

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書  
**【提出先】** 関東財務局長殿  
**【提出日】** 2020年2月10日提出  
**【計算期間】** 第2期(自 2018年11月13日 至 2019年11月11日)  
**【ファンド名】** リスクコントロール世界資産分散ファンド  
**【発行者名】** アセットマネジメントOne株式会社  
**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 菅野 暁  
**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【事務連絡者氏名】** 酒井 隆  
**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【電話番号】** 03-6774-5100  
**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

#### <ファンドの特色>

## 1 国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド\*1を通じて投資します。\*2\*3

\*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

\*2 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

\*3 有価証券指数等先物等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

また、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

## 2 基本資産配分によるポートフォリオの変動リスク\*1を年率2%程度\*2に抑えた安定的な運用をめざします。

●各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産の収益率のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度となるよう最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

●通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

\*1 価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

\*2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

### 3 基準価額の下落を一定水準(下値目安値\*1)までに抑えることをめざします。

- 基本配分比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率\*2を機動的に変更します。

下値目安値は、過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

- \*1 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)
- \*2 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

### 4 年1回決算を行います。

- 毎年11月11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

#### 運用プロセス

##### 基本配分比率の決定

資産価格に影響を与える「変動要因」および各資産の「トレンド」を勘案し、基本配分比率を決定します。  
基本配分比率は月次で見直します。  
※2020年4月15日以降、基本配分比率の決定にあたっては、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。



##### 合計資産比率の機動的な変更

基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に機動的に合計資産比率を変更します。  
下値目安値は毎営業日決定します。

## リスクを抑えるための2つの運用手法により、安定的なリターンをめざします。



当ファンドでは、投資対象資産である国内外の8資産に対して、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目した分散投資を行うことで、特定の要因で大きく基準価額が変動するリスクを回避し、変動を抑えて運用を行うことをめざします。

### 投資対象資産

	安定資産		リスク性資産
	国内	先進国	新興国
債券	国内債券	為替ヘッジ先進国債券	新興国債券
株式	国内株式	先進国株式	新興国株式
リート	国内リート	先進国リート	

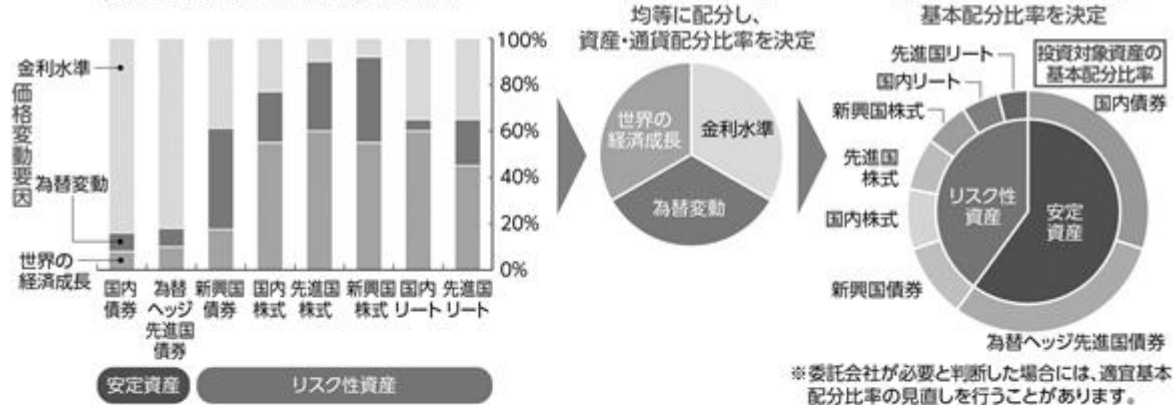
※当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

### 当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

資産価格に影響を与える変動要因を判定し、変動要因の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産のトレンドを勘案した上で、基準価額の変動が小さくなるように最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。

通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

(例)各資産における価格変動要因の比率



### 価格変動要因が変化した場合

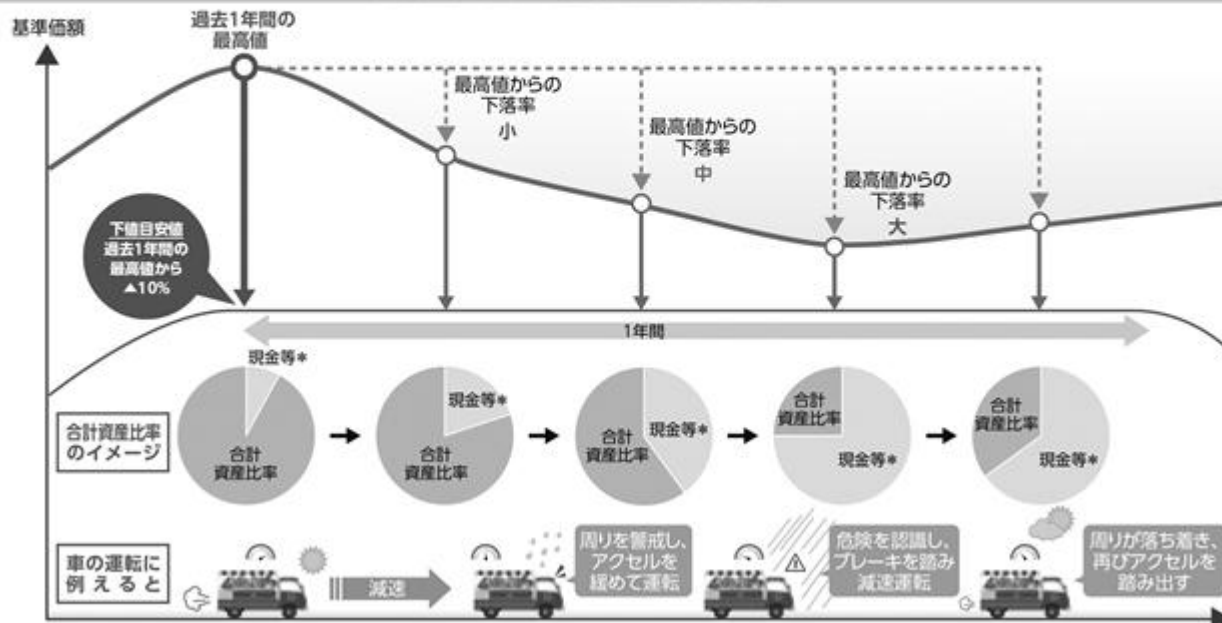


※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



当ファンドでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等には、現金等の比率を増やすことで基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざします。

### 下値目安値と合計資産比率変更イメージ



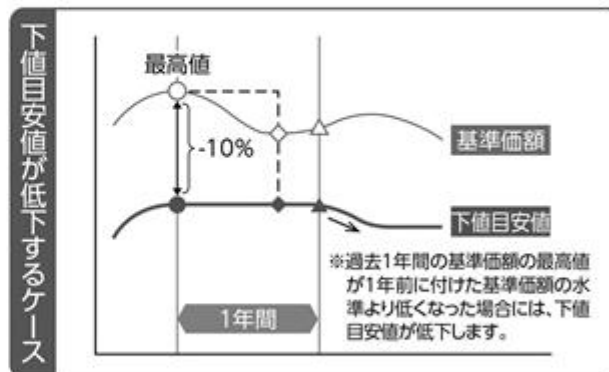
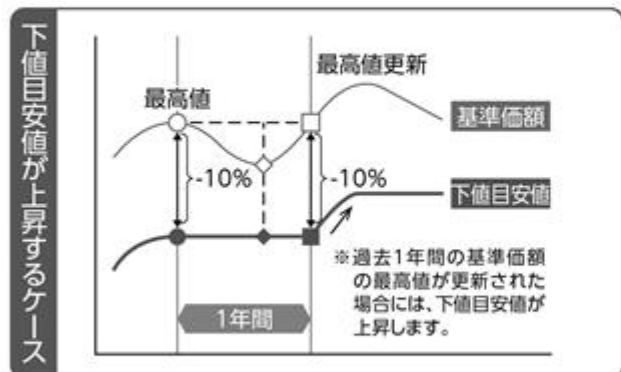
\*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

\*合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

### 下値目安値について

下値目安値は過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

\*設定後1年に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。



\*下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去1年間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去1年間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

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

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

## ■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

※分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

### < 商品分類 >

#### ・ 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	国内	株式 債券
追加型	海外	不動産投信
	内外	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	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、「株式」、「債券」、「不動産投信」および「その他資産」のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

## &lt; 属性区分 &gt;

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

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

(注2) 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（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年 1 回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

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

（注2）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/>）をご覧ください。

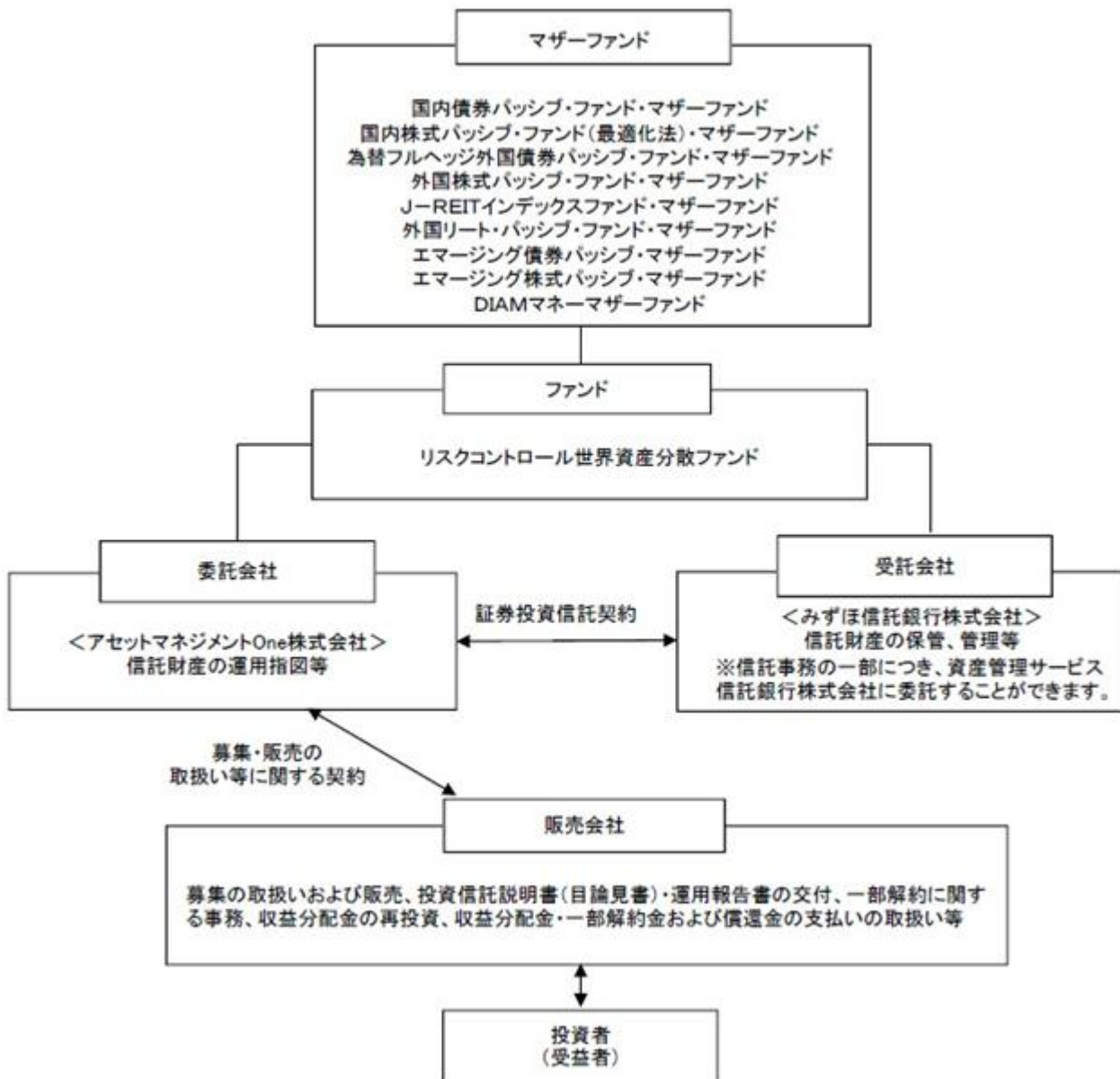
（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

## （2）【ファンドの沿革】

2018年5月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始



## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

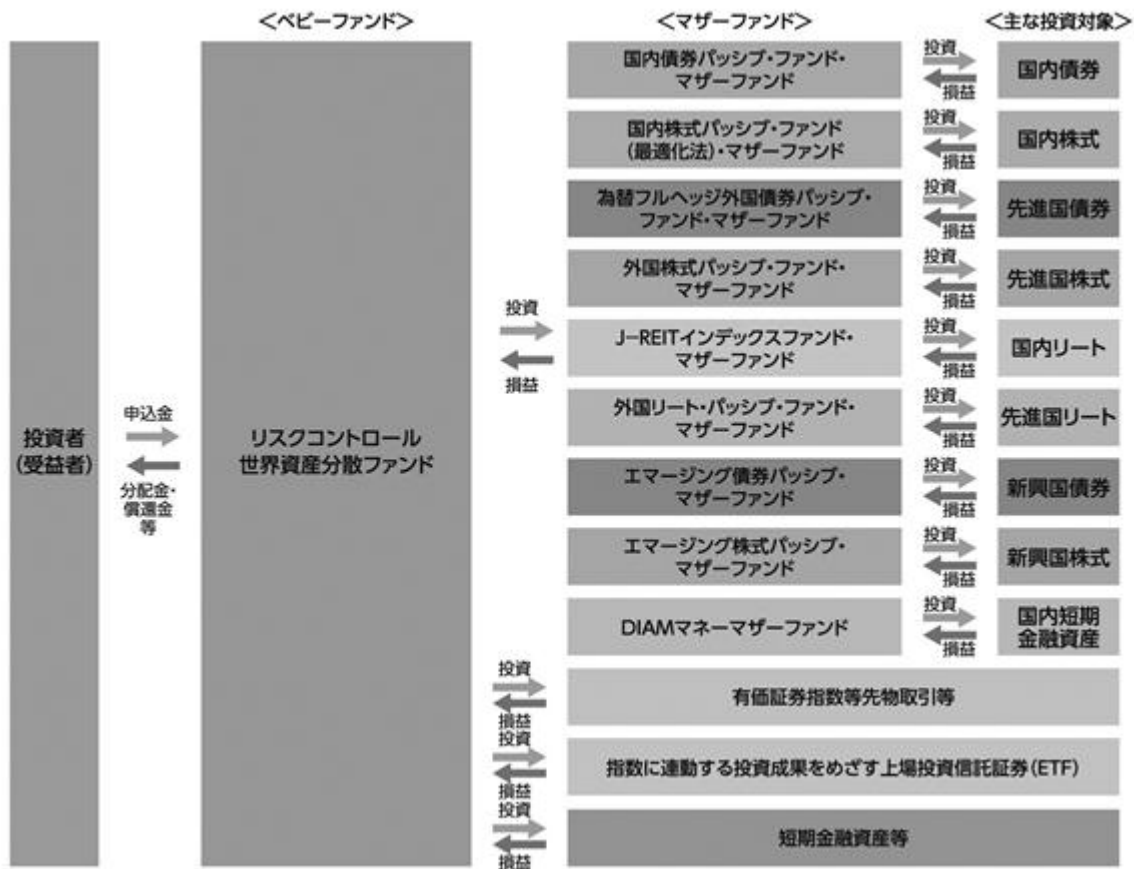
委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

2020年4月15日に、委託会社は投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間において投資顧問契約（当ファンドの運用にかかる助言契約）を締結する予定です。

## ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



## 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

## 資本金の額

20億円（2019年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 D I A M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 <sup>1</sup>	70.0% <sup>2</sup>
第一生命ホールディングス株式会社	東京都千代田区有楽町一丁目13番1号	12,000株	30.0% <sup>2</sup>

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

#### <投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）に投資する場合があります。また、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

#### <投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）等への投資を通じて、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（以下「各資産」ということがあります。）に実質的に分散投資を行います。

- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド

・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度<sup>1</sup>となるよう最終的に基本配分比率を決定します<sup>2</sup>。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜見直しを行うことがあります。

1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

2 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

基準価額の下落を一定水準(下値目安値<sup>(\*)</sup>)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率<sup>(\*\*)</sup>を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

(\*\*) 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。

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

## (2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

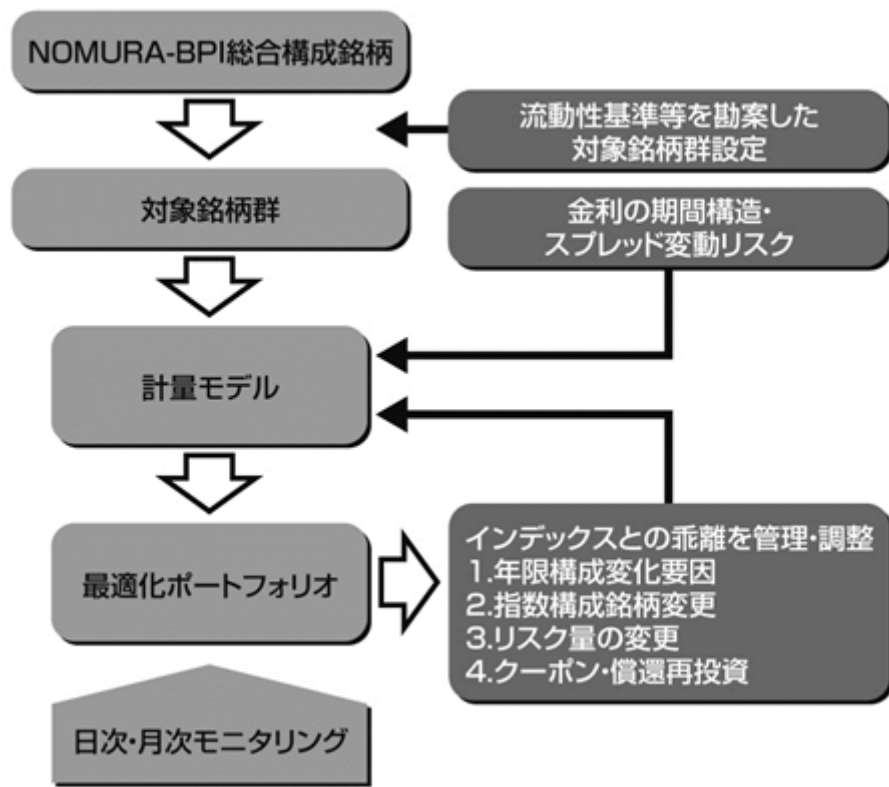
#### 運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

#### (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン、償還再投資</p>  <pre> graph TD     A[NOMURA-BPI総合構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[金利の期間構造・スプレッド変動リスク] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     G[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年限構成変化要因 2. 指数構成銘柄変更 3. リスク量の変更 4. クーポン・償還再投資] --&gt; F     F --&gt; H[日次・月次モニタリング]   </pre>
--------	---

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

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



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

## 運用プロセス

## 1.流動性基準による対象銘柄群設定

マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

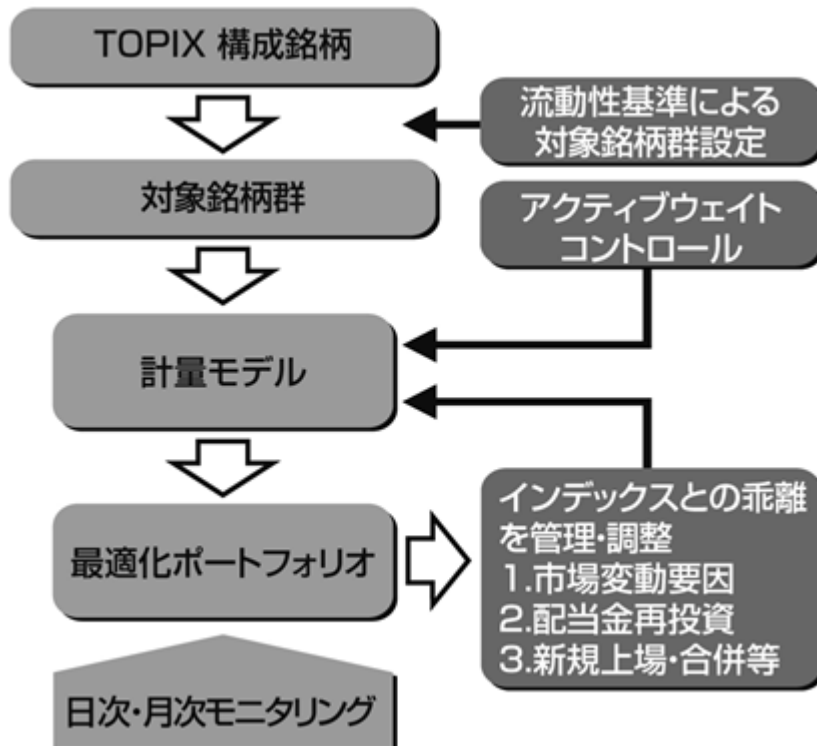
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

## 3.インデックスとの乖離を管理

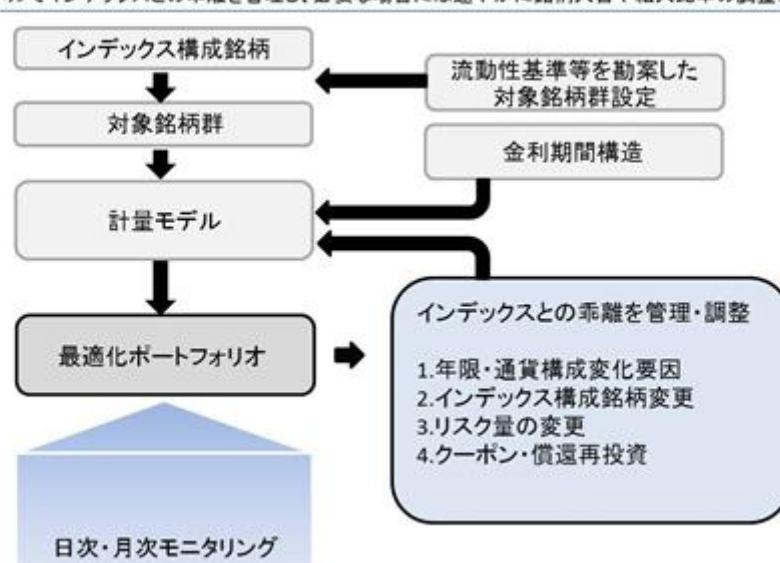
日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



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

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre>       graph TD         A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]         B --&gt; C[計量モデル]         C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]         D --&gt; E[日次・月次モニタリング]                  F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; B         G[金利期間構造] --&gt; C                  D --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整]         subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整]           H1[1. 年限・通貨構成変化要因]           H2[2. インデックス構成銘柄変更]           H3[3. リスク量の変更]           H4[4. クーポン・償還再投資]         end     </pre>

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

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

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

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

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

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

る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

## 運用プロセス

## 1.流動性基準による対象銘柄群設定

取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

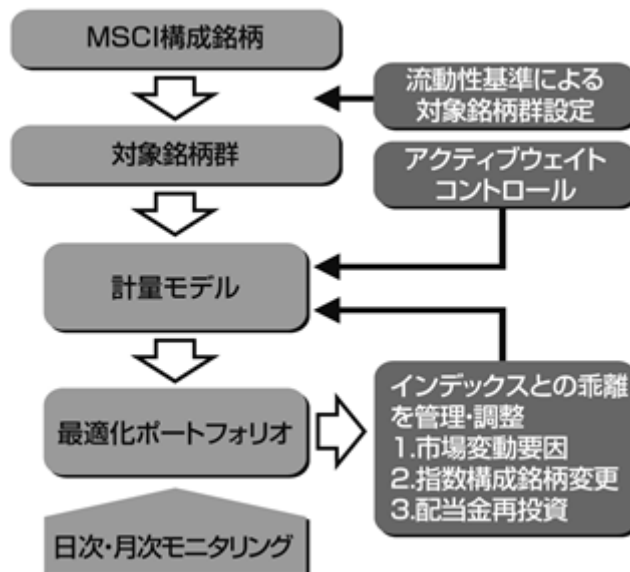
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

## 3.インデックスとの乖離を管理

日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施





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

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

## 投資態度

1. 東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
2. 不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
3. 但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

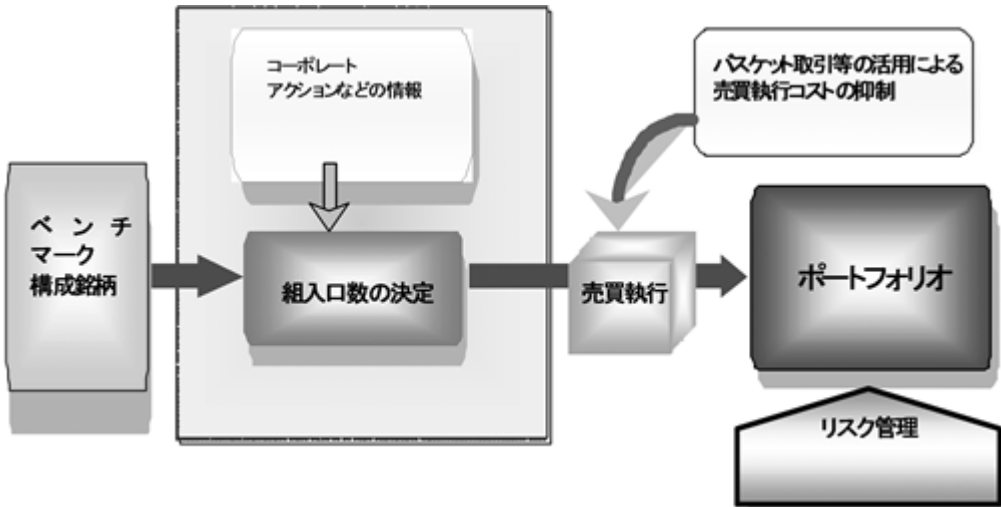
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> <li>・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</li> <li>・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</li> <li>・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</li> </ul> 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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



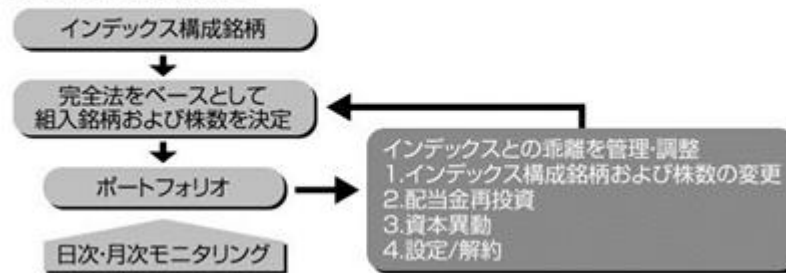
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、それらの各関連会社(総称して「S&P Dow Jones Indices」)によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の所有者またはいかなる一般人に対して、有価証券全般または具体的な商品への投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS & P 先進国 R E I T インデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I T インデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I T インデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I T インデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホルダーの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

先進国 R E I Tインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

## 運用プロセス

ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。



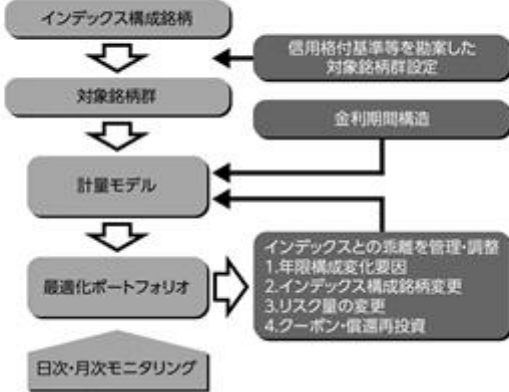
## 主な投資制限

1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
3. 株式への直接投資は行いません。
4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 R E I Tインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 R E I Tインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。
5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。
7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名

エマージング債券パッシブ・マザーファンド



基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S&amp;PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     C[信用格付基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --&gt; B     B --&gt; D[計量モデル]     E[金利期間構造] --&gt; D     D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]     F --&gt; G[日次・月次モニタリング]     F --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資]   </pre>

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

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

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

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、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に對りなく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對して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

	る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。          日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre>         graph TD             A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]             B --&gt; C[計量モデル]             C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]             D --&gt; E[日々・月次モニタリング]             F[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C             F --&gt; D             G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --&gt; D           </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>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。</li> <li>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見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（人数60～70人程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施し、必要に応じて対応を指示します。

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2019年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

毎決算時（原則として毎年11月11日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

#### 収益の分配方式

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

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



金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

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

#### (5)【投資制限】

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

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

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

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

同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

1)委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者

割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### 信用取引の指図範囲(約款第23条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - 2.株式分割により取得する株券
  - 3.有償増資により取得する株券
  - 4.売出しにより取得する株券
  - 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
  - 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
  - 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  - 3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第25条)

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

- 3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第26条)

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

じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第27条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第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次の1.2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第29条)

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

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

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

#### 公社債の借入れの指図および範囲(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るときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第31条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第32条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ(約款第38条)

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

- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、公社債、株式およびリートに資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

また、当ファンドは現金等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

#### 不動産投資信託証券(リート)の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない資産については、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。

為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、当ファンドは投資環境によっては、為替予約取引の売建を実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があるため、為替相場の影響を受けます。なお、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。



## 信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

## 流動性リスク

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

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

## カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

- ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。

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

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

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

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

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

当ファンドは過去1年間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に10%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

基準価額の水準が下値目安値に近づいた場合等では、下値目安値を意識した資産配分(組入比率)をめざすため、投資対象資産の合計資産比率の引上げについては機動的に行えない場合があります。

#### 注意事項

- ・当ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)など値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

### < リスク管理体制 >

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

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



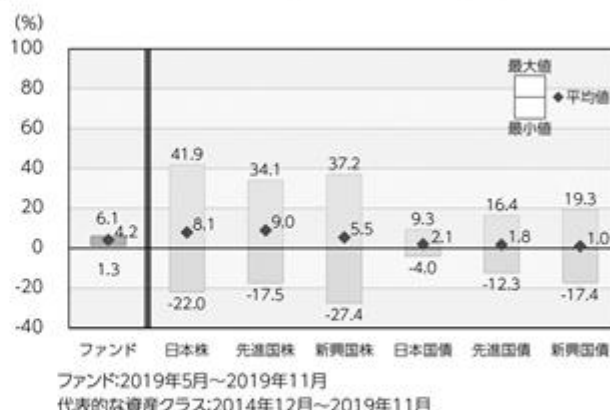
リスク管理体制は2019年11月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## &lt;参考情報&gt;

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



\*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(拠東京証券取引所)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、拠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・ディバシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に1.1%(税抜1.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

##### (2)【換金(解約)手数料】

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.089%(税抜0.99%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.48%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.48%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

2020年4月15日以降、委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)に対する投資顧問報酬(当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.216%)が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

##### (4)【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日(休業日の場合は翌営業日)および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

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

上場投資信託(ETFおよびリート)は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託(ETFおよびリート)の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

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。

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2019年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、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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	66,002,679,975	90.75
内 日本	66,002,679,975	90.75
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,727,864,522	9.25
純資産総額	72,730,544,497	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	187,693,801,300	78.80
内 日本	187,693,801,300	78.80
地方債証券	20,756,402,339	8.71
内 日本	20,756,402,339	8.71
特殊債券	17,984,013,294	7.55
内 日本	17,984,013,294	7.55
社債券	11,075,586,800	4.65
内 日本	10,670,554,800	4.48
内 フランス	405,032,000	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	688,217,797	0.29
純資産総額	238,198,021,530	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	249,993,060,280	97.71
内 日本	249,993,060,280	97.71
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	5,871,749,153	2.29
純資産総額	255,864,809,433	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）	5,956,470,000	2.33
内 日本	5,956,470,000	2.33

（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。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	436,680,909,788	96.14
内 アメリカ	213,922,785,039	47.10
内 フランス	42,969,289,821	9.46
内 イタリア	38,017,202,537	8.37
内 イギリス	27,995,579,469	6.16
内 ドイツ	26,578,520,146	5.85
内 スペイン	24,163,142,982	5.32
内 ベルギー	10,926,009,699	2.41
内 オーストラリア	9,047,983,157	1.99
内 オランダ	8,540,363,959	1.88
内 カナダ	7,642,439,952	1.68
内 オーストリア	6,299,938,875	1.39
内 アイルランド	3,691,855,017	0.81
内 メキシコ	3,126,285,373	0.69
内 フィンランド	2,997,972,135	0.66
内 ポーランド	2,151,116,945	0.47
内 南アフリカ	2,121,770,725	0.47
内 デンマーク	1,936,367,836	0.43
内 シンガポール	1,559,150,787	0.34
内 スウェーデン	1,168,156,189	0.26
内 マレーシア	1,164,862,416	0.26
内 ノルウェー	660,116,729	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	17,512,769,868	3.86
純資産総額	454,193,679,656	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	336,600,443,118	95.30
内 アメリカ	221,248,362,576	62.64
内 イギリス	19,841,507,977	5.62
内 カナダ	12,941,570,159	3.66
内 フランス	12,770,869,033	3.62
内 スイス	12,609,064,425	3.57
内 ドイツ	10,855,079,601	3.07
内 オーストラリア	7,928,849,373	2.24
内 オランダ	6,604,762,919	1.87
内 アイルランド	6,459,889,300	1.83
内 スペイン	3,497,277,526	0.99
内 スウェーデン	3,057,615,950	0.87
内 香港	3,041,291,832	0.86
内 イタリア	2,405,189,609	0.68
内 デンマーク	2,286,677,158	0.65
内 シンガポール	1,470,417,491	0.42
内 フィンランド	1,361,538,400	0.39

内	バミューダ	1,346,253,910	0.38
内	ジャージー	1,237,564,459	0.35
内	ベルギー	1,224,853,421	0.35
内	ケイマン諸島	819,298,460	0.23
内	ノルウェー	768,710,717	0.22
内	イスラエル	741,657,019	0.21
内	オランダ領キュラソー	437,038,150	0.12
内	ニュージーランド	327,408,542	0.09
内	ルクセンブルグ	318,608,677	0.09
内	オーストリア	291,101,342	0.08
内	ポルトガル	195,335,922	0.06
内	リベリア	187,051,514	0.05
内	パナマ	158,349,438	0.04
内	マン島	59,670,997	0.02
内	パプアニューギニア	57,708,248	0.02
内	イギリス領バージン諸島	49,868,973	0.01
投資信託受益証券		792,228,086	0.22
	内 オーストラリア	623,846,733	0.18
	内 シンガポール	168,381,353	0.05
投資証券		8,778,027,953	2.49
	内 アメリカ	7,863,291,322	2.23
	内 イギリス	243,890,155	0.07
	内 フランス	212,543,104	0.06
	内 香港	196,182,000	0.06
	内 オランダ	186,286,406	0.05
	内 カナダ	75,834,966	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,012,111,130	1.99
純資産総額		353,182,810,287	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)	6,872,515,575	1.95
内 アメリカ	4,889,176,627	1.38
内 ドイツ	1,155,613,970	0.33
内 イギリス	409,052,182	0.12
内 カナダ	253,088,520	0.07
内 オーストラリア	165,584,276	0.05

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

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

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	42,764,478,440	97.03
内 日本	42,764,478,440	97.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,308,093,516	2.97
純資産総額	44,072,571,956	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(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,111,969,500	2.52
内 日本	1,111,969,500	2.52

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

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	5,937,620,900	10.43
内 オーストラリア	3,711,733,459	6.52
内 シンガポール	2,225,887,441	3.91
投資証券	50,731,665,668	89.12
内 アメリカ	41,945,459,195	73.68
内 イギリス	2,887,613,441	5.07
内 カナダ	1,101,432,532	1.93
内 フランス	1,080,672,896	1.90
内 香港	1,058,327,398	1.86
内 オランダ	1,049,283,931	1.84
内 ベルギー	578,313,074	1.02
内 スペイン	369,700,790	0.65
内 ニュージーランド	237,610,457	0.42
内 ドイツ	151,998,327	0.27
内 ガーンジー	108,474,629	0.19
内 アイルランド	74,690,143	0.13
内 イスラエル	47,089,463	0.08
内 マン島	18,506,929	0.03
内 イタリア	13,246,912	0.02
内 韓国	9,245,551	0.02
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	257,695,477	0.45
純資産総額	56,926,982,045	100.00

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

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

## エマージング債券パッシブ・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	140,091,580,499	97.97
内 メキシコ	22,075,726,788	15.44
内 インドネシア	18,657,182,407	13.05
内 ロシア	18,088,397,399	12.65
内 ブラジル	16,438,117,917	11.50
内 コロンビア	15,391,586,666	10.76
内 フィリピン	12,964,159,223	9.07
内 南アフリカ	7,724,007,702	5.40
内 ハンガリー	7,224,801,083	5.05
内 パナマ	6,807,096,981	4.76
内 ルーマニア	4,967,475,727	3.47
内 ペルー	4,931,507,570	3.45
内 クロアチア	4,821,521,036	3.37
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,907,133,722	2.03
純資産総額	142,998,714,221	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	45,066,952,771	88.05
内 ケイマン諸島	8,144,173,950	15.91
内 中国	5,766,544,848	11.27
内 韓国	5,317,891,709	10.39
内 台湾	5,269,840,565	10.30
内 インド	4,183,882,716	8.17
内 ブラジル	3,098,365,561	6.05
内 南アフリカ	1,961,746,472	3.83
内 ロシア	1,706,141,489	3.33
内 香港	1,344,744,919	2.63
内 タイ	1,232,861,480	2.41
内 サウジアラビア	1,114,347,311	2.18
内 インドネシア	860,573,066	1.68
内 マレーシア	843,237,682	1.65
内 メキシコ	772,468,842	1.51
内 フィリピン	456,796,850	0.89
内 カタール	427,544,619	0.84
内 ポーランド	410,473,870	0.80
内 バミューダ	395,782,684	0.77
内 チリ	319,927,585	0.63
内 アラブ首長国連邦	283,900,855	0.55
内 トルコ	232,096,472	0.45
内 コロンビア	158,718,113	0.31
内 アメリカ	145,035,676	0.28
内 ギリシャ	133,561,906	0.26
内 ハンガリー	131,872,199	0.26

内 チェコ	63,592,355	0.12
内 エジプト	53,807,969	0.11
内 ルクセンブルグ	49,302,727	0.10
内 アルゼンチン	41,842,175	0.08
内 オランダ	32,119,913	0.06
内 マン島	26,351,800	0.05
内 ジャージー	25,995,511	0.05
内 ペルー	24,470,532	0.05
内 パキスタン	16,164,022	0.03
内 シンガポール	9,116,800	0.02
内 ベルギー	6,049,517	0.01
内 スペイン	5,608,011	0.01
新株予約権証券	771,623	0.00
内 タイ	771,623	0.00
投資信託受益証券	386,618,517	0.76
内 メキシコ	253,137,554	0.49
内 ブラジル	133,480,963	0.26
投資証券	109,048,543	0.21
内 南アフリカ	74,359,161	0.15
内 メキシコ	34,689,382	0.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,619,883,076	10.98
純資産総額	51,183,274,530	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)	5,590,162,597	10.92
内 アメリカ	5,590,162,597	10.92

(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	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	23,142,672,935	1.4028 32,465,299,403	1.4127 32,693,654,055	- -	44.95
2	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,334,267,466	2.0266 8,783,916,893	2.0526 8,896,517,400	- -	12.23
3	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,631,441,177	1.3180 8,740,266,978	1.3217 8,764,775,803	- -	12.05
4	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,734,610,324	2.6916 4,668,903,668	2.6861 4,659,336,791	- -	6.41
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,008,779,404	1.3612 4,095,713,587	1.3981 4,206,574,484	- -	5.78
6	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,052,166,566	1.1741 3,583,798,069	1.1675 3,563,404,465	- -	4.90
7	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	465,345,349	3.8375 1,785,804,466	3.9192 1,823,781,491	- -	2.51
8	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	567,802,087	2.3942 1,359,437,016	2.4562 1,394,635,486	- -	1.92

(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	90.75
合計	90.75

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,330,000,000	101.93 2,375,074,000	102.03 2,377,345,600	0.1 2026/9/20	1.00
2	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,250,000,000	102.81 2,313,247,000	102.27 2,301,097,500	0.1 2028/3/20	0.97
3	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,140,000,000	104.07 2,227,286,500	103.36 2,212,032,400	0.4 2025/6/20	0.93
4	128回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,200,000,000	100.63 2,213,948,000	100.43 2,209,548,000	0.1 2021/6/20	0.93
5	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,120,000,000	103.96 2,203,979,000	103.60 2,196,320,000	0.6 2024/6/20	0.92
6	129回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,120,000,000	100.70 2,134,850,500	100.51 2,130,896,800	0.1 2021/9/20	0.89
7	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.91 2,119,924,000	101.99 2,121,392,000	0.1 2026/6/20	0.89
8	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,030,000,000	101.83 2,067,295,000	102.29 2,076,608,800	0.1 2027/9/20	0.87
9	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	102.15 2,022,671,000	101.91 2,017,857,600	0.1 2026/3/20	0.85
10	399回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	2,000,000,000	100.40 2,008,180,000	100.37 2,007,440,000	0.1 2021/4/1	0.84
11	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,960,000,000	102.34 2,006,045,000	102.14 2,002,042,000	0.1 2026/12/20	0.84
12	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,950,000,000	101.86 1,986,342,000	102.25 1,994,050,500	0.1 2027/6/20	0.84
13	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,910,000,000	103.18 1,970,756,000	103.06 1,968,465,100	0.3 2025/12/20	0.83
14	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,900,000,000	103.73 1,971,036,000	103.52 1,966,880,000	0.4 2025/9/20	0.83
15	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,900,000,000	103.84 1,973,076,000	103.34 1,963,498,000	0.5 2024/9/20	0.82



16	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,920,000,000	101.88 1,956,096,000	102.22 1,962,643,200	0.1 2027/3/20	0.82
17	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,860,000,000	102.21 1,901,259,000	102.20 1,901,068,800	0.1 2028/6/20	0.80
18	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,820,000,000	102.03 1,857,046,000	102.13 1,858,911,600	0.1 2028/9/20	0.78
19	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	104.22 1,844,694,000	103.55 1,832,905,800	0.8 2023/6/20	0.77
20	127回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,820,000,000	100.54 1,829,869,200	100.35 1,826,370,000	0.1 2021/3/20	0.77
21	313回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,790,000,000	103.08 1,845,185,700	101.89 1,823,920,500	1.3 2021/3/20	0.77
22	135回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,800,000,000	101.45 1,826,250,000	101.01 1,818,216,000	0.1 2023/3/20	0.76
23	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	102.52 1,804,438,000	102.28 1,800,233,600	0.1 2027/12/20	0.76
24	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,730,000,000	103.69 1,793,885,500	103.21 1,785,550,300	0.4 2025/3/20	0.75
25	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,650,000,000	101.42 1,673,493,000	102.10 1,684,749,000	0.1 2028/12/20	0.71
26	320回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,500,000,000	103.34 1,550,145,000	102.41 1,536,240,000	1 2021/12/20	0.64
27	315回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,500,000,000	103.22 1,548,330,000	102.14 1,532,130,000	1.2 2021/6/20	0.64
28	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,470,000,000	102.18 1,502,112,800	102.02 1,499,694,000	0.1 2029/3/20	0.63
29	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,450,000,000	103.57 1,501,777,000	101.92 1,477,941,500	0.1 2029/6/20	0.62
30	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,450,000,000	101.24 1,467,985,000	101.18 1,467,153,500	0.1 2023/12/20	0.62

（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	78.80
地方債証券	8.71
特殊債証券	7.55
社債証券	4.65
合計	99.71

（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。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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	1,161,300	6,639.86 7,710,878,575	7,638.00 8,870,009,400	- -	3.47
2	ソニー 日本	株式 電気機器	658,600	4,863.34 3,202,999,589	6,904.00 4,546,974,400	- -	1.78
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,075,400	572.59 4,051,373,171	578.10 4,090,288,740	- -	1.60
4	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	867,000	4,393.66 3,809,303,759	4,455.00 3,862,485,000	- -	1.51
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	683,500	4,693.29 3,207,869,746	5,527.00 3,777,704,500	- -	1.48
6	キーエンス 日本	株式 電気機器	94,400	31,253.00 2,950,283,239	37,440.00 3,534,336,000	- -	1.38
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	811,400	4,931.78 4,001,651,872	4,253.00 3,450,884,200	- -	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	710,800	3,898.83 2,771,291,006	3,989.00 2,835,381,200	- -	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	713,300	2,972.56 2,120,329,901	3,962.00 2,826,094,600	- -	1.10
10	任天堂 日本	株式 その他製品	63,900	31,139.43 1,989,809,744	42,350.00 2,706,165,000	- -	1.06
11	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	820,500	2,975.36 2,441,287,140	3,067.00 2,516,473,500	- -	0.98

12	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	762,100	2,682.75 2,044,529,333	3,139.00 2,392,231,900	- -	0.93
13	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	13,966,300	171.93 2,401,296,221	169.20 2,363,097,960	- -	0.92
14	NTTドコモ 日本	株式 情報・通 信業	755,400	2,625.99 1,983,673,724	3,003.00 2,268,466,200	- -	0.89
15	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	367,500	5,373.60 1,974,798,804	5,952.00 2,187,360,000	- -	0.85
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	500,700	3,602.48 1,803,763,962	4,300.00 2,153,010,000	- -	0.84
17	花王 日本	株式 化学	249,500	8,060.26 2,011,037,115	8,612.00 2,148,694,000	- -	0.84
18	HOYA 日本	株式 精密機器	209,800	6,863.85 1,440,036,361	9,990.00 2,095,902,000	- -	0.82
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	132,800	11,994.60 1,592,882,961	15,745.00 2,090,936,000	- -	0.82
20	ファナック 日本	株式 電気機器	99,000	18,888.85 1,869,996,572	20,905.00 2,069,595,000	- -	0.81
21	三菱商事 日本	株式 卸売業	720,200	3,103.28 2,234,988,290	2,866.00 2,064,093,200	- -	0.81
22	信越化学工業 日本	株式 化学	175,200	9,473.49 1,659,756,515	11,710.00 2,051,592,000	- -	0.80
23	第一三共 日本	株式 医薬品	298,200	3,974.46 1,185,184,002	6,862.00 2,046,248,400	- -	0.80
24	日本電産 日本	株式 電気機器	125,400	13,302.34 1,668,114,048	16,190.00 2,030,226,000	- -	0.79
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	306,100	5,719.39 1,750,706,141	6,344.00 1,941,898,400	- -	0.76
26	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	86,600	23,465.01 2,032,070,674	22,095.00 1,913,427,000	- -	0.75
27	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	183,400	10,163.13 1,863,918,991	10,070.00 1,846,838,000	- -	0.72
28	三井物産 日本	株式 卸売業	902,100	1,750.51 1,579,143,032	1,939.50 1,749,622,950	- -	0.68
29	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	717,900	2,049.14 1,471,083,531	2,388.00 1,714,345,200	- -	0.67
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	916,600	1,653.16 1,515,295,481	1,867.50 1,711,750,500	- -	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	97.71
合計	97.71

（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		8.36
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		4.46
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		2.28
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	97.71	

（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。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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 1.5 08/31/21 アメリカ	国債証 券	3,389,786,400	99.76 3,381,774,944	99.69 3,379,325,721	1.5 2021/8/31	0.74
2	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	3,126,842,400	102.92 3,218,343,548	103.15 3,225,533,362	2.25 2025/11/15	0.71
3	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	2,401,555,200	110.15 2,645,351,652	111.30 2,673,043,496	3.125 2028/11/15	0.59
4	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証 券	2,527,549,200	99.93 2,525,858,099	99.53 2,515,701,312	1.625 2026/2/15	0.55
5	US T N/B 1.375 10/15/22 アメリカ	国債証 券	2,457,430,800	99.37 2,442,000,813	99.31 2,440,631,949	1.375 2022/10/15	0.54
6	US T N/B 2.125 05/31/21 アメリカ	国債証 券	2,420,180,400	100.52 2,433,007,113	100.69 2,437,102,736	2.125 2021/5/31	0.54
7	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	2,413,606,800	100.03 2,414,376,718	100.02 2,414,266,751	1.625 2022/11/15	0.53
8	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	2,322,672,000	101.26 2,352,151,987	101.61 2,360,233,949	2 2024/5/31	0.52
9	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証 券	2,287,612,800	99.73 2,281,453,105	99.71 2,281,089,511	1.5 2021/9/30	0.50
10	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証 券	2,160,523,200	104.75 2,263,259,503	105.23 2,273,613,085	2.375 2029/5/15	0.50
11	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証 券	2,218,590,000	101.40 2,249,783,375	102.03 2,263,828,423	2.125 2024/3/31	0.50
12	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証 券	2,087,118,000	98.45 2,054,777,706	98.67 2,059,561,508	1.5 2026/8/15	0.45
13	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証 券	1,966,602,000	101.03 1,986,956,330	100.92 1,984,885,242	2.5 2021/1/31	0.44
14	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	1,637,612,200	116.04 1,900,378,215	116.88 1,914,123,019	1.5 2031/5/25	0.42
15	ITALY BTPS 4.5 03/01/26 イタリア	国債証 券	1,556,816,900	122.92 1,913,682,924	122.40 1,905,699,567	4.5 2026/3/1	0.42
16	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証 券	1,094,957,200	172.45 1,888,286,050	173.07 1,895,120,168	5.75 2032/10/25	0.42
17	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証 券	1,794,379,200	105.39 1,891,234,748	105.38 1,891,029,846	0.5 2026/5/25	0.42
18	US T N/B 2.625 07/15/21 アメリカ	国債証 券	1,826,365,200	101.70 1,857,596,044	101.51 1,853,974,691	2.625 2021/7/15	0.41
19	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	999,691,100	184.73 1,846,776,009	182.53 1,824,836,133	4.5 2041/4/25	0.40
20	US T N/B 2.625 06/15/21 アメリカ	国債証 券	1,781,445,600	101.65 1,811,017,596	101.41 1,806,705,927	2.625 2021/6/15	0.40
21	FRANCE OAT 2.25 10/25/22 フランス	国債証 券	1,644,847,600	109.70 1,804,414,265	108.36 1,782,514,764	2.25 2022/10/25	0.39
22	US T N/B 3.125 05/15/48 アメリカ	国債証 券	1,474,677,600	115.22 1,699,146,630	119.68 1,765,004,752	3.125 2048/5/15	0.39

23	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,636,826,400	105.78 1,731,516,807	107.72 1,763,296,806	2.75 2028/2/15	0.39
24	ITALY BTPS 4.0 02/01/37 イタリア	国債証券	1,334,931,300	125.86 1,680,274,964	130.11 1,737,012,607	4 2037/2/1	0.38
25	US T N/B 2.5 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,718,996,400	101.11 1,738,128,829	100.99 1,736,119,202	2.5 2021/2/28	0.38
26	FRANCE OAT 3.0 04/25/22 フランス	国債証券	1,583,346,700	110.39 1,747,884,924	108.76 1,722,079,537	3 2022/4/25	0.38
27	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,651,069,200	102.09 1,685,626,078	103.64 1,711,178,437	2.25 2027/2/15	0.38
28	US T N/B 1.75 07/31/21 アメリカ	国債証券	1,701,466,800	100.06 1,702,606,782	100.10 1,703,261,302	1.75 2021/7/31	0.38
29	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	1,708,040,400	99.91 1,706,535,182	98.64 1,684,821,724	1.625 2029/8/15	0.37
30	US T N/B 2.375 03/15/22 アメリカ	国債証券	1,656,547,200	101.68 1,684,426,889	101.69 1,684,695,548	2.375 2022/3/15	0.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年11月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.14
合計	96.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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	357,198	18,726.65 6,689,125,292	29,344.55 10,481,814,713	- -	2.97
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	575,002	11,801.34 6,785,797,688	16,688.17 9,595,736,416	- -	2.72
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	33,136	178,735.74 5,922,587,486	199,235.95 6,601,882,624	- -	1.87

4	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	189,729	18,037.77 3,422,288,704	22,131.11 4,198,915,266	- -	1.19
5	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	252,148	11,230.65 2,831,787,705	14,468.49 3,648,201,724	- -	1.03
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	24,708	122,940.48 3,037,613,416	143,851.18 3,554,275,064	- -	1.01
7	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	23,567	123,827.00 2,918,231,099	143,756.96 3,387,920,342	- -	0.96
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	208,860	14,706.15 3,071,528,098	15,091.88 3,152,092,145	- -	0.89
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	137,469	15,754.21 2,165,715,596	20,199.57 2,776,815,678	- -	0.79
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	237,247	9,720.17 2,306,081,445	11,439.62 2,714,016,475	- -	0.77
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	198,040	10,843.27 2,147,402,328	13,340.02 2,641,858,669	- -	0.75
12	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	699,644	3,109.54 2,175,574,923	3,661.49 2,561,743,147	- -	0.73
13	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	334,134	8,333.22 2,784,413,815	7,526.77 2,514,950,435	- -	0.71
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	102,604	22,198.04 2,277,607,964	24,157.97 2,478,705,379	- -	0.70
15	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	575,875	3,279.71 1,888,703,641	4,126.02 2,376,077,295	- -	0.67
16	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	142,222	12,273.30 1,745,534,060	16,596.14 2,360,337,474	- -	0.67

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 ア・サー ビス	75,067	28,998.68 2,176,843,988	30,750.20 2,308,325,653	- -	0.65
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	71,792	24,209.03 1,738,014,790	31,958.65 2,294,375,544	- -	0.65
19	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	350,322	5,552.53 1,945,173,615	6,410.35 2,245,688,594	- -	0.64
20	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	326,283	5,939.17 1,937,852,166	6,584.55 2,148,428,685	- -	0.61
21	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	86,872	20,575.48 1,787,433,785	24,431.87 2,122,446,279	- -	0.60
22	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	331,202	5,310.90 1,758,982,634	5,953.49 1,971,807,927	- -	0.56
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	203,186	8,658.02 1,759,188,569	9,598.55 1,950,291,305	- -	0.55
24	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	150,662	12,941.81 1,949,839,197	12,935.74 1,948,925,845	- -	0.55
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	320,243	5,013.85 1,605,651,784	5,910.76 1,892,880,155	- -	0.54
26	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	55,462	29,677.51 1,645,974,063	33,891.11 1,879,669,297	- -	0.53
27	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	438,192	4,587.37 2,010,149,855	4,232.30 1,854,561,228	- -	0.53
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	358,051	4,104.32 1,469,558,968	4,866.65 1,742,510,761	- -	0.49
29	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	169,630	8,632.04 1,464,254,435	10,127.85 1,717,987,399	- -	0.49
30	BOEING CO アメリカ	株式 航空宇 宙・防衛	42,262	44,693.68 1,888,844,307	40,318.07 1,703,922,696	- -	0.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年11月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.30
投資信託受益証券	0.22
投資証券	2.49
合計	98.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

令和1年11月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
銀行	外国	7.63
ソフトウェア		5.43
医薬品		5.41
石油・ガス・消耗燃料		4.83
情報技術サービス		4.17
保険		3.78
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.34
コンピュータ・周辺機器		3.24
半導体・半導体製造装置		3.21
資本市場		2.91
ヘルスケア機器・用品		2.82
インターネット販売・通信販売		2.39
航空宇宙・防衛		2.34
化学		2.19
各種電気通信サービス		2.07
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.01
電力		1.99
飲料		1.94
食品		1.91
バイオテクノロジー		1.84
ホテル・レストラン・レジャー		1.76
専門小売り		1.67
機械		1.61
食品・生活必需品小売り		1.51
繊維・アパレル・贅沢品		1.45
娯楽		1.39
家庭用品		1.34
コングロマリット		1.31
金属・鉱業		1.31
メディア		1.24
総合公益事業		1.06
陸運・鉄道		0.99
各種金融サービス		0.96
タバコ		0.84
自動車		0.80
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.78
専門サービス		0.74
電気設備		0.74

通信機器	0.73
パーソナル用品	0.69
電子装置・機器・部品	0.53
航空貨物・物流サービス	0.53
複合小売り	0.52
不動産管理・開発	0.50
消費者金融	0.48
商業サービス・用品	0.46
建設関連製品	0.41
家庭用耐久財	0.38
建設・土木	0.31
自動車部品	0.29
建設資材	0.29
容器・包装	0.29
商社・流通業	0.28
無線通信サービス	0.28
エネルギー設備・サービス	0.27
運送インフラ	0.20
ガス	0.19
水道	0.11
旅客航空輸送業	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
紙製品・林産品	0.10
販売	0.07
海運業	0.06
レジャー用品	0.04
合計	95.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### J - R E I Tインデックスファンド・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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,666	778,472.91 2,853,881,702	822,000.00 3,013,452,000	- -	6.84
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	3,786	688,145.67 2,605,319,538	745,000.00 2,820,570,000	- -	6.40
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	11,806	180,822.42 2,134,789,494	199,800.00 2,358,838,800	- -	5.35
4	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,543	214,081.41 1,614,816,150	240,700.00 1,815,600,100	- -	4.12
5	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	8,500	193,390.96 1,643,823,181	213,000.00 1,810,500,000	- -	4.11
6	日本リテールファンド投資 法人 日本	投資証券	7,155	223,159.47 1,596,706,064	249,300.00 1,783,741,500	- -	4.05

7	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証 券	5,439	263,216.27 1,431,633,297	293,700.00 1,597,434,300	- -	3.62
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証 券	5,104	278,510.18 1,421,515,975	299,400.00 1,528,137,600	- -	3.47
9	G L P投資法人 日本	投資証 券	9,429	130,597.83 1,231,407,026	145,600.00 1,372,862,400	- -	3.12
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証 券	3,591	334,536.79 1,201,321,646	353,500.00 1,269,418,500	- -	2.88
11	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証 券	2,396	485,288.08 1,162,750,242	498,500.00 1,194,406,000	- -	2.71
12	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証 券	12,196	86,051.50 1,049,484,132	89,700.00 1,093,981,200	- -	2.48
13	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証 券	16,606	62,584.87 1,039,284,394	65,100.00 1,081,050,600	- -	2.45
14	アクティピア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証 券	1,897	512,453.69 972,124,658	565,000.00 1,071,805,000	- -	2.43
15	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証 券	11,069	86,968.67 962,656,308	96,800.00 1,071,479,200	- -	2.43
16	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証 券	1,171	792,155.80 927,614,449	829,000.00 970,759,000	- -	2.20
17	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証 券	1,258	632,989.50 796,300,800	688,000.00 865,504,000	- -	1.96
18	産業ファンド投資法人 日本	投資証 券	4,658	144,300.79 672,153,105	171,200.00 797,449,600	- -	1.81
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証 券	4,356	162,404.60 707,434,471	177,400.00 772,754,400	- -	1.75
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証 券	874	792,986.37 693,070,088	822,000.00 718,428,000	- -	1.63
21	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証 券	2,474	258,948.58 640,638,806	280,200.00 693,214,800	- -	1.57
22	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証 券	3,220	191,194.55 615,646,454	202,000.00 650,440,000	- -	1.48
23	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	1,345	468,660.46 630,348,323	476,000.00 640,220,000	- -	1.45
24	ジャパンエクセレント投資 法人 日本	投資証 券	3,390	168,105.99 569,879,336	185,000.00 627,150,000	- -	1.42
25	イオンリート投資法人 日本	投資証 券	4,086	139,642.56 570,579,532	152,400.00 622,706,400	- -	1.41
26	日本リート投資法人 日本	投資証 券	1,230	439,417.01 540,482,924	484,500.00 595,935,000	- -	1.35

27	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,520	141,870.38 499,383,753	167,200.00 588,544,000	- -	1.34
28	MCUBS MidCity投資法人 日本	投資証券	4,857	112,499.70 546,411,069	118,300.00 574,583,100	- -	1.30
29	プレミア投資法人 日本	投資証券	3,419	147,762.82 505,201,093	163,400.00 558,664,600	- -	1.27
30	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,576	320,798.96 505,579,169	350,000.00 551,600,000	- -	1.25

(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(%)
投資証券	97.03
合計	97.03

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年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	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	242,130	9,232.94 2,235,573,254	10,123.34 2,451,165,282	- -	4.31
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	32,544	61,956.28 2,016,305,405	61,922.21 2,015,196,610	- -	3.54
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	118,186	17,131.33 2,024,683,438	16,567.66 1,958,065,842	- -	3.44
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	155,533	9,519.84 1,480,650,039	9,402.43 1,462,389,576	- -	2.57
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	57,633	26,539.48 1,529,550,213	23,239.86 1,339,383,266	- -	2.35
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	53,608	23,134.13 1,240,174,629	23,617.84 1,266,105,659	- -	2.22
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	133,812	9,017.73 1,206,681,616	9,381.62 1,255,373,710	- -	2.21
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	79,990	13,683.33 1,094,530,365	13,278.67 1,062,160,973	- -	1.87
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	122,183	8,169.01 998,114,644	8,511.71 1,039,987,044	- -	1.83
10	VENTAS INC アメリカ	投資証券	143,079	7,705.13 1,102,442,726	6,432.26 920,322,415	- -	1.62
11	LINK REIT 香港	投資証券	807,020	1,270.44 1,025,275,701	1,134.00 915,160,680	- -	1.61

12	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	52,855	16,004.48 845,917,077	17,093.63 903,483,945	- -	1.59
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	25,242	34,313.79 866,148,735	34,287.89 865,495,111	- -	1.52
14	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	55,209	14,529.72 802,171,553	15,229.93 840,829,514	- -	1.48
15	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	43,567	16,373.80 713,357,700	17,782.68 774,738,176	- -	1.36
16	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	188,672	3,758.29 709,084,172	3,845.55 725,548,741	- -	1.27
17	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	615,815	1,098.33 676,370,653	1,092.82 672,977,165	- -	1.18
18	MID AMERICA アメリカ	投資証券	43,822	13,798.19 604,664,561	15,021.77 658,284,075	- -	1.16
19	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	34,688	15,560.65 539,767,985	18,109.17 628,170,972	- -	1.10
20	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	183,910	3,147.48 578,853,563	3,325.14 611,527,600	- -	1.07
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	65,636	9,580.92 628,853,516	9,273.15 608,653,024	- -	1.07
22	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	2,046,266	290.28 593,999,298	291.37 596,220,933	- -	1.05
23	UDR INC アメリカ	投資証券	112,549	5,166.43 581,477,012	5,262.16 592,251,611	- -	1.04
24	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	49,397	12,287.08 606,945,306	11,636.36 574,801,650	- -	1.01
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	69,882	7,124.35 497,863,866	8,086.62 565,109,430	- -	0.99
26	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	279,131	1,891.97 528,109,854	1,944.68 542,823,264	- -	0.95
27	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	138,224	3,607.68 498,668,919	3,865.27 534,274,020	- -	0.94
28	SEGRO PLC イギリス	投資証券	416,962	1,104.14 460,385,386	1,263.43 526,802,882	- -	0.93
29	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	176,241	2,489.72 438,791,050	2,726.94 480,600,112	- -	0.84
30	REGENCY CENTERS CORP アメリカ	投資証券	64,398	7,472.27 481,199,261	7,129.06 459,097,798	- -	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年11月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.43
投資証券	89.12
合計	99.55

(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。

## エマージング債券パッシブ・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	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,958,120,000	115.98 3,430,827,576	122.83 3,633,636,283	5.25 2047/6/23	2.54
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	2,421,276,000	105.94 2,565,144,714	105.53 2,555,293,626	4.25 2025/1/7	1.79
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,191,200,000	113.19 2,480,383,620	114.74 2,514,259,572	5 2045/6/15	1.76
4	BRAZIL 2.625 01/05/23 ブラジル	国債証券	2,497,968,000	100.40 2,507,976,306	99.85 2,494,246,027	2.625 2023/1/5	1.74
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,752,960,000	123.27 2,160,895,704	126.70 2,221,000,320	5.625 2042/4/4	1.55
6	CROATIA 6.375 03/24/21 クロアチア	国債証券	1,906,344,000	105.85 2,017,937,433	105.30 2,007,380,232	6.375 2021/3/24	1.40
7	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,796,784,000	108.23 1,944,821,472	111.03 1,995,059,114	4.75 2026/5/27	1.40
8	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,522,884,000	127.52 1,942,071,516	129.09 1,965,959,485	6.05 2040/1/11	1.37
9	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,752,960,000	110.48 1,936,801,680	109.65 1,922,138,169	4.5 2029/4/22	1.34
10	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,687,224,000	107.24 1,809,542,262	109.99 1,855,862,038	4.375 2029/3/21	1.30
11	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,424,280,000	128.47 1,829,816,340	127.84 1,820,863,644	6.125 2041/1/18	1.27
12	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,698,180,000	106.11 1,801,960,710	105.73 1,795,596,095	4 2023/10/2	1.26
13	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,599,576,000	112.94 1,806,600,576	110.59 1,769,043,079	5.625 2047/2/21	1.24
14	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,205,160,000	139.81 1,684,997,740	146.21 1,762,178,926	5.625 2050/11/18	1.23
15	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,511,928,000	112.20 1,696,399,650	116.49 1,761,297,844	5.75 2110/10/12	1.23
16	PHILIPPINES 4.2 01/21/24 フィリピン	国債証券	1,621,488,000	108.72 1,762,913,526	107.82 1,748,289,155	4.2 2024/1/21	1.22
17	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,533,840,000	113.29 1,737,698,292	112.82 1,730,554,980	5.75 2023/11/22	1.21

18	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証 券	1,577,664,000	108.77 1,716,049,236	109.44 1,726,650,699	4.75 2044/3/8	1.21
19	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証 券	1,073,688,000	163.11 1,751,381,459	159.80 1,715,817,275	9.5 2030/2/2	1.20
20	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証 券	1,621,488,000	102.14 1,656,207,564	101.84 1,651,396,346	5 2045/1/27	1.15
21	INDONESIA 5.875 01/15/24 インドネシア	国債証 券	1,446,192,000	112.92 1,633,111,001	113.01 1,634,399,686	5.875 2024/1/15	1.14
22	HUNGARY 5.375 02/21/23 ハンガリー	国債証 券	1,490,016,000	110.13 1,641,034,818	109.58 1,632,789,333	5.375 2023/2/21	1.14
23	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証 券	1,511,928,000	106.06 1,603,579,541	107.03 1,618,341,996	4.125 2025/1/15	1.13
24	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証 券	1,511,928,000	106.49 1,610,175,930	106.72 1,613,620,277	4.625 2028/1/13	1.13
25	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証 券	1,468,104,000	109.42 1,606,478,280	109.76 1,611,523,079	4.875 2023/9/16	1.13
26	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48 メキシコ	国債証 券	1,468,104,000	107.50 1,578,244,668	108.09 1,586,939,678	4.6 2048/2/10	1.11
27	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証 券	1,468,104,000	105.80 1,553,341,680	106.85 1,568,669,124	4.15 2027/3/28	1.10
28	COLOMBIA 3.875 04/25/27 コロンビア	国債証 券	1,490,016,000	106.07 1,580,544,113	105.23 1,568,014,612	3.875 2027/4/25	1.10
29	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証 券	1,380,456,000	111.63 1,541,091,776	112.72 1,556,109,362	5.375 2024/3/25	1.09
30	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証 券	1,314,720,000	116.35 1,529,676,720	117.51 1,545,032,649	5.1 2035/3/28	1.08

（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	97.97
合計	97.97

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年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	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	120,303	19,837.21 2,386,476,980	22,001.83 2,646,887,261	- -	5.17
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,744,083	927.81 1,618,192,365	1,111.10 1,937,859,341	- -	3.79
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	406,900	5,241.21 2,132,652,070	4,732.00 1,925,450,800	- -	3.76
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	338,842	4,310.32 1,460,520,642	4,776.02 1,618,319,557	- -	3.16
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	6,750,530	95.03 641,557,728	89.60 604,847,488	- -	1.18
6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	391,000	1,298.07 507,547,284	1,264.90 494,575,900	- -	0.97
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	202,688	2,064.28 418,404,825	2,433.66 493,274,083	- -	0.96



8	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	31,350	17,777.19 557,315,044	15,733.99 493,260,614	- -	0.96
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	114,677	3,179.28 364,590,624	3,557.01 407,907,809	- -	0.80
10	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	4,651,235	81.50 379,085,481	80.35 373,773,244	- -	0.73
11	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信 サービス	432,500	1,024.87 443,260,469	844.20 365,116,500	- -	0.71
12	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	378,961	620.25 235,051,367	865.52 327,999,840	- -	0.64
13	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	194,838	1,602.68 312,264,299	1,609.98 313,686,101	- -	0.61
14	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	341,947	854.76 292,285,851	899.59 307,615,521	- -	0.60
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	38,564	7,313.50 282,037,836	7,708.67 297,277,535	- -	0.58
16	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	28,275	9,425.24 266,498,748	10,452.02 295,530,978	- -	0.58
17	VALE SA ブラジル	株式 金属・鋁 業	222,421	1,309.66 291,297,799	1,309.61 291,286,990	- -	0.57
18	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	868,225	311.49 270,444,105	322.38 279,900,111	- -	0.55
19	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	338,459	715.06 242,018,897	799.49 270,594,924	- -	0.53
20	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	243,197	1,131.39 275,150,752	1,080.84 262,859,234	- -	0.51

21	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	19,729	16,327.79 322,131,094	13,093.51 258,321,969	- -	0.50
22	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,600,200	50.34 281,917,556	44.94 251,672,988	- -	0.49
23	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	285,250	889.78 253,812,026	863.46 246,301,965	- -	0.48
24	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	302,912	693.14 209,963,030	767.77 232,569,775	- -	0.45
25	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	58,332	3,482.03 203,113,830	3,882.26 226,460,573	- -	0.44
26	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,263,000	193.70 244,651,789	164.36 207,586,680	- -	0.41
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	63,926	3,305.64 211,316,728	3,199.11 204,506,881	- -	0.40
28	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,314,678	81.30 188,183,826	84.63 195,907,864	- -	0.38
29	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	53,031	3,231.35 171,362,174	3,631.91 192,604,031	- -	0.38
30	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO ブラジル	株式 資本市場	145,216	922.09 133,902,891	1,251.89 181,795,910	- -	0.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和1年11月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	88.05
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.76
投資証券	0.21
合計	89.02

(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

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
銀行	外国	14.88
インターネット販売・通信販売		7.20
石油・ガス・消耗燃料		6.50
半導体・半導体製造装置		5.45
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.07
コンピュータ・周辺機器		4.49
保険		3.60
金属・鉱業		2.98
不動産管理・開発		2.41
無線通信サービス		2.39
化学		2.18
電子装置・機器・部品		2.02
食品		1.76
自動車		1.55
食品・生活必需品小売り		1.43
情報技術サービス		1.39
資本市場		1.34
各種電気通信サービス		1.28
医薬品		1.16
コングロマリット		1.15
飲料		0.97
建設資材		0.95
電力		0.87
貯蓄・抵当・不動産金融		0.83
運送インフラ		0.83
繊維・アパレル・贅沢品		0.77
娯楽		0.69
ホテル・レストラン・レジャー		0.68
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.64
建設・土木		0.64
機械		0.63
各種金融サービス		0.62
各種消費者サービス		0.60
パーソナル用品		0.59
ガス		0.55
複合小売り		0.53
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス		0.50
専門小売り		0.49
自動車部品		0.48
家庭用品		0.39
タバコ		0.38
バイオテクノロジー		0.36
家庭用耐久財		0.35
ライフサイエンス・ツール / サービス		0.30
消費者金融		0.29
陸運・鉄道		0.29
電気設備		0.27
旅客航空輸送業		0.24

水道	0.22
メディア	0.21
航空貨物・物流サービス	0.20
紙製品・林産品	0.18
ソフトウェア	0.18
商業サービス・用品	0.17
航空宇宙・防衛	0.16
ヘルスケア機器・用品	0.14
通信機器	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
海運業	0.09
レジャー用品	0.09
エネルギー設備・サービス	0.08
総合公益事業	0.06
建設関連製品	0.04
専門サービス	0.03
商社・流通業	0.03
合計	88.05

(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)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年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	351	5,963,395,830	5,956,470,000	2.33

（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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・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	283	4,743,294,748	4,889,176,627	1.38
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec19	買建	259	1,141,437,409	1,155,613,970	0.33
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec19	買建	39	403,348,211	409,052,182	0.12
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec19	買建	15	246,553,533	253,088,520	0.07
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Dec19	買建	13	161,224,844	165,584,276	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J-REITインデックスファンド・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 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0112月	買建	501	1,065,502,908	1,111,969,500	2.52

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年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	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Dec19	買建	967	5,554,867,296	5,590,162,597	10.92

(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30年11月12日)	16,055	16,055	0.9834	0.9834
第2計算期間末 (令和1年11月11日)	63,143	63,143	1.0389	1.0389
平成30年11月末日	16,133	-	0.9883	-
12月末日	15,987	-	0.9852	-
平成31年1月末日	16,061	-	0.9929	-
2月末日	16,142	-	0.9955	-
3月末日	15,977	-	1.0130	-
4月末日	15,882	-	1.0100	-
令和1年5月末日	17,746	-	1.0118	-
6月末日	20,597	-	1.0257	-
7月末日	25,581	-	1.0319	-
8月末日	31,626	-	1.0507	-
9月末日	44,949	-	1.0484	-
10月末日	60,111	-	1.0434	-
11月末日	72,730	-	1.0456	-

#### 【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

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
第2計算期間	48,308,726,995	3,853,963,676

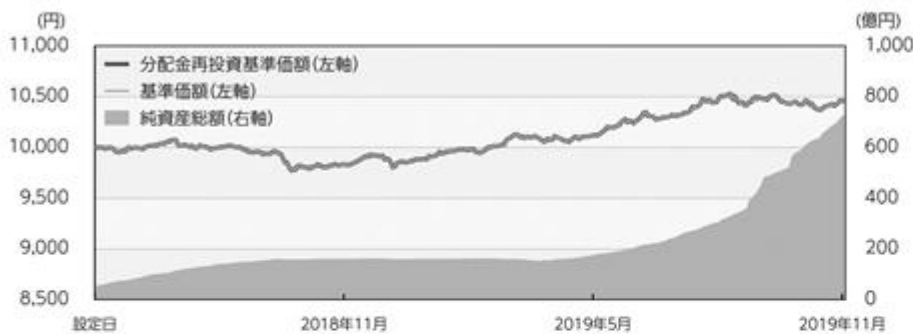
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2019年11月29日

## 基準価額・純資産の推移 (2018年5月25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:2018年5月25日)

## 分配の推移(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	44.95
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	12.23
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.05
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.41
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.78
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	4.90
7	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.51
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	1.92

## ■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/9/20	1.00
2	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	0.97
3	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	0.93
4	128回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/6/20	0.93
5	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	0.92

○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。



### ■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.47
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.78
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	1.48

### ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.5 08/31/21	国債証券	アメリカ	1.5	2021/8/31	0.74
2	US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	アメリカ	2.25	2025/11/15	0.71
3	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	0.59
4	US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	アメリカ	1.625	2026/2/15	0.55
5	US T N/B 1.375 10/15/22	国債証券	アメリカ	1.375	2022/10/15	0.54

### ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	2.97
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.72
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.87
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.19
5	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.03

### ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.84
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.40
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.35
4	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	4.12
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	投資証券	日本	4.11

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

### ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	4.31
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	3.54
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.44
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.57
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.35

### ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.54
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.25	2025/1/7	1.79
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.76
4	BRAZIL 2.625 01/05/23	国債証券	ブラジル	2.625	2023/1/5	1.74
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.55

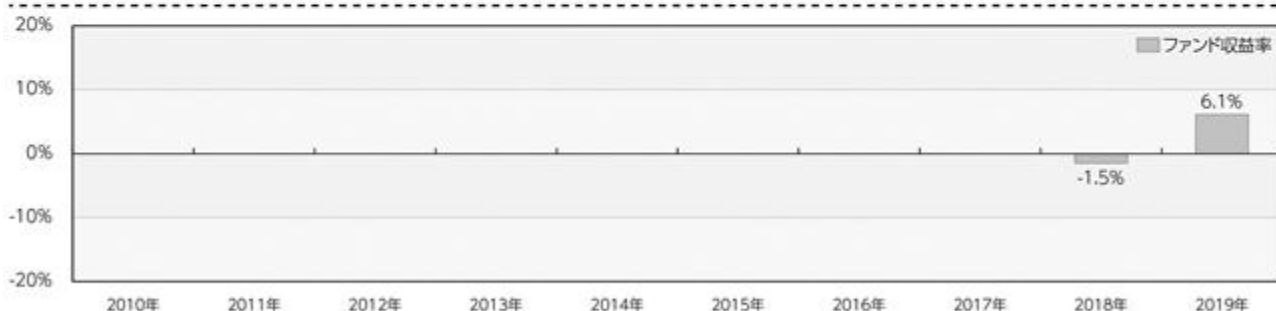
### ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	5.17
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.79
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.76
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.16
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	銀行	1.18

## 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。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2019年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

- ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

#### < 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### ・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

#### ・払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

信託期間は、2018年5月25日（設定日）から原則として2028年5月11日までです。

下記(5)その他 イ．償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年11月12日から翌年11月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解

任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

#### ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項(上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。



## 八. 関係法人との契約の更改

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

なお、2020年4月15日に締結予定の投資顧問契約については以下の通りです。

委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）の間の当該契約は、原則として期間満了の90日前までにいずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、当ファンドの信託終了まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二. 公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

## ホ. 運用報告書

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

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

## 4【受益者の権利等】

### (1) 収益分配金請求権

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

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

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(平成30年11月13日から令和1年11月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 平成30年11月12日現在	第2期 令和1年11月11日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	892,499,865	5,113,628,953
親投資信託受益証券	15,277,997,195	58,252,140,080
派生商品評価勘定	-	9,623,458
流動資産合計	16,170,497,060	63,375,392,491
資産合計	16,170,497,060	63,375,392,491
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	36,190,431	39,748,904
未払解約金	15,147,911	19,841,342
未払受託者報酬	1,913,786	5,217,685
未払委託者報酬	61,242,669	166,967,475
その他未払費用	250,846	530,613
流動負債合計	114,745,643	232,306,019
負債合計	114,745,643	232,306,019
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	16,326,185,927	60,780,949,246
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	270,434,510	2,362,137,226
(分配準備積立金)	98,696,164	493,757,030
元本等合計	16,055,751,417	63,143,086,472
純資産合計	16,055,751,417	63,143,086,472
負債純資産合計	16,170,497,060	63,375,392,491

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	平成30年5月25日 至 平成30年11月12日	自	平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		174,002,805		1,160,142,885
為替差損益		30,482,645		109,795,130
営業収益合計		204,485,450		1,050,347,755
<b>営業費用</b>				
支払利息		391,775		1,045,273
受託者報酬		1,913,786		7,801,834
委託者報酬		61,242,669		249,661,605
その他費用		264,118		868,656
営業費用合計		63,812,348		259,377,368
営業利益又は営業損失( )		268,297,798		790,970,387
経常利益又は経常損失( )		268,297,798		790,970,387
当期純利益又は当期純損失( )		268,297,798		790,970,387
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( )		6,954,323		85,405,717
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		270,434,510
剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,927,007,066
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		33,858,916
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		1,893,148,150
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,091,035		-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		20,698		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,070,337		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		270,434,510		2,362,137,226

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第2期	
	自 平成30年11月13日	至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年11月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を平成30年11月12日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期	第2期
	平成30年11月12日現在	令和1年11月11日現在
1. 期首元本額	5,541,516,151円	16,326,185,927円
期中追加設定元本額	11,699,564,143円	48,308,726,995円
期中一部解約元本額	914,894,367円	3,853,963,676円
2. 受益権の総数	16,326,185,927口	60,780,949,246口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は270,434,510円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期	第2期
	自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(98,696,164円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(13,140,329円)及び分配準備積立金(0円)より分配対象収益は111,836,493円(1万口当たり68.50円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(406,155,537円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(7,612,501円)、信託約款に規定される収益調整金(1,868,380,196円)及び分配準備積立金(79,988,992円)より分配対象収益は2,362,137,226円(1万口当たり388.63円)ですが、分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自 平成30年5月25日 至 平成30年11月12日	第2期 自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第1期 平成30年11月12日現在	第2期 令和1年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第1期 平成30年11月12日現在	第2期 令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	112,200,357	806,595,991
合計	112,200,357	806,595,991



(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第1期 平成30年11月12日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	2,572,930,069	-	2,609,120,500	36,190,431
アメリカ・ドル	159,741,054	-	161,510,800	1,769,746
イギリス・ポンド	1,129,067,940	-	1,148,784,000	19,716,060
オーストラリア・ドル	160,841,808	-	165,141,600	4,299,792
カナダ・ドル	319,893,420	-	322,462,800	2,569,380
ユーロ	803,385,847	-	811,221,300	7,835,453
合計	2,572,930,069	-	2,609,120,500	36,190,431

種類	第2期 令和1年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	10,765,210,454	-	10,795,335,900	30,125,446
アメリカ・ドル	1,536,188,475	-	1,553,250,000	17,061,525
イギリス・ポンド	1,848,219,456	-	1,844,718,800	3,500,656
オーストラリア・ドル	1,844,219,097	-	1,854,547,500	10,328,403
カナダ・ドル	1,843,289,024	-	1,855,648,000	12,358,976
ユーロ	3,693,294,402	-	3,687,171,600	6,122,802
合計	10,765,210,454	-	10,795,335,900	30,125,446

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第1期 平成30年11月12日現在	第2期 令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9834円 (9,834円)	1.0389円 (10,389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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	1,543,795,221	4,157,903,668	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,899,428,577	7,774,266,978	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	505,131,778	1,209,437,016	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	413,955,985	1,588,804,466	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	2,687,069,321	3,658,713,587	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	20,590,043,081	28,869,299,403	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	2,700,992,497	3,178,798,069	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	3,856,551,961	7,814,916,893	
親投資信託受益証券 合計		38,196,968,421	58,252,140,080	
合計			58,252,140,080	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

（参考）

当ファンドは、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,091,155,366
国債証券	187,688,255,600
地方債証券	21,276,132,984
特殊債券	17,975,726,042
社債券	11,787,557,820
未収利息	462,937,040
前払費用	20,353,727
流動資産合計	240,302,118,579
資産合計	240,302,118,579
負債の部	
流動負債	
未払金	6,612,312,000
未払解約金	695,113,000
流動負債合計	7,307,425,000
負債合計	7,307,425,000
純資産の部	
元本等	
元本	176,800,196,123
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,194,497,456
元本等合計	232,994,693,579
純資産合計	232,994,693,579
負債純資産合計	240,302,118,579

#### 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	263,721,851,914円
同期中追加設定元本額	123,180,588,067円
同期中一部解約元本額	210,102,243,858円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	20,729,530,766円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	81,540,372円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	75,008,603円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	20,965,757円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	905,773,822円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	243,482,194円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	27,343,223円
たわらノーロード 国内債券	8,740,349,706円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	488,081,340円
たわらノーロード バランス(堅実型)	133,100,172円
たわらノーロード バランス(標準型)	236,896,391円
たわらノーロード バランス(積極型)	30,426,334円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	10,408,447円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	341,643,025円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	346,847,065円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	89,695,946円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	21,312,619円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	4,416,249円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,055,858円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,270,232円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,124,955円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	17,517円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,873,905,012円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	6,560,495,292円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	9,073,024,155円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,586,249,434円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,793,272,580円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,979,816,162円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	301,846,117円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	85,601,103円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,378,734,022円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	2,280,341円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,415,613,828円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	925,327,096円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	193,056,255円
投資のソムリエ	4,073,453,643円
クルーズコントロール	2,568,559,689円
投資のソムリエ<DC年金>	422,463,609円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,839,519,981円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	328,322,866円
クルーズコントロール<DC年金>	2,612,109円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	8,585,072円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	19,906,875円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	522,947,140円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,918,423,134円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	3,849,808円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,799,545円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,093,379円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,874,781円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,219,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,899,428,577円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,895,256,741円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	616,984円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	519,556円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	527,148円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	292,240円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,840,820,043円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	411,160,875円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,950,527,114円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,974,701,827円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,973,723,860円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,993,014,716円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,014,750,592円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	228,284,294円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	167,283,951円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	60,790,498円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	155,610,178円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	77,359,515円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	35,103,199円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	86,431,937円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	170,193,759円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,700,145,306円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,612,419,991円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,929,141,423円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	521,119,651円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	241,029,849円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,854,775,088円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	291,934,478円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	19,111,994円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	59,877,782円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,687,751,753円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	87,302,121円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	554,223,829円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	936,910,246円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	7,309,355円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	581,046円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	377,921円

D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	18,778,381,693円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	390,158,306円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	112,548,419円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	491,976,182円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	732,208円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	396,351円
計	176,800,196,123円
2. 受益権の総数	176,800,196,123口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	386,964,800
地方債証券	95,419,670
特殊債券	7,517,143
社債券	79,061,480
合計	220,000,793

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年2月15日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額	1.3178円
(1万口当たり純資産額)	(13,178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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	396回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	702,310,000	
	397回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,840,000	
	398回 利付国庫債券(2年)	1,100,000,000	1,104,224,000	
	399回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,008,180,000	
	127回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,827,134,400	
	128回 利付国庫債券(5年)	2,200,000,000	2,210,076,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,131,236,000	
	130回 利付国庫債券(5年)	1,150,000,000	1,157,164,500	
	131回 利付国庫債券(5年)	1,420,000,000	1,430,053,600	
	132回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,209,408,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,190,159,800	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,191,056,600	
	135回 利付国庫債券(5年)	1,800,000,000	1,818,198,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,263,600,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,416,310,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	1,450,000,000	1,467,994,500	
	139回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,317,108,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	1,300,000,000	1,317,810,000	
	141回 利付国庫債券(5年)	550,000,000	557,947,500	
	2回 利付国庫債券(40年)	380,000,000	563,361,400	
3回 利付国庫債券(40年)	380,000,000	568,198,800		
4回 利付国庫債券(40年)	490,000,000	739,821,600		
5回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	701,995,200		



6回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	721,750,000	
7回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	806,495,800	
8回 利付国庫債券(40年)	520,000,000	676,852,800	
9回 利付国庫債券(40年)	780,000,000	760,679,400	
10回 利付国庫債券(40年)	770,000,000	880,795,300	
11回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	645,337,000	
12回 利付国庫債券(40年)	310,000,000	312,049,100	
313回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,826,104,300	
314回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	813,968,000	
315回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,533,390,000	
316回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,020,650,000	
317回 利付国庫債券(10年)	600,000,000	614,346,000	
318回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,430,870,000	
319回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	821,800,000	
320回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,537,695,000	
321回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	822,576,000	
322回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	512,925,000	
323回 利付国庫債券(10年)	750,000,000	771,480,000	
324回 利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,077,321,000	
325回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,337,128,000	
326回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	513,975,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,237,284,000	
328回 利付国庫債券(10年)	1,090,000,000	1,119,222,900	
329回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,833,560,700	
330回 利付国庫債券(10年)	450,000,000	467,388,000	
331回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	670,065,500	
332回 利付国庫債券(10年)	1,410,000,000	1,456,374,900	

333回 利付国庫債券(10年)	1,250,000,000	1,293,600,000	
334回 利付国庫債券(10年)	2,120,000,000	2,198,270,400	
335回 利付国庫債券(10年)	1,500,000,000	1,551,090,000	
336回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	725,263,000	
337回 利付国庫債券(10年)	940,000,000	964,233,200	
338回 利付国庫債券(10年)	2,130,000,000	2,199,118,500	
339回 利付国庫債券(10年)	2,140,000,000	2,212,738,600	
340回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,967,526,000	
341回 利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,968,388,700	
342回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	2,016,907,200	
343回 利付国庫債券(10年)	2,080,000,000	2,120,331,200	
344回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,968,870,200	
345回 利付国庫債券(10年)	1,960,000,000	2,000,199,600	
346回 利付国庫債券(10年)	1,920,000,000	1,960,032,000	
347回 利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	1,991,301,000	
348回 利付国庫債券(10年)	2,030,000,000	2,073,624,700	
349回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,798,297,600	
350回 利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,297,565,000	
351回 利付国庫債券(10年)	1,860,000,000	1,898,855,400	
352回 利付国庫債券(10年)	1,820,000,000	1,856,654,800	
353回 利付国庫債券(10年)	1,650,000,000	1,681,861,500	
354回 利付国庫債券(10年)	1,470,000,000	1,497,033,300	
355回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,475,244,500	
356回 利付国庫債券(10年)	450,000,000	457,587,000	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	128,352,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	125,236,000	
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,298,000	

4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,218,000	
5回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,534,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,932,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	244,982,000	
11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	243,598,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	255,010,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,513,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	384,363,100	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,696,000	
16回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	404,205,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,450,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	424,508,800	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,962,000	
20回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	409,179,000	
21回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	400,791,000	
22回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	438,960,000	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	275,022,000	
24回 利付国庫債券(30年)	300,000,000	413,853,000	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	269,906,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	547,564,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	585,013,800	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	671,851,200	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	777,487,200	
30回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	990,604,800	
31回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	819,762,000	
32回 利付国庫債券(30年)	760,000,000	1,058,634,400	
33回 利付国庫債券(30年)	870,000,000	1,164,851,700	

34回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,136,036,200	
35回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,039,538,500	
36回 利付国庫債券(30年)	950,000,000	1,288,276,000	
37回 利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,325,946,600	
38回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	754,104,300	
39回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	647,140,800	
40回 利付国庫債券(30年)	450,000,000	597,604,500	
41回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	601,381,000	
42回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	667,482,900	
43回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	655,125,000	
44回 利付国庫債券(30年)	490,000,000	643,463,100	
45回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	760,104,000	
46回 利付国庫債券(30年)	730,000,000	926,552,500	
47回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	854,851,800	
48回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	736,001,400	
49回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	823,785,600	
50回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	747,510,400	
51回 利付国庫債券(30年)	550,000,000	535,485,500	
52回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	695,640,000	
53回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	629,340,000	
54回 利付国庫債券(30年)	550,000,000	604,978,000	
55回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	648,663,700	
56回 利付国庫債券(30年)	730,000,000	802,175,100	
57回 利付国庫債券(30年)	650,000,000	713,882,000	
58回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	943,979,000	

59回 利付国庫債券(30年)	580,000,000	621,464,200	
60回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	562,485,000	
61回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	641,904,000	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	507,795,000	
63回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	563,285,400	
64回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	197,368,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	389,175,500	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	378,474,400	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	157,372,600	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	212,547,300	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	271,118,400	
83回 利付国庫債券(20年)	480,000,000	547,713,600	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	504,442,400	
88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	407,998,500	
90回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	815,626,000	
92回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,163,650,000	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	290,380,000	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	526,036,500	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	416,423,000	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	593,865,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	533,281,500	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	718,932,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	439,239,600	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	479,472,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	422,670,500	

107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	481,072,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	473,716,000	
109回 利付国庫債券(20年)	520,000,000	617,578,000	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	398,148,300	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	353,811,600	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	665,703,500	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	935,804,100	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	670,428,000	
115回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	491,648,000	
116回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	554,764,500	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	794,573,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	376,935,200	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	358,392,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	469,348,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	652,784,400	
122回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	299,495,000	
123回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	839,494,000	
124回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	611,720,000	
125回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	449,895,600	
126回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	552,154,500	
127回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	303,915,000	
128回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	670,466,500	
129回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	350,157,600	
130回 利付国庫債券(20年)	580,000,000	702,095,800	
131回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	359,604,000	

132回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	648,756,000	
133回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	691,672,200	
134回 利付国庫債券(20年)	520,000,000	632,476,000	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	421,403,500	
136回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	238,344,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	422,324,000	
138回 利付国庫債券(20年)	280,000,000	330,845,200	
139回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	513,467,300	
140回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	1,137,371,800	
141回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	788,086,000	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	490,172,000	
143回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	672,879,200	
144回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	665,481,600	
145回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,278,889,500	
146回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,037,263,500	
147回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,184,437,800	
148回 利付国庫債券(20年)	880,000,000	1,053,553,600	
149回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,079,010,000	
150回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,126,643,000	
151回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	995,570,400	
152回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,031,768,100	
153回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,046,034,800	
154回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	986,688,500	
155回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,107,498,000	
156回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,013,437,600	

157回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	850,000,000	
158回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	901,331,600	
159回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	926,019,300	
160回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	918,187,000	
161回 利付国庫債券(20年)	710,000,000	754,438,900	
162回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	849,304,000	
163回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	816,677,400	
164回 利付国庫債券(20年)	1,010,000,000	1,052,450,300	
165回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	770,147,600	
166回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	807,135,000	
167回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	831,160,000	
168回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	815,376,000	
169回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	850,000,000	
170回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	300,279,000	
国債証券 合計	169,790,000,000	187,688,255,600	
地方債証券			
697回 東京都公募公債	500,000,000	508,960,000	
701回 東京都公募公債	700,000,000	712,943,000	
708回 東京都公募公債	500,000,000	511,730,000	
720回 東京都公募公債	300,000,000	309,462,000	
726回 東京都公募公債	400,000,000	412,072,000	
5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	111,315,000	
9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	232,138,000	
10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	347,763,000	
22年度12回 北海道公募公債	200,000,000	203,138,000	
30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	303,675,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,470,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	307,695,000	
345回 大阪府公募公債	300,000,000	304,266,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	204,548,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	306,912,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	310,494,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	358,606,500	



26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	204,924,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	315,330,000	
23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	204,300,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	214,894,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	112,798,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	512,985,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	309,177,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	201,118,000	
23年度2回 埼玉県公募公債	200,000,000	203,682,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	411,616,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	356,835,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	206,000,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	354,216,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	307,005,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	206,398,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	112,329,000	
94回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,505,000	
99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	713,377,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,483,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,000,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	716,485,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,330,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,985,000	
126回 共同発行市場公募地方債	793,900,000	818,955,484	
127回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,540,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,052,000	
137回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,650,000	
139回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	513,605,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,120,000	

	144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,192,000	
	146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,336,000	
	148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,915,000	
	166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,115,000	
	29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	202,038,000	
	488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	463,176,000	
	4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	117,153,000	
	30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	305,529,000	
	22年度5回 横浜市公募公債	200,000,000	202,756,000	
	23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	459,504,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	413,108,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	205,802,000	
	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	202,468,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	118,183,000	
	23年度1回 千葉市公募公債	200,000,000	203,976,000	
	<b>地方債証券 合計</b>	<b>20,543,900,000</b>	<b>21,276,132,984</b>	
<b>特殊債券</b>	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,736,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	232,365,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	279,578,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	716,037,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	102,768,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	198,492,000	
	9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,714,000	
	18回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	312,327,000	
	121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	594,140,000	
	149回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	408,876,000	
	180回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1,000,000,000	1,025,540,000	
	189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,740,000	
	193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	517,425,000	
	195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	342,130,800	
	239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	342,270,000	
	241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,765,000	
	260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	243,002,000	

309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	811,384,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	211,636,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	542,056,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	236,082,000	
20回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,578,000	
24回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,634,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	239,404,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,434,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	237,858,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	411,704,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	518,145,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	560,715,260	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	309,015,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	230,648,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,288,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	238,368,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	216,604,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	239,894,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	425,908,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,591,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,728,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	39,078,000	40,586,020	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,366,000	28,514,551	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,977,000	42,766,055	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	43,560,000	45,848,206	
13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	13,863,000	14,153,013	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	69,985,000	71,230,733	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,501,000	15,264,912	

	4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,320,000	58,038,424	
	5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,079,000	43,028,198	
	1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,870,000	71,520,117	
	2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	145,900,000	157,691,638	
	3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	250,976,000	267,296,969	
	1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	261,534,000	264,165,032	
	1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,268,000	279,383,256	
	1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	275,877,000	279,899,286	
	1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	280,179,000	283,882,966	
	1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,783,000	283,487,326	
	1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	287,625,000	292,871,280	
	い第828号 利付商工債	100,000,000	100,502,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	400,296,000	
	220号 利附商工債(3年)	300,000,000	300,498,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	119,012,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	514,210,000	
特殊債券 合計		16,843,741,000	17,975,726,042	
社債券	1回 B P C E S A円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,776,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	205,110,000	
	337回 東京交通債	200,000,000	205,998,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	203,830,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,946,000	
	6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	103,439,000	
	14回 プリヂェストン社債	200,000,000	200,554,000	
	23回 ジェイ エフ イーホールディングス社債	100,000,000	99,813,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	101,004,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	205,842,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,632,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	102,858,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	102,389,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	102,641,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	103,077,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	212,856,000	
	28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	200,000,000	203,510,000	

32回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	307,245,000	
9回 三菱UFJ信託銀行劣後債	100,000,000	102,310,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,706,000	
10回 セブン銀行社債	100,000,000	102,384,000	
23回 三井住友銀行劣後社債	400,000,000	406,640,000	
47回 日立キャピタル社債	200,000,000	204,594,000	
56回 三菱UFJリース社債	200,000,000	201,516,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	110,226,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	200,806,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	107,636,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,312,000	
19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,345,000	
21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,668,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	332,229,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	223,080,000	
9回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	210,670,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	322,737,000	
6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,349,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	310,287,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	215,838,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,166,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	137,625,600	
60回 日本電信電話社債	300,000,000	304,041,000	
518回 中部電力社債	200,000,000	200,738,000	
377回 中国電力社債	400,000,000	415,328,000	
379回 中国電力社債	300,000,000	302,145,000	
301回 北陸電力社債	100,000,000	103,584,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	105,412,000	
471回 東北電力社債	400,000,000	417,012,000	
473回 東北電力社債	300,000,000	302,391,000	
253回 四国電力社債	200,000,000	206,516,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	208,814,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	415,384,000	
320回 北海道電力社債	200,000,000	202,092,000	
321回 北海道電力社債	161,000,000	166,477,220	
340回 北海道電力社債	300,000,000	303,381,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	220,534,000	
38回 電源開発社債	300,000,000	310,533,000	
23回 東京瓦斯社債	300,000,000	310,119,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	104,422,000	
27回 NTTデータ社債	100,000,000	102,652,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,338,000	
社債券 合計	11,381,000,000	11,787,557,820	
合計		238,727,672,446	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,476,608,072
株式	253,322,028,630
派生商品評価勘定	85,876,190
未収入金	18,415,320
未収配当金	2,437,279,037
流動資産合計	260,340,207,249
資産合計	260,340,207,249
負債の部	
流動負債	
前受金	117,831,200
未払解約金	763,001,000
流動負債合計	880,832,200
負債合計	880,832,200
純資産の部	
元本等	
元本	96,335,804,545
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	163,123,570,504
元本等合計	259,459,375,049
純資産合計	259,459,375,049
負債純資産合計	260,340,207,249

## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	108,734,086,652円
同期中追加設定元本額	40,145,855,528円
同期中一部解約元本額	52,544,137,635円
元本の内訳 ファンド名 One DC 国内株式インデックスファンド	13,296,034,678円

DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,901,967,759円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,734,948円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,943,573円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	10,924,613円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,157,546円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,577,530円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,246,476円
たわらノーロード TOPIX	513,008,972円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	251,477,197円
たわらノーロード バランス(堅実型)	7,460,883円
たわらノーロード バランス(標準型)	49,531,151円
たわらノーロード バランス(積極型)	77,992,235円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	431,198円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	42,214,609円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	103,757,765円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	76,004,292円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	142,974,602円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	199,840円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,323,098円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,438,424円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,393,354円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,473,951円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	37,043,559,817円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,032,561,362円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,302,512,272円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,345,483,403円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	360,429,151円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,217,172,488円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,130,034,396円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	40,453,112円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,122,661,356円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	26,148,359円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	310,533,554円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	228,201,959円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	394,247,738円
投資のソムリエ	4,920,571,631円
クルーズコントロール	1,352,604,976円
投資のソムリエ<DC年金>	509,795,679円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	257,305,526円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	298,933,432円
クルーズコントロール<DC年金>	1,374,277円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	13,618,553円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	31,364,306円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	270,859,947円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,062,664,885円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	5,488,424円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,994,409円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,120,880円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	8,067,458円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	26,538,957円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,543,795,221円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	191,268,813円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	890,438円



投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	753,885円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	761,926円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	118,856円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	62,987,040円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	798,977,348円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	95,905,620円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	211,072,875円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,120,761円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,251,010円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	15,578,762円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	13,257,174円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	29,000,197円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	57,147,828円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	886,715,678円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	876,382,701円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,480,759,818円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	175,735,006円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	48,495,760円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	478,982,523円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	146,958,746円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,205,659円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	38,010,492円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	507,166,456円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	43,962,671円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	139,442,077円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	353,900,784円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	460,109円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	117,300円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	191,197円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	5,672,676,043円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	59,870,059円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	24,273,537円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	24,726,650円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	105,377円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	120,211円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	395,415,043円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,266,057,452円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,678,627,712円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	67,986,729円
計	96,335,804,545円
2. 受益権の総数	96,335,804,545口

3. 差入代用有価証券 株式	3,964,500,000円
-------------------	----------------

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	19,865,829,947	
合計	19,865,829,947	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年2月8日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引 先物取引 買建	5,474,650,900	-	5,560,635,000	85,984,100
合計	5,474,650,900	-	5,560,635,000	85,984,100

## (注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.6933円 (26,933円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

令和1年11月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	2,996.00	14,980,000	
日本水産	142,900	640.00	91,456,000	
マルハニチロ	20,600	2,910.00	59,946,000	
ハウスイ	900	864.00	777,600	
カネコ種苗	4,400	1,508.00	6,635,200	
サカタのタネ	17,000	3,660.00	62,220,000	
ホクト	10,900	1,941.00	21,156,900	
ホクリヨウ	2,300	687.00	1,580,100	
ヒノキヤグループ	3,600	2,154.00	7,754,400	
ショーボンドホールディングス	20,400	4,355.00	88,842,000	
ミライト・ホールディングス	42,500	1,735.00	73,737,500	
タマホーム	6,900	1,967.00	13,572,300	
サンヨーホームズ	1,300	690.00	897,000	
日本アクア	5,600	688.00	3,852,800	
ファーストコーポレーション	4,400	691.00	3,040,400	
ベステラ	2,500	1,244.00	3,110,000	
TATERU	29,400	205.00	6,027,000	
スペースバリューホールディングス	17,400	531.00	9,239,400	
住石ホールディングス	28,700	141.00	4,046,700	
日鉄鉱業	3,300	4,705.00	15,526,500	
三井松島ホールディングス	5,600	1,257.00	7,039,200	
国際石油開発帝石	573,400	1,063.50	609,810,900	
石油資源開発	18,700	2,937.00	54,921,900	
K&Oエナジーグループ	7,000	1,675.00	11,725,000	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	929.00	2,601,200	
第一カッター興業	1,800	1,822.00	3,279,600	
安藤・間	85,100	886.00	75,398,600	
東急建設	41,800	818.00	34,192,400	
コムシスホールディングス	50,700	3,100.00	157,170,000	

ミサワホーム	9,900	1,223.00	12,107,700
ビーアールホールディングス	15,600	460.00	7,176,000
高松コンストラクショングループ	8,900	2,722.00	24,225,800
東建コーポレーション	4,400	7,310.00	32,164,000
ソネック	1,500	811.00	1,216,500
ヤマウラ	6,300	888.00	5,594,400
大成建設	110,100	4,240.00	466,824,000
大林組	330,100	1,126.00	371,692,600
清水建設	335,000	1,033.00	346,055,000
飛島建設	9,400	1,436.00	13,498,400
長谷工コーポレーション	127,800	1,458.00	186,332,400
松井建設	13,000	867.00	11,271,000
銭高組	1,400	4,230.00	5,922,000
鹿島建設	259,200	1,511.00	391,651,200
不動テトラ	8,600	1,583.00	13,613,800
大末建設	3,800	990.00	3,762,000
鉄建建設	7,200	2,964.00	21,340,800
西松建設	25,400	2,377.00	60,375,800
三井住友建設	79,600	625.00	49,750,000
大豊建設	7,400	3,135.00	23,199,000
前田建設工業	82,700	1,061.00	87,744,700
佐田建設	7,100	419.00	2,974,900
ナカノフドー建設	9,100	512.00	4,659,200
奥村組	17,900	3,170.00	56,743,000
東鉄工業	14,200	3,380.00	47,996,000
イチケン	2,400	1,817.00	4,360,800
富士ピー・エス	4,800	642.00	3,081,600
浅沼組	3,700	4,450.00	16,465,000
戸田建設	137,200	693.00	95,079,600
熊谷組	15,300	3,360.00	51,408,000
北野建設	2,000	2,985.00	5,970,000
植木組	1,500	2,652.00	3,978,000
矢作建設工業	14,700	835.00	12,274,500
ピーエス三菱	10,900	747.00	8,142,300
日本ハウスホールディングス	22,500	515.00	11,587,500
大東建託	39,500	14,085.00	556,357,500
新日本建設	14,100	911.00	12,845,100
N I P P O	27,300	2,275.00	62,107,500
東亜道路工業	2,100	3,380.00	7,098,000
前田道路	35,000	2,422.00	84,770,000
日本道路	3,200	6,690.00	21,408,000
東亜建設工業	10,300	1,586.00	16,335,800
日本国土開発	19,300	670.00	12,931,000
若築建設	6,000	1,691.00	10,146,000
東洋建設	36,900	525.00	19,372,500
五洋建設	130,800	671.00	87,766,800
世紀東急工業	15,900	809.00	12,863,100
福田組	3,800	4,920.00	18,696,000
日本ドライケミカル	2,700	1,323.00	3,572,100
住友林業	83,600	1,588.00	132,756,800

日本基礎技術	11,200	387.00	4,334,400
バコーボレーション	14,500	431.00	6,249,500
大和ハウス工業	326,600	3,440.00	1,123,504,000
ライト工業	18,900	1,624.00	30,693,600
積水ハウス	361,200	2,315.50	836,358,600
日特建設	8,700	736.00	6,403,200
北陸電気工事	5,800	1,074.00	6,229,200
ユアテック	18,900	702.00	13,267,800
四電工	1,700	2,752.00	4,678,400
中電工	13,300	2,593.00	34,486,900
関電工	46,900	1,039.00	48,729,100
きんでん	78,400	1,662.00	130,300,800
東京エネシス	11,000	968.00	10,648,000
トーエネック	3,300	3,710.00	12,243,000
住友電設	9,300	2,406.00	22,375,800
日本電設工業	18,100	2,318.00	41,955,800
協和エクシオ	50,000	2,737.00	136,850,000
新日本空調	8,800	2,181.00	19,192,800
日本工営	6,800	3,460.00	23,528,000
九電工	23,200	3,700.00	85,840,000
三機工業	23,800	1,401.00	33,343,800
日揮ホールディングス	101,600	1,621.00	164,693,600
中外炉工業	3,600	1,769.00	6,368,400
ヤマト	10,600	749.00	7,939,400
太平電業	8,000	2,373.00	18,984,000
高砂熱学工業	28,700	1,941.00	55,706,700
三晃金属工業	1,400	2,610.00	3,654,000
NECネットエスアイ	9,800	3,365.00	32,977,000
朝日工業社	2,200	3,345.00	7,359,000
明星工業	21,400	919.00	19,666,600
大気社	16,100	3,815.00	61,421,500
ダイダン	7,900	2,720.00	21,488,000
日比谷総合設備	10,700	1,997.00	21,367,900
東芝プラントシステム	25,500	2,103.00	53,626,500
日本製粉	30,900	1,769.00	54,662,100
日清製粉グループ本社	119,400	2,118.00	252,889,200
日東富士製粉	700	6,390.00	4,473,000
昭和産業	9,700	3,055.00	29,633,500
鳥越製粉	9,400	946.00	8,892,400
中部飼料	12,900	1,333.00	17,195,700
フィード・ワン	70,900	167.00	11,840,300
東洋精糖	1,700	1,139.00	1,936,300
日本甜菜製糖	5,600	2,099.00	11,754,400
三井製糖	9,300	2,309.00	21,473,700
塩水港精糖	11,100	216.00	2,397,600
日新製糖	5,000	2,029.00	10,145,000
LIFULL	35,100	680.00	23,868,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,700	2,026.00	13,574,200
日本M&Aセンター	76,000	3,300.00	250,800,000
メンバーズ	3,000	2,385.00	7,155,000

中広	1,100	546.00	600,600	
アイティメディア	3,000	792.00	2,376,000	
タケエイ	9,600	1,222.00	11,731,200	
E・Jホールディングス	1,300	1,469.00	1,909,700	
トラスト・テック	11,100	1,403.00	15,573,300	
コシダカホールディングス	24,200	1,581.00	38,260,200	
アルトナー	2,400	747.00	1,792,800	
パソナグループ	12,300	1,556.00	19,138,800	
CDS	2,500	1,440.00	3,600,000	
リンクアンドモチベーション	22,200	602.00	13,364,400	
GCA	12,100	870.00	10,527,000	
エス・エム・エス	31,300	2,851.00	89,236,300	
サニーサイドアップ	2,200	1,005.00	2,211,000	
パーソルホールディングス	100,600	2,120.00	213,272,000	
リニカル	4,800	998.00	4,790,400	
クックパッド	35,100	373.00	13,092,300	
エスクリ	3,200	891.00	2,851,200	
アイ・ケイ・ケイ	5,000	704.00	3,520,000	
森永製菓	24,800	5,720.00	141,856,000	
中村屋	2,700	4,680.00	12,636,000	
江崎グリコ	31,300	5,090.00	159,317,000	
名糖産業	5,100	1,316.00	6,711,600	
井村屋グループ	4,500	2,110.00	9,495,000	
不二家	5,900	2,142.00	12,637,800	
山崎製パン	79,200	1,903.00	150,717,600	
第一屋製パン	1,800	983.00	1,769,400	
モロゾフ	1,800	5,040.00	9,072,000	
亀田製菓	6,000	5,130.00	30,780,000	
寿スピリッツ	10,200	7,330.00	74,766,000	
カルビー	48,100	3,610.00	173,641,000	
森永乳業	19,500	4,645.00	90,577,500	
六甲バター	7,000	1,779.00	12,453,000	
ヤクルト本社	72,700	6,250.00	454,375,000	
明治ホールディングス	69,900	7,930.00	554,307,000	
雪印メグミルク	25,400	2,856.00	72,542,400	
プリマハム	16,500	2,575.00	42,487,500	
日本ハム	40,400	4,900.00	197,960,000	
林兼産業	3,500	667.00	2,334,500	
丸大食品	11,300	2,460.00	27,798,000	
S Foods	8,400	2,990.00	25,116,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	68,000	718.00	48,824,000	
学情	3,600	1,525.00	5,490,000	
スタジオアリス	5,100	1,928.00	9,832,800	
クロスキャット	2,700	1,022.00	2,759,400	
シミックホールディングス	5,600	1,701.00	9,525,600	
エプコ	1,600	1,460.00	2,336,000	
システナ	36,800	1,520.00	55,936,000	
NJS	2,300	1,732.00	3,983,600	
デジタルアーツ	5,100	5,990.00	30,549,000	
日鉄ソリューションズ	15,500	3,645.00	56,497,500	

総合警備保障	40,000	5,720.00	228,800,000
キューブシステム	5,400	797.00	4,303,800
いちご	132,000	431.00	56,892,000
エイジア	1,900	1,310.00	2,489,000
日本駐車場開発	114,100	167.00	19,054,700
コア	4,400	1,416.00	6,230,400
カカクコム	75,300	2,458.00	185,087,400
アイロムグループ	3,500	1,446.00	5,061,000
セントケア・ホールディング	6,500	513.00	3,334,500
サイネックス	1,800	661.00	1,189,800
ルネサンス	5,600	1,757.00	9,839,200
ディップ	14,200	3,070.00	43,594,000
SBSホールディングス	9,100	1,850.00	16,835,000
オプトホールディング	5,400	1,766.00	9,536,400
新日本科学	10,900	725.00	7,902,500
ツクイ	23,700	464.00	10,996,800
キャリアデザインセンター	2,500	1,452.00	3,630,000
ベネフィット・ワン	27,600	2,044.00	56,414,400
エムスリー	221,700	2,804.00	621,646,800
ツカダ・グローバルホールディング	6,600	613.00	4,045,800
プラス	800	688.00	550,400
アウトソーシング	57,500	1,175.00	67,562,500
ウェルネット	9,500	845.00	8,027,500
ワールドホールディングス	3,300	1,791.00	5,910,300
ディー・エヌ・エー	49,300	1,743.00	85,929,900
博報堂DYホールディングス	139,900	1,732.00	242,306,800
ぐるなび	17,500	1,001.00	17,517,500
タカミヤ	10,700	720.00	7,704,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,800	1,246.00	8,472,800
ファンコミュニケーションズ	27,600	516.00	14,241,600
ライク	4,000	1,684.00	6,736,000
ビジネス・ブレークスルー	4,300	360.00	1,548,000
エスプール	19,400	645.00	12,513,000
WDBホールディングス	4,600	2,666.00	12,263,600
ティア	5,900	607.00	3,581,300
CDG	1,100	1,417.00	1,558,700
パリュウ・コマース	5,600	1,702.00	9,531,200
インフォマート	55,100	1,843.00	101,549,300
サッポロホールディングス	36,000	2,652.00	95,472,000
アサヒグループホールディングス	221,300	5,316.00	1,176,430,800
麒麟ホールディングス	448,100	2,547.00	1,141,310,700
宝ホールディングス	79,100	1,073.00	84,874,300
オエノンホールディングス	27,900	383.00	10,685,700
養命酒製造	3,300	2,001.00	6,603,300
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	74,200	2,673.00	198,336,600
サントリー食品インターナショナル	70,700	4,865.00	343,955,500
ダイドーグループホールディングス	5,400	4,490.00	24,246,000
伊藤園	32,100	5,340.00	171,414,000
キーコーヒー	10,400	2,434.00	25,313,600



ユニカフェ	2,700	1,051.00	2,837,700
ジャパンフーズ	1,500	1,230.00	1,845,000
日清オイリオグループ	13,600	4,035.00	54,876,000
不二製油グループ本社	25,800	3,335.00	86,043,000
かどや製油	1,100	3,905.00	4,295,500
J-オイルミルズ	5,500	4,480.00	24,640,000
ローソン	26,200	6,090.00	159,558,000
サンエー	8,600	5,270.00	45,322,000
カワチ薬品	8,000	2,261.00	18,088,000
エービーシー・マート	16,200	7,430.00	120,366,000
ハードオフコーポレーション	4,100	814.00	3,337,400
高千穂交易	4,000	1,124.00	4,496,000
アスクル	10,800	2,886.00	31,168,800
ゲオホールディングス	18,700	1,362.00	25,469,400
アダストリア	14,400	2,789.00	40,161,600
ジーフット	6,300	626.00	3,943,800
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	674.00	1,011,000
伊藤忠食品	2,400	5,260.00	12,624,000
くら寿司	5,400	4,670.00	25,218,000
キャンドゥ	4,900	1,605.00	7,864,500
エレマテック	9,700	1,101.00	10,679,700
パルグループホールディングス	5,300	3,590.00	19,027,000
JALUX	2,900	2,569.00	7,450,100
エディオン	47,600	1,193.00	56,786,800
あらた	8,200	4,185.00	34,317,000
サーラコーポレーション	21,100	642.00	13,546,200
ワッツ	4,600	617.00	2,838,200
トーメンデバイス	1,600	2,667.00	4,267,200
ハローズ	3,900	2,800.00	10,920,000
J Pホールディングス	31,600	300.00	9,480,000
フジオフードシステム	4,400	3,795.00	16,698,000
あみやき亭	2,100	3,530.00	7,413,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,131.00	8,097,800
ひらまつ	19,100	320.00	6,112,000
フィールズ	7,900	480.00	3,792,000
双日	572,300	349.00	199,732,700
アルフレッサ ホールディングス	115,200	2,471.00	284,659,200
大黒天物産	2,500	3,395.00	8,487,500
ハニーズホールディングス	9,100	1,391.00	12,658,100
ファーマライズホールディングス	2,300	652.00	1,499,600
キッコーマン	76,000	5,530.00	420,280,000
味の素	233,300	1,892.00	441,403,600
キュービー	58,800	2,501.00	147,058,800
ハウス食品グループ本社	39,500	3,970.00	156,815,000
カゴメ	40,100	2,715.00	108,871,500
焼津水産化学工業	5,200	1,058.00	5,501,600
アリアケジャパン	9,700	8,370.00	81,189,000
ピエトロ	1,400	1,634.00	2,287,600
エバラ食品工業	2,500	2,199.00	5,497,500
やまみ	500	2,072.00	1,036,000

ニチレイ	50,300	2,501.00	125,800,300
横浜冷凍	29,000	1,074.00	31,146,000
東洋水産	54,400	4,820.00	262,208,000
イトアンド	3,700	1,780.00	6,586,000
大冷	1,400	1,995.00	2,793,000
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	952.00	5,521,600
日清食品ホールディングス	44,900	8,420.00	378,058,000
永谷園ホールディングス	5,200	2,181.00	11,341,200
一正蒲鉾	3,900	1,093.00	4,262,700
フジッコ	11,400	2,038.00	23,233,200
ロック・フィールド	11,400	1,531.00	17,453,400
日本たばこ産業	610,100	2,463.00	1,502,676,300
ケンコーマヨネーズ	5,900	2,717.00	16,030,300
わらべや日洋ホールディングス	6,900	1,907.00	13,158,300
なとり	5,900	1,709.00	10,083,100
イフジ産業	2,000	757.00	1,514,000
ピククルスコーポレーション	2,300	2,694.00	6,196,200
北の達人コーポレーション	36,900	667.00	24,612,300
ユーグレナ	45,000	772.00	34,740,000
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,933.00	10,438,200
片倉工業	15,000	1,412.00	21,180,000
グンゼ	7,600	5,260.00	39,976,000
ヒューリック	221,800	1,184.00	262,611,200
神栄	1,500	756.00	1,134,000
ラサ商事	5,600	891.00	4,989,600
アルペン	8,000	1,843.00	14,744,000
ハブ	2,900	1,010.00	2,929,000
ラクーンホールディングス	5,000	677.00	3,385,000
クオールホールディングス	15,200	1,604.00	24,380,800
アルコニックス	11,000	1,435.00	15,785,000
神戸物産	35,200	3,100.00	109,120,000
ソリトンシステムズ	4,500	1,049.00	4,720,500
ジーンズホールディングス	5,500	6,690.00	36,795,000
ビックカメラ	61,500	1,237.00	76,075,500
DCMホールディングス	55,900	1,085.00	60,651,500
ペッパーフードサービス	8,300	1,681.00	13,952,300
Monotaro	73,700	3,105.00	228,838,500
東京一番フーズ	2,600	627.00	1,630,200
DDホールディングス	4,100	1,485.00	6,088,500
あいホールディングス	14,800	1,992.00	29,481,600
ディービーエクス	3,700	970.00	3,589,000
きちりホールディングス	2,800	834.00	2,335,200
アークランドサービスホールディングス	7,600	1,940.00	14,744,000
J・フロントリテイリング	123,800	1,428.00	176,786,400
ドトール・日レスホールディングス	16,500	2,203.00	36,349,500
マツモトキヨシホールディングス	42,800	4,085.00	174,838,000
ブロンコピリー	5,400	2,678.00	14,461,200
ZOZO	101,800	2,549.00	259,488,200
トレジャー・ファクトリー	3,000	1,148.00	3,444,000

物語コーポレーション	2,600	8,540.00	22,204,000	
ココカラファイン	10,800	6,330.00	68,364,000	
三越伊勢丹ホールディングス	181,100	1,005.00	182,005,500	
東洋紡	40,700	1,659.00	67,521,300	
ユニチカ	30,000	377.00	11,310,000	
富士紡ホールディングス	5,000	3,410.00	17,050,000	
日清紡ホールディングス	70,100	951.00	66,665,100	
倉敷紡績	10,600	2,572.00	27,263,200	
ダイワボウホールディングス	8,800	5,190.00	45,672,000	
シキボウ	5,500	945.00	5,197,500	
日東紡績	15,700	3,805.00	59,738,500	
トヨタ紡織	30,700	1,710.00	52,497,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	24,700	1,805.00	44,583,500	
H a m e e	3,200	1,206.00	3,859,200	
ラクト・ジャパン	3,900	3,570.00	13,923,000	
ウエルシアホールディングス	30,800	6,260.00	192,808,000	
クリエイトSDホールディングス	15,300	2,783.00	42,579,900	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,500	1,091.00	21,274,500	
八洲電機	8,100	914.00	7,403,400	
メディアスホールディングス	5,900	849.00	5,009,100	
レスターホールディングス	10,800	1,981.00	21,394,800	
ジュテックホールディングス	2,300	1,098.00	2,525,400	
丸善CHIホールディングス	12,500	378.00	4,725,000	
大光	4,300	740.00	3,182,000	
OCHIホールディングス	3,000	1,371.00	4,113,000	
TOKAIホールディングス	54,800	1,094.00	59,951,200	
黒谷	1,900	458.00	870,200	
ミサワ	2,100	862.00	1,810,200	
ティーライフ	1,500	865.00	1,297,500	
C o m i n i x	1,900	818.00	1,554,200	
エー・ピーカンパニー	2,100	559.00	1,173,900	
三洋貿易	5,200	2,358.00	12,261,600	
チムニー	3,200	2,358.00	7,545,600	
シュッピン	7,000	1,007.00	7,049,000	
ビューティガレージ	1,700	1,651.00	2,806,700	
ウイン・パートナーズ	7,500	1,485.00	11,137,500	
ネクステージ	14,800	1,131.00	16,738,800	
ジョイフル本田	30,400	1,467.00	44,596,800	
鳥貴族	3,400	2,018.00	6,861,200	
キリン堂ホールディングス	4,100	2,164.00	8,872,400	
ホットランド	6,900	1,258.00	8,680,200	
すかいらーくホールディングス	116,200	2,019.00	234,607,800	
SFPホールディングス	4,400	2,294.00	10,093,600	
綿半ホールディングス	3,900	2,071.00	8,076,900	
日本毛織	34,000	1,094.00	37,196,000	
ダイトウボウ	17,000	85.00	1,445,000	
トーア紡コーポレーション	4,000	543.00	2,172,000	
ダイドーリミテッド	14,000	280.00	3,920,000	
ヨシックス	1,700	2,783.00	4,731,100	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,100	983.00	29,588,300	
三栄建築設計	4,200	1,577.00	6,623,400	
野村不動産ホールディングス	63,000	2,530.00	159,390,000	
三重交通グループホールディングス	21,200	621.00	13,165,200	
サムティ	14,700	2,129.00	31,296,300	
ディア・ライフ	13,400	568.00	7,611,200	
コーセーアールイー	3,100	802.00	2,486,200	
エー・ディー・ワークス	192,800	31.00	5,976,800	
日本商業開発	6,600	1,546.00	10,203,600	
プレサンスコーポレーション	16,500	1,810.00	29,865,000	
ユニゾホールディングス	15,700	4,955.00	77,793,500	
THEグローバル社	5,400	479.00	2,586,600	
ハウスコム	1,400	1,660.00	2,324,000	
日本管理センター	6,900	1,422.00	9,811,800	
サンセイランディック	3,100	946.00	2,932,600	
エストラスト	1,500	799.00	1,198,500	
フージャースホールディングス	20,800	728.00	15,142,400	
オープンハウス	30,100	2,853.00	85,875,300	
東急不動産ホールディングス	282,300	705.00	199,021,500	
飯田グループホールディングス	86,600	1,840.00	159,344,000	
イーグランド	1,800	793.00	1,427,400	
ムゲンエステート	7,300	742.00	5,416,600	
帝国繊維	11,600	2,066.00	23,965,600	
日本コークス工業	87,800	84.00	7,375,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	699.00	3,285,300	
ミタチ産業	3,000	770.00	2,310,000	
B E E N O S	3,600	1,530.00	5,508,000	
あさひ	7,700	1,251.00	9,632,700	
日本調剤	3,100	3,890.00	12,059,000	
コスモス薬品	4,600	22,480.00	103,408,000	
シップヘルスケアホールディングス	16,600	4,725.00	78,435,000	
トーエル	4,900	804.00	3,939,600	
ソフトクリエイイトホールディングス	4,500	1,816.00	8,172,000	
オンリー	1,700	806.00	1,370,200	
セブン&アイ・ホールディングス	405,600	4,245.00	1,721,772,000	
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	27,800	1,848.00	51,374,400	
明治電機工業	3,300	1,556.00	5,134,800	
ツルハホールディングス	22,500	12,580.00	283,050,000	
デリカフーズホールディングス	3,600	684.00	2,462,400	
スターティアホールディングス	2,400	657.00	1,576,800	
サンマルクホールディングス	8,200	2,478.00	20,319,600	
フェリシモ	2,300	1,042.00	2,396,600	
トリドールホールディングス	12,800	2,399.00	30,707,200	
帝人	84,100	2,142.00	180,142,200	
東レ	746,400	788.60	588,611,040	
クラレ	162,300	1,388.00	225,272,400	
旭化成	687,600	1,272.50	874,971,000	
サカイオーベックス	2,700	1,858.00	5,016,600	

TOKYO BASE	9,200	779.00	7,166,800
稲葉製作所	5,900	1,466.00	8,649,400
宮地エンジニアリンググループ	3,200	2,240.00	7,168,000
トーカロ	28,900	1,095.00	31,645,500
アルファ	3,700	1,333.00	4,932,100
SUMCO	124,600	1,762.00	219,545,200
川田テクノロジーズ	2,100	7,180.00	15,078,000
RS Technologies	2,900	4,270.00	12,383,000
信和	4,500	1,052.00	4,734,000
ビーロット	2,400	2,040.00	4,896,000
ファーストブラザーズ	2,400	1,276.00	3,062,400
ハウストゥ	5,700	1,571.00	8,954,700
シーアールイー	2,700	1,064.00	2,872,800
プロパティエージェント	1,600	1,155.00	1,848,000
ケイアイスター不動産	3,300	2,019.00	6,662,700
アグレ都市デザイン	1,500	504.00	756,000
グッドコムアセット	2,400	1,719.00	4,125,600
ジェイ・エス・ビー	1,100	4,775.00	5,252,500
テンポイノベーション	1,200	1,670.00	2,004,000
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	706.00	1,200,200
住江織物	3,000	2,953.00	8,859,000
日本フェルト	5,600	499.00	2,794,400
イチカワ	1,500	1,577.00	2,365,500
エコナックホールディングス	18,900	140.00	2,646,000
日東製網	1,200	1,633.00	1,959,600
芦森工業	2,100	1,442.00	3,028,200
アツギ	8,600	800.00	6,880,000
ウイルプラスホールディングス	1,600	820.00	1,312,000
ジャパンミート	5,200	2,215.00	11,518,000
コメダホールディングス	22,500	2,063.00	46,417,500
サツドラホールディングス	1,500	1,772.00	2,658,000
デファクトスタンダード	700	359.00	251,300
アレンザホールディングス	5,200	853.00	4,435,600
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,488.00	3,980,800
パロックジャパンリミテッド	7,200	968.00	6,969,600
クスリのアオキホールディングス	10,300	8,200.00	84,460,000
ダイニック	3,800	792.00	3,009,600
共和レザー	5,700	811.00	4,622,700
力の源ホールディングス	4,700	869.00	4,084,300
スシローグローバルホールディングス	11,400	8,020.00	91,428,000
LIXILピバ	10,200	1,993.00	20,328,600
アセンテック	800	1,821.00	1,456,800
セーレン	25,300	1,526.00	38,607,800
ソトー	3,700	988.00	3,655,600
東海染工	1,400	1,140.00	1,596,000
小松マテーレ	16,900	848.00	14,331,200
ワコールホールディングス	26,900	2,927.00	78,736,300
ホギメディカル	11,700	3,660.00	42,822,000
レナウン	26,600	113.00	3,005,800
クラウドシアホールディングス	2,800	488.00	1,366,400

T S Iホールディングス	34,600	596.00	20,621,600	
マツオカコーポレーション	2,900	1,994.00	5,782,600	
ワールド	14,600	2,910.00	42,486,000	
T I S	34,400	6,050.00	208,120,000	
ネオス	4,000	843.00	3,372,000	
電算システム	3,900	2,930.00	11,427,000	
グリー	71,200	536.00	38,163,200	
コーエーテックモホールディングス	21,100	2,529.00	53,361,900	
三菱総合研究所	4,400	3,740.00	16,456,000	
ボルテージ	1,800	555.00	999,000	
電算	1,200	2,179.00	2,614,800	
A G S	5,900	770.00	4,543,000	
ファインデックス	8,700	952.00	8,282,400	
ブレインパッド	2,000	5,690.00	11,380,000	
K L a b	19,900	903.00	17,969,700	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,500	1,051.00	13,137,500	
イーブクイニシアティブジャパン	1,500	1,864.00	2,796,000	
ネクソン	293,800	1,434.00	421,309,200	
アイスタイル	26,700	963.00	25,712,100	
エムアップ	3,000	1,935.00	5,805,000	
エイチーム	7,100	1,068.00	7,582,800	
エニグモ	7,300	963.00	7,029,900	
テクノスジャパン	8,000	487.00	3,896,000	
e n i s h	4,500	657.00	2,956,500	
コロプラ	33,800	1,223.00	41,337,400	
オルトプラス	7,000	759.00	5,313,000	
ブロードリーフ	51,200	617.00	31,590,400	
クロス・マーケティンググループ	4,400	376.00	1,654,400	
デジタルハーツホールディングス	5,500	904.00	4,972,000	
システム情報	5,200	1,012.00	5,262,400	
メディアドゥホールディングス	3,200	3,475.00	11,120,000	
じげん	25,500	606.00	15,453,000	
バイキューブ	6,200	462.00	2,864,400	
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	757.00	1,286,900	
サイバーリンクス	1,600	1,167.00	1,867,200	
ディー・エル・イー	7,200	180.00	1,296,000	
フィックスターズ	11,000	1,500.00	16,500,000	
C A R T A H O L D I N G S	5,000	1,230.00	6,150,000	
オブティム	2,700	2,695.00	7,276,500	
セレス	3,400	1,163.00	3,954,200	
特種東海製紙	6,600	4,200.00	27,720,000	
ティーガイア	9,200	2,654.00	24,416,800	
セック	1,500	3,240.00	4,860,000	
日本アジアグループ	11,000	382.00	4,202,000	
豆蔵ホールディングス	7,000	1,517.00	10,619,000	
テクマトリックス	7,300	2,183.00	15,935,900	
プロシップ	3,000	1,319.00	3,957,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,900	2,389.00	59,486,100	

GMOペイメントゲートウェイ	17,000	7,820.00	132,940,000	
ザッパラス	5,600	391.00	2,189,600	
システムリサーチ	2,700	1,901.00	5,132,700	
インターネットイニシアティブ	15,300	2,526.00	38,647,800	
さくらインターネット	11,100	637.00	7,070,700	
ヴィンクス	2,900	1,130.00	3,277,000	
GMOクラウド	1,900	2,853.00	5,420,700	
SRAホールディングス	5,500	2,561.00	14,085,500	
MINORIソリューションズ	2,000	2,696.00	5,392,000	
システムインテグレータ	3,300	766.00	2,527,800	
朝日ネット	7,400	644.00	4,765,600	
eBASE	6,200	1,171.00	7,260,200	
アバント	3,700	2,103.00	7,781,100	
アドソル日進	3,600	2,104.00	7,574,400	
フリービット	6,100	880.00	5,368,000	
コムチュア	11,600	2,055.00	23,838,000	
サイバーコム	1,800	2,069.00	3,724,200	
アステリア	6,300	636.00	4,006,800	
アイル	3,600	1,266.00	4,557,600	
王子ホールディングス	430,900	634.00	273,190,600	
日本製紙	45,600	1,969.00	89,786,400	
三菱製紙	11,700	513.00	6,002,100	
北越コーポレーション	68,400	587.00	40,150,800	
中越パルプ工業	4,100	1,688.00	6,920,800	
巴川製紙所	3,100	968.00	3,000,800	
大王製紙	45,200	1,495.00	67,574,000	
阿波製紙	2,800	422.00	1,181,600	
マークラインズ	5,200	2,198.00	11,429,600	
メディカル・データ・ビジョン	7,900	1,170.00	9,243,000	
gumi	13,200	740.00	9,768,000	
ショーケース	2,400	726.00	1,742,400	
モバイルファクトリー	2,300	1,446.00	3,325,800	
テラスカイ	3,700	2,237.00	8,276,900	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4,600	1,737.00	7,990,200	
PCIホールディングス	2,100	2,173.00	4,563,300	
パイプドHD	1,300	1,819.00	2,364,700	
アイビーシー	1,900	1,074.00	2,040,600	
ネオジャパン	2,000	995.00	1,990,000	
PR TIMES	900	2,480.00	2,232,000	
ランドコンピュータ	1,300	1,133.00	1,472,900	
ダブルスタンダード	1,300	5,210.00	6,773,000	
オーブンドア	5,100	1,653.00	8,430,300	
マイネット	3,300	535.00	1,765,500	
アカツキ	3,600	6,100.00	21,960,000	
ベネフィットジャパン	800	1,750.00	1,400,000	
Ubicomホールディングス	2,300	1,262.00	2,902,600	
LINE	23,600	4,350.00	102,660,000	
カナミックネットワーク	6,200	641.00	3,974,200	
ノムラシステムコーポレーション	2,200	544.00	1,196,800	

レンゴー	97,400	806.00	78,504,400
トーモク	6,300	1,882.00	11,856,600
ザ・パック	7,800	3,795.00	29,601,000
チェンジ	2,000	2,122.00	4,244,000
シンクロ・フード	4,400	517.00	2,274,800
オークネット	6,400	1,516.00	9,702,400
セグエグループ	800	1,399.00	1,119,200
エイトレッド	1,300	1,466.00	1,905,800
AOI TYO HOLDINGS	10,400	672.00	6,988,800
マクロミル	18,400	1,001.00	18,418,400
ビーグリー	2,100	994.00	2,087,400
オロ	2,700	2,839.00	7,665,300
テモナ	1,300	516.00	670,800
ニーズウェル	1,200	693.00	831,600
サインポスト	1,600	1,848.00	2,956,800
昭和電工	73,400	3,170.00	232,678,000
住友化学	757,300	520.00	393,796,000
住友精化	4,600	3,660.00	16,836,000
日産化学	57,600	4,975.00	286,560,000
ラサ工業	3,600	1,538.00	5,536,800
クレハ	8,800	7,080.00	62,304,000
多木化学	3,000	4,590.00	13,770,000
テイカ	7,600	2,075.00	15,770,000
石原産業	18,500	1,191.00	22,033,500
片倉コープアグリ	2,700	1,209.00	3,264,300
日本曹達	15,300	3,055.00	46,741,500
東ソー	159,400	1,665.00	265,401,000
トクヤマ	29,700	3,080.00	91,476,000
セントラル硝子	21,100	2,741.00	57,835,100
東亜合成	64,700	1,252.00	81,004,400
大阪ソーダ	10,500	3,115.00	32,707,500
関東電化工業	24,400	969.00	23,643,600
デンカ	37,600	3,445.00	129,532,000
イビデン	64,400	2,446.00	157,522,400
信越化学工業	181,700	12,020.00	2,184,034,000
日本カーバイド工業	3,500	1,540.00	5,390,000
堺化学工業	6,700	2,596.00	17,393,200
第一稀元素化学工業	11,200	870.00	9,744,000
エア・ウォーター	84,400	2,015.00	170,066,000
大陽日酸	99,100	2,595.00	257,164,500
日本化学工業	3,200	3,410.00	10,912,000
東邦アセチレン	1,500	1,415.00	2,122,500
日本パーカライジング	52,000	1,281.00	66,612,000
高压ガス工業	16,400	897.00	14,710,800
チタン工業	1,300	2,584.00	3,359,200
四国化成工業	15,900	1,297.00	20,622,300
戸田工業	2,400	2,304.00	5,529,600
ステラ ケミファ	5,600	3,270.00	18,312,000
保土谷化学工業	3,800	3,965.00	15,067,000
日本触媒	16,000	6,970.00	111,520,000



大日精化工業	9,100	3,335.00	30,348,500
カネカ	26,700	3,920.00	104,664,000
協和キリン	105,900	2,041.00	216,141,900
三菱瓦斯化学	97,300	1,681.00	163,561,300
三井化学	93,600	2,801.00	262,173,600
J S R	96,000	2,063.00	198,048,000
東京応化工業	17,700	4,180.00	73,986,000
大阪有機化学工業	9,500	1,272.00	12,084,000
三菱ケミカルホールディングス	689,000	877.10	604,321,900
K Hネオケム	18,200	2,554.00	46,482,800
ダイセル	141,000	1,134.00	159,894,000
住友ベークライト	16,200	4,615.00	74,763,000
積水化学工業	221,700	1,888.00	418,569,600
日本ゼオン	93,000	1,371.00	127,503,000
アイカ工業	30,900	3,470.00	107,223,000
宇部興産	52,000	2,418.00	125,736,000
積水樹脂	18,600	2,266.00	42,147,600
タキロンシーアイ	22,300	689.00	15,364,700
旭有機材	5,800	1,701.00	9,865,800
日立化成	47,700	3,390.00	161,703,000
ニチバン	5,400	1,950.00	10,530,000
リケンテクノス	26,000	546.00	14,196,000
大倉工業	4,900	2,095.00	10,265,500
積水化成成品工業	13,800	857.00	11,826,600
群栄化学工業	2,400	2,582.00	6,196,800
タイガースポリマー	5,500	607.00	3,338,500
ミライアル	3,600	1,407.00	5,065,200
ダイキアクシス	3,600	951.00	3,423,600
ダイキョーニシカワ	21,800	910.00	19,838,000
竹本容器	3,700	1,011.00	3,740,700
森六ホールディングス	5,500	2,540.00	13,970,000
日本化薬	63,800	1,424.00	90,851,200
カーリットホールディングス	11,000	641.00	7,051,000
E P Sホールディングス	15,100	1,427.00	21,547,700
ソルクシーズ	4,400	923.00	4,061,200
レグス	2,500	1,409.00	3,522,500
プレステージ・インターナショナル	37,600	882.00	33,163,200
フェイス	3,600	810.00	2,916,000
プロトコーポレーション	9,200	1,322.00	12,162,400
ハイマックス	1,300	1,980.00	2,574,000
アミューズ	5,500	2,889.00	15,889,500
野村総合研究所	172,600	2,313.00	399,223,800
ドリームインキュベータ	3,100	1,623.00	5,031,300
サイバネットシステム	7,300	736.00	5,372,800
クイック	6,200	1,605.00	9,951,000
T A C	5,700	230.00	1,311,000
C Eホールディングス	6,000	445.00	2,670,000
ケネディクス	95,700	586.00	56,080,200
日本システム技術	1,700	1,245.00	2,116,500
電通	103,700	3,995.00	414,281,500

インテージホールディングス	12,900	993.00	12,809,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,800	1,316.00	5,000,800	
東邦システムサイエンス	2,700	948.00	2,559,600	
ぴあ	2,800	4,830.00	13,524,000	
イオンファンタジー	3,900	3,030.00	11,817,000	
ソースネクスト	48,900	507.00	24,792,300	
シーティーエス	11,400	723.00	8,242,200	
ネクシィーズグループ	3,500	2,138.00	7,483,000	
インフォコム	11,300	2,269.00	25,639,700	
メディカルシステムネットワーク	10,000	561.00	5,610,000	
日本精化	8,300	1,305.00	10,831,500	
扶桑化学工業	10,400	3,125.00	32,500,000	
トリケミカル研究所	2,300	7,810.00	17,963,000	
ラクスル	5,500	3,600.00	19,800,000	
F I G	11,200	323.00	3,617,600	
システムサポート	900	1,382.00	1,243,800	
A D E K A	47,500	1,650.00	78,375,000	
日油	38,800	3,815.00	148,022,000	
ミヨシ油脂	4,100	1,298.00	5,321,800	
新日本理化	17,100	208.00	3,556,800	
ハリマ化成グループ	8,500	1,301.00	11,058,500	
アルテリア・ネットワークス	11,400	1,505.00	17,157,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,600.00	3,680,000	
花王	252,000	8,612.00	2,170,224,000	
第一工業製薬	3,800	3,880.00	14,744,000	
石原ケミカル	2,800	1,785.00	4,998,000	
日華化学	3,400	916.00	3,114,400	
ニイタカ	1,600	1,725.00	2,760,000	
三洋化成工業	6,200	5,410.00	33,542,000	
武田薬品工業	875,800	4,319.00	3,782,580,200	
アステラス製薬	925,900	1,813.50	1,679,119,650	
大日本住友製薬	78,000	1,878.00	146,484,000	
塩野義製薬	134,600	6,314.00	849,864,400	
田辺三菱製薬	128,500	1,349.00	173,346,500	
わかもと製薬	12,700	280.00	3,556,000	
あすか製薬	12,000	1,163.00	13,956,000	
日本新薬	27,600	9,370.00	258,612,000	
ピオフェルミン製薬	1,700	2,249.00	3,823,300	
中外製薬	109,800	9,244.00	1,014,991,200	
科研製薬	18,000	5,930.00	106,740,000	
エーザイ	126,000	7,471.00	941,346,000	
理研ビタミン	5,000	4,010.00	20,050,000	
ロート製薬	54,000	3,300.00	178,200,000	
小野薬品工業	248,600	2,239.00	556,615,400	
久光製薬	31,100	5,080.00	157,988,000	
有機合成薬品工業	7,900	279.00	2,204,100	
持田製薬	14,600	4,345.00	63,437,000	
参天製薬	196,000	2,056.00	402,976,000	
扶桑薬品工業	3,700	2,145.00	7,936,500	

日本ケミファ	1,400	2,961.00	4,145,400
ツムラ	32,600	3,220.00	104,972,000
日医工	29,700	1,276.00	37,897,200
テルモ	297,900	3,863.00	1,150,787,700
みらかホールディングス	28,100	2,700.00	75,870,000
キッセイ薬品工業	18,600	2,932.00	54,535,200
生化学工業	20,400	1,285.00	26,214,000
栄研化学	18,500	1,874.00	34,669,000
日水製薬	4,500	1,280.00	5,760,000
鳥居薬品	6,600	2,781.00	18,354,600
JCRファーマ	7,400	8,380.00	62,012,000
東和薬品	13,500	2,769.00	37,381,500
富士製薬工業	7,200	1,328.00	9,561,600
沢井製薬	21,600	6,060.00	130,896,000
ゼリア新薬工業	19,100	2,139.00	40,854,900
第一三共	301,200	6,699.00	2,017,738,800
キョーリン製薬ホールディングス	23,200	1,819.00	42,200,800
大幸薬品	4,200	2,830.00	11,886,000
ダイト	6,100	3,200.00	19,520,000
大塚ホールディングス	200,500	4,493.00	900,846,500
大正製薬ホールディングス	22,300	7,710.00	171,933,000
ペプチドリーム	53,200	5,290.00	281,428,000
大日本塗料	11,700	1,158.00	13,548,600
日本ペイントホールディングス	85,100	6,030.00	513,153,000
関西ペイント	115,800	2,657.00	307,680,600
神東塗料	8,600	195.00	1,677,000
中国塗料	29,300	1,098.00	32,171,400
日本特殊塗料	7,700	1,411.00	10,864,700
藤倉化成	13,900	584.00	8,117,600
太陽ホールディングス	7,600	4,310.00	32,756,000
DIC	43,500	3,255.00	141,592,500
サカタインクス	22,500	1,267.00	28,507,500
東洋インキS Cホールディングス	21,800	2,765.00	60,277,000
T & K TOKA	8,100	1,055.00	8,545,500
アルプス技研	8,900	1,693.00	15,067,700
サニックス	17,600	400.00	7,040,000
ダイオーズ	2,000	1,345.00	2,690,000
日本空調サービス	10,600	713.00	7,557,800
オリエンタルランド	107,000	15,500.00	1,658,500,000
フォーカスシステムズ	6,400	880.00	5,632,000
ダスキン	25,800	2,896.00	74,716,800
パーク24	55,700	2,572.00	143,260,400
明光ネットワークジャパン	11,800	991.00	11,693,800
ファルコホールディングス	5,600	1,791.00	10,029,600
クレスコ	3,100	3,530.00	10,943,000
フジ・メディア・ホールディングス	99,500	1,494.00	148,653,000
秀英予備校	2,300	440.00	1,012,000
田谷	2,000	600.00	1,200,000
ラウンドワン	28,100	1,212.00	34,057,200
リゾートトラスト	46,100	1,841.00	84,870,100

オービック	35,800	13,900.00	497,620,000
ジャストシステム	16,800	5,210.00	87,528,000
TDCソフト	9,000	858.00	7,722,000
Zホールディングス	1,418,400	375.00	531,900,000
ビー・エム・エル	12,900	3,250.00	41,925,000
ワタベウェディング	1,700	602.00	1,023,400
トレンドマイクロ	45,900	5,630.00	258,417,000
りらいあコミュニケーションズ	18,200	1,432.00	26,062,400
IDホールディングス	3,900	1,450.00	5,655,000
リソー教育	45,900	417.00	19,140,300
日本オラクル	20,900	9,510.00	198,759,000
早稲田アカデミー	3,300	944.00	3,115,200
アルファシステムズ	3,200	2,884.00	9,228,800
フューチャー	12,500	1,773.00	22,162,500
CAC Holdings	6,700	1,394.00	9,339,800
SBテクノロジー	3,700	1,948.00	7,207,600
トーセ	2,800	863.00	2,416,400
ユー・エス・エス	112,600	2,098.00	236,234,800
オービックビジネスコンサルタント	10,600	4,450.00	47,170,000
伊藤忠テクノソリューションズ	47,100	2,865.00	134,941,500
アイティフォー	12,500	887.00	11,087,500
東京個別指導学院	3,600	771.00	2,775,600
東計電算	1,500	3,395.00	5,092,500
サイバーエージェント	57,800	3,620.00	209,236,000
楽天	468,800	996.00	466,924,800
エクスネット	1,700	982.00	1,669,400
クリーク・アンド・リバー社	5,200	1,134.00	5,896,800
テー・オー・ダブリュー	8,700	825.00	7,177,500
大塚商会	55,900	4,175.00	233,382,500
サイボウズ	12,100	1,099.00	13,297,900
ソフトブレイン	6,000	551.00	3,306,000
山田コンサルティンググループ	4,900	1,825.00	8,942,500
セントラルスポーツ	3,800	3,340.00	12,692,000
バラカ	2,700	2,046.00	5,524,200
電通国際情報サービス	6,400	3,790.00	24,256,000
デジタルガレージ	18,600	3,595.00	66,867,000
イーエムシステムズ	7,200	2,147.00	15,458,400
ウェザーニューズ	3,500	3,455.00	12,092,500
C I J	7,700	920.00	7,084,000
ビジネスエンジニアリング	1,200	2,999.00	3,598,800
日本エンタープライズ	10,500	229.00	2,404,500
WOWOW	4,900	2,777.00	13,607,300
スカラ	7,300	868.00	6,336,400
インテリジェント ウェイブ	3,800	745.00	2,831,000
フルキャストホールディングス	10,100	2,242.00	22,644,200
エン・ジャパン	17,900	4,960.00	88,784,000
富士フイルムホールディングス	201,800	4,819.00	972,474,200
コニカミノルタ	229,900	720.00	165,528,000
資生堂	209,200	8,046.00	1,683,223,200
ライオン	136,900	2,133.00	292,007,700

高砂香料工業	6,600	2,729.00	18,011,400
マンダム	23,700	3,000.00	71,100,000
ミルボン	14,100	5,720.00	80,652,000
ファンケル	42,600	2,923.00	124,519,800
コーセー	19,800	17,560.00	347,688,000
コタ	5,600	1,392.00	7,795,200
シーボン	1,200	2,523.00	3,027,600
ポーラ・オルビスホールディングス	44,900	2,590.00	116,291,000
ノエビアホールディングス	10,100	6,050.00	61,105,000
アジュバンコスメジャパン	2,300	947.00	2,178,100
エステー	6,800	1,684.00	11,451,200
アグロ カネショウ	3,300	1,596.00	5,266,800
コニシ	17,300	1,519.00	26,278,700
長谷川香料	14,000	2,010.00	28,140,000
星光PMC	6,000	876.00	5,256,000
小林製薬	29,500	8,890.00	262,255,000
荒川化学工業	9,400	1,637.00	15,387,800
メック	7,200	1,807.00	13,010,400
日本高純度化学	2,900	2,605.00	7,554,500
タカラバイオ	27,500	2,238.00	61,545,000
JCU	12,700	2,759.00	35,039,300
新田ゼラチン	6,800	733.00	4,984,400
OATアグリオ	1,800	1,757.00	3,162,600
デクセリアルズ	27,100	1,016.00	27,533,600
アース製薬	7,900	5,880.00	46,452,000
北興化学工業	10,800	644.00	6,955,200
大成ラミック	3,200	2,969.00	9,500,800
クミアイ化学工業	43,500	1,051.00	45,718,500
日本農薬	18,800	605.00	11,374,000
富士興産	3,100	732.00	2,269,200
ニチレキ	12,400	1,309.00	16,231,600
ユシロ化学工業	5,900	1,458.00	8,602,200
ピーピー・カストロール	3,800	1,530.00	5,814,000
富士石油	28,100	248.00	6,968,800
MORESCO	3,800	1,358.00	5,160,400
出光興産	118,400	3,220.00	381,248,000
JXTGホールディングス	1,632,600	514.80	840,462,480
コスモエネルギーホールディングス	30,500	2,342.00	71,431,000
横浜ゴム	60,900	2,488.00	151,519,200
TOYO TIRE	60,400	1,616.00	97,606,400
ブリヂストン	323,500	4,607.00	1,490,364,500
住友ゴム工業	94,500	1,431.00	135,229,500
藤倉コンポジット	9,100	499.00	4,540,900
オカモト	6,400	4,425.00	28,320,000
アキレス	7,300	1,897.00	13,848,100
フコク	4,700	734.00	3,449,800
ニッタ	11,900	3,255.00	38,734,500
クリエートメディック	3,300	1,069.00	3,527,700
住友理工	20,400	1,007.00	20,542,800
三ツ星ベルト	13,900	2,186.00	30,385,400

バンドー化学	18,500	987.00	18,259,500
A G C	104,100	4,070.00	423,687,000
日本板硝子	50,200	657.00	32,981,400
石塚硝子	1,900	2,211.00	4,200,900
有沢製作所	16,600	1,062.00	17,629,200
日本山村硝子	4,400	1,249.00	5,495,600
日本電気硝子	42,300	2,506.00	106,003,800
オハラ	4,200	1,480.00	6,216,000
住友大阪セメント	19,900	4,950.00	98,505,000
太平洋セメント	66,500	3,220.00	214,130,000
リソルホールディングス	1,000	4,005.00	4,005,000
日本ヒューム	10,600	825.00	8,745,000
日本コンクリート工業	22,700	329.00	7,468,300
三谷セキサン	4,900	3,815.00	18,693,500
アジアパイルホールディングス	14,900	558.00	8,314,200
東海カーボン	110,200	1,070.00	117,914,000
日本カーボン	5,400	4,195.00	22,653,000
東洋炭素	6,200	2,442.00	15,140,400
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	4,710.00	27,318,000
T O T O	75,200	4,630.00	348,176,000
日本碍子	128,500	1,871.00	240,423,500
日本特殊陶業	81,900	2,251.00	184,356,900
ダントーホールディングス	7,800	115.00	897,000
M A R U W A	4,000	7,720.00	30,880,000
品川リフラクトリーズ	2,800	3,270.00	9,156,000
黒崎播磨	2,100	6,090.00	12,789,000
ヨータイ	8,400	734.00	6,165,600
イソライト工業	5,300	654.00	3,466,200
東京窯業	13,100	330.00	4,323,000
ニッカトー	4,700	783.00	3,680,100
フジインコーポレーテッド	9,400	2,923.00	27,476,200
クニミネ工業	4,300	1,255.00	5,396,500
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,246.00	2,242,800
ニチアス	28,800	2,487.00	71,625,600
日本製鉄	465,800	1,622.50	755,760,500
神戸製鋼所	190,500	592.00	112,776,000
中山製鋼所	14,300	499.00	7,135,700
合同製鐵	5,600	2,676.00	14,985,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	281,100	1,402.00	394,102,200
東京製鐵	50,700	875.00	44,362,500
共英製鋼	11,700	2,223.00	26,009,100
大和工業	22,100	2,823.00	62,388,300
東京鐵鋼	4,300	1,609.00	6,918,700
大阪製鐵	5,600	1,476.00	8,265,600
淀川製鋼所	14,100	2,187.00	30,836,700
丸一鋼管	33,800	3,065.00	103,597,000
モリ工業	3,100	2,387.00	7,399,700
大同特殊鋼	17,000	5,140.00	87,380,000
日本高周波鋼業	3,500	451.00	1,578,500

日本冶金工業	8,600	2,481.00	21,336,600
山陽特殊製鋼	7,500	1,539.00	11,542,500
愛知製鋼	5,900	3,665.00	21,623,500
日立金属	112,100	1,430.00	160,303,000
日本金属	2,400	1,007.00	2,416,800
大平洋金属	7,000	2,532.00	17,724,000
新日本電工	67,000	182.00	12,194,000
栗本鐵工所	5,300	1,978.00	10,483,400
虹 技	1,600	1,444.00	2,310,400
日本鑄鉄管	1,100	1,381.00	1,519,100
日本製鋼所	31,600	2,329.00	73,596,400
三菱製鋼	7,700	1,194.00	9,193,800
日亜鋼業	15,400	352.00	5,420,800
日本精線	1,700	2,800.00	4,760,000
エンビプロ・ホールディングス	3,800	674.00	2,561,200
大紀アルミニウム工業所	17,200	774.00	13,312,800
日本軽金属ホールディングス	263,200	233.00	61,325,600
三井金属鉱業	28,100	3,175.00	89,217,500
東邦亜鉛	5,300	2,095.00	11,103,500
三菱マテリアル	68,800	3,140.00	216,032,000
住友金属鉱山	133,100	3,529.00	469,709,900
D O W Aホールディングス	26,300	4,005.00	105,331,500
古河機械金属	18,500	1,568.00	29,008,000
エス・サイエンス	46,800	52.00	2,433,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,800	1,687.00	18,219,600
東邦チタニウム	18,600	925.00	17,205,000
U A C J	15,800	2,497.00	39,452,600
C Kサンエツ	1,900	2,976.00	5,654,400
古河電気工業	32,300	3,125.00	100,937,500
住友電気工業	389,100	1,573.00	612,054,300
フジクラ	125,600	488.00	61,292,800
昭和電線ホールディングス	12,100	1,055.00	12,765,500
東京特殊電線	1,600	2,172.00	3,475,200
タツタ電線	20,600	581.00	11,968,600
カナレ電気	1,700	1,888.00	3,209,600
平河ヒューテック	3,900	1,261.00	4,917,900
リョービ	12,800	2,220.00	28,416,000
アーレスティ	13,700	569.00	7,795,300
アサヒホールディングス	18,200	2,541.00	46,246,200
東洋製罐グループホールディングス	66,300	1,965.00	130,279,500
ホッカンホールディングス	5,700	1,808.00	10,305,600
コロナ	5,800	1,180.00	6,844,000
横河ブリッジホールディングス	19,300	1,928.00	37,210,400
O S J Bホールディングス	52,000	265.00	13,780,000
駒井ハルテック	1,900	1,777.00	3,376,300
高田機工	900	2,636.00	2,372,400
三和ホールディングス	99,800	1,254.00	125,149,200
文化シャッター	30,700	982.00	30,147,400
三協立山	14,400	1,219.00	17,553,600
アルインコ	7,600	1,213.00	9,218,800

東洋シャッター	2,500	759.00	1,897,500
LIXILグループ	153,600	2,055.00	315,648,000
日本フィルコン	8,100	553.00	4,479,300
ノーリツ	21,600	1,410.00	30,456,000
長府製作所	10,600	2,416.00	25,609,600
リンナイ	20,200	8,670.00	175,134,000
ユニプレス	20,400	1,688.00	34,435,200
ダイニチ工業	5,800	696.00	4,036,800
日東精工	14,400	603.00	8,683,200
三洋工業	1,400	2,053.00	2,874,200
岡部	21,100	921.00	19,433,100
ジーテクト	12,900	1,861.00	24,006,900
東ブレ	19,400	1,934.00	37,519,600
高周波熱錬	20,100	930.00	18,693,000
東京製綱	7,400	1,166.00	8,628,400
サンコール	5,900	504.00	2,973,600
モリテックスチール	7,900	427.00	3,373,300
パイオラックス	15,400	2,226.00	34,280,400
エイチワン	10,200	747.00	7,619,400
日本発条	111,700	970.00	108,349,000
中央発條	1,200	2,974.00	3,568,800
アドパネクス	1,300	1,741.00	2,263,300
三浦工業	45,000	3,625.00	163,125,000
タクマ	35,300	1,317.00	46,490,100
テクノプロ・ホールディングス	20,200	7,120.00	143,824,000
アトラ	2,300	398.00	915,400
インターワークス	1,900	509.00	967,100
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	3,720.00	15,252,000
Keeper 技研	3,700	1,492.00	5,520,400
ファーストロジック	2,300	666.00	1,531,800
三機サービス	2,100	995.00	2,089,500
Gunosy	7,000	1,744.00	12,208,000
デザインワン・ジャパン	2,300	304.00	699,200
イー・ガーディアン	5,100	1,979.00	10,092,900
リブセンス	6,500	381.00	2,476,500
ジャパンマテリアル	30,900	1,724.00	53,271,600
ベクトル	12,500	992.00	12,400,000
ウチヤマホールディングス	5,000	538.00	2,690,000
チャーム・ケア・コーポレーション	3,200	2,162.00	6,918,400
ライクキッズ	2,400	908.00	2,179,200
キャリアリンク	3,300	580.00	1,914,000
IBJ	6,800	997.00	6,779,600
アサンテ	4,000	2,094.00	8,376,000
N・フィールド	6,800	663.00	4,508,400
バリューHR	2,000	3,245.00	6,490,000
M&Aキャピタルパートナーズ	3,600	8,000.00	28,800,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,386.00	5,266,800
ERIホールディングス	2,900	803.00	2,328,700



アビスト	1,600	2,740.00	4,384,000
シグマクシス	6,900	1,873.00	12,923,700
ウィルグループ	6,500	1,077.00	7,000,500
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,800	232.00	3,201,600
リクルートホールディングス	720,500	3,732.00	2,688,906,000
エラン	5,900	1,694.00	9,994,600
ツガミ	21,500	1,040.00	22,360,000
オークマ	12,100	6,460.00	78,166,000
東芝機械	11,800	2,504.00	29,547,200
アマダホールディングス	132,300	1,296.00	171,460,800
アイダエンジニアリング	28,100	950.00	26,695,000
滝澤鉄工所	3,300	1,373.00	4,530,900
F U J I	44,800	1,924.00	86,195,200
牧野フライス製作所	12,200	5,450.00	66,490,000
オーエスジー	48,100	2,356.00	113,323,600
ダイジェット工業	1,200	1,523.00	1,827,600
旭ダイヤモンド工業	27,300	666.00	18,181,800
D M G 森精機	65,800	1,782.00	117,255,600
ソディック	24,400	966.00	23,570,400
ディスコ	14,100	23,300.00	328,530,000
日東工器	5,700	2,352.00	13,406,400
日進工具	3,100	2,294.00	7,111,400
パンチ工業	9,400	548.00	5,151,200
富士ダイス	4,500	668.00	3,006,000
土木管理総合試験所	4,400	464.00	2,041,600
ネットマーケティング	3,600	931.00	3,351,600
日本郵政	824,500	1,020.00	840,990,000
ベルシステム24ホールディングス	16,800	1,715.00	28,812,000
鎌倉新書	7,500	1,567.00	11,752,500
S M N	1,600	966.00	1,545,600
一蔵	1,300	745.00	968,500
L I T A L I C O	3,400	2,214.00	7,527,600
グローバルキッズCOMPANY	1,400	850.00	1,190,000
エボラブルアジア	4,500	1,912.00	8,604,000
アトラエ	2,600	3,210.00	8,346,000
ストライク	3,800	4,210.00	15,998,000
ソラスト	27,700	1,278.00	35,400,600
セラク	3,100	745.00	2,309,500
インソース	4,900	3,270.00	16,023,000
豊田自動織機	85,200	6,600.00	562,320,000
豊和工業	5,800	755.00	4,379,000
O K K	4,200	745.00	3,129,000
石川製作所	2,500	1,316.00	3,290,000
東洋機械金属	7,400	588.00	4,351,200
津田駒工業	2,000	1,294.00	2,588,000
エンシュウ	2,500	1,309.00	3,272,500
島精機製作所	16,700	2,843.00	47,478,100
オプトラン	11,600	3,245.00	37,642,000
N C ホールディングス	3,200	495.00	1,584,000
イワキ	5,000	1,079.00	5,395,000

フリー	10,200	980.00	9,996,000
ヤマシンフィルタ	22,600	1,004.00	22,690,400
日阪製作所	12,900	976.00	12,590,400
やまびこ	20,200	1,276.00	25,775,200
平田機工	4,900	7,560.00	37,044,000
ペガサスミシン製造	10,600	525.00	5,565,000
マルマエ	4,300	1,007.00	4,330,100
タツモ	4,900	1,315.00	6,443,500
ナブテスコ	61,300	3,375.00	206,887,500
三井海洋開発	11,100	2,642.00	29,326,200
レオン自動機	10,200	1,827.00	18,635,400
S M C	33,000	49,390.00	1,629,870,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,100	558.00	5,077,800
ホソカワミクロン	3,700	4,210.00	15,577,000
ユニオンツール	3,900	3,375.00	13,162,500
オイレス工業	13,500	1,755.00	23,692,500
日精エー・エス・ビー機械	3,500	3,945.00	13,807,500
サトーホールディングス	14,800	3,305.00	48,914,000
技研製作所	9,100	3,970.00	36,127,000
日本エアテック	3,200	703.00	2,249,600
カワタ	3,100	1,209.00	3,747,900
日精樹脂工業	8,800	1,041.00	9,160,800
オカダアイヨン	3,300	1,323.00	4,365,900
ワイエイシーホールディングス	4,500	865.00	3,892,500
小松製作所	476,800	2,664.50	1,270,433,600
住友重機械工業	60,200	3,345.00	201,369,000
日立建機	42,200	2,858.00	120,607,600
日工	14,400	682.00	9,820,800
巴工業	4,500	2,337.00	10,516,500
井関農機	10,500	1,711.00	17,965,500
T O W A	10,600	1,095.00	11,607,000
丸山製作所	2,200	1,266.00	2,785,200
北川鉄工所	4,800	2,244.00	10,771,200
シンニッタン	16,300	442.00	7,204,600
ローツェ	4,600	3,665.00	16,859,000
タカキタ	3,600	569.00	2,048,400
クボタ	558,400	1,715.50	957,935,200
荏原実業	2,600	2,143.00	5,571,800
東洋エンジニアリング	13,700	718.00	9,836,600
三菱化工機	3,600	1,990.00	7,164,000
月島機械	19,400	1,754.00	34,027,600
帝国電機製作所	8,700	1,385.00	12,049,500
東京機械製作所	4,100	386.00	1,582,600
新東工業	25,000	1,056.00	26,400,000
澁谷工業	9,200	2,804.00	25,796,800
アイチコーポレーション	18,300	686.00	12,553,800
小森コーポレーション	26,700	1,203.00	32,120,100
鶴見製作所	8,200	2,024.00	16,596,800
住友精密工業	1,600	3,455.00	5,528,000

日本ギア工業	3,100	421.00	1,305,100
酒井重工業	2,000	3,305.00	6,610,000
荏原製作所	46,700	3,265.00	152,475,500
石井鐵工所	1,400	2,502.00	3,502,800
西島製作所	10,600	1,042.00	11,045,200
北越工業	10,900	1,285.00	14,006,500
ダイキン工業	134,100	15,290.00	2,050,389,000
オルガノ	3,800	6,380.00	24,244,000
トーヨーカネツ	4,600	2,063.00	9,489,800
栗田工業	57,000	3,230.00	184,110,000
椿本チエイン	15,000	3,905.00	58,575,000
大同工業	4,900	863.00	4,228,700
日機装	31,500	1,196.00	37,674,000
木村化工機	8,700	438.00	3,810,600
レイズネクスト	17,700	1,186.00	20,992,200
アネスト岩田	16,400	1,065.00	17,466,000
ダイフク	53,800	6,000.00	322,800,000
サムコ	2,900	1,098.00	3,184,200
加藤製作所	5,700	1,959.00	11,166,300
油研工業	1,700	1,692.00	2,876,400
タダノ	50,800	1,050.00	53,340,000
フジテック	38,300	1,673.00	64,075,900
C K D	29,300	1,593.00	46,674,900
キトー	8,000	1,767.00	14,136,000
平和	29,400	2,265.00	66,591,000
理想科学工業	9,300	1,830.00	17,019,000
SANKYO	23,400	3,770.00	88,218,000
日本金銭機械	11,600	919.00	10,660,400
マースグループホールディングス	6,700	2,052.00	13,748,400
福島工業	6,500	3,590.00	23,335,000
オーイズミ	4,400	549.00	2,415,600
ダイコク電機	4,800	1,558.00	7,478,400
竹内製作所	17,600	1,777.00	31,275,200
アマノ	27,600	3,185.00	87,906,000
JUKI	14,600	983.00	14,351,800
サンデンホールディングス	13,700	886.00	12,138,200
蛇の目ミシン工業	9,400	417.00	3,919,800
ブラザー工業	128,500	2,222.00	285,527,000
マックス	16,100	2,025.00	32,602,500
モリタホールディングス	18,400	1,875.00	34,500,000
グローリー	29,200	3,375.00	98,550,000
新晃工業	9,800	2,019.00	19,786,200
大和冷機工業	15,200	1,262.00	19,182,400
セガサミーホールディングス	104,400	1,646.00	171,842,400
日本ピストンリング	3,900	1,429.00	5,573,100
リケン	4,900	4,320.00	21,168,000
T P R	14,100	2,035.00	28,693,500
ツバキ・ナカシマ	21,400	1,995.00	42,693,000
ホシザキ	30,800	9,750.00	300,300,000
大豊工業	8,600	885.00	7,611,000

日本精工	198,200	1,101.00	218,218,200
NTN	243,300	361.00	87,831,300
ジェイテクト	101,000	1,464.00	147,864,000
不二越	9,800	5,360.00	52,528,000
ミネベアミツミ	195,400	2,164.00	422,845,600
日本トムソン	31,200	494.00	15,412,800
THK	61,200	3,175.00	194,310,000
ユーシン精機	8,200	1,045.00	8,569,000
前澤給装工業	3,900	2,123.00	8,279,700
イーグル工業	13,000	1,129.00	14,677,000
前澤工業	7,200	401.00	2,887,200
日本ピラー工業	10,600	1,482.00	15,709,200
キッツ	42,700	768.00	32,793,600
日立製作所	505,800	4,281.00	2,165,329,800
三菱電機	1,052,600	1,568.00	1,650,476,800
富士電機	63,400	3,515.00	222,851,000
東洋電機製造	4,100	1,584.00	6,494,400
安川電機	113,300	4,195.00	475,293,500
シンフォニアテクノロジー	13,600	1,413.00	19,216,800
明電舎	19,300	2,133.00	41,166,900
オリジン	2,800	1,552.00	4,345,600
山洋電気	5,100	5,250.00	26,775,000
デンヨー	9,000	2,000.00	18,000,000
ベイカレント・コンサルティング	6,100	5,310.00	32,391,000
Orchestra Holdings	2,000	1,088.00	2,176,000
アイモバイル	3,100	678.00	2,101,800
キャリアインデックス	4,100	455.00	1,865,500
MS-Japan	3,300	1,388.00	4,580,400
船場	1,700	1,026.00	1,744,200
グレイステクノロジー	4,600	3,105.00	14,283,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,600	2,945.00	31,217,000
フルテック	1,200	1,394.00	1,672,800
グリーンズ	3,800	1,249.00	4,746,200
ツナググループ・ホールディングス	1,200	591.00	709,200
GAMEWITH	2,200	854.00	1,878,800
ソウルドアウト	1,500	1,633.00	2,449,500
MS&Consulting	1,400	998.00	1,397,200
日総工産	6,700	1,203.00	8,060,100
キュービーネットホールディングス	6,100	2,289.00	13,962,900
RPAホールディングス	5,700	1,280.00	7,296,000
三櫻工業	13,300	1,385.00	18,420,500
マキタ	137,300	3,720.00	510,756,000
東芝テック	13,200	4,195.00	55,374,000
芝浦メカトロニクス	1,900	4,100.00	7,790,000
マブチモーター	29,100	4,620.00	134,442,000
日本電産	126,700	16,335.00	2,069,644,500
トレックス・セミコンダクター	6,000	1,434.00	8,604,000
東光高岳	5,900	1,203.00	7,097,700

ダブル・スコープ	15,200	632.00	9,606,400
宮越ホールディングス	3,900	1,095.00	4,270,500
ダイヘン	11,500	3,740.00	43,010,000
ヤーマン	15,100	699.00	10,554,900
JVCケンウッド	85,600	281.00	24,053,600
ミマキエンジニアリング	9,400	551.00	5,179,400
第一精工	3,800	3,160.00	12,008,000
日新電機	24,700	1,245.00	30,751,500
大崎電気工業	21,000	751.00	15,771,000
オムロン	97,900	6,540.00	640,266,000
日東工業	15,500	2,292.00	35,526,000
I D E C	15,200	2,289.00	34,792,800
正興電機製作所	2,500	831.00	2,077,500
不二電機工業	1,200	1,248.00	1,497,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,100	2,228.00	78,202,800
サクサホールディングス	2,500	1,937.00	4,842,500
メルコホールディングス	3,600	3,020.00	10,872,000
テクノメディカ	2,400	2,134.00	5,121,600
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,700	1,147.00	1,949,900
日本電気	127,700	4,395.00	561,241,500
富士通	101,500	9,422.00	956,333,000
沖電気工業	42,700	1,642.00	70,113,400
岩崎通信機	4,700	823.00	3,868,100
電気興業	5,100	3,240.00	16,524,000
サンケン電気	11,500	3,070.00	35,305,000
ナカヨ	1,900	1,713.00	3,254,700
アイホン	6,000	1,896.00	11,376,000
ルネサスエレクトロニクス	501,900	700.00	351,330,000
セイコーエプソン	130,600	1,564.00	204,258,400
ワコム	70,700	455.00	32,168,500
アルバック	21,000	4,810.00	101,010,000
アクセル	4,300	646.00	2,777,800
E I Z O	8,200	4,235.00	34,727,000
ジャパンディスプレイ	304,000	69.00	20,976,000
日本信号	26,800	1,309.00	35,081,200
京三製作所	24,600	519.00	12,767,400
能美防災	13,900	2,301.00	31,983,900
ホーチキ	7,600	1,492.00	11,339,200
星和電機	4,000	582.00	2,328,000
エレコム	11,400	3,905.00	44,517,000
パナソニック	1,202,700	1,020.00	1,226,754,000
シャープ	121,800	1,622.00	197,559,600
アンリツ	67,800	2,147.00	145,566,600
富士通ゼネラル	28,600	1,999.00	57,171,400
ソニー	665,200	6,683.00	4,445,531,600
T D K	50,800	11,280.00	573,024,000
帝国通信工業	4,700	1,212.00	5,696,400
タムラ製作所	35,100	637.00	22,358,700
アルプスアルパイン	93,100	2,379.00	221,484,900

池上通信機	3,400	1,080.00	3,672,000
日本電波工業	9,500	437.00	4,151,500
鈴木	5,700	797.00	4,542,900
日本トリム	1,400	5,220.00	7,308,000
ローランド ディー・ジー・	5,800	2,189.00	12,696,200
フォスター電機	11,000	2,062.00	22,682,000
SMK	2,700	3,060.00	8,262,000
ヨコオ	6,800	3,140.00	21,352,000
ティアック	7,600	205.00	1,558,000
ホシデン	28,800	1,259.00	36,259,200
ヒロセ電機	16,300	13,860.00	225,918,000
日本航空電子工業	24,100	2,150.00	51,815,000
TOA	11,300	1,152.00	13,017,600
マクセルホールディングス	22,700	1,514.00	34,367,800
古野電気	13,500	1,208.00	16,308,000
ユニデンホールディングス	2,900	1,987.00	5,762,300
スミダコーポレーション	8,100	1,221.00	9,890,100
アイコム	5,800	2,523.00	14,633,400
リオン	4,400	2,590.00	11,396,000
本多通信工業	8,900	505.00	4,494,500
船井電機	10,600	671.00	7,112,600
横河電機	96,500	1,975.00	190,587,500
新電元工業	3,700	3,850.00	14,245,000
アズビル	66,500	3,160.00	210,140,000
東亜ディーケーケー	5,200	920.00	4,784,000
日本光電工業	43,500	3,015.00	131,152,500
チノー	3,700	1,489.00	5,509,300
共和電業	11,300	423.00	4,779,900
日本電子材料	4,100	733.00	3,005,300
堀場製作所	20,800	7,580.00	157,664,000
アドバンテスト	78,300	5,430.00	425,169,000
小野測器	4,100	525.00	2,152,500
エスベック	9,300	2,019.00	18,776,700
キーエンス	47,700	73,760.00	3,518,352,000
日置電機	5,500	3,775.00	20,762,500
シスメックス	75,200	7,775.00	584,680,000
日本マイクロニクス	18,300	1,044.00	19,105,200
メガチップス	9,800	2,273.00	22,275,400
OBARA GROUP	5,500	4,060.00	22,330,000
IMAGICA GROUP	8,700	618.00	5,376,600
澤藤電機	1,300	1,806.00	2,347,800
デンソー	231,800	5,122.00	1,187,279,600
原田工業	5,000	900.00	4,500,000
コーセル	12,900	1,249.00	16,112,100
イリソ電子工業	8,800	5,420.00	47,696,000
オブテックスグループ	17,300	1,632.00	28,233,600
千代田インテグレ	4,900	2,374.00	11,632,600
アイ・オー・データ機器	3,900	942.00	3,673,800
レーザーテック	21,600	7,920.00	171,072,000
スタンレー電気	74,300	3,125.00	232,187,500

岩崎電気	4,200	1,473.00	6,186,600
ウシオ電機	61,200	1,645.00	100,674,000
岡谷電機産業	7,300	402.00	2,934,600
ヘリオス テクノ ホールディング	9,700	501.00	4,859,700
エノモト	3,200	1,136.00	3,635,200
日本セラミック	10,700	2,815.00	30,120,500
遠藤照明	5,500	700.00	3,850,000
古河電池	7,500	768.00	5,760,000
双信電機	5,100	464.00	2,366,400
山一電機	7,600	1,606.00	12,205,600
図研	6,800	2,294.00	15,599,200
日本電子	20,800	3,020.00	62,816,000
カシオ計算機	93,100	1,973.00	183,686,300
ファナック	100,000	21,250.00	2,125,000,000
日本シイエムケイ	24,700	700.00	17,290,000
エンプラス	5,400	3,580.00	19,332,000
大真空	3,900	1,172.00	4,570,800
ローム	46,700	8,560.00	399,752,000
浜松ホトニクス	75,500	4,410.00	332,955,000
三井ハイテック	11,600	1,973.00	22,886,800
新光電気工業	35,400	1,069.00	37,842,600
京セラ	148,100	7,180.00	1,063,358,000
協栄産業	1,200	1,532.00	1,838,400
太陽誘電	46,800	2,939.00	137,545,200
村田製作所	309,200	6,145.00	1,900,034,000
双葉電子工業	16,700	1,398.00	23,346,600
日東電工	72,600	6,150.00	446,490,000
北陸電気工業	4,300	1,180.00	5,074,000
東海理化電機製作所	27,700	2,169.00	60,081,300
ニチコン	35,700	1,140.00	40,698,000
日本ケミコン	8,000	1,970.00	15,760,000
K O A	15,900	1,455.00	23,134,500
三井E & Sホールディングス	38,000	902.00	34,276,000
日立造船	83,200	415.00	34,528,000
三菱重工業	176,400	4,386.00	773,690,400
川崎重工業	81,900	2,599.00	212,858,100
I H I	75,800	2,588.00	196,170,400
名村造船所	33,900	294.00	9,966,600
サノヤスホールディングス	12,900	190.00	2,451,000
スプリックス	3,400	1,559.00	5,300,600
日本車輛製造	3,800	2,947.00	11,198,600
三菱ロジスネクスト	13,900	1,029.00	14,303,100
近畿車輛	1,600	1,475.00	2,360,000
F P G	32,600	1,197.00	39,022,200
島根銀行	2,100	708.00	1,486,800
じもとホールディングス	70,100	109.00	7,640,900
全国保証	29,300	4,360.00	127,748,000
めぶきフィナンシャルグループ	539,200	287.00	154,750,400
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,000	1,541.00	21,574,000
九州フィナンシャルグループ	170,200	455.00	77,441,000

かんぽ生命保険	36,800	1,766.00	64,988,800	
ゆうちょ銀行	294,300	1,096.00	322,552,800	
富山第一銀行	24,700	347.00	8,570,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	610,400	470.00	286,888,000	
ジェイリース	2,700	336.00	907,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	70,700	866.00	61,226,200	
マーキュリアインベストメント	4,600	767.00	3,528,200	
イントラスト	3,600	729.00	2,624,400	
日本モーゲージサービス	2,100	1,441.00	3,026,100	
CASA	3,600	1,273.00	4,582,800	
アルヒ	16,500	2,535.00	41,827,500	
プレミアグループ	5,600	1,997.00	11,183,200	
日産自動車	1,241,500	707.40	878,237,100	
いすゞ自動車	305,000	1,260.00	384,300,000	
トヨタ自動車	1,173,000	7,929.00	9,300,717,000	代用有価証券 500,000株
日野自動車	131,400	1,056.00	138,758,400	
三菱自動車工業	389,600	509.00	198,306,400	
エフテック	7,400	747.00	5,527,800	
レシップホールディングス	4,100	675.00	2,767,500	
GMB	1,900	827.00	1,571,300	
ファルテック	1,900	811.00	1,540,900	
武蔵精密工業	23,400	1,575.00	36,855,000	
日産車体	20,600	1,047.00	21,568,200	
新明和工業	28,400	1,399.00	39,731,600	
極東開発工業	19,600	1,554.00	30,458,400	
日信工業	21,400	2,232.00	47,764,800	
トピー工業	8,700	2,207.00	19,200,900	
ティラド	3,800	2,115.00	8,037,000	
曙ブレーキ工業	57,800	228.00	13,178,400	
タチエス	17,300	1,504.00	26,019,200	
NOK	56,600	1,752.00	99,163,200	
フタバ産業	29,200	857.00	25,024,400	
KYB	11,800	3,655.00	43,129,000	
市光工業	15,700	842.00	13,219,400	
大同メタル工業	20,100	729.00	14,652,900	
プレス工業	52,200	494.00	25,786,800	
ミクニ	13,400	351.00	4,703,400	
太平洋工業	22,000	1,581.00	34,782,000	
ケーヒン	24,200	2,583.00	62,508,600	
河西工業	14,200	931.00	13,220,200	
アイシン精機	86,700	4,370.00	378,879,000	
マツダ	309,700	1,003.00	310,629,100	
今仙電機製作所	9,600	994.00	9,542,400	
本田技研工業	828,700	3,201.00	2,652,668,700	
スズキ	208,600	5,015.00	1,046,129,000	
SUBARU	326,800	3,014.00	984,975,200	
安永	5,100	1,380.00	7,038,000	



ヤマハ発動機	137,200	2,177.00	298,684,400
ショーワ	24,800	2,285.00	56,668,000
小糸製作所	63,100	5,930.00	374,183,000
T B K	12,900	468.00	6,037,200
エクセディ	14,300	2,520.00	36,036,000
ミツバ	19,400	752.00	14,588,800
豊田合成	34,000	2,621.00	89,114,000
愛三工業	16,500	961.00	15,856,500
盟和産業	1,600	1,166.00	1,865,600
日本プラスト	8,300	733.00	6,083,900
ヨロズ	9,800	1,462.00	14,327,600
エフ・シー・シー	17,200	2,446.00	42,071,200
新家工業	2,300	1,615.00	3,714,500
シマノ	39,400	17,720.00	698,168,000
テイ・エス テック	24,400	3,460.00	84,424,000
関西みらいフィナンシャルグループ	61,000	739.00	45,079,000
三十三フィナンシャルグループ	9,600	1,727.00	16,579,200
第四北越フィナンシャルグループ	18,000	2,881.00	51,858,000
ジャムコ	5,300	1,468.00	7,780,400
小野建	9,300	1,391.00	12,936,300
はるやまホールディングス	4,400	849.00	3,735,600
南陽	2,100	1,765.00	3,706,500
ノジマ	18,400	2,331.00	42,890,400
佐島電機	7,500	937.00	7,027,500
カップ・クリエイト	14,500	1,477.00	21,416,500
エコートレーディング	2,300	541.00	1,244,300
伯東	6,300	1,367.00	8,612,100
コンドーテック	8,100	1,091.00	8,837,100
中山福	6,100	564.00	3,440,400
ライトオン	7,800	578.00	4,508,400
ナガイレーベン	15,000	2,554.00	38,310,000
ジーンズメイト	3,300	331.00	1,092,300
三菱食品	11,400	2,833.00	32,296,200
良品計画	137,600	2,470.00	339,872,000
三城ホールディングス	11,200	286.00	3,203,200
松田産業	7,600	1,663.00	12,638,800
第一興商	15,400	5,430.00	83,622,000
メディカルホールディングス	111,900	2,486.00	278,183,400
アドヴァン	15,800	1,249.00	19,734,200
S P K	2,300	2,794.00	6,426,200
萩原電気ホールディングス	3,800	2,920.00	11,096,000
アルビス	3,900	2,405.00	9,379,500
アズワン	6,800	9,260.00	62,968,000
スズデン	3,600	1,439.00	5,180,400
尾家産業	3,100	1,339.00	4,150,900
シモジマ	6,400	1,267.00	8,108,800
ドウシシャ	9,800	1,776.00	17,404,800
小津産業	2,300	1,845.00	4,243,500
コナカ	12,400	421.00	5,220,400
高速	6,200	1,320.00	8,184,000

ハウス オブ ローゼ	1,300	1,672.00	2,173,600
G-7ホールディングス	3,100	3,780.00	11,718,000
たけびし	3,400	1,457.00	4,953,800
イオン北海道	10,600	805.00	8,533,000
コジマ	17,600	440.00	7,744,000
ヒマラヤ	3,400	847.00	2,879,800
コーナン商事	14,700	2,567.00	37,734,900
ネットワンシステムズ	39,300	2,916.00	114,598,800
エコス	3,800	1,704.00	6,475,200
ワタミ	12,300	1,424.00	17,515,200
マルシェ	2,800	783.00	2,192,400
リックス	2,300	1,641.00	3,774,300
システムソフト	24,700	112.00	2,766,400
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	248,400	1,800.00	447,120,000
丸文	9,100	614.00	5,587,400
西松屋チェーン	22,700	961.00	21,814,700
ゼンショーホールディングス	49,700	2,470.00	122,759,000
ハビネット	8,700	1,410.00	12,267,000
幸楽苑ホールディングス	6,600	2,063.00	13,615,800
ハークスレイ	2,000	1,057.00	2,114,000
橋本総業ホールディングス	2,100	1,748.00	3,670,800
日本ライフライン	30,700	1,538.00	47,216,600
サイゼリヤ	17,100	2,418.00	41,347,800
タカショー	4,900	486.00	2,381,400
エクセル	3,000	1,252.00	3,756,000
V Tホールディングス	42,900	490.00	21,021,000
マルカ	3,700	2,390.00	8,843,000
アルゴグラフィックス	8,800	3,095.00	27,236,000
魚力	2,900	1,540.00	4,466,000
IDOM	27,900	468.00	13,057,200
日本エム・ディ・エム	6,100	2,034.00	12,407,400
ポブラ	2,900	507.00	1,470,300
フジ・コーポレーション	2,800	2,227.00	6,235,600
ユナイテッドアローズ	10,900	3,505.00	38,204,500
進和	6,100	2,505.00	15,280,500
エスケイジャパン	2,200	451.00	992,200
ダイترون	4,400	1,524.00	6,705,600
ハイデイ日高	15,000	2,189.00	32,835,000
シークス	13,200	1,628.00	21,489,600
京都きもの友禅	6,800	363.00	2,468,400
コロワイド	34,400	2,231.00	76,746,400
ピーシーデポコーポレーション	13,800	488.00	6,734,400
田中商事	3,200	724.00	2,316,800
オーハシテクニカ	5,900	1,499.00	8,844,100
壱番屋	7,300	5,050.00	36,865,000
白銅	3,800	1,436.00	5,456,800
トップカルチャー	3,800	345.00	1,311,000
PLANT	2,700	677.00	1,827,900
スギホールディングス	20,700	6,070.00	125,649,000

薬王堂ホールディングス	4,500	2,591.00	11,659,500
島津製作所	125,800	3,200.00	402,560,000
JMS	9,000	682.00	6,138,000
クボテック	2,700	423.00	1,142,100
長野計器	7,600	772.00	5,867,200
ブイ・テクノロジー	4,900	6,250.00	30,625,000
スター精密	16,500	1,672.00	27,588,000
東京計器	6,700	997.00	6,679,900
愛知時計電機	1,300	4,320.00	5,616,000
インターアクション	5,600	2,185.00	12,236,000
オーバル	9,500	257.00	2,441,500
東京精密	19,100	3,740.00	71,434,000
マニー	41,900	2,957.00	123,898,300
ニコン	170,300	1,522.00	259,196,600
トプコン	53,000	1,519.00	80,507,000
オリンパス	582,400	1,718.00	1,000,563,200
理研計器	9,300	2,215.00	20,599,500
SCREENホールディングス	18,300	7,400.00	135,420,000
キヤノン電子	11,100	2,007.00	22,277,700
タムロン	8,500	2,476.00	21,046,000
HOYA	211,900	9,361.00	1,983,595,900
シード	4,500	929.00	4,180,500
ノーリツ鋼機	7,100	1,712.00	12,155,200
エー・アンド・デイ	9,600	811.00	7,785,600
朝日インテック	89,300	3,115.00	278,169,500
キヤノン	566,700	3,007.00	1,704,066,900
リコー	267,700	1,075.00	287,777,500
シチズン時計	123,200	605.00	74,536,000
リズム時計工業	3,300	922.00	3,042,600
大研医器	7,300	538.00	3,927,400
メニコン	14,400	3,955.00	56,952,000
シンシア	1,200	660.00	792,000
中本パックス	2,700	1,518.00	4,098,600
スノーピーク	4,800	1,038.00	4,982,400
パラマウントベッドホールディングス	11,100	4,200.00	46,620,000
トランザクション	6,600	969.00	6,395,400
SHOBI	3,100	396.00	1,227,600
ニホンフラッシュ	4,900	2,508.00	12,289,200
前田工織	11,600	1,840.00	21,344,000
永大産業	14,000	356.00	4,984,000
アートネイチャー	11,400	759.00	8,652,600
バンダイナムコホールディングス	108,800	6,549.00	712,531,200
アイフィスジャパン	2,800	753.00	2,108,400
共立印刷	17,900	165.00	2,953,500
SHOEI	5,100	4,845.00	24,709,500
フランスベッドホールディングス	14,900	1,030.00	15,347,000
マーベラス	15,800	789.00	12,466,200
パイロットコーポレーション	18,400	4,370.00	80,408,000
萩原工業	5,800	1,572.00	9,117,600
エイベックス	17,800	1,395.00	24,831,000

トッパン・フォームズ	22,600	1,088.00	24,588,800
フジシールインターナショナル	23,600	2,533.00	59,778,800
タカラトミー	47,200	1,207.00	56,970,400
廣済堂	7,300	729.00	5,321,700
エステールホールディングス	2,700	664.00	1,792,800
アーク	39,700	94.00	3,731,800
レック	11,200	1,376.00	15,411,200
タカノ	4,100	830.00	3,403,000
三光合成	11,900	426.00	5,069,400
プロネクサス	9,100	1,238.00	11,265,800
ホクシン	6,400	169.00	1,081,600
ウッドワン	3,400	1,194.00	4,059,600
大建工業	7,100	1,993.00	14,150,300
きもと	17,500	180.00	3,150,000
凸版印刷	148,600	2,063.00	306,561,800
大日本印刷	137,700	2,948.00	405,939,600
共同印刷	3,100	2,917.00	9,042,700
N I S S H A	21,600	1,213.00	26,200,800
光村印刷	900	1,774.00	1,596,600
藤森工業	9,400	3,670.00	34,498,000
ヴィア・ホールディングス	12,700	666.00	8,458,200
宝印刷	5,100	1,779.00	9,072,900
前澤化成工業	6,700	1,220.00	8,174,000
未来工業	5,700	2,236.00	12,745,200
アシックス	86,900	1,664.00	144,601,600
ツツミ	3,300	2,108.00	6,956,400
ウェーブロックホールディングス	3,600	813.00	2,926,800
J S P	6,200	1,977.00	12,257,400
ニチハ	14,600	3,030.00	44,238,000
エフピコ	11,600	6,710.00	77,836,000
小松ウオール工業	3,200	2,337.00	7,478,400
ヤマハ	62,600	5,890.00	368,714,000
河合楽器製作所	3,200	3,410.00	10,912,000
クリナップ	9,900	677.00	6,702,300
ピジョン	63,600	5,160.00	328,176,000
天馬	7,000	2,049.00	14,343,000
兼松サステック	700	1,761.00	1,232,700
キングジム	8,700	886.00	7,708,200
象印マホービン	30,800	1,745.00	53,746,000
リンテック	25,100	2,350.00	58,985,000
信越ポリマー	18,900	977.00	18,465,300
東リ	26,400	305.00	8,052,000
イトーキ	22,400	520.00	11,648,000
任天堂	64,500	41,960.00	2,706,420,000
三菱鉛筆	17,300	1,761.00	30,465,300
松風	4,800	1,718.00	8,246,400
タカラスタANDARD	21,800	1,948.00	42,466,400
コクヨ	50,500	1,623.00	81,961,500
ナカバヤシ	10,400	605.00	6,292,000
ニフコ	38,600	3,025.00	116,765,000

立川ブラインド工業	4,600	1,451.00	6,674,600
グロープライド	4,700	2,763.00	12,986,100
オカムラ	36,700	1,085.00	39,819,500
バルカー	8,600	2,436.00	20,949,600
MUTOHホールディングス	1,400	1,837.00	2,571,800
伊藤忠商事	725,200	2,370.50	1,719,086,600
丸紅	1,078,900	806.10	869,701,290
スクロール	15,900	347.00	5,517,300
高島	1,600	1,734.00	2,774,400
ヨンドシーホールディングス	10,600	2,662.00	28,217,200
三陽商会	5,400	1,528.00	8,251,200
長瀬産業	58,300	1,613.00	94,037,900
ナイガイ	3,900	463.00	1,805,700
蝶理	6,600	1,944.00	12,830,400
豊田通商	115,700	3,800.00	439,660,000
オンワードホールディングス	62,000	640.00	39,680,000
三共生興	15,800	586.00	9,258,800
兼松	38,600	1,408.00	54,348,800
美津濃	9,600	2,962.00	28,435,200
ツカモトコーポレーション	1,800	1,094.00	1,969,200
ファミリーマート	82,800	2,696.00	223,228,800
ルックホールディングス	3,500	1,148.00	4,018,000
三井物産	911,200	1,916.00	1,745,859,200
日本紙パルプ商事	5,900	4,080.00	24,072,000
東京エレクトロン	70,200	21,865.00	1,534,923,000
日立ハイテクノロジーズ	36,000	6,690.00	240,840,000
カメイ	13,600	1,341.00	18,237,600
東都水産	1,300	2,533.00	3,292,900
OUGホールディングス	1,600	2,709.00	4,334,400
スターゼン	3,800	4,695.00	17,841,000
セイコーホールディングス	14,900	2,725.00	40,602,500
山善	40,500	1,035.00	41,917,500
椿本興業	1,900	4,170.00	7,923,000
住友商事	654,100	1,679.50	1,098,560,950
日本ユニシス	32,300	3,460.00	111,758,000
内田洋行	4,400	4,265.00	18,766,000
三菱商事	727,500	2,872.00	2,089,380,000
第一実業	5,100	3,660.00	18,666,000
キヤノンマーケティングジャパン	29,600	2,390.00	70,744,000
西華産業	5,900	1,496.00	8,826,400
佐藤商事	8,600	933.00	8,023,800
菱洋エレクトロ	10,500	1,921.00	20,170,500
東京産業	9,400	577.00	5,423,800
ユアサ商事	9,800	3,560.00	34,888,000
神鋼商事	2,600	2,641.00	6,866,600
小林産業	6,600	318.00	2,098,800
阪和興業	19,300	2,887.00	55,719,100
正栄食品工業	6,700	3,315.00	22,210,500
カナデン	8,400	1,378.00	11,575,200
菱電商事	7,500	1,688.00	12,660,000

ニプロ	72,800	1,265.00	92,092,000
フルサト工業	5,800	1,684.00	9,767,200
岩谷産業	23,000	3,690.00	84,870,000
すてきナイスグループ	4,300	988.00	4,248,400
昭光通商	3,300	668.00	2,204,400
ニチモウ	1,700	2,008.00	3,413,600
極東貿易	3,000	1,997.00	5,991,000
イワキ	13,400	467.00	6,257,800
兼松エレクトロニクス	5,600	3,410.00	19,096,000
三愛石油	25,500	1,174.00	29,937,000
稲畑産業	22,800	1,504.00	34,291,200
G S Iクレオス	2,600	1,127.00	2,930,200
明和産業	9,600	591.00	5,673,600
クワザワ	3,600	623.00	2,242,800
キムラタン	51,900	32.00	1,660,800
ゴールドウイン	18,700	7,680.00	143,616,000
ユニ・チャーム	202,900	3,411.00	692,091,900
デサント	20,100	1,500.00	30,150,000
キング	4,900	575.00	2,817,500
ワキタ	22,100	1,132.00	25,017,200
ヤマトインターナショナル	6,200	397.00	2,461,400
東邦ホールディングス	33,200	2,686.00	89,175,200
サンゲツ	28,500	2,120.00	60,420,000
ミツウロコグループホールディングス	15,300	1,442.00	22,062,600
シナネンホールディングス	4,300	2,060.00	8,858,000
伊藤忠エネクス	22,900	915.00	20,953,500
サンリオ	29,100	2,202.00	64,078,200
サンワテクノス	7,400	1,129.00	8,354,600
リョーサン	11,400	2,879.00	32,820,600
新光商事	16,300	901.00	14,686,300
トーヨー	4,700	1,834.00	8,619,800
三信電気	5,600	1,611.00	9,021,600
東陽テクニカ	12,000	1,169.00	14,028,000
モスフードサービス	13,600	3,045.00	41,412,000
加賀電子	10,300	2,511.00	25,863,300
三益半導体工業	9,300	2,053.00	19,092,900
ソーダニッカ	10,700	649.00	6,944,300
立花エレテック	7,700	1,780.00	13,706,000
木曽路	13,500	2,848.00	38,448,000
S R Sホールディングス	12,200	1,044.00	12,736,800
千趣会	18,800	402.00	7,557,600
タカキュー	8,100	195.00	1,579,500
ケーヨー	21,400	540.00	11,556,000
上新電機	12,200	2,563.00	31,268,600
日本瓦斯	16,400	3,070.00	50,348,000
ロイヤルホールディングス	18,100	2,542.00	46,010,200
東天紅	800	1,298.00	1,038,400
いなげや	12,900	1,515.00	19,543,500
島忠	21,900	3,035.00	66,466,500
チヨダ	10,900	1,664.00	18,137,600

ライフコーポレーション	7,900	2,530.00	19,987,000
リンガーハット	12,800	2,455.00	31,424,000
MrMaxHD	14,300	503.00	7,192,900
テンアライド	9,800	443.00	4,341,400
AOKIホールディングス	20,800	1,167.00	24,273,600
オークワ	16,300	1,396.00	22,754,800
コメリ	16,000	2,370.00	37,920,000
青山商事	21,400	1,918.00	41,045,200
しまむら	12,100	9,480.00	114,708,000
はせがわ	5,200	408.00	2,121,600
高島屋	75,400	1,326.00	99,980,400
松屋	20,900	882.00	18,433,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,100	1,252.00	61,473,200
近鉄百貨店	4,000	3,560.00	14,240,000
パルコ	10,000	1,306.00	13,060,000
丸井グループ	95,000	2,556.00	242,820,000
クレディセゾン	72,700	1,660.00	120,682,000
アクシアル リテイリング	8,600	4,130.00	35,518,000
井筒屋	5,600	249.00	1,394,400
イオン	398,900	2,277.50	908,494,750
イズミ	21,100	4,295.00	90,624,500
フォーバル	4,600	1,034.00	4,756,400
平和堂	21,000	2,136.00	44,856,000
フジ	12,500	1,991.00	24,887,500
ヤオコー	11,800	5,250.00	61,950,000
ゼビオホールディングス	12,500	1,288.00	16,100,000
ケーズホールディングス	100,000	1,354.00	135,400,000
PALTAC	16,600	5,490.00	91,134,000
三谷産業	13,800	336.00	4,636,800
Olympicグループ	5,400	613.00	3,310,200
日産東京販売ホールディングス	14,600	311.00	4,540,600
新生銀行	76,200	1,782.00	135,788,400
あおぞら銀行	61,800	2,834.00	175,141,200
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,146,400	592.70	4,235,671,280
りそなホールディングス	1,139,300	478.10	544,699,330
三井住友トラスト・ホールディングス	196,300	4,124.00	809,541,200
三井住友フィナンシャルグループ	718,000	4,018.00	2,884,924,000
千葉銀行	357,000	617.00	220,269,000
群馬銀行	203,800	389.00	79,278,200
武蔵野銀行	15,500	2,043.00	31,666,500
千葉興業銀行	28,400	357.00	10,138,800
筑波銀行	43,100	225.00	9,697,500
七十七銀行	35,000	1,806.00	63,210,000
青森銀行	8,000	2,910.00	23,280,000
秋田銀行	6,700	2,268.00	15,195,600
山形銀行	11,700	1,659.00	19,410,300
岩手銀行	6,800	3,065.00	20,842,000
東邦銀行	92,700	273.00	25,307,100
東北銀行	5,100	1,029.00	5,247,900
みちのく銀行	6,700	1,635.00	10,954,500

ふくおかフィナンシャルグループ	87,400	2,153.00	188,172,200	
静岡銀行	257,000	843.00	216,651,000	
十六銀行	13,000	2,655.00	34,515,000	
スルガ銀行	106,200	496.00	52,675,200	
八十二銀行	250,400	489.00	122,445,600	
山梨中央銀行	12,100	1,132.00	13,697,200	
大垣共立銀行	20,500	2,660.00	54,530,000	
福井銀行	8,900	1,619.00	14,409,100	
北國銀行	10,700	3,300.00	35,310,000	
清水銀行	4,300	2,002.00	8,608,600	
富山銀行	2,000	2,526.00	5,052,000	
滋賀銀行	20,800	2,671.00	55,556,800	
南都銀行	17,300	2,791.00	48,284,300	
百五銀行	93,400	365.00	34,091,000	
京都銀行	37,200	4,570.00	170,004,000	
紀陽銀行	36,700	1,702.00	62,463,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	69,100	1,127.00	77,875,700	
広島銀行	153,100	566.00	86,654,600	
山陰合同銀行	61,500	673.00	41,389,500	
中国銀行	89,300	1,089.00	97,247,700	
鳥取銀行	3,600	1,404.00	5,054,400	
伊予銀行	148,000	605.00	89,540,000	
百十四銀行	11,000	2,284.00	25,124,000	
四国銀行	15,800	1,018.00	16,084,400	
阿波銀行	17,000	2,658.00	45,186,000	
大分銀行	6,000	3,040.00	18,240,000	
宮崎銀行	6,900	2,694.00	18,588,600	
佐賀銀行	6,300	1,653.00	10,413,900	
沖縄銀行	9,500	3,760.00	35,720,000	
琉球銀行	24,000	1,197.00	28,728,000	
セブン銀行	346,800	332.00	115,137,600	
みずほフィナンシャルグループ	14,107,000	172.00	2,426,404,000	
高知銀行	3,700	910.00	3,367,000	
山口フィナンシャルグループ	129,500	775.00	100,362,500	
芙蓉総合リース	10,900	7,300.00	79,570,000	
みずほリース	16,000	3,220.00	51,520,000	
東京センチュリー	20,900	5,740.00	119,966,000	
SBIホールディングス	115,900	2,357.00	273,176,300	
日本証券金融	45,800	521.00	23,861,800	
アイフル	158,200	252.00	39,866,400	
日本アジア投資	8,800	293.00	2,578,400	
長野銀行	3,500	1,665.00	5,827,500	
名古屋銀行	8,400	3,320.00	27,888,000	
北洋銀行	156,300	243.00	37,980,900	
愛知銀行	3,800	3,820.00	14,516,000	
中京銀行	4,300	2,211.00	9,507,300	
大光銀行	3,600	1,834.00	6,602,400	
愛媛銀行	14,500	1,182.00	17,139,000	
トマト銀行	4,200	1,105.00	4,641,000	
京葉銀行	44,200	649.00	28,685,800	



栃木銀行	50,300	230.00	11,569,000
北日本銀行	3,200	1,988.00	6,361,600
東和銀行	18,300	946.00	17,311,800
福島銀行	9,600	310.00	2,976,000
大東銀行	5,500	630.00	3,465,000
リコーリース	8,200	3,795.00	31,119,000
イオンフィナンシャルサービス	63,500	1,690.00	107,315,000
アコム	208,700	433.00	90,367,100
ジャックス	11,500	2,634.00	30,291,000
オリエントコーポレーション	280,800	159.00	44,647,200
日立キャピタル	24,500	2,562.00	62,769,000
アプラスフィナンシャル	50,000	98.00	4,900,000
オリックス	649,300	1,763.00	1,144,715,900
三菱UFJリース	263,500	704.00	185,504,000
ジャフコ	16,000	4,225.00	67,600,000
九州リースサービス	4,900	616.00	3,018,400
トモニホールディングス	80,000	380.00	30,400,000
大和証券グループ本社	832,700	512.60	426,842,020
野村ホールディングス	1,826,600	516.90	944,169,540
岡三証券グループ	88,500	397.00	35,134,500
丸三証券	30,800	522.00	16,077,600
東洋証券	36,800	171.00	6,292,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	119,000	321.00	38,199,000
光世証券	2,500	703.00	1,757,500
水戸証券	30,100	264.00	7,946,400
いちよし証券	19,500	699.00	13,630,500
松井証券	59,300	903.00	53,547,900
SOMPOホールディングス	195,200	4,433.00	865,321,600
だいこう証券ビジネス	5,100	597.00	3,044,700
日本取引所グループ	298,000	1,882.00	560,836,000
マネックスグループ	78,200	279.00	21,817,800
極東証券	14,000	819.00	11,466,000
岩井コスモホールディングス	9,800	1,223.00	11,985,400
藍澤証券	18,700	727.00	13,594,900
フィデアホールディングス	101,300	133.00	13,472,900
池田泉州ホールディングス	119,400	200.00	23,880,000
アニコムホールディングス	8,600	4,160.00	35,776,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	271,400	3,554.00	964,555,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	85,300	2,424.00	206,767,200
マネーパートナーズグループ	11,000	254.00	2,794,000
スパークス・グループ	36,000	245.00	8,820,000
小林洋行	3,100	262.00	812,200
第一生命ホールディングス	587,500	1,877.00	1,102,737,500
東京海上ホールディングス	371,200	5,946.00	2,207,155,200
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	919.00	4,686,900
イー・ギャランティ	11,100	1,400.00	15,540,000
アサックス	5,500	637.00	3,503,500

NECキャピタルソリューション	4,200	2,419.00	10,159,800	
T&Dホールディングス	321,100	1,343.00	431,237,300	
アドバンスクリエイト	2,500	1,990.00	4,975,000	
三井不動産	518,400	2,765.00	1,433,376,000	
三菱地所	727,500	2,061.00	1,499,377,500	
平和不動産	19,100	2,587.00	49,411,700	
東京建物	113,500	1,518.00	172,293,000	
ダイビル	26,800	1,154.00	30,927,200	
京阪神ビルディング	16,900	1,345.00	22,730,500	
住友不動産	233,400	3,979.00	928,698,600	
太平洋興発	4,000	837.00	3,348,000	
テーオーシー	20,500	852.00	17,466,000	
東京楽天地	1,400	6,100.00	8,540,000	
レオパレス21	136,100	266.00	36,202,600	
スターツコーポレーション	14,200	2,896.00	41,123,200	
フジ住宅	12,200	711.00	8,674,200	
空港施設	10,700	572.00	6,120,400	
明和地所	6,000	595.00	3,570,000	
ゴールドクレスト	8,200	2,334.00	19,138,800	
リログループ	55,000	2,875.00	158,125,000	
エスリード	4,100	2,065.00	8,466,500	
日神不動産	15,600	510.00	7,956,000	
日本エスコン	18,800	905.00	17,014,000	
タカラレーベン	47,500	478.00	22,705,000	
サンヨーハウジング名古屋	6,000	970.00	5,820,000	
イオンモール	52,100	1,751.00	91,227,100	
毎日コムネット	2,200	820.00	1,804,000	
ファースト住建	4,500	1,344.00	6,048,000	
ランド	566,400	11.00	6,230,400	
カチタス	12,900	4,640.00	59,856,000	
東祥	6,300	2,555.00	16,096,500	
トーセイ	14,300	1,400.00	20,020,000	
穴吹興産	1,100	2,892.00	3,181,200	
サンフロンティア不動産	14,400	1,346.00	19,382,400	
エフ・ジェー・ネクスト	9,100	1,064.00	9,682,400	
インテリックス	3,000	753.00	2,259,000	
ランドビジネス	4,200	789.00	3,313,800	
日本社宅サービス	2,700	1,094.00	2,953,800	
グランディハウス	8,200	505.00	4,141,000	
東武鉄道	111,000	3,945.00	437,895,000	
相鉄ホールディングス	33,700	3,030.00	102,111,000	
東急	265,500	2,152.00	571,356,000	
京浜急行電鉄	135,200	2,229.00	301,360,800	
小田急電鉄	156,500	2,748.00	430,062,000	
京王電鉄	54,600	6,910.00	377,286,000	
京成電鉄	73,200	4,575.00	334,890,000	
富士急行	14,300	4,300.00	61,490,000	
新京成電鉄	2,800	2,265.00	6,342,000	
東日本旅客鉄道	185,300	10,120.00	1,875,236,000	
西日本旅客鉄道	93,800	9,704.00	910,235,200	

東海旅客鉄道	87,500	22,555.00	1,973,562,500	
西武ホールディングス	141,300	1,849.00	261,263,700	
鴻池運輸	16,700	1,681.00	28,072,700	
西日本鉄道	29,200	2,480.00	72,416,000	
ハマキョウレックス	8,100	3,620.00	29,322,000	
サカイ引越センター	5,500	6,490.00	35,695,000	
近鉄グループホールディングス	99,700	6,100.00	608,170,000	
阪急阪神ホールディングス	133,000	4,590.00	610,470,000	
南海電気鉄道	47,200	2,963.00	139,853,600	
京阪ホールディングス	44,400	5,430.00	241,092,000	
神戸電鉄	2,400	3,965.00	9,516,000	
名古屋鉄道	81,900	3,585.00	293,611,500	
山陽電気鉄道	7,100	2,270.00	16,117,000	
トランコム	2,800	7,170.00	20,076,000	
日本通運	35,200	6,720.00	236,544,000	
ヤマトホールディングス	174,700	1,802.00	314,809,400	
山九	27,700	5,970.00	165,369,000	
日新	8,600	1,784.00	15,342,400	
丸運	5,800	275.00	1,595,000	
丸全昭和運輸	8,100	3,160.00	25,596,000	
センコーグループホールディングス	54,900	891.00	48,915,900	
トナミホールディングス	2,400	5,110.00	12,264,000	
ニッコンホールディングス	35,700	2,725.00	97,282,500	
日本石油輸送	1,100	2,864.00	3,150,400	
福山通運	12,800	4,030.00	51,584,000	
セイノーホールディングス	74,600	1,530.00	114,138,000	
エスライン	3,000	987.00	2,961,000	
神奈川中央交通	2,500	3,940.00	9,850,000	
日立物流	18,300	3,185.00	58,285,500	
丸和運輸機関	10,500	2,359.00	24,769,500	
C & F ロジホールディングス	10,100	1,442.00	14,564,200	
日本郵船	83,300	1,998.00	166,433,400	
商船三井	63,100	3,030.00	191,193,000	
川崎汽船	30,700	1,765.00	54,185,500	
NSユナイテッド海運	5,500	2,320.00	12,760,000	
明治海運	10,000	352.00	3,520,000	
飯野海運	47,300	369.00	17,453,700	
共栄タンカー	800	1,481.00	1,184,800	
九州旅客鉄道	88,900	3,775.00	335,597,500	
SGホールディングス	104,600	2,665.00	278,759,000	
日本航空	182,500	3,371.00	615,207,500	
ANAホールディングス	182,200	3,759.00	684,889,800	
パスコ	1,900	1,159.00	2,202,100	
西本Wismettacホールディングス	1,900	3,765.00	7,153,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,452.00	1,306,800	
Genky DrugStores	5,100	2,524.00	12,872,400	
国際紙パルプ商事	24,600	329.00	8,093,400	
ナルミヤ・インターナショナル	1,700	1,272.00	2,162,400	
総合メディカルホールディングス	9,000	1,900.00	17,100,000	

ブックオフグループホールディングス	6,000	1,065.00	6,390,000
三菱倉庫	31,600	2,878.00	90,944,800
三井倉庫ホールディングス	11,400	1,977.00	22,537,800
住友倉庫	36,700	1,527.00	56,040,900
澁澤倉庫	5,500	2,190.00	12,045,000
ヤマタネ	5,200	1,483.00	7,711,600
東陽倉庫	18,200	340.00	6,188,000
乾汽船	5,800	1,195.00	6,931,000
日本トランスシティ	22,000	558.00	12,276,000
ケイヒン	1,800	1,375.00	2,475,000
中央倉庫	6,100	1,269.00	7,740,900
川西倉庫	1,800	1,190.00	2,142,000
安田倉庫	8,300	1,019.00	8,457,700
ファイズホールディングス	2,100	660.00	1,386,000
東洋埠頭	3,000	1,445.00	4,335,000
宇徳	8,700	524.00	4,558,800
上組	57,100	2,656.00	151,657,600
サンリツ	2,300	698.00	1,605,400
キムラユニティー	2,700	1,114.00	3,007,800
キューソー流通システム	2,500	1,996.00	4,990,000
近鉄エクスプレス	21,200	1,882.00	39,898,400
東海運	5,900	290.00	1,711,000
エーアイティー	7,000	951.00	6,657,000
内外トランスライン	3,500	1,491.00	5,218,500
ショーエイコーポレーション	1,200	739.00	886,800
日本コンセプト	3,200	1,478.00	4,729,600
東京放送ホールディングス	62,800	1,746.00	109,648,800
日本テレビホールディングス	86,200	1,479.00	127,489,800
朝日放送グループホールディングス	10,400	777.00	8,080,800
テレビ朝日ホールディングス	28,400	1,782.00	50,608,800
スカパーJ S A Tホールディングス	68,000	465.00	31,620,000
テレビ東京ホールディングス	8,500	2,324.00	19,754,000
日本BS放送	3,500	1,085.00	3,797,500
ビジョン	9,600	1,727.00	16,579,200
スマートパリュウ	3,100	780.00	2,418,000
USEN-NEXT HOLDINGS	3,900	1,061.00	4,137,900
ワイヤレスゲート	4,900	740.00	3,626,000
コネクシオ	5,900	1,522.00	8,979,800
日本通信	79,700	201.00	16,019,700
クロップス	2,000	720.00	1,440,000
日本電信電話	690,300	5,522.00	3,811,836,600
KDDI	769,700	3,200.00	2,463,040,000
ソフトバンク	938,600	1,493.00	1,401,329,800
光通信	10,600	24,930.00	264,258,000
NTTドコモ	763,000	3,052.00	2,328,676,000
エムティーアイ	10,000	730.00	7,300,000
GMOインターネット	40,700	1,987.00	80,870,900
ファイバーゲート	1,900	1,369.00	2,601,100

アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	798.00	2,473,800	
KADOKAWA	27,800	1,507.00	41,894,600	
学研ホールディングス	3,500	5,710.00	19,985,000	
ゼンリン	20,600	1,982.00	40,829,200	
昭文社	4,800	450.00	2,160,000	
インプレスホールディングス	8,600	156.00	1,341,600	
東京電力ホールディングス	840,200	510.00	428,502,000	
中部電力	322,000	1,576.50	507,633,000	
関西電力	398,800	1,254.50	500,294,600	
中国電力	145,500	1,479.00	215,194,500	
北陸電力	96,200	821.00	78,980,200	
東北電力	262,900	1,135.00	298,391,500	
四国電力	94,800	1,140.00	108,072,000	
九州電力	216,900	986.00	213,863,400	
北海道電力	98,500	556.00	54,766,000	
沖縄電力	19,500	1,960.00	38,220,000	
電源開発	83,700	2,621.00	219,377,700	
エフオン	5,000	706.00	3,530,000	
イーレックス	15,000	1,624.00	24,360,000	
レノバ	17,400	1,116.00	19,418,400	
東京瓦斯	202,400	2,615.00	529,276,000	
大阪瓦斯	204,200	2,125.00	433,925,000	
東邦瓦斯	52,100	4,360.00	227,156,000	
北海道瓦斯	5,700	1,620.00	9,234,000	
広島ガス	21,800	366.00	7,978,800	
西部瓦斯	11,900	2,558.00	30,440,200	
静岡ガス	29,900	907.00	27,119,300	
メタウォーター	5,100	4,015.00	20,476,500	
アイネット	5,300	1,345.00	7,128,500	
松竹	6,800	15,830.00	107,644,000	
東宝	61,800	4,440.00	274,392,000	
エイチ・アイ・エス	15,700	2,856.00	44,839,200	
東映	3,900	15,080.00	58,812,000	
ラックランド	2,000	2,466.00	4,932,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	275,000	1,459.00	401,225,000	
共立メンテナンス	16,700	5,130.00	85,671,000	
イチネンホールディングス	11,300	1,415.00	15,989,500	
建設技術研究所	6,900	1,933.00	13,337,700	
スペース	6,600	1,280.00	8,448,000	
長大	3,700	1,282.00	4,743,400	
アインホールディングス	13,900	6,520.00	90,628,000	
燦ホールディングス	4,400	1,343.00	5,909,200	
ピー・シー・エー	1,300	3,630.00	4,719,000	
スバル興業	600	7,140.00	4,284,000	
東京テアトル	4,000	1,390.00	5,560,000	
タナベ経営	2,000	1,241.00	2,482,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,451.00	4,411,800	
ナガワ	2,700	7,330.00	19,791,000	
よみうりランド	2,200	4,625.00	10,175,000	

東京都競馬	6,600	3,285.00	21,681,000
常磐興産	4,100	1,780.00	7,298,000
カナモト	16,400	3,040.00	49,856,000
東京ドーム	40,700	992.00	40,374,400
D T S	23,100	2,263.00	52,275,300
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,000	4,885.00	214,940,000
シーイーシー	11,100	1,992.00	22,111,200
カプコン	48,700	2,528.00	123,113,600
西尾レントオール	10,200	3,120.00	31,824,000
アイ・エス・ピー	2,000	1,822.00	3,644,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	65,500	33.00	2,161,500
日本空港ビルデング	33,100	5,350.00	177,085,000
トランス・コスモス	9,600	2,925.00	28,080,000
乃村工藝社	43,100	1,374.00	59,219,400
ジャステック	6,600	1,131.00	7,464,600
S C S K	23,800	5,750.00	136,850,000
藤田観光	4,400	3,005.00	13,222,000
K N T - C Tホールディングス	6,300	1,572.00	9,903,600
日本管財	10,800	1,948.00	21,038,400
トーカイ	9,700	2,644.00	25,646,800
白洋舎	1,100	2,930.00	3,223,000
セコム	106,700	9,878.00	1,053,982,600
日本システムウェア	3,400	2,495.00	8,483,000
セントラル警備保障	4,800	6,180.00	29,664,000
アイネス	10,200	1,263.00	12,882,600
丹青社	19,000	1,154.00	21,926,000
メイテック	12,400	5,900.00	73,160,000
T K C	8,700	4,650.00	40,455,000
富士ソフト	13,200	4,325.00	57,090,000
応用地質	10,800	1,281.00	13,834,800
船井総研ホールディングス	20,800	2,498.00	51,958,400
N S D	17,000	3,405.00	57,885,000
進学会ホールディングス	4,000	570.00	2,280,000
丸紅建材リース	1,000	1,822.00	1,822,000
オオバ	7,800	754.00	5,881,200
コナミホールディングス	37,500	4,635.00	173,812,500
いであ	1,900	2,025.00	3,847,500
学究社	3,000	1,304.00	3,912,000
ベネッセホールディングス	33,500	2,979.00	99,796,500
イオンディライト	12,400	3,880.00	48,112,000
ナック	5,600	1,125.00	6,300,000
福井コンピュータホールディングス	4,100	3,340.00	13,694,000
ニチイ学館	14,300	1,937.00	27,699,100
ダイセキ	16,900	3,155.00	53,319,500
ステップ	3,700	1,510.00	5,587,000
日鉄物産	7,400	5,030.00	37,222,000
泉州電業	3,200	2,959.00	9,468,800
元気寿司	2,600	3,005.00	7,813,000

トラスコ中山	21,600	2,697.00	58,255,200
ヤマダ電機	315,800	566.00	178,742,800
オートバックスセブン	38,500	1,826.00	70,301,000
モリト	7,500	816.00	6,120,000
アークランドサカモト	16,300	1,324.00	21,581,200
ニトリホールディングス	44,900	16,815.00	754,993,500
グルメ杵屋	7,400	1,198.00	8,865,200
愛眼	8,100	256.00	2,073,600
ケーユーホールディングス	5,400	951.00	5,135,400
吉野家ホールディングス	34,000	2,697.00	91,698,000
加藤産業	16,200	3,565.00	57,753,000
北恵	2,000	1,093.00	2,186,000
イノテック	6,200	1,047.00	6,491,400
イエローハット	19,600	1,885.00	36,946,000
松屋フーズホールディングス	5,000	4,180.00	20,900,000
JBC Cホールディングス	7,000	1,680.00	11,760,000
J Kホールディングス	9,400	632.00	5,940,800
サガミホールディングス	13,900	1,389.00	19,307,100
日伝	9,400	2,079.00	19,542,600
関西スーパーマーケット	8,600	1,055.00	9,073,000
ミロク情報サービス	9,100	2,923.00	26,599,300
北沢産業	7,600	287.00	2,181,200
杉本商事	5,600	2,073.00	11,608,800
因幡電機産業	14,800	5,130.00	75,924,000
王将フードサービス	7,600	6,610.00	50,236,000
ブレナス	11,600	1,888.00	21,900,800
ミニストップ	7,700	1,522.00	11,719,400
アークス	21,200	2,323.00	49,247,600
パローホールディングス	22,900	1,970.00	45,113,000
東テク	3,400	2,464.00	8,377,600
ミスミグループ本社	129,800	2,803.00	363,829,400
藤久	900	815.00	733,500
アルテック	8,400	243.00	2,041,200
ベルク	5,100	5,260.00	26,826,000
大 庄	5,600	1,599.00	8,954,400
タキヒヨー	3,000	1,902.00	5,706,000
ファーストリテイリング	13,900	67,580.00	939,362,000
ソフトバンクグループ	819,500	4,300.00	3,523,850,000
蔵王産業	1,600	1,450.00	2,320,000
スズケン	43,900	5,540.00	243,206,000
サンドラッグ	39,000	3,890.00	151,710,000
サックスパー ホールディングス	8,700	920.00	8,004,000
ジェコス	7,200	955.00	6,876,000
ヤマザワ	2,000	1,701.00	3,402,000
やまや	2,100	2,166.00	4,548,600
グローセル	9,200	452.00	4,158,400
ベルーナ	22,200	753.00	16,716,600
合計	124,008,600		253,322,028,630

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,224,923,872
コール・ローン	4,863,618,137
国債証券	402,643,224,106
派生商品評価勘定	563,393,444
未収利息	2,722,728,880
前払費用	262,086,057
流動資産合計	418,279,974,496
資産合計	
418,279,974,496	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,211,259,473
未払解約金	645,494,000
流動負債合計	2,856,753,473
負債合計	
2,856,753,473	
純資産の部	
元本等	
元本	296,277,231,415
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	119,145,989,608
元本等合計	415,423,221,023
純資産合計	
415,423,221,023	
負債純資産合計	
418,279,974,496	

## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	215,528,334,101円
同期中追加設定元本額	301,089,720,408円
同期中一部解約元本額	220,340,823,094円
元本の内訳 ファンド名	

たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	4,088,184,211円
たわらノーロード バランス(堅実型)	116,034,572円
たわらノーロード バランス(標準型)	309,476,276円
たわらノーロード バランス(積極型)	148,312,086円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	6,642,850円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	326,127,845円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	369,344,434円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	115,143,449円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	53,316,176円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	2,313,519円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	9,562,783円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	10,334,616円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,760,728円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,282,316円
投資のソムリエ	37,195,521,125円
投資のソムリエ<DC年金>	3,853,007,456円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,735,476,299円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	30,937,468,494円
ワールドアセットバランス(基本コース)	3,731,953,953円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	14,684,163,372円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	26,650,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	19,383,331円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	21,413,189円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	52,137,912円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	20,590,043,081円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,710,534,256円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	4,279,736円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	3,614,017円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	3,655,983円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,999,835,096円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	126,193,320,619円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	630,269,619円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	81,916,684円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	520,029,206円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	1,098,933,780円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	2,570,827円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	17,624,976,278円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	138,408,906円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,171,946,629円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,392,050,786円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	3,166,832,839円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	127,001,575円
計	296,277,231,415円

2. 受益権の総数

296,277,231,415口

## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和1年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,235,471,291
合計	2,235,471,291

(注) 「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月25日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	416,432,008,579	-	418,079,874,608	1,647,866,029
アメリカ・ドル	202,259,956,212	-	204,269,280,900	2,009,324,688
イギリス・ポンド	26,693,096,058	-	26,645,846,746	47,249,312
オーストラリア・ドル	8,351,350,309	-	8,389,259,775	37,909,466
カナダ・ドル	7,902,628,014	-	7,929,574,480	26,946,466
シンガポール・ドル	1,672,459,811	-	1,690,042,900	17,583,089
スウェーデン・クローナ	1,204,018,258	-	1,207,372,500	3,354,242
デンマーク・クローネ	2,202,007,017	-	2,193,404,890	8,602,127
ノルウェー・クローネ	717,336,923	-	726,776,784	9,439,861
ポーランド・ズロチ	2,419,796,594	-	2,407,655,425	12,141,169
マレーシア・リングgit	1,096,013,826	-	1,103,441,400	7,427,574
メキシコ・ペソ	3,624,314,340	-	3,669,286,068	44,971,728
ユーロ	155,962,371,513	-	155,467,257,470	495,114,043
南アフリカ・ランド	2,326,659,704	-	2,380,675,270	54,015,566
合計	416,432,008,579	-	418,079,874,608	1,647,866,029

(注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和1年11月11日現在	
1口当たり純資産額	1.4021円
(1万口当たり純資産額)	(14,021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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.125 02/28/21	1,740,000.000	1,726,814.050	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,907,031.200	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,763,171.870	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,888,281.250	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	425,464.840	
		US T N/B 1.25 03/31/21	12,310,000.000	12,236,909.370	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,261,531.200	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,413,867.130	
		US T N/B 1.375 01/31/21	6,760,000.000	6,735,706.250	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,953,906.200	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	12,287,285.090	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	543,425.770	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,386,445.260	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,881,875.000	
		US T N/B 1.5 08/15/26	19,050,000.000	18,636,257.810	
		US T N/B 1.625 02/15/26	20,030,000.000	19,789,014.050	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,772,437.500	
		US T N/B 1.625 05/15/26	14,030,000.000	13,850,240.620	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,455,551.550	
		US T N/B 1.625 06/30/21	3,190,000.000	3,186,635.530	
		US T N/B 1.625 08/15/29	8,070,000.000	7,848,705.420	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,273,593.730	
		US T N/B 1.625 10/31/23	1,780,000.000	1,774,854.670	
		US T N/B 1.625 11/15/22	18,500,000.000	18,463,144.480	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,190,225.000	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,512,304.630	
		US T N/B 1.75 03/31/22	5,290,000.000	5,297,852.310	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,252,490.220	
		US T N/B 1.75 05/15/23	14,390,000.000	14,410,235.930	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,507,052.290	
		US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,169,675.000	
		US T N/B 1.75 06/30/24	7,510,000.000	7,514,106.990	
		US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	2,944,478.880	
		US T N/B 1.75 07/31/21	15,530,000.000	15,542,739.410	
US T N/B 1.75 07/31/24	11,200,000.000	11,205,250.000			
US T N/B 1.75 09/30/22	5,360,000.000	5,367,956.220			
US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,382,156.250			
US T N/B 1.75 12/31/20	12,590,000.000	12,600,819.460			
US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,868,321.840			
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,450,103.110			
US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	13,358,187.500			

US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,436,267.910	
US T N/B 1.875 06/30/26	6,470,000.000	6,486,680.430	
US T N/B 1.875 07/31/22	10,290,000.000	10,337,430.410	
US T N/B 1.875 07/31/26	10,760,000.000	10,786,059.320	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,363,462.500	
US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	8,907,760.890	
US T N/B 1.875 10/31/22	12,380,000.000	12,442,867.120	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	10,070,703.100	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	14,132,343.680	
US T N/B 2.0 02/15/25	21,670,000.000	21,922,252.220	
US T N/B 2.0 04/30/24	14,260,000.000	14,421,538.980	
US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,612,832.770	
US T N/B 2.0 05/31/24	9,830,000.000	9,947,499.160	
US T N/B 2.0 06/30/24	7,540,000.000	7,626,592.140	
US T N/B 2.0 07/31/22	12,300,000.000	12,407,625.000	
US T N/B 2.0 08/15/25	7,730,000.000	7,809,111.680	
US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	7,097,230.410	
US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,316,781.250	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,949,683.570	
US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	8,993,867.140	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,125,175.000	
US T N/B 2.0 12/31/21	14,720,000.000	14,817,749.920	
US T N/B 2.125 02/29/24	3,330,000.000	3,385,413.260	
US T N/B 2.125 03/31/24	20,250,000.000	20,580,644.420	
US T N/B 2.125 05/15/22	12,700,000.000	12,833,449.180	
US T N/B 2.125 05/15/25	12,390,000.000	12,609,728.820	
US T N/B 2.125 05/31/21	22,090,000.000	22,230,651.000	
US T N/B 2.125 05/31/26	6,070,000.000	6,178,596.060	
US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,863,273.410	
US T N/B 2.125 07/31/24	3,520,000.000	3,580,224.980	
US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,659,677.290	
US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,877,328.070	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,767,812.480	
US T N/B 2.125 11/30/23	10,290,000.000	10,448,369.470	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	4,040,715.620	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	7,063,984.340	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,675,078.120	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,860,620.290	
US T N/B 2.25 02/15/27	15,070,000.000	15,479,715.620	
US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	12,009,865.590	
US T N/B 2.25 03/31/26	9,450,000.000	9,692,156.250	
US T N/B 2.25 04/15/22	22,820,000.000	23,120,403.840	
US T N/B 2.25 04/30/21	8,490,000.000	8,557,322.980	
US T N/B 2.25 04/30/24	11,660,000.000	11,916,884.370	
US T N/B 2.25 08/15/27	12,780,000.000	13,137,440.610	
US T N/B 2.25 08/15/46	5,670,000.000	5,476,865.620	
US T N/B 2.25 08/15/49	4,150,000.000	4,002,804.680	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,668,300.000	
US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,896,296.800	

US T N/B 2.25 11/15/25	6,710,000.000	6,876,177.310	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,870,000.000	13,229,957.800	
US T N/B 2.25 12/31/23	9,550,000.000	9,748,460.930	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,640,418.750	
US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,817,356.250	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,953,609.340	
US T N/B 2.375 03/15/22	15,120,000.000	15,366,290.580	
US T N/B 2.375 04/30/26	8,680,000.000	8,968,881.250	
US T N/B 2.375 05/15/27	11,010,000.000	11,414,273.430	
US T N/B 2.375 05/15/29	19,720,000.000	20,477,987.490	
US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	12,971,552.260	
US T N/B 2.5 01/15/22	14,320,000.000	14,571,159.330	
US T N/B 2.5 01/31/21	17,950,000.000	18,124,591.750	
US T N/B 2.5 01/31/24	10,750,000.000	11,082,578.120	
US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	3,089,421.870	
US T N/B 2.5 02/15/22	7,160,000.000	7,286,698.410	
US T N/B 2.5 02/15/45	10,160,000.000	10,316,368.690	
US T N/B 2.5 02/15/46	10,100,000.000	10,257,023.360	
US T N/B 2.5 02/28/21	15,690,000.000	15,851,190.110	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,740,800.000	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,894,824.960	
US T N/B 2.5 05/15/24	21,710,000.000	22,425,751.550	
US T N/B 2.5 05/15/46	8,840,000.000	8,976,743.740	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,891,054.650	
US T N/B 2.5 12/31/20	14,350,000.000	14,483,970.590	
US T N/B 2.625 01/31/26	8,050,000.000	8,427,343.750	
US T N/B 2.625 02/15/29	12,420,000.000	13,157,437.500	
US T N/B 2.625 02/28/23	12,400,000.000	12,762,312.490	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,622,774.190	
US T N/B 2.625 06/15/21	16,260,000.000	16,494,372.610	
US T N/B 2.625 06/30/23	2,650,000.000	2,734,882.810	
US T N/B 2.625 07/15/21	16,670,000.000	16,924,608.070	
US T N/B 2.625 12/15/21	11,320,000.000	11,542,420.220	
US T N/B 2.625 12/31/23	9,670,000.000	10,016,760.100	
US T N/B 2.625 12/31/25	7,300,000.000	7,640,476.520	
US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,429,568.750	
US T N/B 2.75 02/15/28	14,940,000.000	15,929,775.000	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,598,111.680	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	11,040,115.620	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	4,017,618.750	
US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	8,515,125.000	
US T N/B 2.75 07/31/23	10,070,000.000	10,442,904.680	
US T N/B 2.75 08/15/21	12,560,000.000	12,788,140.590	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,830,000.000	4,071,768.750	
US T N/B 2.75 08/15/47	7,440,000.000	7,942,781.210	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,296,920.310	
US T N/B 2.75 08/31/25	8,140,000.000	8,562,898.380	
US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	3,016,540.610	
US T N/B 2.75 11/15/23	13,330,000.000	13,859,034.370	



US T N/B 2.75 11/15/42	3,480,000.000	3,698,587.500	
US T N/B 2.75 11/15/47	7,520,000.000	8,026,425.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,460,671.870	
US T N/B 2.875 05/15/28	13,610,000.000	14,654,142.180	
US T N/B 2.875 05/15/43	5,430,000.000	5,892,822.620	
US T N/B 2.875 05/15/49	11,920,000.000	13,076,612.490	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,810,914.060	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,250,000.000	3,439,414.060	
US T N/B 2.875 08/15/28	13,130,000.000	14,151,678.120	
US T N/B 2.875 08/15/45	8,370,000.000	9,108,260.100	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,148,026.560	
US T N/B 2.875 10/15/21	13,100,000.000	13,392,191.300	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	9,701,517.920	
US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,636,823.410	
US T N/B 2.875 11/15/46	6,810,000.000	7,434,072.610	
US T N/B 2.875 11/30/23	9,810,000.000	10,246,085.100	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	7,191,037.500	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,270,000.000	7,011,623.430	
US T N/B 3.0 02/15/48	8,610,000.000	9,637,818.750	
US T N/B 3.0 02/15/49	11,710,000.000	13,146,304.670	
US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,557,242.180	
US T N/B 3.0 05/15/45	8,570,000.000	9,534,794.450	
US T N/B 3.0 05/15/47	10,720,000.000	11,986,300.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	10,310,000.000	11,558,476.540	
US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	7,923,398.430	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	6,999,212.460	
US T N/B 3.0 11/15/44	9,340,000.000	10,370,318.750	
US T N/B 3.0 11/15/45	8,800,000.000	9,803,750.000	
US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	3,121,603.090	
US T N/B 3.125 02/15/43	6,130,000.000	6,926,421.020	
US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	102,066.400	
US T N/B 3.125 05/15/48	11,010,000.000	12,622,792.890	
US T N/B 3.125 08/15/44	8,090,000.000	9,168,245.300	
US T N/B 3.125 11/15/28	21,320,000.000	23,445,337.480	
US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,657,703.120	
US T N/B 3.375 05/15/44	8,900,000.000	10,496,437.500	
US T N/B 3.375 11/15/48	9,650,000.000	11,594,324.160	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,574,289.060	
US T N/B 3.625 02/15/21	7,430,000.000	7,607,333.140	
US T N/B 3.625 02/15/44	8,510,000.000	10,423,420.310	
US T N/B 3.625 08/15/43	8,930,000.000	10,917,622.600	
US T N/B 3.75 08/15/41	4,490,000.000	5,558,128.870	
US T N/B 3.75 11/15/43	6,190,000.000	7,718,639.800	
US T N/B 3.875 08/15/40	5,580,000.000	7,020,773.390	
US T N/B 4.25 05/15/39	660,000.000	868,853.900	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,650,000.000	4,824,558.570	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,608,921.870	
US T N/B 4.375 05/15/40	4,250,000.000	5,701,640.620	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,150,000.000	4,238,718.750	

	US T N/B 4.375 11/15/39	2,340,000.000	3,134,137.500	
	US T N/B 4.5 02/15/36	4,950,000.000	6,572,671.850	
	US T N/B 4.5 05/15/38	2,250,000.000	3,039,082.010	
	US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,406,148.420	
	US T N/B 4.625 02/15/40	5,110,000.000	7,062,978.110	
	US T N/B 4.75 02/15/41	4,420,000.000	6,222,531.240	
	US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,262,409.370	
	US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,065,642.170	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,171,218.750	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	3,094,039.030	
	US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,200,208.580	
	US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	998,000.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,701,195.300	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,210,000.000	1,706,194.500	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,397,625.000	
	US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	653,046.870	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,360,285.130	
	アメリカ・ドル 小計	1,718,610,000.000 (187,603,467,600)	1,789,796,844.860 (195,374,223,585)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,710,000.000	5,709,657.400	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	7,430,000.000	7,493,942.580	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,990,000.000	2,007,929.900	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	6,690,000.000	6,827,211.900	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	4,480,000.000	4,694,771.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	2,240,000.000	2,380,672.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	4,620,000.000	4,830,672.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	6,410,000.000	6,925,871.650	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,420,000.000	1,565,862.400	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,460,000.000	1,716,562.880	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,520,000.000	2,790,648.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	2,820,000.000	3,265,842.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,920,000.000	6,125,187.200	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	4,350,000.000	4,737,150.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	680,000.000	739,222.560	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,820,000.000	4,071,658.540	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,940,000.000	5,727,578.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,765,112.500		

	UK TREASURY 3.25 01/22/44	4,890,000.000	6,870,450.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,640,000.000	6,831,936.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	3,150,000.000	5,791,590.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,670,000.000	6,106,513.000	
	UK TREASURY 3.75 09/07/21	6,840,000.000	7,237,404.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	3,560,000.000	6,707,396.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	2,350,000.000	2,539,175.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,590,000.000	6,739,956.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,990,000.000	2,775,055.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	3,560,000.000	5,469,940.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,290,000.000	4,233,604.900	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	2,100,000.000	3,270,540.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,750,000.000	6,275,250.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	2,310,000.000	4,005,540.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,870,000.000	7,256,637.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,920,000.000	5,785,528.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,420,000.000	5,630,346.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,700,000.000	3,827,250.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,470,000.000	5,593,640.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	4,180,000.000	5,160,001.000	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,128,179.500	
	イギリス・ポンド 小計	142,700,000.000 (19,928,055,000)	184,611,484.110 (25,780,993,756)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	670,000.000	681,723.790	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	3,020,000.000	3,090,073.660	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	5,770,000.000	6,228,138.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	3,730,000.000	3,882,441.370	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	5,650,000.000	6,312,689.620	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	6,850,000.000	7,389,007.970	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,050,000.000	1,231,102.310	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,770,000.000	2,071,098.390	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	6,130,000.000	6,837,463.300	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	5,400,000.000	6,076,745.270	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	4,710,000.000	5,351,502.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,580,000.000	3,191,131.780	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	6,540,000.000	7,311,069.910	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	5,230,000.000	6,140,924.790	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,090,000.000	2,632,179.610	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,830,000.000	2,426,411.070	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,310,000.000	6,347,117.860	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,580,000.000	4,935,722.710	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	7,300,000.000	9,158,468.270	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	6,120,000.000	7,072,835.040	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	7,000,000.000	7,900,155.180	
オーストラリア・ドル 小計		92,330,000.000 (6,908,130,600)	106,268,001.900 (7,950,971,902)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,307,466.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	6,760,000.000	6,595,056.000	
	CANADA 0.75 09/01/21	5,860,000.000	5,773,272.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	3,890,000.000	3,731,365.800	
	CANADA 1.0 09/01/22	4,670,000.000	4,596,027.200	
	CANADA 1.25 06/01/30	630,000.000	608,794.200	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,690,000.000	3,682,546.200	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,030,000.000	1,026,013.900	
	CANADA 1.5 08/01/21	2,740,000.000	2,735,396.800	
	CANADA 1.5 09/01/24	2,960,000.000	2,952,600.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,740,000.000	3,759,672.400	
	CANADA 1.75 05/01/21	3,180,000.000	3,185,469.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,970,000.000	3,069,257.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,820,000.000	2,865,232.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,840,000.000	1,964,641.600	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,190,000.000	3,282,892.800	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,110,000.000	3,224,354.700	
	CANADA 2.25 06/01/29	2,290,000.000	2,426,140.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	3,600,000.000	3,749,004.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,350,000.000	3,447,686.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	3,140,000.000	3,867,224.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	790,000.000	1,045,154.200	
	CANADA 3.25 06/01/21	2,400,000.000	2,459,760.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,770,000.000	5,148,312.000	
CANADA 4.0 06/01/41	2,720,000.000	3,814,337.600		
CANADA 5.0 06/01/37	2,190,000.000	3,271,487.700		
CANADA 5.75 06/01/29	3,000,000.000	4,093,860.000		
CANADA 5.75 06/01/33	2,430,000.000	3,632,801.400		
カナダ・ドル 小計		83,660,000.000 (6,903,623,200)	91,315,826.800 (7,535,382,028)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,700,000.000	1,711,560.000	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	260,000.000	261,638.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	580,000.000	589,294.090	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	930,000.000	955,575.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	830,000.000	864,445.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	920,000.000	954,960.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	470,000.000	499,291.620	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,020,000.000	1,089,768.000	

	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,630,000.000	1,834,467.200	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,140,000.000	1,279,650.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,610,000.000	1,677,781.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	680,171.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	900,000.000	991,350.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,970,000.000	2,094,218.350	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,330,000.000	1,388,653.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,490,000.000	1,757,730.650	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,900,000.000	2,131,800.000	
シンガポール・ドル 小計		19,300,000.000 (1,548,825,000)	20,762,352.910 (1,666,178,821)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	11,190,000.000	11,946,054.560	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	10,070,000.000	10,761,960.050	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	15,310,000.000	16,522,552.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	20,890,000.000	22,412,337.860	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	15,290,000.000	17,598,178.400	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	11,770,000.000	18,515,387.000	
スウェーデン・クローナ 小計		84,520,000.000 (950,850,000)	97,756,469.870 (1,099,760,286)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	22,850,000.000	24,498,261.900	
	DENMARK 0.5 11/15/29	6,770,000.000	7,277,343.800	
	DENMARK 1.5 11/15/23	15,980,000.000	17,360,672.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,910,000.000	14,675,407.620	
	DENMARK 4.5 11/15/39	27,740,000.000	52,860,456.320	
デンマーク・クローネ 小計		86,250,000.000 (1,387,762,500)	116,672,141.640 (1,877,254,759)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	8,270,000.000	8,299,113.700	
	NORWAY 1.75 02/17/27	11,630,000.000	11,824,721.090	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,070,000.000	10,254,784.500	
	NORWAY 1.75 09/06/29	6,280,000.000	6,373,634.800	
	NORWAY 2.0 04/26/28	7,530,000.000	7,793,550.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,085,441.580	
ノルウェー・クローネ 小計		53,210,000.000 (634,795,300)	54,631,245.670 (651,750,761)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 1.75 07/25/21	4,510,000.000	4,538,705.240	
	POLAND 2.25 04/25/22	6,730,000.000	6,850,599.570	
	POLAND 2.25 10/25/24	310,000.000	315,852.950	
	POLAND 2.5 01/25/23	7,180,000.000	7,368,775.820	
	POLAND 2.5 04/25/24	8,470,000.000	8,722,706.680	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,420,000.000	9,678,362.340	
	POLAND 2.5 07/25/27	8,370,000.000	8,604,778.500	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,700,000.000	3,867,906.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	3,250,000.000	3,415,730.150	
	POLAND 3.25 07/25/25	7,180,000.000	7,668,383.600	
	POLAND 4.0 10/25/23	10,380,000.000	11,278,077.600	

	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,383,772.400	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,570,000.000	5,100,805.500	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,913,189.300	
ポーランド・ズロチ 小計		78,560,000.000 (2,214,606,400)	82,707,645.650 (2,331,528,531)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	5,037,538.500	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,947,006.580	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,609,982.510	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,360,250.610	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,548,313.050	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,539,268.360	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,235,006.400	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,272,936.830	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	2,116,414.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,567,027.840	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	3,047,440.050	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,050,000.000	1,154,287.150	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	5,540,000.000	6,290,432.330	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	3,965,751.960	
MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,678,222.160		
マレーシア・リングgit 小計		41,940,000.000 (1,105,957,800)	44,369,878.330 (1,170,033,692)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	1,315,000.000	1,686,277.100	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	66,505,000.000	75,917,452.650	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	38,064,000.000	36,138,342.240	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	57,079,000.000	56,991,098.340	
	MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	41,968,000.000	42,522,816.960	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	72,017,000.000	74,891,918.640	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	34,054,000.000	36,192,931.740	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	44,721,000.000	47,197,648.980	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	19,500,000.000	20,736,105.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	24,740,000.000	26,028,954.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	33,666,000.000	36,547,718.690	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	49,237,000.000	51,593,975.190	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	42,703,000.000	47,579,255.570	

	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	37,143,000.000	42,097,876.200	
メキシコ・ペソ 小計		562,712,000.000 (3,213,085,520)	596,122,371.300 (3,403,858,740)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	3,060,000.000	3,214,753.380	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,418,394.800	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	2,030,000.000	2,177,498.760	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,300,000.000	3,527,601.000	
	AUSTRIA 07/15/23	2,760,000.000	2,809,542.000	
	AUSTRIA 09/20/22	3,400,000.000	3,453,954.600	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,840,000.000	3,098,457.040	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,250,000.000	1,552,422.500	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	560,000.000	716,744.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,990,000.000	2,192,396.930	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	2,760,000.000	3,005,805.600	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,120,000.000	1,842,372.000	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,400,000.000	1,836,360.400	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,760,000.000	2,862,784.320	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	20,000.000	22,407.980	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,830,000.000	5,192,733.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	170,000.000	187,595.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	900,000.000	1,920,193.200	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,810,000.000	2,986,138.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	230,000.000	305,694.770	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,737,030.400	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	2,020,000.000	2,070,298.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	1,530,000.000	1,595,278.980	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,581,070.670	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,195,734.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	3,390,000.000	3,631,368.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	2,330,000.000	2,526,577.440	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	3,770,000.000	4,075,811.090	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	3,220,000.000	3,533,306.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	700,000.000	792,834.140	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	1,000,000.000	1,162,505.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	2,230,000.000	2,699,508.660	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	1,180,000.000	1,452,780.600	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,519,629.560	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	1,130,000.000	1,559,287.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	2,950,000.000	3,246,804.500	
	BELGIUM 2.25 06/22/57	1,610,000.000	2,259,683.300	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	2,630,000.000	2,997,116.440	
	BELGIUM 3.0 06/22/34	1,410,000.000	1,956,507.540	
	BELGIUM 3.75 06/22/45	1,530,000.000	2,629,167.300	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,279,278.690		
BELGIUM 4.25 03/28/41	4,350,000.000	7,522,720.350		
BELGIUM 4.25 09/28/21	7,470,000.000	8,156,179.260		
BELGIUM 4.25 09/28/22	4,100,000.000	4,672,138.600		
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,220,000.000	2,896,749.240		

BELGIUM 5.0 03/28/35	4,250,000.000	7,205,951.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,460,000.000	2,149,756.560	
BUNDESOBL 04/05/24	5,990,000.000	6,138,779.620	
BUNDESOBL 04/08/22	2,500,000.000	2,538,075.000	
BUNDESOBL 04/09/21	2,870,000.000	2,895,629.100	
BUNDESOBL 04/14/23	2,960,000.000	3,023,768.760	
BUNDESOBL 10/07/22	3,000,000.000	3,055,815.000	
BUNDESOBL 10/08/21	3,400,000.000	3,440,902.000	
BUNDESOBL 10/13/23	4,800,000.000	4,913,760.000	
BUNDESSCHAT 03/12/21	1,640,000.000	1,653,739.920	
BUNDESSCHAT 06/11/21	1,040,000.000	1,050,368.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,580,000.000	7,961,274.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	4,420,000.000	4,649,017.880	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,890,000.000	4,091,424.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,628,271.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,250,000.000	6,639,312.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	6,940,000.000	7,446,967.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,812,597.520	
DEUTSCHLAND 08/15/26	4,380,000.000	4,518,775.920	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,331,929.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	7,080,000.000	7,702,402.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	4,460,000.000	5,720,891.060	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,317,437.100	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,300,480.250	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	7,210,000.000	7,890,047.200	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,501,293.400	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	4,200,000.000	4,621,134.000	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	9,530,000.000	10,139,624.570	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	8,030,000.000	8,493,009.800	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,187,604.600	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,842,101.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	6,300,000.000	9,844,443.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	4,340,000.000	6,937,368.480	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,990,000.000	3,182,197.200	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,950,000.000	3,319,641.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,000,000.000	6,777,768.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,740,000.000	6,825,013.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,604,330.000	



DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	4,120,000.000	7,082,898.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,980,000.000	5,854,061.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,740,000.000	9,471,459.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,440,000.000	5,149,920.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,517,940.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,343,516.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,563,550.200	
FINLAND 0.5 04/15/26	910,000.000	955,535.490	
FINLAND 0.5 09/15/27	1,160,000.000	1,221,011.360	
FINLAND 0.5 09/15/28	830,000.000	874,516.370	
FINLAND 0.5 09/15/29	880,000.000	925,774.960	
FINLAND 0.75 04/15/31	990,000.000	1,066,984.380	
FINLAND 0.875 09/15/25	780,000.000	834,746.640	
FINLAND 09/15/23	2,090,000.000	2,129,091.360	
FINLAND 1.125 04/15/34	750,000.000	847,713.000	
FINLAND 1.375 04/15/47	470,000.000	580,071.650	
FINLAND 1.5 04/15/23	10,000.000	10,700.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	3,580,000.000	3,804,491.060	
FINLAND 2.0 04/15/24	1,770,000.000	1,963,468.080	
FINLAND 2.625 07/04/42	870,000.000	1,299,267.570	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,180,000.000	1,474,439.500	
FINLAND 3.5 04/15/21	2,470,000.000	2,615,522.520	
FINLAND 4.0 07/04/25	320,000.000	400,122.560	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,948,051.480	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	6,490,000.000	6,708,596.180	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	7,840,000.000	8,218,672.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	10,560,000.000	11,093,734.080	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	6,690,000.000	7,019,950.800	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	5,470,000.000	5,873,324.980	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	6,690,000.000	7,181,273.460	
FRANCE OAT 02/25/22	2,810,000.000	2,846,938.290	
FRANCE OAT 03/25/23	5,720,000.000	5,827,701.880	
FRANCE OAT 03/25/24	2,480,000.000	2,530,229.920	
FRANCE OAT 03/25/25	6,250,000.000	6,367,600.000	
FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,196,982.400	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,583,669.850	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,010,000.000	5,461,310.820	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	8,080,000.000	8,724,153.760	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,080,000.000	4,641,669.120	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	5,580,000.000	6,339,996.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	6,870,000.000	7,966,706.190	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,780,000.000	4,482,747.360	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	7,450,000.000	8,060,169.900	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,710,000.000	3,498,815.960	

FRANCE OAT 1.75 06/25/39	4,200,000.000	5,183,892.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	9,220,000.000	10,228,437.500	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	5,910,000.000	7,798,339.560	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	8,220,000.000	9,238,170.300	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	13,640,000.000	14,790,945.920	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	8,110,000.000	10,208,048.890	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	10,570,000.000	13,053,886.580	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	13,130,000.000	14,297,834.720	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,110,000.000	9,795,380.920	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,090,000.000	7,626,486.120	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,840,000.000	9,780,400.000	
FRANCE OAT 3.75 04/25/21	5,550,000.000	5,902,297.350	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,480,000.000	6,794,700.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,910,000.000	3,906,538.280	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,100,000.000	6,757,697.900	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	10,990,000.000	13,085,793.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	8,070,000.000	14,576,841.000	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,370,000.000	12,329,494.100	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	4,730,000.000	7,223,135.700	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,540,000.000	14,681,173.780	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,062,647.840	
IRISH 0.9 05/15/28	1,970,000.000	2,114,184.300	
IRISH 1.0 05/15/26	3,730,000.000	3,991,174.600	
IRISH 1.1 05/15/29	1,740,000.000	1,901,120.520	
IRISH 1.3 05/15/33	810,000.000	904,457.340	
IRISH 1.35 03/18/31	400,000.000	448,366.400	
IRISH 1.5 05/15/50	640,000.000	728,458.240	
IRISH 1.7 05/15/37	1,140,000.000	1,343,649.600	
IRISH 10/18/22	3,340,000.000	3,382,129.090	
IRISH 2.0 02/18/45	1,890,000.000	2,401,401.870	
IRISH 2.4 05/15/30	2,250,000.000	2,767,151.250	
IRISH 3.4 03/18/24	990,000.000	1,151,072.010	
IRISH 5.4 03/13/25	1,700,000.000	2,208,779.400	
ITALY BTPS 0.05 04/15/21	950,000.000	952,405.400	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	10,200,000.000	10,272,205.800	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,781,237.500	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,896,211.790	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	3,064,500.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	2,000,000.000	2,046,358.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,763,450.000	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	6,800,000.000	6,964,029.600	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,773,440.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,597,331.500	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,092,697.600	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	5,980,000.000	6,233,492.200	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,295,978.640	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,925,568.800	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	7,430,000.000	7,764,483.740	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,472,920.000	

ITALY BTPS 1.65 03/01/32	4,320,000.000	4,435,058.880	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,140,000.000	4,375,152.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,973,880.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	7,300,000.000	7,884,372.300	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	3,119,411.100	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,700,000.000	6,161,426.400	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	20,000.000	21,631.640	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,010,000.000	2,100,450.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,729,750.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,570,160.000	
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	3,300,000.000	3,446,490.300	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,650,000.000	2,936,019.800	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	3,030,000.000	3,274,633.110	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,430,000.000	3,782,932.930	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,290,000.000	5,798,898.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,650,000.000	2,963,760.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,100,000.000	1,197,900.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,190,000.000	3,659,867.860	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,130,000.000	2,451,204.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	3,850,000.000	4,493,070.120	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,130,000.000	2,510,966.260	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,900,000.000	3,545,595.100	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,370,000.000	4,100,392.220	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	3,090,000.000	3,908,299.980	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,100,000.000	6,196,915.630	
ITALY BTPS 3.75 03/01/21	2,950,000.000	3,100,739.100	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,170,580.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	6,930,000.000	7,379,895.600	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	6,380,000.000	7,346,113.190	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	3,970,000.000	5,331,466.240	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	4,670,000.000	6,133,578.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	4,104,922.500	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	2,600,000.000	2,978,523.860	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,666,437.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,810,000.000	4,138,422.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	8,450,000.000	11,076,716.300	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,670,000.000	6,982,176.770	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,500,000.000	2,786,250.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	9,640,000.000	11,842,175.090	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	5,450,000.000	7,799,495.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	5,680,000.000	8,477,968.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,630,000.000	6,923,239.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,380,000.000	8,791,002.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,406,951.410	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,704,426.550	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,870,000.000	5,807,322.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,415,170.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,830,720.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	3,078,155.000	

ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,279,870.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,630,000.000	2,729,650.700	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,260,000.000	2,344,847.180	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,370,000.000	1,443,660.790	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,140,000.000	3,317,567.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,670,000.000	3,956,551.390	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	2,340,000.000	2,536,337.700	
NETHERLANDS 01/15/22	5,180,000.000	5,248,189.520	
NETHERLANDS 01/15/24	3,980,000.000	4,064,793.900	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	5,200,000.000	5,648,786.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,600,000.000	4,022,359.200	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,400,000.000	4,518,035.600	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,830,000.000	3,021,276.930	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,240,000.000	5,582,313.480	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,907,140.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,760,000.000	6,664,622.560	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,080,000.000	5,107,256.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	3,020,000.000	4,442,420.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	743,223.000	
SPAIN 0.05 10/31/21	6,080,000.000	6,132,510.520	
SPAIN 0.35 07/30/23	3,270,000.000	3,337,437.210	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,362,139.000	
SPAIN 0.6 10/31/29	6,020,000.000	6,146,510.300	
SPAIN 0.75 07/30/21	10,940,000.000	11,160,484.760	
SPAIN 1.3 10/31/26	4,350,000.000	4,707,135.000	
SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	4,121,204.400	
SPAIN 1.4 07/30/28	4,280,000.000	4,683,176.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	5,320,000.000	5,861,458.960	
SPAIN 1.45 10/31/27	3,470,000.000	3,810,382.710	
SPAIN 1.5 04/30/27	2,700,000.000	2,964,600.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	3,110,000.000	3,389,511.250	
SPAIN 1.85 07/30/35	2,770,000.000	3,205,413.530	
SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,363,549.000	
SPAIN 1.95 07/30/30	4,840,000.000	5,602,861.440	
SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	5,240,683.920	
SPAIN 2.35 07/30/33	3,400,000.000	4,150,380.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	2,560,000.000	3,452,111.360	
SPAIN 2.75 10/31/24	6,960,000.000	7,949,899.920	
SPAIN 2.9 10/31/46	3,720,000.000	5,160,108.720	
SPAIN 3.45 07/30/66	2,350,000.000	3,781,725.750	

	SPAIN 3.8 04/30/24	5,600,000.000	6,584,648.000	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,190,000.000	8,023,188.810	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,080,000.000	4,823,709.740	
	SPAIN 4.65 07/30/25	4,820,000.000	6,100,312.500	
	SPAIN 4.7 07/30/41	2,060,000.000	3,532,708.420	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,629,055.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,360,000.000	7,551,956.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	6,277,194.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	3,000,000.000	5,623,965.000	
	SPAIN 5.4 01/31/23	6,210,000.000	7,348,516.560	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,710,000.000	4,033,912.680	
	SPAIN 5.75 07/30/32	4,390,000.000	7,212,629.520	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,739,304.960	
	SPAIN 5.9 07/30/26	4,440,000.000	6,163,363.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,308,852.500	
	ユーロ 小計	1,049,620,000.000 (126,216,805,000)	1,260,571,795.290 (151,583,758,384)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	54,860,000.000	60,744,826.700	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,595,690.020	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	21,670,000.000	14,990,463.020	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	17,190,000.000	14,381,154.000	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	32,290,000.000	29,961,835.760	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	28,830,000.000	26,373,098.750	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	36,310,000.000	32,205,672.250	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	33,480,000.000	29,451,640.860	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	58,790,000.000	51,408,886.100	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	13,250,000.000	12,347,529.250	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	19,430,000.000	17,654,851.870	
	南アフリカ・ランド 小計	333,730,000.000 (2,449,578,200)	302,115,648.580 (2,217,528,861)	
	国債証券 合計	361,065,542,120 (361,065,542,120)	402,643,224,106 (402,643,224,106)	
	合計		402,643,224,106 (402,643,224,106)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 205銘柄	47.03	48.52
イギリス・ポンド	国債証券 39銘柄	6.21	6.40
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	1.91	1.97
カナダ・ドル	国債証券 28銘柄	1.81	1.87
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.40	0.41
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.26	0.27
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.45	0.47
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.16	0.16
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.56	0.58
マレーシア・リングgit	国債証券 15銘柄	0.28	0.29
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.82	0.85
ユーロ	国債証券 280銘柄	36.49	37.65
南アフリカ・ランド	国債証券 11銘柄	0.53	0.55

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,032,545,897
コール・ローン	149,900,497
株式	330,117,434,633
投資信託受益証券	740,756,041
投資証券	8,228,968,081
派生商品評価勘定	174,344,017
未収入金	32,416,560
未収配当金	379,705,196
差入委託証拠金	2,025,319,866
流動資産合計	347,881,390,788
資産合計	347,881,390,788
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	901,908
未払解約金	563,418,100
流動負債合計	564,320,008
負債合計	564,320,008
純資産の部	
元本等	
元本	90,492,519,767
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	256,824,551,013
元本等合計	347,317,070,780
純資産合計	347,317,070,780
負債純資産合計	347,881,390,788

## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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 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 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 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 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11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	94,537,119,407円
同期中追加設定元本額	32,005,804,469円
同期中一部解約元本額	36,050,404,109円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,133,435,182円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,840,533円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	7,968,977円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	11,947,117円



グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,584,057円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	25,877,612円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	15,589,217円
たわらノーロード 先進国株式	11,032,049,108円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	146,315,396円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,481,274,899円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	176,407,677円
たわらノーロード バランス(堅実型)	15,299,784円
たわらノーロード バランス(標準型)	134,325,617円
たわらノーロード バランス(積極型)	168,501,451円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	457,369円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	52,244,691円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	128,005,778円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	95,484,726円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	184,610,861円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	55,875円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	692,537円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,547,607円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	972,861円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,771,584円
たわらノーロード 全世界株式	32,643,942円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	41,788,511,716円
One DC 先進国株式インデックスファンド	136,754,877円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	182,117,600円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	895,666,856円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,108,003,315円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	125,776,632円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	354,914,715円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	313,526,730円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,630,766円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	794,746,502円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	195,250,872円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	217,784,100円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	158,910,873円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	275,096,111円
投資のソムリエ	1,424,463,470円
クルーズコントロール	473,136,036円
投資のソムリエ<DC年金>	147,418,549円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	179,846,067円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	100,025,555円
クルーズコントロール<DC年金>	480,395円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,164,753円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,309,362円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	73,222,236円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	829,857,009円
ワールドアセットバランス(基本コース)	491,833,708円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,941,628,723円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	1,330,710円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	970,885円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	574,253円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	1,360,519円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	9,332,537円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	413,955,985円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	134,253,938円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	216,398円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	182,785円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	185,412円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	41,400円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	86,235,351円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,196,582,747円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,254,823,803円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	206,012,410円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	18,813,518円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	66,859,444円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	147,172,768円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	9,147,911円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,668,908円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,429,738円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,163,835円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,244,059円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,792,144円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	412,516,778円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	535,258,378円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,731,706,558円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	618,607,727円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	102,257,224円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	668,467,752円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	34,144,634円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,135,693円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	10,613,057円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	235,982,145円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	30,690,286円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	97,339,769円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	164,518,552円
DIAMバランス30VA(適格機関投資家限定)	1,618,835円
DIAMバランス50VA(適格機関投資家限定)	327,209円
DIAMバランス70VA(適格機関投資家限定)	488,306円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	3,960,265,598円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	51,776,197円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	220,688円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	250,937円
計	90,492,519,767円
2. 受益権の総数	90,492,519,767口

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
----	-------------------------------

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	33,449,248,327
投資信託受益証券	47,377,832
投資証券	597,681,002
合計	34,094,307,161

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年2月16日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	447,479,026	-	446,247,640	1,231,386
アメリカ・ドル	299,427,680	-	298,852,700	574,980
イギリス・ポンド	56,036,000	-	55,856,000	180,000
オーストラリア・ドル	10,169,145	-	10,099,350	69,795
カナダ・ドル	15,268,320	-	15,181,840	86,480
ユーロ	66,577,881	-	66,257,750	320,131
買建	638,188,139	-	638,207,990	19,851
アメリカ・ドル	442,671,840	-	442,671,840	-
イギリス・ポンド	26,109,314	-	26,112,680	3,366
オーストラリア・ドル	17,504,136	-	17,505,540	1,404
カナダ・ドル	28,297,157	-	28,300,930	3,773
ユーロ	123,605,692	-	123,617,000	11,308
合計	1,085,667,165	-	1,084,455,630	1,251,237

(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ではありません。

## 株式関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	8,569,730,034	-	8,741,920,906	172,190,872
合計	8,569,730,034	-	8,741,920,906	172,190,872

## (注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.8381円 (38,381円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

令和1年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	33,054	1,785.880	59,030,477.520	
	ABBOTT LABORATORIES	139,517	83.740	11,683,153.580	
	AES CORP	55,631	17.640	981,330.840	
	ABIOMED INC	3,574	219.620	784,921.880	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	70,063	137.610	9,641,369.430	
	ADVANCED MICRO DEVICES	83,797	36.290	3,040,993.130	
	ADOBE INC	38,479	292.460	11,253,568.340	
	CHUBB LTD	36,631	151.510	5,549,962.810	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,359	233.870	4,059,749.330	
	ALLEGHANY CORP	1,094	775.300	848,178.200	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	96.280	582,686.560	
	RALPH LAUREN CORP	3,283	113.770	373,506.910	
	ALLSTATE CORP	25,832	108.190	2,794,764.080	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	57,633	181.210	10,443,675.930	
	AMGEN INC	48,063	221.110	10,627,209.930	
	HESS CORP	21,367	71.850	1,535,218.950	
	AMERICAN EXPRESS CO	55,876	121.470	6,787,257.720	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,277	89.070	3,498,402.390	
	AFLAC INC	60,093	54.140	3,253,435.020	
	AMERICAN INTL GROUP	68,037	55.910	3,803,948.670	
AMERCO	585	387.070	226,435.950		
ANALOG DEVICES	29,105	113.020	3,289,447.100		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	110.790	2,015,491.680		

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	61,876	42.520	2,630,967.520	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	161.640	660,622.680	
VALERO ENERGY CORP	33,171	100.860	3,345,627.060	
APACHE CORP	31,470	24.430	768,812.100	
ANSYS INC	6,770	224.310	1,518,578.700	
APPLE INC	363,209	260.140	94,485,189.260	
APPLIED MATERIALS INC	74,621	56.030	4,181,014.630	
ALBEMARLE CORP	7,634	67.980	518,959.320	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,602	43.310	1,975,022.620	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,600	86.390	829,344.000	
AMEREN CORP	19,487	73.810	1,438,335.470	
ARROW ELECTRONICS INC	7,754	81.730	633,734.420	
AUTOLIV INC	5,913	86.310	510,351.030	
AUTODESK INC	17,235	152.960	2,636,265.600	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	34,670	162.730	5,641,849.100	
AUTOZONE INC	1,917	1,165.860	2,234,953.620	
AVERY DENNISON CORP	6,549	133.830	876,452.670	
BALL CORP	25,262	64.650	1,633,188.300	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	102,604	221.310	22,707,291.240	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,637	49.200	3,278,540.400	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,658	78.510	2,956,529.580	
BECTON DICKINSON & CO	21,455	244.790	5,251,969.450	
AMETEK INC	17,821	96.540	1,720,439.340	
VERIZON COMM INC	326,283	59.350	19,364,896.050	
WR BERKLEY CORP	12,201	67.890	828,325.890	
BEST BUY CO INC	18,720	76.850	1,438,632.000	
YUM! BRANDS INC	24,852	98.900	2,457,862.800	
FIRSTENERGY CORP	43,584	46.590	2,030,578.560	
H&R BLOCK INC	16,114	24.420	393,503.880	
BOEING CO	42,262	351.000	14,833,962.000	
ROBERT HALF INTL INC	8,097	57.940	469,140.180	
BORGWARNER INC	17,210	46.310	796,995.100	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	110,194	40.510	4,463,958.940	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,988	78.060	779,663.280	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,766	116.960	1,025,271.360	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	708.860	1,367,390.940	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	127,741	58.020	7,411,532.820	
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3,426	86.860	297,582.360	
INGREDION INC	5,305	84.620	448,909.100	

ONEOK INC	32,427	70.480	2,285,454.960	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	110.520	652,068.000	
UNITED RENTALS INC	6,505	155.320	1,010,356.600	
SEMPRA ENERGY	21,599	142.120	3,069,649.880	
FEDEX CORP	19,368	163.220	3,161,244.960	
VERISIGN INC	8,048	183.790	1,479,141.920	
AMPHENOL CORP	23,150	102.700	2,377,505.000	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	64.500	1,572,574.500	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	6.850	857,989.900	
CSX CORP	59,540	74.030	4,407,746.200	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	18.370	577,111.920	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	46.250	649,812.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,798	58.790	1,222,714.420	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,871	187.560	2,414,084.760	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	53.750	1,233,562.500	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	45.050	1,439,888.100	
CATERPILLAR INC	44,868	148.160	6,647,642.880	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	115.420	1,138,618.300	
CELGENE CORP	56,106	109.540	6,145,851.240	
CITRIX SYSTEMS INC	10,886	110.730	1,205,406.780	
CENTURYLINK INC	80,424	14.790	1,189,470.960	
CERNER CORP	25,143	67.310	1,692,375.330	
JPMORGAN CHASE & CO	256,348	130.380	33,422,652.240	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	67.580	1,344,571.680	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,715	108.700	1,382,120.500	
CINTAS CORP	7,247	260.880	1,890,597.360	
CISCO SYSTEMS INC	338,608	48.830	16,534,228.640	
CLOROX COMPANY	9,876	148.000	1,461,648.000	
COCA-COLA CO/THE	320,243	52.210	16,719,887.030	
COPART INC	16,749	81.460	1,364,373.540	
COGNEX CORP	12,284	53.340	655,228.560	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,469	66.630	4,228,939.470	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,145	133.200	2,949,714.000	
COMERICA INC	12,770	71.830	917,269.100	
NRG ENERGY, INC.	21,039	38.440	808,739.160	
COMCAST CORP-CL A	358,051	45.190	16,180,324.690	
CONAGRA BRANDS INC	40,573	27.440	1,113,323.120	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,181	87.920	2,213,913.520	
CMS ENERGY CORP	22,937	59.610	1,367,274.570	
COOPER COS INC	3,936	291.400	1,146,950.400	
MOLSON COORS BREWING CO	16,200	53.790	871,398.000	
CORNING INC	63,750	30.370	1,936,087.500	
SEALED AIR CORP	13,870	40.020	555,077.400	
HEICO CORP-CL A	5,292	93.680	495,754.560	



CUMMINS INC	12,238	186.270	2,279,572.260	
DR HORTON INC	28,355	51.150	1,450,358.250	
DANAHER CORP	50,997	135.230	6,896,324.310	
MOODY'S CORP	13,582	218.130	2,962,641.660	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	44,962	62.860	2,826,311.320	
TARGET CORP	41,066	110.150	4,523,419.900	
DEERE & CO	24,182	178.360	4,313,101.520	
MORGAN STANLEY	100,406	49.150	4,934,954.900	
REPUBLIC SERVICES INC	18,081	86.180	1,558,220.580	
COSTAR GROUP INC	2,795	549.310	1,535,321.450	
THE WALT DISNEY CO	142,222	137.960	19,620,947.120	
DOLLAR TREE INC	18,697	110.350	2,063,213.950	
DOVER CORP	11,113	109.350	1,215,206.550	
OMNICOM GROUP	17,365	80.770	1,402,571.050	
DTE ENERGY CO	14,817	120.490	1,785,300.330	
DUKE ENERGY CORP	56,837	89.950	5,112,488.150	
FLOWERVE CORP	9,882	49.130	485,502.660	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	114.910	1,114,627.000	
EBAY INC	66,614	35.140	2,340,815.960	
BANK OF AMERICA CORP	713,639	33.260	23,735,633.140	
CITIGROUP INC	182,613	76.120	13,900,501.560	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,935	83.900	1,001,346.500	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,663	43.480	767,987.240	
EATON CORP PLC	32,606	92.220	3,006,925.320	
EATON VANCE CORP	9,184	47.960	440,464.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	67.100	1,518,338.800	
DISH NETWORK CORP	17,517	35.320	618,700.440	
ECOLAB INC	20,479	190.390	3,898,996.810	
PERKINELMER INC	8,338	87.300	727,907.400	
ELECTRONIC ARTS INC	23,975	98.270	2,356,023.250	
SALESFORCE.COM INC	65,596	161.110	10,568,171.560	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	180.100	403,964.300	
EMERSON ELECTRIC CO	48,177	73.880	3,559,316.760	
ATMOS ENERGY CORP	8,650	107.320	928,318.000	
ENTERGY CORP	14,365	114.900	1,650,538.500	
EOG RESOURCES INC	45,209	74.700	3,377,112.300	
EQUIFAX INC	9,161	133.960	1,227,207.560	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,346	187.270	3,248,385.420	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,711	77.270	982,178.970	
EXXON MOBIL CORP	334,134	70.770	23,646,663.180	
FMC CORP	10,209	97.700	997,419.300	
NEXTERA ENERGY INC	37,460	222.080	8,319,116.800	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,875	246.720	709,320.000	
ASSURANT INC	4,594	130.070	597,541.580	
FASTENAL CO	45,891	37.070	1,701,179.370	
FIFTH THIRD BANCORP	58,144	30.560	1,776,880.640	
M&T BANK CORP	10,640	167.590	1,783,157.600	

FISERV INC	45,716	110.610	5,056,646.760	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	53.240	618,808.520	
MACY'S INC	24,741	15.880	392,887.080	
FORD MOTOR CO	310,836	9.040	2,809,957.440	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	28.280	670,603.640	
FREEMPORT-MCMORAN INC	120,727	11.520	1,390,775.040	
FLEX LTD	34,372	11.840	406,964.480	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	91.150	1,300,710.500	
GAP INC/THE	18,295	16.680	305,160.600	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	57.420	1,055,724.120	
GENERAL DYNAMICS CORP	19,290	185.080	3,570,193.200	
GENERAL MILLS INC	46,468	52.500	2,439,570.000	
GENUINE PARTS CO	11,605	106.150	1,231,870.750	
GILEAD SCIENCES INC	101,430	65.380	6,631,493.400	
GARTNER INC	7,384	160.360	1,184,098.240	
MCKESSON CORP	14,558	140.200	2,041,031.600	
NVIDIA CORP	45,479	207.780	9,449,626.620	
GENERAL ELECTRIC CO	682,967	11.520	7,867,779.840	
WW GRAINGER INC	3,762	324.920	1,222,349.040	
HALLIBURTON CO	66,843	21.280	1,422,419.040	
MONSTER BEVERAGE CORP	33,500	58.160	1,948,360.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25,659	222.910	5,719,647.690	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	39.390	508,170.390	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,586	196.020	3,447,207.720	
HASBRO INC	9,473	95.530	904,955.690	
HENRY SCHEIN INC	11,516	68.910	793,567.560	
HEICO CORP	4,236	121.690	515,478.840	
HELMERICH & PAYNE INC	10,055	40.750	409,741.250	
HERSHEY FOODS CORP	11,330	140.970	1,597,190.100	
HP INC	121,318	19.520	2,368,127.360	
F5 NETWORKS INC	4,874	148.410	723,350.340	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	75.000	785,400.000	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	26.170	731,163.630	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	54.140	641,829.700	
HOLOGIC INC	20,210	46.560	940,977.600	
UNUM GROUP	15,185	30.000	455,550.000	
HOME DEPOT INC	86,872	232.840	20,227,276.480	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	15,079	75.900	1,144,496.100	
HORMEL FOODS CORP	24,161	41.970	1,014,037.170	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	28.780	1,084,372.840	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	245.010	713,714.130	
HUMANA INC	10,620	317.580	3,372,699.600	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,359	119.980	882,932.820	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	14.980	1,191,164.660	
NEKTAR THERAPEUTICS	15,689	20.040	314,407.560	

BIOGEN INC	15,267	293.250	4,477,047.750	
IDEX CORP	6,154	159.620	982,301.480	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,049	176.410	4,595,304.090	
INTUIT INC	20,659	256.850	5,306,264.150	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	254.740	1,729,939.340	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	11,699	57.060	667,544.940	
INGERSOLL-RAND PLC	19,439	130.440	2,535,623.160	
INTEL CORP	353,705	58.270	20,610,390.350	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	132.810	1,057,831.650	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	46.210	1,359,082.310	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	22.970	662,960.140	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,108	94.600	956,216.800	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	149.510	899,900.690	
INCYTE CORP	13,798	85.100	1,174,209.800	
JOHNSON & JOHNSON	209,690	133.000	27,888,770.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,441	61.090	1,798,550.690	
KLA CORPORATION	12,724	174.210	2,216,648.040	
DEVON ENERGY CORP	33,312	22.910	763,177.920	
KELLOGG CO	19,160	63.990	1,226,048.400	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	45.890	530,488.400	
KEYCORP	79,497	19.360	1,539,061.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	27,296	131.460	3,588,332.160	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,066	490.210	4,444,243.860	
KOHL'S CORP	11,910	57.040	679,346.400	
KROGER CO	66,610	27.020	1,799,802.200	
LAM RESEARCH CORP	11,854	272.680	3,232,348.720	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	113.900	813,587.700	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	84.530	1,120,360.620	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	55.180	603,007.040	
LENNAR CORP	22,753	57.800	1,315,123.400	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	19.490	405,294.550	
ELI LILLY & CO	68,853	113.530	7,816,881.090	
L BRANDS INC	21,698	17.750	385,139.500	
LINCOLN NATIONAL CORP	16,387	60.380	989,447.060	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	54,529	124.300	6,777,954.700	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,544	76.640	1,957,692.160	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,343	381.860	7,768,177.980	
LOEWS CORP	21,759	51.000	1,109,709.000	
LOWE'S COS INC	62,772	114.000	7,156,008.000	
DOMINION ENERGY INC	63,870	80.280	5,127,483.600	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	31.410	1,211,577.930	
MCCORMICK & CO INC	9,935	159.690	1,586,520.150	
MCDONALD'S CORPORATION	60,345	193.610	11,683,395.450	
S&P GLOBAL INC	19,821	255.300	5,060,301.300	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	265.350	826,299.900	
MANPOWERGROUP INC	4,555	94.290	429,490.950	
MARKEL CORPORATION	1,065	1,165.420	1,241,172.300	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,561	234.160	3,877,923.760	
MARSH & MCLENNAN COS	40,294	103.310	4,162,773.140	
MASCO CORP	24,537	46.300	1,136,063.100	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	256.900	1,229,523.400	
METLIFE INC	61,857	49.320	3,050,787.240	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	59.550	1,273,536.300	
MEDTRONIC PLC	106,145	107.030	11,360,699.350	
ACTIVISION BLIZZARD INC	60,243	54.300	3,271,194.900	
CVS HEALTH CORP	101,372	72.470	7,346,428.840	
MERCK & CO. INC.	203,186	83.590	16,984,317.740	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	21.630	706,998.180	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	168.410	1,355,532.090	
MICROSOFT CORP	575,002	145.960	83,927,291.920	
MICRON TECH INC	88,668	47.190	4,184,242.920	
MIDDLEBY CORP	4,188	120.050	502,769.400	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,473	96.210	1,777,287.330	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	27.070	1,318,715.050	
3M CO	45,183	173.150	7,823,436.450	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	152.030	756,501.280	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,680	164.960	2,091,692.800	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	153.310	1,167,302.340	
MYLAN NV	43,574	17.610	767,338.140	
ILLUMINA INC	11,619	293.390	3,408,898.410	
XCEL ENERGY INC	41,501	60.080	2,493,380.080	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33,468	23.380	782,481.840	
NETAPP INC	17,963	59.410	1,067,181.830	
NEWELL BRANDS INC	33,317	20.370	678,667.290	
NEWMONT GOLDCORP CORP	63,869	36.610	2,338,244.090	
NVR INC	263	3,423.250	900,314.750	
NIKE INC-CL B	99,219	89.810	8,910,858.390	
NOBLE ENERGY INC	39,436	21.430	845,113.480	
NORDSTROM INC	9,487	36.650	347,698.550	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,266	195.440	4,156,227.040	
EVERSOURCE ENERGY	24,768	79.410	1,966,826.880	

NISOURCE INC	31,548	26.410	833,182.680	
TAPESTRY INC	21,790	27.230	593,341.700	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	107.650	1,717,986.350	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,618	350.110	4,417,687.980	
WELLS FARGO & CO	337,198	54.100	18,242,411.800	
NUCOR CORP	25,192	55.560	1,399,667.520	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	61.740	1,183,864.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	36,209	97.260	3,521,687.340	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,550	40.100	2,788,955.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	194.180	1,011,483.620	
OGE ENERGY CORP	16,028	42.830	686,479.240	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,185	439.230	2,716,637.550	
ORACLE CORP	188,971	56.490	10,674,971.790	
PACCAR INC	27,394	80.070	2,193,437.580	
PTC INC	7,766	73.230	568,704.180	
EXELON CORP	77,211	44.710	3,452,103.810	
PARKER HANNIFIN CORP	10,092	199.540	2,013,757.680	
PAYCHEX INC	25,329	83.250	2,108,639.250	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,375	259.920	1,656,990.000	
PPL CORPORATION	58,220	33.720	1,963,178.400	
PEPSICO INC	110,679	133.130	14,734,695.270	
PENTAIR PLC	12,511	43.370	542,602.070	
PFIZER INC	438,192	37.050	16,235,013.600	
CONOCOPHILLIPS	90,316	59.160	5,343,094.560	
PVH CORP	5,101	97.960	499,693.960	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,908	134.990	1,742,450.920	
ALTRIA GROUP INC	146,052	46.410	6,778,273.320	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,495	152.200	5,402,339.000	
POLARIS INC	4,095	103.440	423,586.800	
GARMIN LTD	10,774	95.890	1,033,118.860	
FLUOR CORP (NEW)	9,821	18.800	184,634.800	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	128.920	2,453,476.520	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	147.250	384,028.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,711	302.620	10,504,242.820	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,483	119.580	2,210,197.140	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	101.570	1,105,386.310	
PROCTER & GAMBLE CO	198,040	119.700	23,705,388.000	
PROGRESSIVE CORP	46,127	73.670	3,398,176.090	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,039	61.430	2,398,165.770	
PULTE GROUP INC	21,209	38.180	809,759.620	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,692	170.260	4,033,799.920	
QUALCOMM INC	95,114	94.030	8,943,569.420	

RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	89.290	927,544.520	
EXACT SCIENCES CORP	9,418	83.660	787,909.880	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,161	184.590	583,488.990	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,547	341.790	2,237,699.130	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	167.950	846,803.900	
RESMED INC	11,116	143.850	1,599,036.600	
US BANCORP	118,332	58.900	6,969,754.800	
SEATTLE GENETICS INC /WA	8,265	108.340	895,430.100	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	40.580	1,278,270.000	
ROSS STORES INC	28,814	111.820	3,221,981.480	
ROLLINS INC	12,378	38.680	478,781.040	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,404	337.500	2,836,350.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,251	177.820	1,645,012.820	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	114.530	1,612,009.750	
RAYTHEON COMPANY	21,972	215.840	4,742,436.480	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	107.900	415,199.200	
ACCENTURE PLC-CL A	50,417	189.700	9,564,104.900	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	114,749	51.730	5,935,965.770	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,190	185.100	1,886,169.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	20,724	133.290	2,762,301.960	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	48,861	130.690	6,385,644.090	
BOOKING HOLDINGS INC	3,445	1,879.190	6,473,809.550	
SCHLUMBERGER LTD	108,486	36.340	3,942,381.240	
SCHWAB (CHARLES) CORP	97,212	43.540	4,232,610.480	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,659	144.000	2,398,896.000	
BUNGE LTD	10,622	55.890	593,663.580	
SEI INVESTMENTS CO	11,883	62.440	741,974.520	
ANTHEM INC	20,569	282.090	5,802,309.210	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	86.070	1,097,306.430	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,125	55.300	1,278,812.500	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,454	581.350	3,752,032.900	
CENTENE CORP	33,216	55.060	1,828,872.960	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	238.600	964,898.400	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	219.950	1,375,127.400	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	52.080	591,160.080	
ACUITY BRANDS INC	3,087	128.080	395,382.960	
SNAP-ON INC	3,981	166.940	664,588.140	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,388	92.890	2,915,631.320	

ADVANCE AUTO PARTS	5,297	167.400	886,717.800	
EDISON INTERNATIONAL	28,779	66.300	1,908,047.700	
SOUTHERN CO	82,609	61.260	5,060,627.340	
BB&T CORP	61,315	54.940	3,368,646.100	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	58.180	660,459.360	
AT&T INC	575,875	39.380	22,677,957.500	
CHEVRON CORP	150,662	120.930	18,219,555.660	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,776	157.840	1,858,723.840	
STATE STREET CORP	30,100	73.100	2,200,310.000	
STARBUCKS CORP	95,691	81.770	7,824,653.070	
STEEL DYNAMICS INC	19,030	31.620	601,728.600	
STRYKER CORP	26,746	199.780	5,343,315.880	
NETFLIX INC	34,491	291.570	10,056,540.870	
SUNTRUST BANKS INC	35,828	71.040	2,545,221.120	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	24.830	1,215,552.650	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	37.800	370,175.400	
SYNOPSIS INC	11,855	136.210	1,614,769.550	
SYSCO CORP	38,229	80.400	3,073,611.600	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,143	548.950	5,019,049.850	
TELEFLEX INC	3,456	331.180	1,144,558.080	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	96,274	9.300	895,348.200	
TEXAS INSTRUMENTS INC	74,184	120.110	8,910,240.240	
TEXTRON INC	16,304	46.610	759,929.440	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	31,582	294.650	9,305,636.300	
TIFFANY & CO	8,733	125.670	1,097,476.110	
GLOBE LIFE INC	8,807	98.930	871,276.510	
DAVITA INC	8,159	69.850	569,906.150	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	94.820	907,711.860	
TRIMBLE INC	20,073	40.790	818,777.670	
TYSON FOODS INC	22,736	82.630	1,878,675.680	
UGI CORP	14,797	46.540	688,652.380	
MARATHON OIL CORP	58,418	12.530	731,977.540	
UNION PACIFIC CORP	56,020	176.100	9,865,122.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	64,508	148.880	9,603,951.040	
UNITEDHEALTH GROUP INC	75,067	256.970	19,289,966.990	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	141.130	868,372.890	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	124.760	901,515.760	
VF CORP	26,750	87.070	2,329,122.500	
CBS CORP	27,306	38.110	1,040,631.660	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	20,059	201.310	4,038,077.290	
VULCAN MATERIALS CO	10,913	136.440	1,488,969.720	

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,250	59.240	3,569,210.000	
WALMART INC	113,189	119.440	13,519,294.160	
WASTE MANAGEMENT INC	33,679	111.030	3,739,379.370	
WATERS CORP	5,468	210.080	1,148,717.440	
ALLERGAN PLC	26,094	181.280	4,730,320.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	106.270	975,133.520	
VAIL RESORTS INC	3,109	240.630	748,118.670	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	52.020	1,173,935.340	
WABTEC CORP	14,964	78.850	1,179,911.400	
WHIRLPOOL CORP	4,614	154.770	714,108.780	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	100.440	1,396,316.880	
WYNN RESORTS LTD	7,970	126.470	1,007,965.900	
NASDAQ INC	9,020	100.660	907,953.200	
CME GROUP INC	27,978	198.170	5,544,400.260	
WILLIAMS COS INC	97,461	22.090	2,152,913.490	
LKQ CORP	26,690	35.200	939,488.000	
ALLIANT ENERGY CORP	17,169	51.680	887,293.920	
WEC ENERGY GROUP INC	25,582	87.830	2,246,867.060	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	40.480	883,273.600	
CARMAX INC	12,265	93.880	1,151,438.200	
XILINX INC	20,599	95.500	1,967,204.500	
CIMAREX ENERGY CO	9,253	46.540	430,634.620	
TJX COMPANIES INC	95,661	59.230	5,666,001.030	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	3,937	241.860	952,202.820	
ZIONS BANCORP NA	13,142	51.070	671,161.940	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	6.270	171,798.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	5.620	429,368.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	57.000	894,900.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	31.830	544,293.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,192	93.030	762,101.760	
SIGNATURE BANK	4,171	125.900	525,128.900	
CBRE GROUP INC	26,222	54.890	1,439,325.580	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	24.820	316,008.240	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	3,819	302.960	1,157,004.240	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	16.880	1,290,982.400	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	280.660	913,828.960	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	74.700	224,100.000	
T-MOBILE US INC	27,710	80.940	2,242,847.400	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	64.080	1,778,796.720	
MOSAIC CO/THE	31,433	20.810	654,120.730	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,892	347.150	1,003,957.800	



CELANESE CORP	10,326	127.310	1,314,603.060	
DEXCOM INC	6,740	198.080	1,335,059.200	
DISCOVERY INC-A	10,423	30.905	322,122.810	
EXPEDIA GROUP INC	11,527	101.320	1,167,915.640	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	46.630	861,489.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,312	158.540	1,634,864.480	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	23.450	797,839.350	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,248	90.470	4,003,116.560	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	17.560	258,061.760	
VIACOM INC-CLASS B	30,282	22.750	688,915.500	
LIVE NATION	11,339	63.160	716,171.240	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,040	731.620	1,492,504.800	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	93.440	421,227.520	
TRANSDIGM GROUP INC	3,685	541.080	1,993,879.800	
MASTERCARD INC	71,792	274.890	19,734,902.880	
QURATE RETAIL INC	35,733	9.400	335,890.200	
HANESBRANDS INC	27,619	15.860	438,037.340	
WESTERN UNION CO	35,222	27.870	981,637.140	
OWENS CORNING	7,756	62.590	485,448.040	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	87.200	969,053.600	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	60.430	532,207.010	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,384	87.770	648,093.680	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	22.190	384,996.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	119.580	1,097,266.080	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	31,119	16.960	527,778.240	
DELTA AIR LINES INC	13,898	57.580	800,246.840	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	32.720	197,563.360	
DISCOVER FINANCIAL	26,157	84.710	2,215,759.470	
TE CONNECTIVITY LTD	25,992	93.900	2,440,648.800	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	72.750	1,161,817.500	
WABCO HOLDING INC	4,076	134.670	548,914.920	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,939	204.130	1,824,718.070	
VMWARE INC	6,532	164.950	1,077,453.400	
MERCADOLIBRE INC	3,500	494.420	1,730,470.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	239.290	1,095,230.330	
INVESCO LTD	33,443	17.820	595,954.260	
MSCI INC	6,714	245.000	1,644,930.000	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	122,545	83.570	10,241,085.650	
VISA INC	137,469	178.970	24,602,826.930	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	116.300	1,690,536.800	
DISCOVERY INC-C	30,421	28.615	870,496.910	
MARATHON PETROLEUM CORP	51,474	66.230	3,409,123.020	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	62.060	721,385.440	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	160,064	20.030	3,206,081.920	
XYLEM INC	13,160	77.330	1,017,662.800	
ALKERMES PLC	12,053	20.110	242,385.830	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	97.390	2,033,113.640	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	251.210	873,959.590	
SPLUNK INC	12,240	125.030	1,530,367.200	
EPAM SYSTEMS INC	4,003	189.230	757,487.690	
HCA HEALTHCARE INC	21,724	136.840	2,972,712.160	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	136.750	1,684,760.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	130.140	556,088.220	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	293.450	2,020,403.250	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,805	110.220	1,521,587.100	
CIT GROUP INC	9,287	44.810	416,150.470	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,652	117.620	2,664,328.240	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	39.900	759,616.200	
LEAR CORP	4,681	129.110	604,363.910	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	114.880	990,495.360	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	57.840	998,781.120	
DOLLAR GENERAL CORP	20,252	157.860	3,196,980.720	
FORTINET INC	11,150	96.230	1,072,964.500	
AON PLC	19,041	194.570	3,704,807.370	
TESLA INC	10,304	337.140	3,473,890.560	
GENERAL MOTORS CO	100,695	38.670	3,893,875.650	
XPO LOGISTICS INC	8,181	84.640	692,439.840	
TRIPADVISOR INC	9,263	31.960	296,045.480	
ALLY FINANCIAL INC	33,215	31.560	1,048,265.400	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	36.620	444,493.560	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	57.420	589,875.660	
APTIV PLC	20,610	96.880	1,996,696.800	
PHILLIPS 66	35,701	119.700	4,273,409.700	
FACEBOOK INC	189,729	190.840	36,207,882.360	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	137.590	1,850,998.270	
DIAMONDBACK ENERGY INC	13,109	75.430	988,811.870	
SERVICENOW INC	14,548	248.450	3,614,450.600	

PALO ALTO NETWORKS INC	7,242	236.930	1,715,847.060	
WORKDAY INC	13,168	162.420	2,138,746.560	
ABBVIE INC	116,273	85.210	9,907,622.330	
ZOETIS INC	38,223	117.860	4,504,962.780	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	51.820	875,706.180	
COTY INC	23,813	12.840	305,758.920	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	12.900	390,392.700	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	40.830	574,682.250	
CDW CORP	11,406	133.520	1,522,929.120	
SPRINT CORP	63,882	6.110	390,319.020	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	30.760	313,721.240	
ARCONIC INC	30,749	28.970	890,798.530	
TWILIO INC	8,128	93.230	757,773.440	
SNAP INC	51,731	14.190	734,062.890	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	14,304	39.860	570,157.440	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	46.210	231,327.260	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	46.530	660,958.650	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	15.880	244,710.800	
OKTA INC	8,816	109.660	966,762.560	
BAKER HUGHES CO	51,005	22.250	1,134,861.250	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,669	78.950	842,317.550	
ALTICE USA INC-A	13,887	26.230	364,256.010	
TECHNIPFMC LTD	31,257	20.600	643,894.200	
BROADCOM INC	31,228	313.410	9,787,167.480	
MONGODB INC	2,869	126.130	361,866.970	
BURLINGTON STORES INC	5,095	202.750	1,033,011.250	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	9,985	41.020	409,584.700	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29,578	27.230	805,408.940	
VEEVA SYSTEMS INC	9,780	143.770	1,406,070.600	
TWITTER INC	57,562	29.210	1,681,386.020	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	53.030	700,738.420	
EVERGY INC	18,388	63.060	1,159,547.280	
PLAINS GP HOLDINGS LP	14,935	18.430	275,252.050	
ALLEGION PLC	7,469	115.650	863,789.850	
STERIS PLC	6,658	145.840	971,002.720	
DOCUSIGN INC	9,325	66.730	622,257.250	
WIX.COM LTD	4,000	128.100	512,400.000	
DROPBOX INC	17,573	19.795	347,857.530	
KKR & CO INC	37,307	29.150	1,087,499.050	
PERRIGO CO PLC	10,553	50.050	528,177.650	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,290	99.090	2,208,716.100	
ARAMARK	18,144	42.990	780,010.560	
CIGNA CORP	30,329	188.200	5,707,917.800	

DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	54.310	703,857.600	
DOW INC	59,468	55.990	3,329,613.320	
AMCOR PLC	130,000	9.770	1,270,100.000	
XEROX HOLDINGS CORP	17,455	38.850	678,126.750	
FOX CORP-A	30,595	35.140	1,075,108.300	
FOX CORP-B	13,009	34.430	447,899.870	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,312	27.010	359,557.120	
CORTEVA INC	59,322	26.200	1,554,236.400	
GRUBHUB INC	8,158	36.190	295,238.020	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,772	218.420	823,880.240	
SABRE CORP	19,809	22.650	448,673.850	
PARSLEY ENERGY INC	25,677	17.100	439,076.700	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	192.610	855,381.010	
IHS MARKIT LTD	29,796	69.640	2,074,993.440	
FNF GROUP	21,372	47.000	1,004,484.000	
SYNCHRONY FINANCIAL	50,790	36.940	1,876,182.600	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	38.520	1,379,786.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	114.100	394,443.700	
CDK GLOBAL INC	9,969	51.785	516,244.660	
WAYFAIR INC	5,091	84.220	428,764.020	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,515	105.250	1,632,953.750	
QORVO INC	8,871	104.040	922,938.840	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,888	34.230	578,076.240	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	116.760	969,925.320	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	30.230	514,454.140	
GODADDY INC	14,641	69.000	1,010,229.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	20.350	533,251.400	
TRANSUNION	15,000	80.620	1,209,300.000	
SQUARE INC	26,487	62.450	1,654,113.150	
DUPONT DE NEMOURS INC	59,916	71.130	4,261,825.080	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	51.290	990,974.090	
WESTROCK CO	18,059	39.750	717,845.250	
KRAFT HEINZ CO	51,163	32.850	1,680,704.550	
FORTIVE CORP	24,560	72.880	1,789,932.800	
WASTE CONNECTIONS INC	20,417	88.840	1,813,846.280	
ALPHABET INC-CL A	23,530	1,309.000	30,800,770.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	104,040	17.430	1,813,417.200	
PAYPAL HOLDINGS INC	87,864	101.420	8,911,166.880	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	23,220	23.180	538,239.600	
DXC TECHNOLOGY CO	20,848	30.080	627,107.840	
ZILLOW GROUP INC-C	11,723	37.550	440,198.650	
ALPHABET INC-CL C	24,708	1,311.370	32,401,329.960	

	BEIGENE LTD ADR	3,159	199.440	630,030.960	
	LINDE PLC	43,407	203.000	8,811,621.000	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	43.940	520,557.180	
	ROKU INC	6,674	121.940	813,827.560	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,571	469.750	5,905,227.250	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	26.000	780,000.000	
アメリカ・ドル	小計	23,831,885		2,078,192,565.230 (226,855,500,423)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	9.328	296,611.740	
	ASHTED GROUP	36,689	23.590	865,493.510	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	22.130	403,142.210	
	BHP GROUP PLC	168,058	17.268	2,902,025.540	
	BARCLAYS PLC	1,342,831	1.664	2,234,470.780	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	6.268	515,749.840	
	BT GROUP PLC	629,282	1.871	1,177,386.620	
	BUNZL PLC	27,838	20.900	581,814.200	
	EASYJET PLC	13,628	13.035	177,640.980	
	AVIVA PLC	314,691	4.307	1,355,374.130	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	47.800	496,689.800	
	DIAGEO PLC	187,608	30.900	5,797,087.200	
	SCHRODERS PLC	10,932	32.340	353,540.880	
	DCC PLC	7,898	74.960	592,034.080	
	NATIONAL GRID PLC	262,780	8.899	2,338,479.220	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.178	360,851.040	
	BAE SYSTEMS PLC	248,672	5.796	1,441,302.910	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	182,423	28.855	5,263,815.660	
	HALMA PLC	27,812	19.070	530,374.840	
	NEXT PLC	10,018	66.000	661,188.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	77,987	17.740	1,383,489.380	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	32.190	483,397.230	
	ANGLO AMERICAN PLC	84,546	20.645	1,745,452.170	
	COMPASS GROUP PLC	125,998	20.220	2,547,679.560	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,596,388	5.956	9,508,086.920	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	450,601	2.694	1,213,919.090	
	CENTRICA PLC	471,340	0.729	343,606.860	
	UNILEVER PLC	87,137	46.750	4,073,654.750	
	MEGGITT PLC	62,181	6.396	397,709.670	
	MORRISON SUPERMARKETS	168,676	1.989	335,496.560	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.294	451,915.170	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.472	442,487.800	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	30,240	24.430	738,763.200	
	PEARSON PLC	65,009	7.060	458,963.540	

PERSIMMON PLC	26,085	23.580	615,084.300	
PRUDENTIAL PLC	204,940	13.680	2,803,579.200	
RIO TINTO PLC	87,857	42.060	3,695,265.420	
VODAFONE GROUP PLC	2,125,994	1.622	3,448,362.260	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	56,430	59.100	3,335,013.000	
RELX PLC	153,894	18.500	2,847,039.000	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	4.378	615,621.220	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	7.768	1,081,833.820	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	2.130	846,534.420	
ST JAMES'S PLACE PLC	48,466	10.655	516,405.230	
SSE PLC	83,105	12.500	1,038,812.500	
BP PLC	1,608,793	5.086	8,182,321.190	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	7.338	639,220.510	
SMITHS GROUP PLC	31,720	16.595	526,393.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	84.400	465,719.200	
STANDARD CHARTERED PLC	218,329	7.260	1,585,068.540	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,606,356	0.562	3,150,772.070	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.678	423,337.580	
TESCO PLC	757,316	2.379	1,801,654.760	
3I GROUP PLC	76,643	11.390	872,963.770	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	16.505	1,122,785.630	
GLAXOSMITHKLINE PLC	393,231	17.370	6,830,422.470	
WEIR GROUP	19,161	15.025	287,894.020	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,660	69.040	1,702,526.400	
WPP PLC	95,148	10.070	958,140.360	
ASTRAZENECA PLC	103,134	72.770	7,505,061.180	
WHITBREAD PLC	9,814	42.440	416,506.160	
CARNIVAL PLC	13,350	32.370	432,139.500	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.860	328,717.800	
JOHN WOOD GROUP PLC	48,988	3.780	185,174.640	
INTERTEK GROUP PLC	12,083	52.500	634,357.500	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	20.440	647,661.840	
INVESTEC PLC	50,655	4.406	223,185.930	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,653	47.845	605,382.780	
ITV PLC	254,308	1.342	341,281.330	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.010	275,802.150	
G4S PLC	122,250	2.060	251,835.000	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	20.800	330,574.400	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,726	44.500	477,307.000	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	343,568	23.410	8,042,926.880	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	296,907	23.295	6,916,448.560	

	TUI AG-DI	29,824	10.340	308,380.160	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	214,715	3.105	666,690.070	
	EXPERIAN PLC	70,598	23.880	1,685,880.240	
	MONDI PLC	39,767	17.090	679,618.030	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	17.525	366,745.670	
	FRESNILLO PLC NPR	15,639	6.734	105,313.020	
	OCADO GROUP PLC	40,627	11.895	483,258.160	
	INFORMA PLC	102,475	8.000	819,800.000	
	GLENCORE PLC	866,421	2.544	2,204,175.020	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.032	398,531.770	
	EVRAZ PLC	48,765	3.708	180,820.620	
	NMC HEALTH PLC	8,149	23.180	188,893.820	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.757	310,697.350	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	23.660	359,821.280	
	FERGUSON PLC	18,865	67.420	1,271,878.300	
	M&G PLC	204,940	2.180	446,769.200	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	6,406,328	0.001	6,406.320	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	10.770	281,097.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.342	407,851.010	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	417,620	2.253	940,897.860	
イギリス・ポンド 小計		30,283,978		141,590,352.900 (19,773,092,782)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	79,754	28.730	2,291,332.420	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	128,049	26.020	3,331,834.980	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	564.400	993,344.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.640	1,597,375.760	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.260	803,422.860	
	NICE LTD	4,902	557.000	2,730,414.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	86.650	904,972.600	
	AZRIELI GROUP	2,291	261.000	597,951.000	
イスラエル・シュケル 小計		378,745		13,250,647.620 (413,817,725)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	11,115	71.650	796,389.750	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	219,575	26.250	5,763,843.750	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	274,793	27.420	7,534,824.060	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	30,569	8.750	267,478.750	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	9.580	1,108,041.960	
	TELSTRA CORP LTD	360,654	3.510	1,265,895.540	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.790	420,961.060	
	AMP LTD	302,414	1.945	588,195.230	

ASX LTD	15,573	80.400	1,252,069.200	
BHP GROUP LTD	230,460	37.300	8,596,158.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	27.960	585,650.160	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	70,363	4.190	294,820.970	
COMPUTERSHARE LT	38,040	16.640	632,985.600	
CSL LIMITED	36,126	261.340	9,441,168.840	
REA GROUP LTD	4,119	102.850	423,639.150	
TRANSURBAN GROUP	209,477	14.720	3,083,501.440	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	10.490	509,824.490	
COCHLEAR LTD	4,381	213.820	936,745.420	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	8.230	1,093,437.800	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,350	79.170	10,873,999.500	
BORAL LIMITED	86,101	4.980	428,782.980	
RIO TINTO LIMITED	30,337	95.230	2,888,992.510	
APA GROUP	94,106	11.140	1,048,340.840	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	31.650	1,434,472.950	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	7.870	1,421,109.510	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.600	189,545.400	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	39.710	130,050.250	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	27.660	938,393.160	
ORICA LTD	27,865	24.180	673,775.700	
CIMIC GROUP LTD	8,709	34.380	299,415.420	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	19.270	828,108.980	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.120	521,606.920	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.800	749,144.000	
MACQUARIE GROUP LTD	26,417	137.740	3,638,677.580	
WORLEY LTD	19,922	14.300	284,884.600	
SUNCORP GROUP LTD	104,783	13.340	1,397,805.220	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	28.470	6,446,205.870	
NEWCREST MINING LTD	62,080	29.980	1,861,158.400	
OIL SEARCH LTD	105,470	7.380	778,368.600	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.630	495,226.380	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	12.910	1,391,956.200	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	8.070	368,855.490	
SANTOS LTD	132,862	8.110	1,077,510.820	
SONIC HEALTHCARE	34,684	29.150	1,011,038.600	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,007	23.090	346,511.630	
TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	4.790	711,482.650	
WESFARMERS LTD	91,516	40.810	3,734,767.960	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.420	446,763.460	



	WOODSIDE PETROLEUM LTD	69,115	33.630	2,324,337.450	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	101,937	37.680	3,840,986.160	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	49.330	493,053.350	
	SEEK LTD	25,899	22.480	582,209.520	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.850	305,372.100	
	AGL ENERGY LTD	49,644	19.920	988,908.480	
	BRAMBLES LTD	126,693	12.030	1,524,116.790	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.480	410,105.280	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.720	858,858.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	54,001	17.770	959,597.770	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	3.210	664,181.100	
	SOUTH32 LTD(AUD)	443,160	2.740	1,214,258.400	
	COLES GROUP LTD	96,821	15.250	1,476,520.250	
	オーストラリア・ドル 小計	5,980,586		106,655,087.400 (7,979,933,639)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,876	76.280	1,516,141.280	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	68,496	39.930	2,735,045.280	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	21.620	3,047,403.860	
	ATCO LTD	7,193	49.560	356,485.080	
	BANK OF MONTREAL	50,286	100.680	5,062,794.480	
	BANK OF NOVA SCOTIA	97,707	76.500	7,474,585.500	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,548	69.390	1,772,775.720	
	BCE INC	11,673	63.210	737,850.330	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	66,522	74.590	4,961,875.980	
	BAUSCH HEALTH COS INC	25,819	34.670	895,144.730	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	2.020	306,262.300	
	SAPUTO INC	18,601	40.390	751,294.390	
	BLACKBERRY LTD	39,652	7.340	291,045.680	
	CGI INC	20,610	106.160	2,187,957.600	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	57.110	647,627.400	
	CAE INC	23,000	34.320	789,360.000	
	CAMECO CORP	32,627	12.670	413,384.090	
	ROGERS COMM-CL B	27,696	62.450	1,729,615.200	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,564	114.980	3,974,168.720	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	96,491	36.940	3,564,377.540	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	153.610	746,851.820	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	38.660	352,540.540	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,704	125.100	7,218,770.400	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	17,676	21.450	379,150.200	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	36.010	572,955.110	
	OPEN TEXT CORP	21,795	54.970	1,198,071.150	
	EMPIRE CO LTD	15,093	34.700	523,727.100	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	5.520	550,570.320	

FORTIS INC	32,068	52.720	1,690,624.960	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	12.610	697,282.560	
TELUS CORP	15,945	49.870	795,177.150	
GREAT WEST LIFECO INC	20,722	32.710	677,816.620	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	35.310	760,648.020	
ENBRIDGE INC	161,215	49.550	7,988,203.250	
IGM FINANCIAL INC	8,426	39.700	334,512.200	
MANULIFE FINANCIAL CORP	154,854	26.130	4,046,335.020	
LOBLAW CO LTD	15,354	70.600	1,083,992.400	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,247	74.740	1,886,960.780	
SUN LIFE FINANCIAL INC	47,728	61.190	2,920,476.320	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	610.600	1,265,163.200	
METRO INC	19,949	55.910	1,115,348.590	
HUSKY ENERGY INC	28,749	10.540	303,014.460	
EMERA INC	19,138	52.620	1,007,041.560	
METHANEX CORP	5,281	54.230	286,388.630	
ONEX CORP	6,646	79.280	526,894.880	
POWER CORP OF CANADA	23,792	32.080	763,247.360	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	32.480	704,036.480	
QUEBECOR INC-B	17,548	31.740	556,973.520	
ROYAL BANK OF CANADA	113,038	108.440	12,257,840.720	
SNC-LAVALIN GROUP INC	13,134	26.390	346,606.260	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,747	311.180	3,344,251.460	
SHAW COMM INC-B	35,431	26.730	947,070.630	
SUNCOR ENERGY INC	123,985	42.660	5,289,200.100	
LUNDIN MINING CORP	43,480	7.550	328,274.000	
ENCANA CORP	96,391	6.400	616,902.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	22.450	920,809.200	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	89.010	1,459,229.940	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	143,825	76.550	11,009,803.750	
TC ENERGY CORP	72,907	66.490	4,847,586.430	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	57.560	327,861.760	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	103.900	642,517.600	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	137.210	1,507,800.690	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	34.770	1,215,663.510	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,565	1,277.060	1,998,598.900	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	126.520	1,887,931.440	
CI FINANCIAL CORP	20,695	20.840	431,283.800	
TOURMALINE OIL CORP	13,354	12.790	170,797.660	
KEYERA CORP	16,668	32.330	538,876.440	
ALTAGAS LTD	23,944	19.920	476,964.480	
PEMBINA PIPELINE CORP	38,119	47.010	1,791,974.190	

	DOLLARAMA INC	23,536	46.750	1,100,308.000	
	STARS GROUP INC	18,529	28.800	533,635.200	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	12.110	977,531.310	
	VERMILION ENERGY INC	12,923	19.850	256,521.550	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	14,127	59.800	844,794.600	
	INTER PIPELINE LTD	27,474	21.700	596,185.800	
	NUTRIEN LTD	44,453	64.900	2,884,999.700	
	CRONOS GROUP INC	16,000	11.260	180,160.000	
	WSP GLOBAL INC	8,400	86.140	723,576.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	67.690	548,559.760	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	13.360	199,878.960	
	AIR CANADA	10,722	48.630	521,410.860	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	18,531	88.010	1,630,913.310	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	5.030	334,806.860	
	SHOPIFY INC	7,998	393.750	3,149,212.500	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	28.320	527,714.880	
	HYDRO ONE LTD	27,340	23.630	646,044.200	
カナダ・ドル 小計		3,231,880		152,182,068.610 (12,558,064,302)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.120	515,000.000	
	SEBACORP INDUSTRIES	81,400	2.270	184,778.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.340	289,458.000	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	692,140	0.215	148,810.100	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	141,900	26.610	3,775,959.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	10.880	396,032.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	32.270	191,812.880	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	5.130	245,214.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.160	631,124.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.710	758,750.650	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.940	391,416.000	
	KEPPEL CORP LTD	100,200	6.920	693,384.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.390	425,181.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	251,553	11.130	2,799,784.890	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	670,722	3.350	2,246,918.700	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	9.320	442,700.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	103,200	26.950	2,781,240.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.950	321,975.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.600	348,600.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.880	552,124.000	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.980	185,024.000		

シンガポール・ドル 小計		3,687,774		18,325,286.220 (1,470,604,219)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	207,887	13.045	2,711,885.910	
	NESTLE SA-REGISTERED	241,926	104.120	25,189,335.120	
	CIE FINANC RICHEMONT	40,915	74.680	3,055,532.200	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	55,462	297.400	16,494,398.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,930	245.900	720,487.000	
	SIKA INHABER	10,209	173.300	1,769,219.700	
	SGS SA-REG	424	2,528.000	1,071,872.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	169,630	87.500	14,842,625.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,127	185.300	764,733.100	
	BARRY CALLEBAUT AG	157	2,056.000	322,792.000	
	CLARIANT AG-REG	19,496	20.480	399,278.080	
	SWISSCOM AG-REG	1,960	513.600	1,006,656.000	
	ABB LTD	144,013	21.550	3,103,480.150	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	60.220	779,487.680	
	GEBERIT AG	2,901	512.400	1,486,472.400	
	LONZA GROUP AG-REG	5,793	344.300	1,994,529.900	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	7,380.000	583,020.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	82,900.000	746,100.000	
	GIVAUDAN-REG	742	2,864.000	2,125,088.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,042	390.200	4,698,788.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	37,997	51.840	1,969,764.480	
	TEMENOS GROUP	4,730	143.350	678,045.500	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	229.300	1,051,111.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	162.600	653,326.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	887.800	704,913.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	277.500	592,185.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	53.100	243,835.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	238.400	396,459.200	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,774	499.000	1,384,226.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	159.500	552,667.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	628.000	397,524.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	102.500	613,975.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	80.400	241,200.000		
DUFREY GROUP	3,138	97.840	307,021.920		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	774.000	1,164,870.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	47.510	848,005.990		
SWISS RE LTD	24,816	106.650	2,646,626.400		
ALCON INC	32,032	58.000	1,857,856.000		
UBS GROUP AG	301,686	12.350	3,725,822.100		
スイス・フラン 小計	1,391,046		103,895,216.930 (11,366,136,732)		
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	353.200	18,466,708.800	

	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,303	309.000	10,290,627.000	
	ERICSSON LM-B SHS	236,160	87.140	20,578,982.400	
	LUNDBERGS B	7,382	372.400	2,749,056.800	
	SKF AB-B SHS	28,812	184.200	5,307,170.400	
	SANDVIK AB	87,784	179.600	15,766,006.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	94.960	12,423,331.920	
	SKANSKA AB-B SHS	24,400	215.900	5,267,960.000	
	SWEDBANK AB	71,958	138.850	9,991,368.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,705	95.840	12,143,407.200	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	150.550	17,949,624.850	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	446.600	5,779,450.600	
	TELE2 AB-B SHS	34,618	138.550	4,796,323.900	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	218.600	2,492,695.800	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	256.100	4,914,815.100	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	162.250	3,909,900.500	
	INVESTOR AB-B SHS	35,180	509.200	17,913,656.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	60,283	193.620	11,671,994.460	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	226.500	18,366,432.000	
	TELIA CO AB	231,855	42.410	9,832,970.550	
	LUNDIN PETROLEUM AB	16,790	311.000	5,221,690.000	
	BOLIDEN AB	21,855	272.350	5,952,209.250	
	ALFA LAVAL AB	23,343	237.600	5,546,296.800	
	KINNEVIK AB-B	18,310	263.200	4,819,192.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	5,332	430.000	2,292,760.000	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	426.200	2,523,104.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	76.900	2,590,914.800	
	HEXAGON AB	22,037	533.000	11,745,721.000	
	EPIROC AB-A	48,955	109.850	5,377,706.750	
	EPIROC AB-B	30,899	106.050	3,276,838.950	
	ESSITY AB-B	46,640	304.300	14,192,552.000	
	NORDEA BANK ABP	259,268	72.660	18,838,412.880	
	スウェーデン・クローナ 小計	1,962,540		292,989,881.410 (3,296,136,166)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	956.000	8,069,596.000	
	A P MOLLER A/S	604	9,102.000	5,497,608.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,535.000	2,330,055.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	95.720	4,884,974.480	
	GENMAB A/S	4,745	1,498.000	7,108,010.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,533	318.000	4,939,494.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	140,645	389.000	54,710,905.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,604	624.400	9,743,137.600	
	COLOPLAST-B	9,729	790.800	7,693,693.200	
	DSV PANALPINA A S	17,626	727.600	12,824,677.600	
	DEMANT A/S	7,244	184.750	1,338,329.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	242.500	1,173,700.000	

	TRYG A/S	11,107	187.000	2,077,009.000	
	PANDORA A/S	8,251	290.400	2,396,090.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,539	529.000	3,988,131.000	
	ISS A/S	11,107	151.300	1,680,489.100	
	ORSTED A/S	15,090	595.000	8,978,550.000	
デンマーク・クローネ 小計		329,412		139,434,449.380 (2,243,500,291)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	9.450	805,565.250	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	13.590	406,259.460	
	A2 MILK CO LTD	55,091	12.390	682,577.490	
	FISHER & PAYKEL	43,184	20.490	884,840.160	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	5.110	327,571.440	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.445	709,524.230	
	MERIDIAN ENERGY LTD	90,173	4.650	419,304.450	
ニュージーランド・ドル 小計		527,314		4,235,642.480 (293,064,103)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	225.500	7,933,766.500	
	DNB ASA	79,858	169.000	13,496,002.000	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	35.530	3,309,228.670	
	TELENOR ASA	54,766	164.450	9,006,268.700	
	ORKLA ASA	64,938	87.300	5,669,087.400	
	EQUINOR ASA	81,022	178.600	14,470,529.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,535	367.700	4,609,119.500	
	AKER BP ASA	8,552	265.400	2,269,700.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	169.950	2,835,275.850	
	SCHIBSTED ASA	7,445	243.400	1,812,113.000	
ノルウェー・クローネ 小計		454,121		65,411,091.620 (780,354,323)	
ユーロ	CRH PLC	61,990	33.140	2,054,348.600	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	93.860	586,249.560	
	KERRY GROUP PLC-A	12,258	114.700	1,405,992.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	46.500	547,212.000	
	UMICORE	14,115	39.330	555,142.950	
	AIR LIQUIDE	34,252	119.550	4,094,826.600	
	AIRBUS SE	46,450	132.960	6,175,992.000	
	AXA	153,753	25.380	3,902,251.140	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	22.800	1,013,437.200	
	ADIDAS AG	14,421	272.000	3,922,512.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	19.180	1,669,235.400	
	DASSAULT AVIATION SA	163	1,274.000	207,662.000	
	DANONE	48,833	73.900	3,608,758.700	
	SAFRAN SA	25,898	145.500	3,768,159.000	
INTESA SANPAOLO	1,154,007	2.343	2,703,838.400		

BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,603	75.040	1,921,249.120	
ACCOR SA	16,000	39.710	635,360.000	
BOUYGUES	17,572	38.170	670,723.240	
BNP PARIBAS	87,496	50.710	4,436,922.160	
THALES SA	8,549	86.700	741,198.300	
CAPGEMINI SA	12,515	105.500	1,320,332.500	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	48.360	206,207.040	
INGENICO GROUP	4,334	97.800	423,865.200	
UNICREDIT SPA	155,718	12.610	1,963,603.980	
NATIXIS	70,166	4.022	282,207.650	
KONINKLIJKE DSM NV	13,812	116.000	1,602,192.000	
COMMERZBANK AG	83,118	5.581	463,881.550	
EIFFAGE	6,461	97.580	630,464.380	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,325	48.400	1,661,330.000	
UNITED INTERNET	9,882	29.670	293,198.940	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	40.860	226,609.560	
PUBLICIS GROUPE	15,071	40.130	604,799.230	
FAURECIA	6,117	49.160	300,711.720	
IBERDROLA SA	475,457	8.968	4,263,898.370	
ENI SPA	197,346	14.190	2,800,339.740	
IMERYS SA	2,256	36.800	83,020.800	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.415	300,854.550	
KBC GROUPE	18,480	66.160	1,222,636.800	
HANNOVER RUECK SE	4,868	165.700	806,627.600	
WARTSILA OYJ	34,935	9.698	338,799.630	
L'OREAL	19,882	264.300	5,254,812.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,883	403.000	8,818,849.000	
GEA GROUP AG	11,838	28.650	339,158.700	
BOLLORE	71,347	4.030	287,528.410	
MEDIOBANCA SPA	56,009	10.435	584,453.910	
MICHELIN(CGDE) -B	13,744	116.150	1,596,365.600	
CONTINENTAL AG	8,312	131.400	1,092,196.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	77,008	32.745	2,521,626.960	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	12.690	201,580.650	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.400	257,532.600	
OMV AG	12,817	53.980	691,861.660	
VERBUND AG	4,095	44.860	183,701.700	
PERNOD-RICARD	16,719	167.400	2,798,760.600	
PEUGEOT SA	43,905	24.120	1,058,988.600	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,249	68.960	913,651.040	
RENAULT SA	14,917	46.745	697,295.160	
REPSOL SA	111,616	15.040	1,678,704.640	
REMY COINTREAU	1,860	122.000	226,920.000	
MERCK KGAA	9,875	109.550	1,081,806.250	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,436	37.455	1,477,075.380	
RWE AG	41,119	26.180	1,076,495.420	
SEB SA	1,551	139.000	215,589.000	
SOCIETE GENERALE-A	58,575	28.390	1,662,944.250	
VINCI S.A.	40,007	100.150	4,006,701.050	
SODEXO	7,075	104.050	736,153.750	
SOLVAY SA	5,563	99.720	554,742.360	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,656	87.460	3,818,153.760	
VIVENDI SA	73,790	24.880	1,835,895.200	
SAP SE	77,393	123.260	9,539,461.180	
TELEFONICA S.A	367,755	6.856	2,521,328.280	
TOTAL SA	188,674	49.295	9,300,684.830	
VALEO	19,653	35.640	700,432.920	
E.ON SE	181,317	8.872	1,608,644.420	
VOEST-ALPINE AG	9,875	24.930	246,183.750	
HENKEL AG & CO KGAA	9,300	88.600	823,980.000	
SIEMENS AG-REG	61,207	113.800	6,965,356.600	
UPM-KYMMENE OYJ	44,548	30.750	1,369,851.000	
ING GROEP NV-CVA	304,508	10.746	3,272,242.960	
PUMA AG	7,351	66.700	490,311.700	
BAYER AG	74,253	70.630	5,244,489.390	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41,234	12.695	523,465.630	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	95.060	1,307,930.540	
DAIMLER AG	70,984	53.450	3,794,094.800	
BASF SE	72,808	70.980	5,167,911.840	
BEIERSDORF AG	8,371	106.750	893,604.250	
HOCHTIEF AG	1,707	113.400	193,573.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	65.100	783,218.100	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,214	68.100	1,104,173.400	
ORANGE	162,849	14.285	2,326,297.960	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	37.370	1,350,589.170	
RANDSTAD NV	9,074	51.440	466,766.560	
ALLIANZ SE	33,915	219.000	7,427,385.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	3.685	742,918.110	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	90,890	24.160	2,195,902.400	
HERMES INTL	2,483	648.600	1,610,473.800	
ENDESA S.A.	23,417	23.910	559,900.470	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	17.425	280,472.800	
ERSTE GROUP BANK AG	25,117	33.560	842,926.520	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,633	253.400	2,947,802.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	46,739	15.482	723,613.190	
SOCIETE BIC SA	2,478	66.950	165,902.100	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,913	136.650	1,491,261.450	



ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	35.630	717,481.310	
HEINEKEN NV	21,066	91.000	1,917,006.000	
AKZO NOBEL	17,491	87.100	1,523,466.100	
ASML HOLDING NV	33,749	242.050	8,168,945.450	
AEGON NV	150,349	4.211	633,119.630	
BANKINTER S.A.	57,960	6.406	371,291.760	
VOLKSWAGEN AG	2,645	180.850	478,348.250	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	181.680	2,616,373.680	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523,594	4.958	2,595,979.050	
KERING	5,915	519.600	3,073,434.000	
CNP ASSURANCES	13,987	18.240	255,122.880	
FORTUM OYJ	37,452	21.180	793,233.360	
AGEAS	14,365	52.880	759,621.200	
UCB SA	9,143	73.480	671,827.640	
THYSSENKRUPP AG	27,110	13.605	368,831.550	
CARREFOUR SA	51,094	15.550	794,511.700	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	23.930	565,035.160	
ATOS SE	6,718	72.600	487,726.800	
NOKIA OYJ	430,800	3.226	1,389,760.800	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,925	39.930	2,871,965.250	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,865	63.700	1,456,500.500	
SANOFI	89,628	83.000	7,439,124.000	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	21.640	1,203,422.040	
ELISA OYJ	10,787	48.750	525,866.250	
BANCO SANTANDER SA	1,337,561	3.762	5,031,904.480	
METSO OYJ	8,585	35.240	302,535.400	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.785	615,289.860	
QIAGEN N.V.	17,974	28.600	514,056.400	
1&1 DRILLISCH AG	3,149	24.120	75,953.880	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	6.901	1,030,898.980	
BMW VORZUG	4,116	59.150	243,461.400	
ENEL SPA	652,089	6.866	4,477,243.070	
COLRUYT NV	4,673	48.680	227,481.640	
VOPAK (KON.)	5,364	48.460	259,939.440	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,592	15.440	4,069,860.480	
SARTORIUS AG	2,712	182.000	493,584.000	
LEONARDO SPA	28,316	11.255	318,696.580	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,935	50.700	300,904.500	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	18.836	1,866,044.840	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	101.800	383,887.800	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.785	810,515.760	
EUROFINS SCIENTIFIC	794	455.400	361,587.600	
TELEPERFORMANCE	4,421	211.000	932,831.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,705	135.400	1,991,057.000	
EURAZEO	2,748	62.350	171,337.800	
BANCO SABADELL	407,477	1.040	423,776.080	

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	93.060	622,478.340	
FRAPORT AG	3,149	74.300	233,970.700	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	85.250	834,682.750	
INDITEX	84,992	27.520	2,338,979.840	
JC DECAUX SA	6,058	25.800	156,296.400	
ANDRITZ AG	6,265	42.060	263,505.900	
MAPFRE SA	84,474	2.566	216,760.280	
ESSILORLUXOTTICA	22,811	135.050	3,080,625.550	
SNAM SPA	169,163	4.587	775,950.680	
CREDIT AGRICOLE SA	85,432	12.280	1,049,104.960	
ENAGAS	18,095	23.040	416,908.800	
WENDEL	2,220	123.900	275,058.000	
WIRECARD AG	8,963	116.050	1,040,156.150	
TENARIS SA	36,959	10.020	370,329.180	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.538	410,319.150	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.532	264,721.070	
ATLANTIA SPA	37,365	22.800	851,922.000	
ILIAD SA	2,102	94.840	199,353.680	
PROXIMUS	14,283	27.610	394,353.630	
SES FDR	25,070	16.895	423,557.650	
TERNA SPA	113,654	5.950	676,241.300	
BIOMERIEUX	3,248	74.700	242,625.600	
GRIFOLS SA	23,518	28.750	676,142.500	
FERROVIAL SA	38,062	26.110	993,798.820	
LANXESS AG	6,856	62.200	426,443.200	
NESTE OYJ	32,931	31.690	1,043,583.390	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	23.140	223,092.740	
RECORDATI SPA	6,859	37.480	257,075.320	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	39,752	8.270	328,749.040	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	240.100	1,000,736.800	
KONE OYJ	26,502	56.800	1,505,313.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	136.700	257,542.800	
ENGIE	148,970	14.185	2,113,139.450	
ALSTOM	15,712	38.550	605,697.600	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	43.440	157,860.960	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	16.660	208,949.720	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	9.184	494,099.200	
IPSEN SA	3,646	100.000	364,600.000	
DEUTSCHE WOHNEN	26,722	33.180	886,635.960	
ARKEMA SA	5,033	97.240	489,408.920	
LEGRAND SA	20,673	70.720	1,461,994.560	
UNILEVER NV	115,908	54.360	6,300,758.880	
ADP	2,313	172.200	398,298.600	
ORION OYJ	8,051	40.660	327,353.660	
RTL GROUP SA	3,446	45.600	157,137.600	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	14.940	598,914.720	
SYMRISE AG	9,988	85.740	856,371.120	
SCOR SE	13,875	38.040	527,805.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	31.320	544,874.040	
PRYSMIAN SPA	21,452	21.300	456,927.600	
CAIXABANK	297,224	2.785	827,768.840	
BUREAU VERITAS SA	23,179	22.790	528,249.410	
GETLINK	37,646	15.000	564,690.000	
SUEZ SA	26,620	13.330	354,844.600	
AMADEUS IT GROUP SA	33,891	71.460	2,421,850.860	
BRENTAG AG	12,353	48.250	596,032.250	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	26.220	448,781.520	
EDENRED	19,188	46.320	888,788.160	
BANKIA SA	100,675	1.812	182,423.100	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.797	172,130.170	
HUGO BOSS AG -ORD	5,218	39.500	206,111.000	
KION GROUP AG	4,567	59.280	270,731.760	
VONOVIA SE	41,548	46.280	1,922,841.440	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	4.470	367,684.320	
KNORR-BREMSE AG	4,492	90.180	405,088.560	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	42.200	483,949.600	
FERRARI NV	9,887	149.600	1,479,095.200	
METRO AG	10,774	14.895	160,478.730	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	10.095	786,915.340	
AROUNDTOWN SA	71,783	7.664	550,144.910	
AIB GROUP PLC	86,464	2.872	248,324.600	
MONCLER SPA	14,353	37.640	540,246.920	
PROSUS NV	39,000	63.170	2,463,630.000	
FERROVIAL SA-RTS	38,062	0.415	15,795.730	
AXEL SPRINGER SE	4,978	63.000	313,614.000	
WORLDLINE SA	7,758	55.100	427,465.800	
NN GROUP NV	25,887	35.530	919,765.110	
FINECOBANK SPA	45,048	11.010	495,978.480	
ZALANDO SE	9,414	37.390	351,989.460	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	89,977	14.634	1,316,723.410	
AENA SME SA	5,338	167.500	894,115.000	
CELLNEX TELECOM SAU	14,116	37.330	526,950.280	
ABN AMRO BANK NV	34,251	17.300	592,542.300	
EXOR NV	7,971	70.640	563,071.440	
COVESTRO AG	12,708	46.690	593,336.520	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	60,646	71.100	4,311,930.600	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	10.840	433,762.600	
AMUNDI SA	4,119	69.850	287,712.150	
ADYEN NV	706	635.400	448,592.400	

	PIRELLI & C SPA	34,086	5.448	185,700.520	
	UNIPER SE	14,252	28.060	399,911.120	
	DELIVERY HERO SE	8,081	44.130	356,614.530	
ユーロ 小計		15,462,013		324,757,770.880 (39,052,121,948)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	19,100	103.600	1,978,760.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.180	2,817,520.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	19.040	1,977,494.400	
	CLP HOLDINGS LTD	136,000	83.750	11,390,000.000	
	PCCW LTD	331,000	4.720	1,562,320.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	56.700	2,806,650.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,440	254.000	23,987,760.000	
	MTR CORP	126,000	45.050	5,676,300.000	
	HANG SENG BANK LTD	58,500	170.000	9,945,000.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	39.500	4,560,275.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	56.150	5,699,225.000	
	(THE) WHARF HOLDINGS LTD	95,750	19.220	1,840,315.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	774,755	15.420	11,946,722.100	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	50,000	31.250	1,562,500.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	178,000	55.250	9,834,500.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	26.250	1,929,375.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	277,000	28.200	7,811,400.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	12.120	1,636,200.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	22.700	1,146,350.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	11.500	5,569,059.000	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	104,000	8.310	864,240.000	
	SINO LAND CO	255,400	12.140	3,100,556.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	125,000	120.700	15,087,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	47,500	76.650	3,640,875.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	62.650	7,110,775.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	33.700	2,359,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	49.750	3,184,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.580	1,338,480.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	17.480	2,174,512.000	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	64,800	12.280	795,744.000	
	AIA GROUP LTD	949,427	82.400	78,232,784.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	12.220	3,531,580.000	
	SANDS CHINA LTD	199,200	40.600	8,087,520.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	25.050	2,610,210.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	46.450	4,447,587.500	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.830	1,800,900.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	90,000	28.550	2,569,500.000	
	WH GROUP LTD	706,500	8.730	6,167,745.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,832	75.150	15,693,724.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	198,332	55.400	10,987,592.800	
香港・ドル	小計	7,613,962		289,462,552.400 (4,035,107,980)	
合計		95,135,256		330,117,434,633 (330,117,434,633)	

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益 証券	オーストラリ ア・ドル	DEXUS	84,575.000	971,766.750		
		GOODMAN GROUP	132,051.000	1,872,483.180		
		GPT GROUP	140,307.000	825,005.160		
		MIRVAC GROUP	290,474.000	926,612.060		
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,626,437.160		
		STOCKLAND	194,018.000	944,867.660		
		VICINITY CENTRES	270,443.000	705,856.230		
		オーストラリア・ドル	小計	1,532,136.000	7,873,028.200 (589,059,970)	
	シンガポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	626,514.720		
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	416,726.000		
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	495,510.000		
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	351,543.000		
		シンガポール・ドル	小計	798,206.000	1,890,293.720 (151,696,071)	
	投資信託受益証券 合計			2,330,342	740,756,041 (740,756,041)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	774,466.710		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,646.000	1,330,705.860		
		AMERICAN TOWER CORP	34,655.000	7,134,424.850		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	987,212.640		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,347.000	2,381,167.950		
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,663,815.180		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	887,787.440		
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	32,699.000	4,277,356.190		

DIGITAL REALTY TRUST INC	16,931.000	1,973,646.670	
DUKE REALTY TRUST	27,278.000	943,546.020	
EQUINIX INC	6,638.000	3,520,197.780	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	910,489.320	
EQUITY RESIDENTIAL	30,415.000	2,554,251.700	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,075.000	1,598,219.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10,754.000	1,143,042.660	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	788,880.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,162.000	1,353,057.780	
HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	946,341.720	
INVITATION HOMES INC	36,281.000	1,070,652.310	
IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	780,211.580	
KIMCO REALTY	32,980.000	687,633.000	
LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	683,796.300	
MID AMERICA	8,834.000	1,183,667.660	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	753,424.800	
PROLOGIS INC	49,995.000	4,353,064.650	
PUBLIC STORAGE	12,188.000	2,575,933.800	
REALTY INCOME CORP	26,099.000	1,991,875.680	
REGENCY CENTERS CORP	12,096.000	782,127.360	
SBA COMMUNICATIONS CORP	8,778.000	2,005,421.880	
SIMON PROPERTY GROUP INC	23,931.000	3,697,100.190	
SL GREEN	7,097.000	610,342.000	
SUN COMMUNITIES INC	6,979.000	1,073,370.200	
THE MACERICH COMPANY	9,014.000	250,048.360	
UDR INC	22,345.000	1,058,482.650	
VENTAS INC	27,669.000	1,647,412.260	
VEREIT INC	69,822.000	655,628.580	
VORNADO REALTY TRUST	12,472.000	820,283.440	
WELLTOWER INC	31,541.000	2,614,118.080	
WEYERHAEUSER CO	57,621.000	1,707,310.230	
WP CAREY INC	13,039.000	1,101,273.940	
アメリカ・ドル 小計	990,475.000	67,271,788.420 (7,343,388,425)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	400,062.870
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	492,535.260
	SEGRO PLC	87,247.000	729,384.920
イギリス・ポンド 小計	212,909.000	1,621,983.050 (226,509,933)	
カナダ・ドル	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	236,241.040

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	355,528.800	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	96,671.840	
カナダ・ドル 小計		27,282.000	688,441.680 (56,810,207)	
ユーロ	COVIVIO	4,265.000	430,338.500	
	GECINA SA	3,670.000	555,638.000	
	ICADE	2,234.000	193,911.200	
	KLEPIERRE	17,042.000	563,408.520	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,558,414.000	
ユーロ 小計		38,109.000	3,301,710.220 (397,030,654)	
香港・ドル	LINK REIT	173,000.000	14,722,300.000	
香港・ドル 小計		173,000.000	14,722,300.000 (205,228,862)	
投資証券 合計		1,441,775	8,228,968,081 (8,228,968,081)	
合計			8,969,724,122 (8,969,724,122)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 609銘柄	65.32	-	-	69.07
	投資証券 40銘柄	-	-	2.11	
イギリス・ポンド	株式 95銘柄	5.69	-	-	5.90
	投資証券 3銘柄	-	-	0.07	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.12	-	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 61銘柄	2.30	-	-	2.53
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.17	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.62	-	-	3.72
	投資証券 3銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式 21銘柄	0.42	-	-	0.48
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.27	-	-	3.35
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.95	-	-	0.97
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.65	-	-	0.66
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08	-	-	0.09
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.22	-	-	0.23
ユーロ	株式 240銘柄	11.24	-	-	11.63
	投資証券 5銘柄	-	-	0.11	
香港・ドル	株式 40銘柄	1.16	-	-	1.25
	投資証券 1銘柄	-	-	0.06	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	639,845,571
投資証券	40,931,978,380
派生商品評価勘定	10,973,592
未収入金	164,788,459
未収配当金	301,996,670
差入委託証拠金	11,934,000
流動資産合計	42,061,516,672
資産合計	
42,061,516,672	
負債の部	
流動負債	
前受金	13,468,500
未払金	79,178,389
未払解約金	190,367,000
流動負債合計	283,013,889
負債合計	
283,013,889	
純資産の部	
元本等	
元本	17,448,816,585
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	24,329,686,198
元本等合計	41,778,502,783
純資産合計	
41,778,502,783	
負債純資産合計	
42,061,516,672	

## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	16,951,549,055円
同期中追加設定元本額	26,242,293,968円
同期中一部解約元本額	25,745,026,438円
元本の内訳	

ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	293,863円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	827,804円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,242,138円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	3,282,348円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	2,695,972円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,620,993円
たわらノーロード 国内リート	4,058,346,361円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	597,655,087円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	272,526,290円
たわらノーロード バランス(堅実型)	4,023,416円
たわらノーロード バランス(標準型)	76,941,024円
たわらノーロード バランス(積極型)	84,787,359円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	113,708円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	51,306,223円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	110,300,601円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	65,643,934円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	113,980,651円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,759,981円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,063,494円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,573,941円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,340,866円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,872,373円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	328,983,580円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	103,553,542円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	98,557,900円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	186,867,192円
投資のソムリエ	2,792,688,902円
投資のソムリエ<DC年金>	289,065,770円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	81,681,089円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	89,409,234円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,012,536,117円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,855,928円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,349,774円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	702,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	3,162,664円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	505,131,778円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	61,409,606円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	298,433円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	248,320円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	252,494円
Jリートインデックスファンド(DC)	23,290,104円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	87,440,668円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	790,022,390円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,445,779,617円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	425,469,752円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,648,159,115円
計	17,448,816,585円

2. 受益権の総数	17,448,816,585口
-----------	-----------------

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	2,429,464,546	
合計	2,429,464,546	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月7日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引 不動産投信指数先物取引 買建	748,201,500	-	759,213,000	11,011,500
合計	748,201,500	-	759,213,000	11,011,500

## (注) 時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3943円 (23,943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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	521	70,335,000	
	GLP投資法人	9,250	1,235,800,000	
	MCUBS MidCity 投資法人	4,405	510,980,000	
	Oneリート投資法人	579	191,938,500	
	いちごオフィスリート投資法人	2,876	312,908,800	
	いちごホテルリート投資法人	615	80,442,000	
	さくら総合リート投資法人	803	75,080,500	
	アクティブ・プロパティーズ 投資法人	1,861	1,045,882,000	
	アドバンス・レジデンス投資法 人	3,522	1,225,656,000	
	イオンリート投資法人	4,008	585,568,800	
	インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人	23,859	487,200,780	
	インヴィンシブル投資法人	16,290	1,037,673,000	
	エスコンジャパンリート投資法 人	381	46,901,100	
	オリックス不動産投資法人	7,399	1,745,424,100	
	グローバル・ワン不動産投資法 人	2,579	356,675,700	
	ケネディクス・オフィス投資法 人	1,149	942,180,000	
	ケネディクス・レジデンシャ ル・ネクスト投資法人	2,311	485,772,200	

ケネディクス商業リート投資法人	1,434	397,074,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,546	535,689,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	743	86,856,700	
サンケイリアルエステート投資法人	538	65,313,200	
ザイマックス・リート投資法人	539	70,447,300	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,963	1,040,781,000	
ジャパンエクセレント投資法人	3,326	606,662,400	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,714	2,655,510,000	
スターアジア不動産投資法人	1,232	138,969,600	
スタープロシード投資法人	578	114,964,200	
タカラレーベン不動産投資法人	1,054	124,899,000	
トーセイ・リート投資法人	808	106,494,400	
ヒューリックリート投資法人	3,158	632,231,600	
フロンティア不動産投資法人	1,319	629,163,000	
プレミアム投資法人	3,354	525,571,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	792	104,702,400	
マリモ地方創生リート投資法人	319	40,895,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,338	1,784,332,000	
ラサールロジポート投資法人	3,453	555,242,400	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	574	68,248,600	
阪急阪神リート投資法人	1,677	294,313,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	914	403,074,000	
三菱地所物流リート投資法人	731	255,119,000	
産業ファンド投資法人	4,569	761,652,300	
森トラスト・ホテルリート投資法人	871	122,985,200	
森トラスト総合リート投資法人	2,654	506,117,800	
森ヒルズリート投資法人	4,273	737,519,800	
星野リゾート・リート投資法人	565	323,745,000	
積水ハウス・リート投資法人	10,858	1,034,767,400	
大江戸温泉リート投資法人	631	60,386,700	
大和ハウスリート投資法人	5,007	1,504,603,500	
大和証券オフィス投資法人	857	718,166,000	
投資法人みらい	4,028	236,040,800	
東急リアル・エステート投資法人	2,490	491,775,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,234	831,716,000	
日本ビルファンド投資法人	3,596	2,869,608,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,351	1,174,324,500	

日本プロロジスリート投資法人	5,336	1,566,649,600	
日本ヘルスケア投資法人	180	36,162,000	
日本リート投資法人	1,206	568,629,000	
日本リートファンド投資法人	7,019	1,706,318,900	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,426	664,966,600	
日本賃貸住宅投資法人	4,177	411,434,500	
福岡リート投資法人	1,921	348,661,500	
平和不動産リート投資法人	2,313	323,126,100	
野村不動産マスターファンド投資法人	11,582	2,259,648,200	
投資証券 合計	214,656	40,931,978,380	
合計		40,931,978,380	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

（単位：円）

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	154,480,338
コール・ローン	73,405,854
投資信託受益証券	5,688,783,599
投資証券	48,143,850,180
派生商品評価勘定	550
未収入金	77,978,139
未収配当金	71,048,973
流動資産合計	54,209,547,633
資産合計	54,209,547,633
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,530
未払金	91,309,162
未払解約金	3,253,000
流動負債合計	94,591,692
負債合計	94,591,692
純資産の部	
元本等	
元本	39,743,134,014
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,371,821,927
元本等合計	54,114,955,941
純資産合計	54,114,955,941
負債純資産合計	54,209,547,633



## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>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。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</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 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11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,380,716,641円
同期中追加設定元本額	63,430,114,745円
同期中一部解約元本額	56,067,697,372円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	150,964,910円
D I A M先進国R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	100,493,786円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,762,024円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	13,257,264円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	19,739,400円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	53,172,675円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	43,458,768円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	25,759,342円
たわらノーロード 先進国リート	4,645,019,320円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	411,865,416円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	202,612,545円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	487,853,382円
たわらノーロード バランス(堅実型)	3,596,058円

たわらノーロード バランス(標準型)	68,865,223円
たわらノーロード バランス(積極型)	140,102,739円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	34,018,626円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	141,881,570円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	107,176,662円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	215,053,313円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,243,768円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,917,573円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,129,019円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,598,425円
One DC 先進国リートインデックスファンド	3,366,747円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,830,346円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	522,069,243円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	51,999,811円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	177,352,318円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	169,079,923円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	334,068,071円
投資のソムリエ	9,987,657,337円
投資のソムリエ<DC年金>	1,034,360,814円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	143,245,142円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	480,552,473円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,437,221,001円
ワールドアセットバランス(基本コース)	920,645,180円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,403,558,370円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	7,379,430円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	5,365,730円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,762,811円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	11,942,106円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,687,069,321円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	110,066,025円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	1,177,882円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	993,968円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	1,008,587円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	775,884,681円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	64,803,797円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	184,233,365円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	317,610,485円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,987,662,328円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,461,256,521円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	557,368,393円
計	39,743,134,014円
2. 受益権の総数	39,743,134,014口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	88,191,342
投資証券	224,538,274
合計	136,346,932

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月25日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	88,837,360	-	88,838,900	1,540
アメリカ・ドル	74,215,200	-	74,215,200	-
イギリス・ポンド	6,981,100	-	6,982,000	900
オーストラリア・ドル	5,236,280	-	5,236,700	420
ユーロ	2,404,780	-	2,405,000	220
買建	11,374,540	-	11,347,100	27,440
カナダ・ドル	4,124,950	-	4,125,500	550
シンガポール・ドル	7,249,590	-	7,221,600	27,990
合計	100,211,900	-	100,186,000	28,980

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和1年11月11日現在	
1口当たり純資産額	1.3616円
(1万口当たり純資産額)	(13,616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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ARA US HOSPITALITY TRUST	181,600.000	153,452.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	540,300.000	502,479.000	
	アメリカ・ドル	小計	721,900.000	655,931.000 (71,601,428)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	131,324.000	504,284.160	
		APN INDUSTRIA REIT	45,032.000	133,745.040	
		ARENA REIT	113,319.000	327,491.910	
		BWP TRUST	184,727.000	764,769.780	
		CENTURIA METROPOLITAN REIT	104,274.000	321,163.920	
		CHARTER HALL GROUP	174,239.000	1,853,902.960	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	123,470.000	660,564.500	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	137,473.000	602,131.740	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	95,570.000	340,229.200	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	715,218.000	922,631.220	
		DEXUS	405,635.000	4,660,746.150	
		GDI PROPERTY GROUP	179,630.000	278,426.500	
		GOODMAN GROUP	598,972.000	8,493,422.960	
		GPT GROUP	721,534.000	4,242,619.920	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	98,082.000	415,867.680	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	51,054.000	163,883.340	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	89,643.000	380,086.320	
		MIRVAC GROUP	1,481,638.000	4,726,425.220	
		NATIONAL STORAGE REIT	274,489.000	518,784.210	
		RURAL FUNDS GROUP	116,459.000	199,144.890	
	SCENTRE GROUP	1,990,326.000	7,702,561.620		
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	335,859.000	900,102.120		
	STOCKLAND	911,615.000	4,439,565.050		
	VICINITY CENTRES	1,205,226.000	3,145,639.860		
	VIVA ENERGY REIT	169,318.000	462,238.140		
	オーストラリア・ドル	小計	10,454,126.000	47,160,428.410 (3,528,543,253)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	173,795.000	243,313.000	
		ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	307,800.000	335,502.000	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	1,125,960.000	3,512,995.200	

	ASCOTT RESIDENCE TRUST	435,615.000	583,724.100	
	CACHE LOGISTICS TRUST	370,580.000	261,258.900	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,072,279.000	2,166,003.580	
	CAPITALAND MALL TRUST	1,065,360.000	2,652,746.400	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	276,380.000	422,861.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	296,600.000	474,560.000	
	ESR REIT	757,530.000	397,703.250	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	302,500.000	214,775.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	205,100.000	211,253.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	276,900.000	725,478.000	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	248,580.000	400,213.800	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	238,200.000	169,122.000	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	592,450.000	722,789.000	
	KEPPEL DC REIT	464,200.000	881,980.000	
	KEPPEL REIT	737,700.000	885,240.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	611,400.000	149,793.000	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	803,400.000	1,823,718.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	572,920.000	1,415,112.400	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,082,420.000	1,785,993.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	806,500.000	1,024,255.000	
	QUE COMMERCIAL REIT	920,355.000	492,389.920	
	PARKWAY LIFE REIT	144,500.000	471,070.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	295,000.000	134,225.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	147,600.000	118,818.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	329,900.000	161,651.000	
	SPH REIT	301,800.000	341,034.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	501,300.000	368,455.500	
	SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	875,290.000	1,601,780.700	
	シンガポール・ドル 小計	16,339,914.000	25,149,814.150 (2,018,272,586)	
香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	537,000.000	5,047,800.000	
香港・ドル 小計		537,000.000	5,047,800.000 (70,366,332)	

投資信託受益証券 合計			28,052,940	5,688,783,599 (5,688,783,599)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,095.000	852,624.900	
		AGREE REALTY CORP	15,814.000	1,178,301.140	
		ALEXANDER'S INC.	733.000	236,267.890	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	42,378.000	6,522,397.980	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,581.000	822,087.560	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	51,496.000	2,425,976.560	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	38,531.000	569,102.870	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	95,529.000	2,456,050.590	
		AMERICOLD REALTY TRUST	71,803.000	2,538,236.050	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	55,754.000	2,964,440.180	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	79,237.000	1,297,109.690	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25,699.000	73,242.150	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	52,142.000	10,941,998.700	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,367.000	97,140.870	
		BOSTON PROPERTIES INC	53,700.000	7,428,858.000	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	11,492.000	105,841.320	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	66,523.000	1,014,475.750	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	111,648.000	2,408,247.360	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	28,083.000	534,559.900	
		BRT APARTMENTS CORP	2,813.000	48,974.330	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	36,221.000	3,988,656.520	
		CARETRUST REIT INC	36,305.000	744,615.550	
		CBL & ASSOCIATES	70,695.000	109,577.250	
		CEDAR REALTY TRUST INC	27,397.000	75,889.690	
		CHATHAM LODGING TRUST	17,523.000	319,269.060	
		CITY OFFICE REIT INC	20,161.000	268,141.300	
		CLIPPER REALTY INC	5,169.000	52,723.800	
		COLONY CAPITAL INC	180,283.000	901,415.000	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	43,082.000	895,674.780	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	7,097.000	320,642.460	
CORECIVIC INC	42,991.000	694,304.650			
COREPOINT LODGING INC	14,852.000	145,549.600			
CORESITE REALTY CORP	13,864.000	1,575,366.320			



CORPORATE OFFICE PROPERTIES	42,169.000	1,233,443.250	
COUSINS PROPERTIES INC	55,044.000	2,191,301.640	
CUBESMART	72,170.000	2,235,826.600	
CYRUSONE INC	42,392.000	2,780,915.200	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	73,564.000	757,709.200	
DIGITAL REALTY TRUST INC	77,800.000	9,069,146.000	
DOUGLAS EMMETT INC	61,724.000	2,668,945.760	
DUKE REALTY TRUST	135,152.000	4,674,907.680	
EAST GROUP	14,101.000	1,846,102.920	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	25,807.000	589,431.880	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	54,274.000	785,887.520	
EPR PROPERTIES	29,089.000	2,125,242.340	
EQUINIX INC	31,656.000	16,787,493.360	
EQUITY COMMONWEALTH	45,867.000	1,463,157.300	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	68,082.000	4,549,239.240	
EQUITY RESIDENTIAL	130,151.000	10,930,080.980	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	27,567.000	711,779.940	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,551.000	7,731,600.920	
EXTRA SPACE STORAGE INC	48,044.000	5,106,596.760	
FARMLAND PARTNERS INC	9,630.000	65,195.100	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,091.000	3,430,444.680	
FIRST INDUSTRIAL RT	47,470.000	1,966,207.400	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	25,645.000	695,235.950	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	39,880.000	346,158.400	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	17,285.000	193,246.300	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	76,358.000	3,208,563.160	
GEO GROUP INC	43,755.000	663,763.350	
GETTY REALTY CORP	12,621.000	416,366.790	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,604.000	241,241.000	
GLADSTONE LAND CORP	7,339.000	88,801.900	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,391.000	151,541.930	
GLOBAL NET LEASE INC	30,585.000	602,830.350	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	48,571.000	1,563,014.780	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	76,928.000	2,237,835.520	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	183,504.000	6,182,249.760	

HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,669.000	194,099.800	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	38,950.000	1,810,006.500	
HOST HOTELS & RESORTS INC	272,943.000	4,686,431.310	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	57,931.000	2,049,598.780	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	33,184.000	474,863.040	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	23,928.000	513,734.160	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	4,211.000	358,861.420	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4,334.000	311,961.320	
INVITATION HOMES INC	178,878.000	5,278,689.780	
IRON MOUNTAIN INC	107,439.000	3,496,065.060	
JBG SMITH PROPERTIES	44,330.000	1,759,014.400	
KILROY REALTY CORP	34,793.000	2,877,381.100	
KIMCO REALTY	158,004.000	3,294,383.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	30,500.000	549,000.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	91,377.000	979,561.440	
LIBERTY PROPERTY TRUST	59,053.000	3,466,411.100	
LIFE STORAGE INC	17,517.000	1,892,186.340	
LTC PROPERTIES INC	15,130.000	701,880.700	
MACK CALI	33,250.000	726,845.000	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	167,056.000	3,332,767.200	
MID AMERICA	42,622.000	5,710,921.780	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	35,095.000	516,598.400	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,320.000	1,293,686.400	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	64,229.000	3,545,440.800	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	21,768.000	703,541.760	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	29,202.000	219,599.040	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,962.000	366,092.760	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,451.000	570,124.170	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	81,051.000	3,328,764.570	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,334.000	141,244.320	
PARAMOUNT GROUP INC	76,006.000	1,041,282.200	
PARK HOTELS & RESORTS INC	89,926.000	2,070,096.520	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	49,184.000	1,302,392.320	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	21,989.000	126,656.640	

PHYSICIANS REALTY TRUST	69,798.000	1,266,135.720	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,477.000	1,037,372.450	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,788.000	84,077.280	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	15,295.000	199,446.800	
PROLOGIS INC	235,585.000	20,512,385.950	
PS BUSINESS PARKS	7,538.000	1,325,029.640	
PUBLIC STORAGE	56,025.000	11,840,883.750	
QTS REALTY TRUST INC	20,860.000	1,057,184.800	
REALTY INCOME CORP	118,836.000	9,069,563.520	
REGENCY CENTERS CORP	62,678.000	4,052,759.480	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	42,011.000	760,819.210	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	80,573.000	1,107,073.020	
RETAIL VALUE INC	5,575.000	204,156.500	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	41,196.000	1,905,726.960	
RLJ LODGING TRUST	64,925.000	1,099,180.250	
RPT REALTY	29,726.000	429,243.440	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,331.000	1,735,150.560	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	71,204.000	1,617,042.840	
SAFEHOLD INC	3,465.000	116,943.750	
SAUL CENTERS INC	4,102.000	217,118.860	
SENIOR HOUSING PPTYS TRUST	90,220.000	751,532.600	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	12,158.000	529,237.740	
SERVICE PROPERTIES TRUST	61,826.000	1,483,205.740	
SIMON PROPERTY GROUP INC	114,964.000	17,760,788.360	
SITE CENTERS CORP	54,598.000	806,412.460	
SL GREEN	30,883.000	2,655,938.000	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	33,858.000	1,670,553.720	
STAG INDUSTRIAL INC	47,827.000	1,435,766.540	
STORE CAPITAL CORP	78,702.000	3,055,211.640	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,731.000	466,321.240	
SUN COMMUNITIES INC	33,893.000	5,212,743.400	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	84,757.000	1,184,055.290	
TANGER FACTORY OUTLET	33,935.000	538,209.100	
TAUBMAN CENTERS INC	22,515.000	792,302.850	
TERRENO REALTY CORP	24,668.000	1,370,307.400	
THE MACERICH COMPANY	41,522.000	1,151,820.280	

	UDR INC	109,465.000	5,185,357.050	
	UMH PROPERTIES INC	13,782.000	207,694.740	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,842.000	558,185.760	
	URBAN EDGE PROPERTIES	42,402.000	877,297.380	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,510.000	250,453.300	
	VENTAS INC	139,152.000	8,285,110.080	
	VEREIT INC	394,879.000	3,707,913.810	
	VICI PROPERTIES INC	172,439.000	4,186,818.920	
	VORNADO REALTY TRUST	59,255.000	3,897,201.350	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	65,686.000	284,420.380	
	WASHINGTON REIT	29,508.000	907,961.160	
	WEINGARTEN REALTY INVST	45,501.000	1,417,811.160	
	WELLTOWER INC	151,211.000	12,532,367.680	
	WHITESTONE REIT	14,179.000	194,535.880	
	WP CAREY INC	63,835.000	5,391,504.100	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	41,488.000	880,375.360	
アメリカ・ドル	小計	8,212,714.000	363,856,157.410 (39,718,538,143)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	43,260.000	41,010.480	
	ASSURA PLC	908,989.000	662,652.980	
	BIG YELLOW GROUP PLC	58,650.000	675,061.500	
	BRITISH LAND CO PLC	352,767.000	2,021,354.910	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	135,437.000	35,619.930	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	234,226.000	203,776.620	
	DERWENT LONDON PLC	39,535.000	1,389,259.900	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	225,310.000	215,171.050	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	99,223.000	770,962.710	
	HAMMERSON PLC	290,611.000	818,360.570	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	145,379.000	146,542.030	
	INTU PROPERTIES PLC	310,885.000	109,431.520	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	281,246.000	2,480,589.720	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	317,439.000	735,188.720	
	LXI REIT PLC	192,272.000	243,416.350	
	NEWRIVER REIT PLC	113,130.000	221,282.280	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	206,987.000	188,565.150	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	452,001.000	632,801.400	
	RDI REIT PLC	102,698.000	135,150.560	
	REGIONAL REIT LTD	144,064.000	152,995.960	

	SAFESTORE HOLDINGS LTD	76,888.000	536,293.800	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	186,278.000	105,247.070	
	SEGRO PLC	405,607.000	3,390,874.520	
	SHAFTESBURY PLC	83,554.000	759,923.630	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	136,136.000	119,799.680	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	643,053.000	945,287.910	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	310,618.000	268,684.570	
	UNITE GROUP PLC	109,135.000	1,232,134.150	
	WORKSPACE GROUP PLC	46,849.000	495,662.420	
イギリス・ポンド 小計		6,652,227.000	19,733,102.090 (2,755,727,707)	
イスラエル・シケル	REIT 1 LTD	64,513.000	1,366,385.340	
イスラエル・シケル 小計		64,513.000	1,366,385.340 (42,672,214)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	21,555.000	1,147,157.100	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,752.000	298,208.160	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,372.000	364,935.480	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	29,507.000	1,598,099.120	
	CHOICE PROPERTIES REIT	57,777.000	773,056.260	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	32,787.000	452,788.470	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	16,832.000	265,272.320	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	25,272.000	380,090.880	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	35,891.000	599,020.790	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	21,325.000	285,328.500	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10,223.000	296,875.920	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,068.000	663,581.880	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	53,018.000	1,165,335.640	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	22,001.000	350,695.940	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,674.000	323,975.820	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,934.000	157,540.480	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,453.000	121,316.400	
NORTHVIEW APARTMENT REIT	10,981.000	317,460.710		

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,311.000	263,492.910	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	56,257.000	1,485,184.800	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	72,594.790	
	SLATE RETAIL REIT	6,406.000	82,381.160	
	SMARTCENTRES REIT	26,666.000	840,512.320	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	19,975.000	248,089.500	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	10,465.000	72,522.450	
カナダ・ドル 小計		565,581.000	12,625,517.800 (1,041,857,729)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	309,776.000	439,881.920	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	419,173.000	880,263.300	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	550,997.000	862,310.300	
	PRECINCT PROPERTIES	392,430.000	706,374.000	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	117,527.000	305,570.200	
ニュージーランド・ドル 小計		1,789,903.000	3,194,399.720 (221,020,517)	
ユーロ	AEDIFICA	9,274.000	1,034,978.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	59,378.000	994,581.500	
	ALTAREA	1,317.000	252,864.000	
	BEFIMMO	8,297.000	480,396.300	
	COFINIMMO SA	9,244.000	1,244,242.400	
	COVIVIO	16,596.000	1,674,536.400	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,743.000	431,043.340	
	GECINA SA	20,525.000	3,107,485.000	
	GREEN REIT PLC	251,137.000	479,671.670	
	HAMBORNER REIT AG	25,203.000	244,670.720	
	HIBERNIA REIT PLC	253,317.000	361,230.040	
	ICADE	10,554.000	916,087.200	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	17,218.000	102,102.740	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	89,766.000	1,042,183.260	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,838.000	214,761.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	124,223.000	212,421.330	
	KLEPIERRE	77,739.000	2,570,051.340	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	23,938.000	191,025.240	
	MERCIALYS	9,805.000	120,993.700	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	137,510.000	1,780,754.500	

	MONTEA SCA	4,022.000	322,564.400	
	NSI NV	5,922.000	244,282.500	
	RETAIL ESTATES	2,953.000	260,749.900	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	51,410.000	7,351,630.000	
	VASTNED RETAIL	7,327.000	218,710.950	
	WAREHOUSES DE PAUW	6,611.000	1,085,526.200	
	WERELDHAVE NV	14,790.000	315,618.600	
	ユーロ 小計	1,261,657.000	27,255,162.830 (3,277,433,330)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	12,185.000	108,446,500.000	
	韓国・ウォン 小計	12,185.000	108,446,500.000 (10,215,660)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	725,070.000	3,792,116.100	
	LINK REIT	786,520.000	66,932,852.000	
	PROSPERITY REIT	491,000.000	1,517,190.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	391,000.000	2,111,400.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	540,000.000	2,862,000.000	
	香港・ドル 小計	2,933,590.000	77,215,558.100 (1,076,384,880)	
投資証券 合計		21,492,370	48,143,850,180 (48,143,850,180)	
合計			53,832,633,779 (53,832,633,779)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 2銘柄	0.13	-	73.91
	投資証券 154銘柄	-	73.40	
イギリス・ポンド	投資証券 29銘柄	-	5.09	5.12
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.08	0.08
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	6.52	-	6.55
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-	1.93	1.94
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	3.73	-	3.75
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.41	0.41
ユーロ	投資証券 27銘柄	-	6.06	6.09
韓国・ウォン	投資証券 1銘柄	-	0.02	0.02
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.13	-	2.13
	投資証券 5銘柄	-	1.99	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



エマージング債券パッシブ・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,564,840,629
コール・ローン	2,337,048,870
国債証券	146,263,748,055
未収利息	827,051,941
前払費用	803,064,403
流動資産合計	154,795,753,898
資産合計	154,795,753,898
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,113,371
未払金	3,675,526,360
未払解約金	1,079,400
流動負債合計	3,679,719,131
負債合計	3,679,719,131
純資産の部	
元本等	
元本	74,574,074,462
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	76,541,960,305
元本等合計	151,116,034,767
純資産合計	151,116,034,767
負債純資産合計	154,795,753,898

## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	令和1年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	44,101,164,374円
同期中追加設定元本額	126,175,631,129円
同期中一部解約元本額	95,702,721,041円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	240,595,848円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	331,293,464円
たわらノーロード バランス（堅実型）	19,539,805円
たわらノーロード バランス（標準型）	56,119,213円
たわらノーロード バランス（積極型）	23,785,681円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	311,382円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,502,400円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	2,014,068円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	564,873円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	643,637円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	60,377,569円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国10）	196,542,262円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国20）	192,934,174円
DIAM DC 8資産バランスファンド（新興国30）	380,855,680円
投資のソムリエ	11,399,627,407円
クルーズコントロール	841,662,876円
投資のソムリエ<DC年金>	1,181,261,678円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	158,257,813円
クルーズコントロール<DC年金>	855,486円
DIAMコア資産設計ファンド（堅実型）	5,623,590円
DIAMコア資産設計ファンド（積極型）	13,036,637円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	683,788,319円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,733,581,258円
ワールドアセットバランス（基本コース）	925,526,321円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,471,489,135円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	7,518,257円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	5,469,058円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	5,355,505円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	12,805,832円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,856,551,961円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	126,191,910円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	1,211,601円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	1,022,964円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	1,032,225円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	28,039,609,016円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,918,213,094円
エマージング債券パッシブファンドVA（適格機関投資家専用）	89,218,318円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA（適格機関投資家限定）	219,292,117円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	152,855,945円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,983,944,402円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,231,991,681円
計	74,574,074,462円

2. 受益権の総数

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	287,488,091
合計	287,488,091

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年4月19日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	1,500,000,000	-	1,496,886,629	3,113,371
合計	1,500,000,000	-	1,496,886,629	3,113,371

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0264円 (20,264円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和1年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	28,800,000.000	28,785,600.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	22,100,000.000	23,453,625.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	6,000,000.000	6,278,820.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	13,800,000.000	14,669,538.000	
		BRAZIL 4.875 01/22/21	3,000,000.000	3,102,780.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	14,800,000.000	14,943,486.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	13,100,000.000	14,406,004.500	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	14,600,000.000	16,037,297.000	

BRAZIL 6.0 04/07/26	10,800,000.000	12,549,708.000	
BRAZIL 7.125 01/20/37	10,300,000.000	13,040,778.500	
BRAZIL 8.25 01/20/34	9,200,000.000	12,561,680.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	6,096,480.000	
COLOMBIA 2.625 03/15/23	10,700,000.000	10,731,297.500	
COLOMBIA 3.875 04/25/27	13,600,000.000	14,379,926.000	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	9,100,000.000	9,574,747.000	
COLOMBIA 4.375 07/12/21	6,200,000.000	6,403,112.000	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	8,000,000.000	8,703,000.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	11,000,000.000	12,164,322.500	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	20,000,000.000	22,818,700.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	10,000,000.000	11,746,000.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	13,000,000.000	15,823,535.000	
COLOMBIA 6.125 01/18/41	11,000,000.000	14,007,895.000	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	9,400,000.000	13,215,883.000	
COLOMBIA 8.125 05/21/24	8,900,000.000	10,906,505.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	11,400,000.000	12,592,759.200	
CROATIA 6.0 01/26/24	13,400,000.000	15,392,151.200	
CROATIA 6.375 03/24/21	20,400,000.000	21,389,400.000	
HUNGARY 5.375 02/21/23	11,600,000.000	12,687,766.800	
HUNGARY 5.375 03/25/24	9,600,000.000	10,770,076.800	
HUNGARY 5.75 11/22/23	14,000,000.000	15,781,990.000	
HUNGARY 6.375 03/29/21	10,000,000.000	10,592,350.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	7,400,000.000	12,028,293.000	
INDONESIA 3.375 04/15/23	11,700,000.000	11,994,843.620	
INDONESIA 3.5 01/11/28	5,200,000.000	5,383,649.330	
INDONESIA 3.85 07/18/27	7,600,000.000	8,011,920.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	7,000,000.000	7,531,405.890	
INDONESIA 4.125 01/15/25	13,800,000.000	14,719,201.840	
INDONESIA 4.35 01/08/27	11,000,000.000	11,985,406.400	
INDONESIA 4.35 01/11/48	9,000,000.000	9,782,366.130	
INDONESIA 4.625 04/15/43	5,400,000.000	5,961,007.080	
INDONESIA 4.75 01/08/26	9,800,000.000	10,798,600.490	
INDONESIA 4.75 02/11/29	7,000,000.000	7,936,955.390	
INDONESIA 4.875 05/05/21	7,100,000.000	7,366,031.390	
INDONESIA 5.125 01/15/45	7,400,000.000	8,718,332.200	
INDONESIA 5.25 01/08/47	3,400,000.000	4,114,032.980	
INDONESIA 5.25 01/17/42	10,300,000.000	12,273,656.740	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	3,801,816.810	
INDONESIA 5.875 01/15/24	13,200,000.000	14,875,746.990	
INDONESIA 5.95 01/08/46	10,200,000.000	13,432,694.360	
INDONESIA 6.75 01/15/44	8,500,000.000	12,041,407.360	
INDONESIA 7.75 01/17/38	8,500,000.000	12,590,439.700	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,488,158.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	9,100,000.000	9,822,312.500	
PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	10,703,695.500	
PANAMA 4.5 05/15/47	7,000,000.000	8,109,045.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	7,900,000.000	10,899,630.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	5,800,000.000	7,259,265.500	

PANAMA 9.375 04/01/29	5,900,000.000	8,934,650.250	
PERU 4.125 08/25/27	5,300,000.000	5,891,466.750	
PERU 5.625 11/18/50	11,000,000.000	15,712,785.000	
PERU 6.55 03/14/37	6,000,000.000	8,545,200.000	
PERU 7.35 07/21/25	7,300,000.000	9,109,305.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	12,000,000.000	12,386,104.430	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	13,000,000.000	14,436,787.680	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	10,600,000.000	11,706,548.840	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,513,629.300	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,718,318.850	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	14,800,000.000	15,997,222.460	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	7,800,000.000	9,959,020.020	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	5,600,000.000	6,658,002.680	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	6,600,000.000	8,955,833.290	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	7,000,000.000	9,838,760.190	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	7,100,000.000	10,521,511.440	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	9,800,000.000	15,602,976.600	
ROMANIA 4.375 08/22/23	8,000,000.000	8,509,784.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	7,217,258.400	
ROMANIA 5.125 06/15/48	6,600,000.000	7,478,512.800	
ROMANIA 6.125 01/22/44	4,400,000.000	5,639,502.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	8,500,000.000	9,292,540.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	11,859,000.000	13,482,615.690	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	10,400,000.000	11,157,463.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	19,400,000.000	20,996,387.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	15,800,000.000	16,631,585.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	16,400,000.000	18,062,336.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	13,400,000.000	14,674,809.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	12,000,000.000	13,689,240.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	31,000,000.000	36,581,705.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	18,000,000.000	22,139,028.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	7,200,000.000	9,137,484.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	9,200,000.000	8,906,823.600	

SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	10,100,000.000	10,562,367.900	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,562,842.400	
SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	6,800,000.000	6,208,570.000	
SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	5,800,000.000	5,544,034.400	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	6,200,000.000	6,045,775.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	8,000,000.000	8,608,160.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	6,400,000.000	6,812,243.200	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	10,070,448.800	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,230,040.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	13,200,000.000	13,760,340.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	12,900,000.000	13,325,700.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	11,200,000.000	11,561,312.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	19,500,000.000	20,556,022.500	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	12,000,000.000	12,777,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	13,400,000.000	14,224,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	7,143,395.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	16,000,000.000	17,384,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	15,000,000.000	15,809,025.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	13,400,000.000	14,199,779.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	14,400,000.000	15,507,864.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	10,400,000.000	12,515,724.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	13,800,000.000	15,779,403.000	
UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	13,900,000.000	17,700,746.500	
UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	7,200,000.000	9,691,200.000	
アメリカ・ドル 小計	1,178,959,000.000 (128,695,164,440)	1,339,902,418.970 (146,263,748,055)	



国債証券 合計	128,695,164,440 (128,695,164,440)	146,263,748,055 (146,263,748,055)	
合計		146,263,748,055 (146,263,748,055)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 114銘柄	96.79	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和1年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,415,856,734
コール・ローン	48,488,514
株式	41,367,880,713
新株予約権証券	772,812
投資信託受益証券	374,453,001
投資証券	100,233,581
派生商品評価勘定	361,935,168
未収入金	300,786
未収配当金	36,603,685
差入委託証拠金	885,672,702
流動資産合計	50,592,197,696
資産合計	50,592,197,696
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	15,575,890
未払解約金	17,254,900
流動負債合計	32,830,790
負債合計	32,830,790
純資産の部	
元本等	
元本	42,960,776,794
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,598,590,112
元本等合計	50,559,366,906
純資産合計	50,559,366,906
負債純資産合計	50,592,197,696

## 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11月13日 至 令和1年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和1年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額 同期中追加設定元本額 同期中一部解約元本額	45,635,552,863円 52,564,439,279円 55,239,215,348円

元本の内訳	
ファンド名	
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	5,369,931,508円
DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	549,488,140円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,893,207円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	10,581,840円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	12,555,715円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	32,315,781円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	33,694,719円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,381,979円
たわらノーロード 新興国株式	5,474,547,557円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,022,487,712円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	578,552,846円
たわらノーロード バランス(堅実型)	4,310,356円
たわらノーロード バランス(標準型)	16,070,106円
たわらノーロード バランス(積極型)	27,245,304円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	245,736円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	27,654,570円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	64,885,647円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	43,569,673円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	81,961,115円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	378,645円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,016,114円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	398,949円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,137,315円
たわらノーロード 全世界株式	15,388,190円
One DC 新興国株式インデックスファンド	870,210円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	448,994,072円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	357,798,598円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	347,912,071円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	675,942,761円
投資のソムリエ	6,692,166,818円
クルーズコントロール	1,561,468,158円
投資のソムリエ<DC年金>	692,941,250円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	300,696,982円
クルーズコントロール<DC年金>	1,583,302円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	26,172,768円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	60,395,653円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	475,886,432円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,385,537,096円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,555,716,267円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	6,220,771,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	6,078,456円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,419,981円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,727,329円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,391,518円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,700,992,497円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	219,719,138円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	991,754円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	842,094円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	850,227円
エマージング株式パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	164,870,533円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	387,941,806円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	270,405,007円
計	42,960,776,794円
2. 受益権の総数	42,960,776,794口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成30年11月13日 至 令和1年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和1年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	578,935,783
新株予約権証券	412,122
投資信託受益証券	17,069,159
投資証券	161,583
合計	596,578,647

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年4月19日から令和1年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和1年11月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	15,585,385	-	15,583,842	1,543	
アメリカ・ドル	15,497,880	-	15,497,880	-	
ブラジル・レアル	87,505	-	85,962	1,543	
買建	87,505	-	86,018	1,487	
アメリカ・ドル	87,505	-	86,018	1,487	
合計	15,672,890	-	15,669,860	56	

(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11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引					
買建	8,334,861,586	-	8,681,220,808	346,359,222	
合計	8,334,861,586	-	8,681,220,808	346,359,222	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和1年11月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1769円 (11,769円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和1年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	BBVA ARGENTINA SA ADR	6,180	3.430	21,197.400	
	TRIP.COM GROUP LTD ADR	29,012	34.170	991,340.040	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,930	15.270	227,981.100	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	69,900	6.030	421,497.000	
	CREDICORP LTD	4,306	206.750	890,265.500	
	SINA CORP	3,696	42.710	157,856.160	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	28,464	9.390	267,276.960	
	NETEASE INC-ADR	4,646	299.040	1,389,339.840	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	4,128	12.410	51,228.480	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,523	37.790	208,714.170	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	7,366	9.040	66,588.640	
	TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SP ADR	6,230	6.730	41,927.900	
	YPF SA ADR	8,927	9.420	84,092.340	
	LUKOIL SPON ADR	26,560	94.400	2,507,264.000	
	GAZPROM PAO ADR	361,911	8.274	2,994,451.610	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	102,425	5.070	519,294.750	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	66,800	0.884	59,051.200	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,736	1.100	95,409.600	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	40,348	7.255	292,724.740	
	51JOB INC ADR	1,814	81.130	147,169.820	
X5 RETAIL GROUP NV GDR	8,930	34.900	311,657.000		
NOVATEK PJSC GDR	6,184	213.400	1,319,665.600		
BAIDU INC -SPON ADR	18,625	124.560	2,319,930.000		
NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,150	20.580	250,047.000		
BANCO MACRO SA ADR	3,717	23.600	87,721.200		



	MMC NORILSK NICKEL ADR	44,004	28.960	1,274,355.840	
	ROSNEFT OIL CO GDR	73,565	7.102	522,458.630	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	9,695	120.430	1,167,568.850	
	SEVERSTAL GDR	17,178	14.120	242,553.360	
	TATNEFT ADR	17,571	73.920	1,298,848.320	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	15,136	7.810	118,212.160	
	VTB BANK OJSC GDR	172,000	1.429	245,788.000	
	DP WORLD PLC	12,841	13.010	167,061.410	
	MAGNIT PJSC GDR	21,066	12.080	254,477.280	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,862	11.880	366,640.560	
	PAMPA ENERGIA SA ADR	5,773	14.030	80,995.190	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	26,298	44.590	1,172,627.820	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	407	33.160	13,496.120	
	SBERBANK ADR	185,668	15.125	2,808,228.500	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	12.780	176,159.520	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	8,822	37.080	327,119.760	
	YY INC-ADR	4,178	65.030	271,695.340	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	4,404	42.920	189,019.680	
	NIO INC ADR	62,042	1.980	122,843.160	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	6,256	14.000	87,584.000	
	58.COM INC ADR	6,955	55.250	384,263.750	
	AUTOHOME INC ADR	3,720	73.230	272,415.600	
	WEIBO CORP ADR	4,093	54.670	223,764.310	
	JD.COM INC ADR	48,777	33.230	1,620,859.710	
	GLOBANT SA	2,096	99.110	207,734.560	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	95,541	187.160	17,881,453.560	
	MOMO INC SPON ADR	9,385	38.800	364,138.000	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,717	42.480	157,898.160	
	PINDUODUO INC ADR	12,456	43.230	538,472.880	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	23,227	43.850	1,018,503.950	
	IQIYI INC ADR	9,440	19.520	184,268.800	
	POLYUS PJSC GDR	4,556	56.150	255,819.400	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	1,538	22.400	34,451.200	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	19,971	22.450	448,348.950	
アメリカ・ドル	小計	1,906,530		50,223,818.380 (5,482,432,014)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.260	716,122.700	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	118,789	16.600	1,971,897.400	

	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	177,861	7.790	1,385,537.190	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	176,159	15.300	2,695,232.700	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	193,358	4.130	798,568.540	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	194,346	2.290	445,052.340	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	77,463	3.600	278,866.800	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.930	343,860.380	
アラブ首長国連邦・ディルハム 小計		1,252,287		8,635,138.050 (257,068,060)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,843	12.100	191,700.300	
イギリス・ポンド 小計		15,843		191,700.300 (26,770,947)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	194,344	1,445.500	280,924,252.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	39,255	502.750	19,735,451.250	
	ASIAN PAINTS LTD	18,318	1,794.850	32,878,062.300	
	EICHER MOTORS LTD	813	21,689.650	17,633,685.450	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	18,384	774.000	14,229,216.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	49,933	580.000	28,961,140.000	
	SHREE CEMENT LTD	702	19,985.950	14,030,136.900	
	ICICI BANK LTD	159,611	489.450	78,121,603.950	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	46,395	293.950	13,637,810.250	
	STATE BANK OF INDIA LTD	116,610	316.000	36,848,760.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,991	570.900	7,416,561.900	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	26,242	439.550	11,534,671.100	
	TATA STEEL LTD	30,106	397.950	11,980,682.700	
	TATA MOTORS LTD	111,599	169.050	18,865,810.950	
	JSW STEEL LTD	47,195	250.000	11,798,750.000	
	TATA POWER CO LTD	100,483	59.550	5,983,762.650	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,615	3,158.000	11,416,170.000	
	NESTLE INDIA LTD	1,484	14,471.300	21,475,409.200	
	GAIL INDIA LTD	96,058	127.050	12,204,168.900	
	VEDANTA LTD	133,208	155.500	20,713,844.000	
	AXIS BANK LTD	127,655	725.500	92,613,702.500	
	TITAN COMPANY LTD	20,828	1,156.750	24,092,789.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	157,916	138.300	21,839,782.800	
	LUPIN LTD	18,852	718.750	13,549,875.000	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,110	4,159.450	46,211,489.500	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	108,853	2,233.200	243,090,519.600	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	30,410	287.500	8,742,875.000		
INFOSYS LTD	228,666	708.150	161,929,827.900		

WIPRO LTD	82,231	256.400	21,084,028.400	
INDIAN OIL CORP LTD	115,396	134.050	15,468,833.800	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	43,350	2,086.400	90,445,440.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	38,459	1,150.100	44,231,695.900	
DABUR INDIA LTD	31,309	473.650	14,829,507.850	
HERO MOTOCORP LTD	7,538	2,646.950	19,952,709.100	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,489	2,822.100	21,134,706.900	
BHARTI AIRTEL LTD	145,571	369.150	53,737,534.650	
UNITED SPIRITS LTD	24,162	633.050	15,295,754.100	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	57,096	422.100	24,100,221.600	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,865	1,699.950	9,970,206.750	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,831	7,200.550	49,186,957.050	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	9,463	286.450	2,710,676.350	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,361	439.950	9,837,721.950	
HAVELLS INDIA LTD	18,543	707.500	13,119,172.500	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	40,483	129.250	5,232,427.750	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,479	1,116.350	16,163,631.650	
PETRONET LNG LTD	40,593	283.400	11,504,056.200	
CIPLA LTD/INDIA	26,157	462.500	12,097,612.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	33,228	1,423.000	47,283,444.000	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,693	4,147.250	27,757,544.250	
ASHOK LEYLAND LTD	64,420	76.550	4,931,351.000	
BOSCH LTD	529	15,353.850	8,122,186.650	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	60,539	2,129.950	128,945,043.050	
NTPC LTD	159,661	117.400	18,744,201.400	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,293	1,776.550	9,403,279.150	
YES BANK LTD	104,338	68.950	7,194,105.100	
AMBUJA CEMENTS LTD	33,112	202.250	6,696,902.000	
BHARAT FORGE LTD	8,492	426.650	3,623,111.800	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	73,359	203.850	14,954,232.150	
ITC LTD	236,170	260.500	61,522,285.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,127	1,354.150	12,359,327.050	
UNITED PHOSPHORUS LTD	35,623	555.850	19,801,044.550	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,088	734.500	16,223,636.000	
TECH MAHINDRA LTD	29,546	771.350	22,790,307.100	
VODAFONE IDEA LTD	248,533	3.750	931,998.750	
MARICO LTD	37,213	370.600	13,791,137.800	
PAGE INDUSTRIES LTD	355	24,403.100	8,663,100.500	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	111,822	191.650	21,430,686.300	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	46,478	386.150	17,947,479.700	

	REC LTD	55,173	138.750	7,655,253.750	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,733	8,818.850	24,101,917.050	
	BAJAJ AUTO LTD	6,471	3,245.550	21,001,954.050	
	COAL INDIA LTD	78,544	209.250	16,435,332.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	11,467	329.000	3,772,643.000	
	BHARTI INFRA TEL LTD	32,296	218.300	7,050,216.800	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	14,918	241.650	3,604,934.700	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	41.650	97,169.450	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	32,930	567.900	18,700,947.000	
	BANDHAN BANK LTD	26,000	550.800	14,320,800.000	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,108	1,968.850	15,963,435.800	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	8,255	1,320.450	10,900,314.750	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,373	1,530.000	8,220,690.000	
インド・ルビー	小計	4,260,232		2,357,505,717.450 (3,630,558,805)	
インドネシ ア・ルビア	BARITO PACIFIC TBK PT	1,499,800	980.000	1,469,804,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	143,901	23,275.000	3,349,295,775.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	347,600	7,750.000	2,693,900,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	92,100	43,150.000	3,974,115,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,318,300	6,625.000	8,733,737,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	3,243,700	4,110.000	13,331,607,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	364,900	7,600.000	2,773,240,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,000	53,500.000	1,712,000,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	2,060.000	1,638,730,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	94,000	20,550.000	1,931,700,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	256,700	8,200.000	2,104,940,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	230,000	2,580.000	593,400,000.000	
	BANK MANDIRI	1,246,000	7,100.000	8,846,600,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	86,800	11,800.000	1,024,240,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,700,600	3,990.000	14,765,394,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	806,800	2,000.000	1,613,600,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	491,500	7,675.000	3,772,262,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,024,700	1,585.000	1,624,149,500.000	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	219,900	12,825.000	2,820,217,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	651,500	31,400.000	20,457,100,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	145,625	5,100.000	742,687,500.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,405.000	1,048,832,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,016,200	1,415.000	1,437,923,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,659,900	580.000	962,742,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,800	11,275.000	1,869,395,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	526,900	1,890.000	995,841,000.000	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	450,000	1,175.000	528,750,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	21,357,226		106,816,203,775.000 (833,166,389)	
オフショア・ 人民元	LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	85.620	659,274.000	
	LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	29,450	34.460	1,014,847.000	
	FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	120,200	5.980	718,796.000	
	NEW HOPE LIUHE CO LTD	30,900	22.400	692,160.000	
	IFLYTEK CO LTD	11,600	34.500	400,200.000	
	BANK OF NINGBO CO LTD	29,400	28.350	833,490.000	
	YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	8,500	89.600	761,600.000	
	EAST MONEY INFORMATION CO LTD	40,200	15.070	605,814.000	
	JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	5,300	99.580	527,774.000	
	WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,300	134.590	1,924,637.000	
	SUNING.COM CO LTD	56,100	10.770	604,197.000	
	BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	168,300	3.630	610,929.000	
	CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	33,200	18.710	621,172.000	
	GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	13,500	63.610	858,735.000	
	MIDEA GROUP CO LTD	14,500	59.620	864,490.000	
	HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	38,800	34.400	1,334,720.000	
	GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,200	12.090	207,948.000	
	PING AN BANK CO LTD	63,800	16.650	1,062,270.000	

WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	20,200	38.880	785,376.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	125,700	4.820	605,874.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,800	26.740	1,117,732.000	
ZTE CORP	9,700	32.850	318,645.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	42,000	12.770	536,340.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	26,200	12.870	337,194.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	71,690	9.390	673,169.100	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	16,120	26.520	427,502.400	
PETROCHINA CO LTD	46,100	5.790	266,919.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	184,100	5.870	1,080,667.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	220,200	3.610	794,922.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.680	309,120.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	131,200	4.930	646,816.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	75,300	37.750	2,842,575.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	38,500	89.170	3,433,045.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	85,600	19.880	1,701,728.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	121,200	12.570	1,523,484.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	161,800	6.200	1,003,160.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	32,200	23.750	764,750.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,400	1,205.000	5,302,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	149,500	5.660	846,170.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	45,200	22.420	1,013,384.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	24,800	36.810	912,888.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	85,200	18.000	1,533,600.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	80,000	7.750	620,000.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	197,700	4.460	881,742.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	128,800	5.160	664,608.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	39,100	5.330	208,403.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	44,200	14.220	628,524.000	

INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	25,000	29.470	736,750.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	119,400	5.640	673,416.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	140,700	5.960	838,572.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	20,600	43.680	899,808.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	30,700	16.250	498,875.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	50,800	14.620	742,696.000	
CRRC CORP LTD	116,500	7.190	837,635.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	15,100	91.300	1,378,630.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	64,400	9.710	625,324.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	34,700	17.710	614,537.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	108,500	5.830	632,555.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	6,100	26.920	164,212.000	
GEMDALE CORP	40,600	11.990	486,794.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	18,100	46.460	840,926.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	21,900	28.770	630,063.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	63,000	8.650	544,950.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	8,400	90.500	760,200.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	69,300	2.720	188,496.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	21,700	25.660	556,822.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	10.050	238,185.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	17,300	20.480	354,304.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	13.680	218,880.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	131,800	3.470	457,346.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	6.410	341,012.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	11,200	30.080	336,896.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	60,800	8.040	488,832.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	2,000	77.430	154,860.000	

	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	82,700	6.970	576,419.000	
	FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	34,000	11.040	375,360.000	
	ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	5,000	111.070	555,350.000	
	SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	3,700	90.770	335,849.000	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,000	22.550	541,200.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	72,351	8.440	610,642.440	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	10,700	113.810	1,217,767.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	39,500	17.210	679,795.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	60,300	10.050	606,015.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	24,000	11.500	276,000.000	
オフショア・人民元 小計		4,683,211		67,099,363.940 (1,047,421,071)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	144,170	3.080	444,043.600	
	QATAR NATIONAL BANK	295,265	19.360	5,716,330.400	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	107,617	4.430	476,743.310	
	OOREDOO QSC	67,600	7.350	496,860.000	
	QATAR FUEL QSC	25,420	22.220	564,832.400	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	46,760	16.060	750,965.600	
	INDUSTRIES QATAR QSC	137,470	10.380	1,426,938.600	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	65,575	15.500	1,016,412.500	
	MASRAF AL RAYAN	218,064	3.850	839,546.400	
	BARWA REAL ESTATE CO	167,630	3.400	569,942.000	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	266,928	2.530	675,327.840	
カタール・リアル 小計		1,542,499		12,977,942.650 (387,651,147)	
コロンビア・ペン	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	26,028	20,200.000	525,765,600.000	
	ECOPETROL SA	301,511	3,130.000	943,729,430.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA-PREF	10,138	28,100.000	284,877,800.000	
	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,410.000	481,981,710.000	
	CEMENTOS ARGOS SA	37,720	6,900.000	260,268,000.000	
	GRUPO ARGOS SA	11,705	18,300.000	214,201,500.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,386	42,660.000	741,686,760.000	



	BANCOLOMBIA SA-PREF	26,080	44,820.000	1,168,905,600.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	18,835	32,820.000	618,164,700.000	
コロンビア・ペソ 小計		791,234		5,239,581,100.000 (171,334,302)	
サウジアラビ ア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,490	52.800	870,672.000	
	JARIR MARKETING CO	4,309	159.800	688,578.200	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,489	68.000	305,252.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	27,652	21.940	606,684.880	
	SAUDI BRITISH BANK	27,107	33.000	894,531.000	
	AL RAJHI BANK	79,173	62.400	4,940,395.200	
	BANK ALBILAD	26,934	25.950	698,937.300	
	BANK AL-JAZIRA	29,448	13.340	392,836.320	
	BANQUE SAUDI FRANSI	39,754	35.200	1,399,340.800	
	RIYAD BANK	87,949	21.500	1,890,903.500	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	59,210	29.050	1,720,050.500	
	SAUDI TELECOM CO	25,005	95.900	2,397,979.500	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	12,215	77.500	946,662.500	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	48,259	91.500	4,415,698.500	
	SAUDI CEMENT CO	5,494	67.000	368,098.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	61,075	20.700	1,264,252.500	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	16,160	21.540	348,086.400	
	SAVOLA GROUP	19,176	30.950	593,497.200	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	24,022	12.440	298,833.680	
	ALMARAI CO JSC	18,322	50.900	932,589.800	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,034	9.360	262,398.240	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,336	16.260	428,223.360	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	7,773	47.500	369,217.500	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	53,869	10.540	567,779.260	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,785	12.020	466,195.700	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	16,050	20.580	330,309.000	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,022	106.000	214,332.000		
ALINMA BANK	40,244	21.720	874,099.680		
SAUDI ARABIAN MINING CO	29,973	41.750	1,251,372.750		
SAUDI AIRLINES CATERING CO	2,944	89.300	262,899.200		

	NATIONAL COMMERCIAL BANK	76,336	45.100	3,442,753.600	
サウジアラビア・リアル 小計		954,609		34,443,460.070 (1,004,371,296)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	38,300	178.000	6,817,400.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	88,100	49.250	4,338,925.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	286,500	16.800	4,813,200.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	25,700	76.000	1,953,200.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	65.750	2,551,100.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,700	118.500	8,140,950.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	711,055	5.200	3,697,486.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	55,300	152.500	8,433,250.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	1.460	1,474,600.000	
	IRPC PCL NVDR	679,600	3.680	2,500,928.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	384,200	12.200	4,687,240.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	17,900	346.000	6,193,400.000	
	SHIN CORP PCL	153,900	67.500	10,388,250.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	231,800	26.500	6,142,700.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	72,500	230.000	16,675,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	300,620	16.700	5,020,354.000	
	PTT PCL	761,200	45.500	34,634,600.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	315,400	14.100	4,447,140.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	413,400	10.100	4,175,340.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	55,850	393.000	21,949,050.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	278,400	80.250	22,341,600.000	
	KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	79,100	153.500	12,141,850.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	151,000	66.250	10,003,750.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	622,800	23.600	14,698,080.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	34,200	131.500	4,497,300.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,210	37.250	6,601,072.500	
THAI OIL PCL NVDR	72,200	72.750	5,252,550.000		
CP ALL PCL NVDR	375,500	78.750	29,570,625.000		
BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	13.600	7,225,680.000		

	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	96,945	124.500	12,069,652.500	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	66,700	63.000	4,202,100.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	85,422	33.000	2,818,926.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,408	55.500	8,236,644.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	89,800	44.750	4,018,550.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	612,500	10.800	6,615,000.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	34,900	171.000	5,967,900.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	61.250	3,638,250.000	
タイ・パーツ	小計	9,224,610		318,933,643.000 (1,148,161,115)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,669	788.000	4,467,172.000	
	CEZ	8,401	522.500	4,389,522.500	
	MONETA MONEY BANK AS	39,312	78.300	3,078,129.600	
チェコ・コルナ	小計	53,382		11,934,824.100 (56,332,370)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,043,748	45.700	230,499,283.600	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,485	39,790.000	98,878,150.000	
	BANCO DE CHILE	2,676,799	91.700	245,462,468.300	
	EMPRESAS CMPC SA	55,525	1,820.000	101,055,500.000	
	EMPRESAS COPEC SA	21,456	6,745.000	144,720,720.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	7,070.000	92,079,680.000	
	ENTEL CHILE SA	13,572	5,594.900	75,933,982.800	
	ENEL AMERICAS SA	2,616,813	144.000	376,821,072.000	
	COLBUN SA	554,294	121.300	67,235,862.200	
	AGUAS ANDINAS SA	224,014	325.000	72,804,550.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	35,748	2,045.000	73,104,660.000	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,621	8,300.000	196,054,300.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,147	19,800.000	181,110,600.000	
	SACI FALABELLA	43,443	3,600.000	156,394,800.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	4.450	58,904,547.650	
	CENCOSUD SA	64,086	1,040.000	66,649,440.000	
ENEL CHILE SA	2,205,539	59.840	131,979,453.760		
チリ・ペソ	小計	26,840,291		2,369,689,070.310 (345,974,604)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	186,045	7.340	1,365,570.300	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	1,860	20.400	37,944.000	
	ARCELIK	16,000	18.460	295,360.000	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	18.910	600,695.060	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	56,434	7.250	409,146.500	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,000	67.600	338,000.000	
	KOC HOLDING AS	49,560	19.850	983,766.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	54,397	4.440	241,522.680	
	TURK HAVA YOLLARI	57,854	12.800	740,531.200	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	13.130	1,222,639.340	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	142,362	9.790	1,393,723.980	
	TURKIYE IS BANKASI	151,063	6.150	929,037.450	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	7,949	127.500	1,013,497.500	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	50,427	8.600	433,672.200	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,201	47.720	1,107,151.720	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	27.440	376,888.400	
トルコ・リラ 小計		940,771		11,489,146.330 (217,604,431)	
ハンガリー・ フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	10,134	5,590.000	56,649,060.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	28,765	3,044.000	87,560,660.000	
	OTP BANK NYRT	13,775	14,040.000	193,401,000.000	
ハンガリー・フォロント 小計		52,674		337,610,720.000 (121,708,665)	
パキスタン・ ルピー	MCB BANK LTD	33,000	192.180	6,341,940.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	130.560	9,726,720.000	
	HABIB BANK LTD	45,000	135.420	6,093,900.000	
パキスタン・ルピー 小計		152,500		22,162,560.000 (15,513,792)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	461,400	47.000	21,685,800.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	85,530	56.000	4,789,680.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	89,510	97.500	8,727,225.000	
	AYALA CORP	16,883	848.500	14,325,225.500	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	52,000	10.620	552,240.000	
	DMCI HOLDINGS INC	50	7.630	381.500	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,900.000	5,291,500.000	

	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	62,790	123.800	7,773,402.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	162,710	78.500	12,772,735.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,330	228.000	8,283,240.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	162,095	67.550	10,949,517.250	
	BDO UNIBANK INC	149,133	159.500	23,786,713.500	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.900	4,713,800.000	
	PLDT INC	6,525	1,110.000	7,242,750.000	
	ROBINSONS LAND CORP	214,900	26.700	5,737,830.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	203.000	4,754,260.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	634,975	40.000	25,399,000.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	58,300	151.500	8,832,450.000	
	SM INVESTMENTS CORP	17,403	1,070.000	18,621,210.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	4.650	5,342,385.000	
	ABOITIZ POWER CORP	153,700	39.600	6,086,520.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	12,630	349.800	4,417,974.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	3,651	900.000	3,285,900.000	
	フィリピン・ペソ 小計	4,517,620		213,371,738.750 (460,882,956)	
ブラジル・レ アル	BRF SA	34,292	34.450	1,181,359.400	
	VALE SA	208,621	49.180	10,259,980.780	
	RAIA DROGASIL SA	16,500	111.500	1,839,750.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	41,300	12.810	529,053.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,250	39.550	761,337.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,400	38.220	626,808.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,300	47.000	2,834,100.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	303,860	13.760	4,181,113.600	
	LOJAS AMERICANAS SA	40,374	19.430	784,466.820	
	GERDAU SA	70,630	15.250	1,077,107.500	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	8,706	81.090	705,969.540	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	198,210	32.910	6,523,091.100	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,200	27.880	1,204,416.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	286,112	30.020	8,589,082.240	
	COGNA EDUCACAO	82,068	9.820	805,907.760	
	CCR SA	71,820	17.360	1,246,795.200	
	WEG SA	55,072	28.240	1,555,233.280	
	BANCO BRADESCO SA PREF	269,450	34.240	9,225,968.000	
	BANCO BRADESCO SA	83,641	32.030	2,679,021.230	
	NATURA COSMETICOS SA	24,600	33.580	826,068.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,606	12.300	585,553.800	

	SUZANO SA	36,775	38.000	1,397,450.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	332,247	36.270	12,050,598.690	
	PORTO SEGURO SA	8,800	56.390	496,232.000	
	B2W CIA DIGITAL	17,000	52.080	885,360.000	
	BRASKEM SA	15,730	31.250	491,562.500	
	ENGIE BRASIL SA	15,487	45.200	700,012.400	
	LOCALIZA RENT A CAR	36,180	41.550	1,503,279.000	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	31,928	54.000	1,724,112.000	
	LOJAS RENNER SA	57,737	48.920	2,824,494.040	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	41,004	20.480	839,761.920	
	COSAN SA	12,000	59.400	712,800.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	10,900	100.250	1,092,725.000	
	EMBRAER SA	50,960	18.080	921,356.800	
	M DIAS BRANCO SA	10,400	35.930	373,672.000	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	63,965	15.160	969,709.400	
	JBS SA	72,200	27.590	1,991,998.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	51,849	13.090	678,703.410	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	19,798	53.900	1,067,112.200	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	23,340	28.760	671,258.400	
	HYPERA SA	29,600	35.140	1,040,144.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	135,216	48.700	6,585,019.200	
	MAGAZINE LUIZA SA	40,900	43.810	1,791,829.000	
	CIELO SA	84,907	7.740	657,180.180	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,700	34.690	1,585,333.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	23,600	58.780	1,387,208.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	27,000	18.870	509,490.000	
	AMBEV SA	305,895	17.300	5,291,983.500	
	RUMO SA	69,000	23.490	1,620,810.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	42,600	35.100	1,495,260.000	
	ブラジル・リアル 小計	3,694,730		111,378,637.390 (2,917,006,513)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	5.900	293,713.800	
	MBANK	1,047	382.800	400,791.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,166	96.400	690,802.400	
	BANK PEKAO SA	11,985	105.050	1,259,024.250	

	ORANGE POLSKA SA	58,600	6.330	370,938.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,130	105.500	2,018,215.000	
	LPP SA	110	8,520.000	937,200.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,258	308.800	697,270.400	
	CD PROJEKT RED SA	4,504	260.800	1,174,643.200	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	60,904	39.000	2,375,256.000	
	CCC SA	2,025	112.000	226,800.000	
	GRUPA LOTOS SA	6,865	94.800	650,802.000	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	75,839	5.000	379,195.000	
	CYFROWY POLSAT SA	23,495	28.700	674,306.500	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	9.524	671,718.190	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	36,949	37.970	1,402,953.530	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA SA	4,000	20.800	83,200.000	
	ALIOR BANK SA	2,278	28.460	64,831.880	
	DINO POLSKA SA	3,444	141.600	487,670.400	
	ポーランド・ズロチ 小計	440,910		14,859,332.150 (418,884,573)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	4.140	556,830.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	13,100	10.120	132,572.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	332,800	5.400	1,797,120.000	
	DIGI.COM BHD	161,500	4.700	759,050.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	48,320	8.490	410,236.800	
	RHB BANK BHD	67,480	5.770	389,359.600	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	41,300	9.900	408,870.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	148,100	4.350	644,235.000	
	GAMUDA BHD	124,000	3.770	467,480.000	
	GENTING BHD	125,600	6.210	779,976.000	
	YTL CORP BHD	283,710	0.910	258,176.100	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	17.280	350,023.680	
	HONG LEONG BANK BHD	50,408	17.060	859,960.480	
	IJM CORP BHD	153,360	2.150	329,724.000	
	IOI CORP BHD	106,413	4.340	461,832.420	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	35,400	22.520	797,208.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	3,400	34.640	117,776.000	
	MALAYAN BANKING BHD	268,675	8.830	2,372,400.250	

	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	88,400	2.780	245,752.000	
	MISC BHD	90,280	8.280	747,518.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,700	145.700	684,790.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	18.240	867,494.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	23.720	464,912.000	
	PETRONAS GAS BHD	34,600	16.320	564,672.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	203,700	3.250	662,025.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,700	17.700	136,290.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	110,300	3.770	415,831.000	
	SP SETIA BHD	130,000	1.320	171,600.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	219,350	13.840	3,035,804.000	
	QL RESOURCES BHD	53,800	7.260	390,588.000	
	DIALOG GROUP BHD	231,044	3.440	794,791.360	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	197,630	19.940	3,940,742.200	
	AIRASIA GROUP BHD	199,300	1.940	386,642.000	
	SIME DARBY BERHAD	259,100	2.290	593,339.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	5.350	626,485.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	173,500	4.370	758,195.000	
	MAXIS BHD	116,200	5.410	628,642.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	156,600	7.650	1,197,990.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	182,000	5.510	1,002,820.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	64,500	4.250	274,125.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	51,900	4.770	247,563.000	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	190,000	0.735	139,650.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	114,000	4.990	568,860.000	
	マレーシア・リングgit 小計	5,181,186		31,439,951.690 (829,071,526)	
メキシコ・ペ ン	ALFA SAB DE CV	264,100	17.140	4,526,674.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,600	97.830	1,330,488.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	124,900	35.870	4,480,163.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,340	203.250	2,101,605.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	184.460	3,737,159.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	67.220	2,527,472.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	167,800	102.950	17,275,010.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	94,025	43.230	4,064,700.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,655	236.730	2,285,628.150	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	99,000	38.240	3,785,760.000	



	ALSEA SAB DE CV	19,900	52.750	1,049,725.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,300	321.290	3,951,867.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	239,052	52.820	12,626,726.640	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,314,678	15.240	35,275,692.720	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	176,800	24.690	4,365,192.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,600	106.920	3,378,672.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	345,600	56.190	19,419,264.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	19,500	202.350	3,945,825.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	24,800	84.380	2,092,624.000	
メキシコ・ペソ	小計	4,025,510		132,220,248.860 (754,977,621)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	86,619	1.781	154,268.430	
	NATIONAL BANK OF GREECE	35,020	2.788	97,635.760	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,304	13.400	191,673.600	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS	178,915	0.880	157,445.200	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	3,854	21.840	84,171.360	
	OPAP SA	19,846	9.700	192,506.200	
	JUMBO SA	6,853	18.260	125,135.780	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	2,700	18.500	49,950.000	
ユーロ	小計	351,241		1,052,786.330 (126,597,556)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,553	24,800.000	137,714,400.000	
	HANMI SCIENCE CO LTD	1,187	41,850.000	49,675,950.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,124	82,800.000	258,667,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,975	235,500.000	465,112,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	4,376	54,200.000	237,179,200.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	3,865	91,600.000	354,034,000.000	
	KT&G CORP	7,884	99,400.000	783,669,600.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	96,000.000	138,624,000.000	
	KOREA GAS CORP	1,737	40,950.000	71,130,150.000	
	CJ CORP	197	91,000.000	17,927,000.000	
	KAKAO CORP	3,350	152,000.000	509,200,000.000	
	CJ ENM CO LTD	563	154,800.000	87,152,400.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	29,250.000	77,044,500.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,341	242,000.000	324,522,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	1,323	93,300.000	123,435,900.000	

MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	33,940	7,540.000	255,907,600.000	
NCSOFT CORPORATION	1,142	529,000.000	604,118,000.000	
LG UPLUS CORP	9,656	13,900.000	134,218,400.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,800.000	64,992,000.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	19,000.000	68,400,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	586	1,253,000.000	734,258,000.000	
LG CHEM LTD	2,952	323,000.000	953,496,000.000	
LG CHEM LTD	726	180,500.000	131,043,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	201	761,000.000	152,961,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	29,147	43,850.000	1,278,095,950.000	
S-OIL CORP	2,872	100,500.000	288,636,000.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	17,250.000	142,985,250.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	11,739	4,485.000	52,649,415.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,354	34,900.000	151,954,600.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	47,850.000	101,729,100.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,085	227,000.000	246,295,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,355	82,900.000	195,229,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,508	120,500.000	302,214,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,618	242,000.000	1,117,556,000.000	
SK HYNIX INC	35,926	82,300.000	2,956,709,800.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,701	45,300.000	212,955,300.000	
HYUNDAI MOTOR CO	744	74,600.000	55,502,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	9,785	124,000.000	1,213,340,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,974	32,950.000	229,793,300.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	14,942	12,250.000	183,039,500.000	
KCC CORP	109	237,500.000	25,887,500.000	
KIA MOTORS CORP	17,752	43,100.000	765,111,200.000	
KOREA ZINC CO LTD	519	434,500.000	225,505,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	19,519	27,000.000	527,013,000.000	
HANWHA CORP	137	24,850.000	3,404,450.000	
KOREAN AIR CO LTD	2,656	26,950.000	71,579,200.000	
OCI COMPANY LTD	1,315	65,100.000	85,606,500.000	
CJ LOGISTICS	985	157,500.000	155,137,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	76,400.000	115,287,600.000	

HLB INC	2,106	147,800.000	311,266,800.000	
LG ELECTRONICS INC	7,254	69,400.000	503,427,600.000	
LOTTE CORP	2,810	37,050.000	104,110,500.000	
LG CORP	6,170	72,400.000	446,708,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	4,435	12,650.000	56,102,750.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,436	32,550.000	144,391,800.000	
NAVER CORP	9,164	163,500.000	1,498,314,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	121	77,400.000	9,365,400.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,236	71,300.000	159,426,800.000	
OTTOGI CORP	100	578,000.000	57,800,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,018	84,100.000	169,713,800.000	
KANGWON LAND INC	8,336	30,450.000	253,831,200.000	
POSCO	5,251	224,000.000	1,176,224,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,773	19,000.000	223,687,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,821	237,500.000	907,487,500.000	
SAMSUNG ELECTRO- MECHANICS CO LTD	3,670	116,000.000	425,720,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	322,130	52,100.000	16,782,973,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	27,888	7,270.000	202,745,760.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	55,914	42,600.000	2,381,936,400.000	
SHINSEGAE CO LTD	725	254,000.000	184,150,000.000	
YUHAN CORP	750	219,000.000	164,250,000.000	
HANON SYSTEMS	13,526	11,550.000	156,225,300.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	28,300.000	160,376,100.000	
GS HOLDINGS CORP	2,933	50,800.000	148,996,400.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,911	14,500.000	216,209,500.000	
CELLTRION INC	6,232	188,000.000	1,171,616,000.000	
HELIXMITH CO LTD	1,305	96,200.000	125,541,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	21,628	36,000.000	778,608,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,420	152,500.000	216,550,000.000	
CELLTRION PHARM INC	683	38,600.000	26,363,800.000	
LOTTE SHOPPING CO	301	133,000.000	40,033,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,580	75,100.000	343,958,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,030	191,500.000	388,745,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,184	96,100.000	113,782,400.000	
SAMSUNG CARD CO	2,877	35,000.000	100,695,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,938	162,000.000	637,956,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	705	244,500.000	172,372,500.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,595.000	84,525,025.000	
LG INNOTEK CO LTD	999	122,500.000	122,377,500.000	

	SK HOLDINGS CO LTD	2,286	268,500.000	613,791,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	25,851	43,300.000	1,119,348,300.000	
	MEDY-TOX INC	320	333,800.000	106,816,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	6,602	38,700.000	255,497,400.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	9,460	7,230.000	68,395,800.000	
	HANMI PHARM CO LTD	250	324,500.000	81,125,000.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	2,415.000	27,456,135.000	
	FILA KOREA LTD	2,826	62,100.000	175,494,600.000	
	E-MART CO LTD	1,295	128,500.000	166,407,500.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	39,650.000	98,411,300.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	4,090	35,350.000	144,581,500.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,233	31,050.000	38,284,650.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	644	348,500.000	224,434,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	182,000.000	114,842,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,298	107,000.000	138,886,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	29,000.000	80,127,000.000	
	NETMARBLE CORP	2,378	94,000.000	223,532,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	28,543	12,300.000	351,078,900.000	
	CJ CORP-PREFERENCE	176	66,200.000	11,651,200.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,403	199,500.000	479,398,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	6,199	102,500.000	635,397,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,066	390,000.000	415,740,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	199,900.000	106,746,600.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	32,850.000	119,442,600.000	
	SILLAJEN INC	5,857	17,550.000	102,790,350.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,789	51,800.000	196,270,200.000	
	韓国・ウォン 小計	1,005,965		54,702,209,235.000 (5,152,948,110)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	9.260	1,148,240.000	
	JIANGSU EXPRESS	124,000	10.660	1,321,840.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	66,000	5.360	353,760.000	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	1,200	2.740	3,288.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	408,500	64.300	26,266,550.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	74,000	49.300	3,648,200.000	
	DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	430,000	1.590	683,700.000	

BEIJING ENTERPRISES	43,000	36.400	1,565,200.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	328,000	3.790	1,243,120.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	218,000	8.260	1,800,680.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	112,000	8.120	909,440.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	49,500	54.100	2,677,950.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	3.050	439,200.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.270	529,480.000	
CNOOC LTD	1,171,000	12.700	14,871,700.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	212,000	9.320	1,975,840.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	328,000	20.950	6,871,600.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	241,120	27.100	6,534,352.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	178,888	34.950	6,252,135.600	
CITIC LTD	416,000	10.420	4,334,720.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	7.940	1,032,200.000	
LENOVO GROUP LTD	554,000	5.820	3,224,280.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,416,000	3.950	5,593,200.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	428,742	7.680	3,292,738.560	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	111,190	19.620	2,181,547.800	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,671,200	4.700	7,854,640.000	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES CO	86,000	7.320	629,520.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	72,000	18.140	1,306,080.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	167,000	8.750	1,461,250.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	51,900	88.500	4,593,150.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	232,000	7.380	1,712,160.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	80,000	5.740	459,200.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	6.510	989,520.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	634,000	1.760	1,115,840.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	76,000	13.040	991,040.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	374,000	2.560	957,440.000	

CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80,000	11.550	924,000.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	56,000	16.960	949,760.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	38,000	13.140	499,320.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	121,200	34.750	4,211,700.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	33,500	22.700	760,450.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	352,000	15.540	5,470,080.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	138,000	3.180	438,840.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	45.650	2,556,400.000	
BYD CO LTD	48,000	39.450	1,893,600.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	840,000	3.330	2,797,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	134,000	11.160	1,495,440.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	860,000	1.350	1,161,000.000	
SINOTRANS LTD	160,000	2.510	401,600.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	140,000	2.970	415,800.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	241,592	6.240	1,507,534.080	
MMG LTD	180,000	1.860	334,800.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	84,000	5.030	422,520.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	429,788	10.140	4,358,050.320	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	3.770	712,530.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	10.340	1,646,128.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	246,000	6.840	1,682,640.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	520,000	21.250	11,050,000.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	401,000	2.960	1,186,960.000	
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	70,000	2.750	192,500.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	9.230	1,624,480.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	193,700	9.840	1,906,008.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	125,440	13.840	1,736,089.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	3.450	345,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	287,000	2.310	662,970.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	58,000	15.160	879,280.000	
TINGYI HOLDING CORP	122,000	11.860	1,446,920.000	

TSINGTAO BREWERY CO LTD	22,000	47.450	1,043,900.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	186,000	17.000	3,162,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	3.730	775,840.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	103,333	41.950	4,334,819.350	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	48,000	7.170	344,160.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	431,500	11.800	5,091,700.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	191,000	30.150	5,758,650.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	384,200	327.200	125,710,240.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	371,000	94.100	34,911,100.000	
LI NING CO LTD	119,000	25.550	3,040,450.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	338,000	4.120	1,392,560.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	970,240	0.720	698,572.800	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.690	354,900.000	
AIR CHINA / HONG KONG	86,000	7.610	654,460.000	
ZTE CORP	47,288	23.250	1,099,446.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	70,000	2.490	174,300.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	239,000	16.140	3,857,460.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	98,500	3.160	311,260.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	506,205	5.510	2,789,189.550	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	150,250	7.200	1,081,800.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	44,500	51.600	2,296,200.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,504,530	6.470	42,084,309.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	54,200	109.100	5,913,220.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	142,000	8.090	1,148,780.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	80,000	11.280	902,400.000	
SSY GROUP LTD	104,000	6.790	706,160.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	80,000	7.800	624,000.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	206,000	7.400	1,524,400.000	
BANK OF CHINA LTD	5,329,200	3.310	17,639,652.000	
SHUI ON LAND LTD	300,000	1.610	483,000.000	

SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	27.400	2,109,800.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	60,000	13.360	801,600.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	253,470	40.300	10,214,841.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	4,336,235	5.860	25,410,337.100	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	24,000	8.610	206,640.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	104,000	8.360	869,440.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	179,600	5.420	973,432.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	290,000	6.260	1,815,400.000	
CHINA COAL ENERGY CO	160,000	3.190	510,400.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	19.080	1,030,320.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	48,500	30.650	1,486,525.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	83,000	23.150	1,921,450.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	2.800	534,800.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	539,142	11.560	6,232,481.520	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	216,000	2.720	587,520.000	
CHINA CITIC BANK-H	588,800	4.740	2,790,912.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	61,000	8.480	517,280.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	50,200	130.800	6,566,160.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	77,000	78.400	6,036,800.000	
FOSUN INTERNATIONAL	173,028	11.120	1,924,071.360	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	318,000	5.560	1,768,080.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	34,000	11.440	388,960.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	133,500	3.070	409,845.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	4.420	663,000.000	
SOHO CHINA LTD	170,000	2.960	503,200.000	
KINGSOFT CORP LTD	58,000	19.160	1,111,280.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	70,000	14.220	995,400.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	288,000	4.940	1,422,720.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	7.860	416,580.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	14.820	778,050.000	



CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	165,000	9.000	1,485,000.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	321,000	6.710	2,153,910.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	168,600	30.500	5,142,300.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	104,000	19.960	2,075,840.000	
CRRC CORP LTD - H	342,450	5.560	1,904,022.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	67,000	12.420	832,140.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	211,500	9.080	1,920,420.000	
BBMG CORP	222,000	2.240	497,280.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	130,000	3.250	422,500.000	
SINOPHARM GROUP CO	96,800	28.450	2,753,960.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	9.000	1,710,000.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	189,000	1.710	323,190.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	190,527	8.760	1,669,016.520	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	4.510	381,095.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	181,000	4.230	765,630.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	4.500	1,224,000.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	48,200	14.940	720,108.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	330,000	2.990	986,700.000	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS GROUP LTD	260,000	1.100	286,000.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	172,000	38.300	6,587,600.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	130,000	3.620	470,600.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	128,500	32.950	4,234,075.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	50,800	33.300	1,691,640.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	555,656	5.670	3,150,569.520	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	3.520	714,560.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	55,200	9.620	531,024.000	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	322,000	3.750	1,207,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,928,000	3.310	6,381,680.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,500	28.100	1,109,950.000	
FAR EAST HORIZON LTD	146,000	7.360	1,074,560.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	133,000	15.440	2,053,520.000	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	132,000	8.530	1,125,960.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	177,200	8.460	1,499,112.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	509,000	3.340	1,700,060.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	31,000	23.500	728,500.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	142,000	5.750	816,500.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	4.730	574,695.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	306,000	4.350	1,331,100.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	120,000	8.050	966,000.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	8.820	846,720.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	12.600	753,480.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	474,000	5.300	2,512,200.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	35,000	53.950	1,888,250.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	54,000	19.000	1,026,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	93,000	27.200	2,529,600.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	188,000	2.310	434,280.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	19,000	11.920	226,480.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,744,000	1.690	4,637,360.000	
XIAOMI CORP	502,400	8.840	4,441,216.000	
WUXI APPTec CO LTD	11,400	97.950	1,116,630.000	
MEITUAN DIANPING	66,700	94.600	6,309,820.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	32,000	36.250	1,160,000.000	

	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	158,000	4.550	718,900.000	
	CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	516,000	1.700	877,200.000	
	LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	102,000	12.340	1,258,680.000	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	95,000	31.750	3,016,250.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	85,261	28.550	2,434,201.550	
	LUYE PHARMA GROUP LTD	143,000	6.650	950,950.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	15.180	592,020.000	
	CGN POWER CO LTD	749,000	2.080	1,557,920.000	
	BAIC MOTOR CORP LTD	175,000	5.080	889,000.000	
	GF SECURITIES CO LTD	112,000	8.750	980,000.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,400	24.450	596,580.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	124,800	12.640	1,577,472.000	
	3SBIO INC	64,500	13.680	882,360.000	
	LEGEND HOLDINGS CORP	13,500	17.560	237,060.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	7.230	672,390.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	604,000	1.230	742,920.000	
	CHINA LITERATURE LTD	15,600	31.100	485,160.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.400	1,015,200.000	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	4.740	668,340.000	
	CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.320	693,000.000	
	MEITU INC	152,500	1.680	256,200.000	
	BOC AVIATION LTD	8,800	76.600	674,080.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	26.050	599,150.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	14.880	1,428,480.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	89.450	3,264,925.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	2,096,000	0.120	251,520.000	
	香港・ドル 小計	65,226,675		647,804,967.330 (9,030,401,250)	
台湾・ドル	ACER INC	220,532	18.300	4,035,735.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	51,554	215.000	11,084,110.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,616	225.000	7,338,600.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,928	43.300	7,141,382.400	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	29,000	172.000	4,988,000.000	

TAIWAN BUSINESS BANK	300,779	12.700	3,819,893.300	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	64.900	4,283,400.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	51,000	89.700	4,574,700.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	54,975	93.800	5,156,655.000	
QUANTA COMPUTER INC	160,858	61.800	9,941,024.400	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	58,070	47.050	2,732,193.500	
EVA AIRWAYS CORP	202,125	14.350	2,900,493.750	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	39,760	279.000	11,093,040.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	416,771	23.200	9,669,087.200	
CHINA AIRLINES	156	9.050	1,411.800	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	161,169	48.350	7,792,521.150	
CHINA STEEL CORP	721,058	23.800	17,161,180.400	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	190,994	26.100	4,984,943.400	
ADVANTECH CO LTD	17,889	308.500	5,518,756.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	199,304	18.800	3,746,915.200	
DELTA ELECTRONICS INC	142,663	139.500	19,901,488.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	72.400	4,923,200.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	250,327	113.500	28,412,114.500	
AU OPTRONICS CORP	742,194	8.040	5,967,239.760	
TAIWAN MOBILE CO LTD	96,800	116.000	11,228,800.000	
EVERGREEN MARINE CORP	198,276	12.750	2,528,019.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	243,824	30.250	7,375,676.000	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	27,307	204.500	5,584,281.500	
ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	392.500	6,013,885.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,285	212.000	8,540,420.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	296,633	97.400	28,892,054.200	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	8,000	34.450	275,600.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	232,594	88.700	20,631,087.800	
GIANT MANUFACTURING	24,151	221.500	5,349,446.500	
MEDIATEK INC	102,507	414.000	42,437,898.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	426,936	45.600	19,468,281.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	589,459	22.300	13,144,935.700	
HOTAI MOTOR CO LTD	22,000	563.000	12,386,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,000	75.700	9,235,400.000	

YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	702,141	19.900	13,972,605.900	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	494,920	42.700	21,133,084.000	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	834,403	10.000	8,344,030.000	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	638,545	27.600	17,623,842.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	832,225	90.900	75,649,252.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	701,495	30.500	21,395,597.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,220	4,760.000	34,367,200.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	576,593	14.500	8,360,598.500	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	795,061	10.400	8,268,634.400	
INVENTEC CO LTD	206,005	22.750	4,686,613.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	156,845	50.400	7,904,988.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	805,443	12.700	10,229,126.100	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,165,048	21.850	25,456,298.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	593,852	22.800	13,539,825.600	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	61,560	94.300	5,805,108.000	
NAN YA PLASTICS CORP	347,828	72.700	25,287,095.600	
WISTRON CORP	213,916	28.350	6,064,518.600	
POU CHEN CORP	111,990	41.200	4,613,988.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	303,297	73.000	22,140,681.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	42,392	309.000	13,099,128.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	92,480	98.600	9,118,528.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	294.500	3,727,781.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	73,393	47.350	3,475,158.550	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	829	75.100	62,257.900	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	37,588	67.000	2,518,396.000	
STANDARD FOODS CORP	34,639	62.100	2,151,081.900	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	46,899	36.500	1,711,813.500	
TAIWAN CEMENT CORP	363,684	40.900	14,874,675.600	
TATUNG CO LTD	120,000	18.400	2,208,000.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,663,083	305.500	508,071,856.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	713,525	14.250	10,167,731.250	

	WINBOND ELECTRONICS CORP	219,000	16.650	3,646,350.000	
	YAGEO CORP	14,160	307.000	4,347,120.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	163,000	36.500	5,949,500.000	
	INNOLUX CORPORATION	666,345	6.970	4,644,424.650	
	WPG HOLDINGS CO LTD	109,203	38.050	4,155,174.150	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	19,645	264.000	5,186,280.000	
	TAIMED BIOLOGICS INC	11,000	133.000	1,463,000.000	
	PEGATRON CORP	105,554	67.300	7,103,784.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	437.500	3,937,500.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	312.500	6,875,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	69,029	140.500	9,698,574.500	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	25,385	147.500	3,744,287.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	677,674	21.100	14,298,921.400	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	255,993	53.000	13,567,629.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	220,903	78.300	17,296,704.900	
	GLOBALWAFERS CO LTD	19,000	363.000	6,897,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	296.500	2,965,000.000	
	台湾・ドル 小計	22,155,264		1,402,065,618.410 (5,033,415,570)	
南アフリカ・ ランド	BIDVEST GROUP LTD	18,432	215.000	3,962,880.000	
	CLICKS GROUP LTD	19,827	250.000	4,956,750.000	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	37,135	50.560	1,877,545.600	
	DISCOVERY LTD	26,029	127.610	3,321,560.690	
	GOLD FIELDS LTD	54,414	76.450	4,159,950.300	
	REMGRO LTD	36,309	180.870	6,567,208.830	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	12,960	160.350	2,078,136.000	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	31,809	20.500	652,084.500	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,729	126.250	2,490,786.250	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,681	1,450.050	3,887,584.050	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	3,907	116.340	454,540.380	
	MTN GROUP LTD	116,247	96.810	11,253,872.070	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,905	283.000	8,180,115.000	
	TELKOM SA SOC LTD	22,080	62.000	1,368,960.000	
	FIRSTRAND LTD	234,367	68.350	16,018,984.450	
	PSG GROUP LTD	11,126	244.290	2,717,970.540	
	NASPERS LTD	29,527	2,150.000	63,483,050.000	
	NEDBANK GROUP LTD	25,563	242.650	6,202,861.950	

NETCARE LTD	39,220	17.100	670,662.000	
PICK'N PAY STORES LTD	11,458	68.800	788,310.400	
RMB HOLDINGS LTD	48,890	81.360	3,977,690.400	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	4,377	1,125.070	4,924,431.390	
SAPPI LTD	50,570	37.800	1,911,546.000	
SASOL LTD	36,985	295.370	10,924,259.450	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	33,217	137.820	4,577,966.940	
MR PRICE GROUP LTD	13,831	161.340	2,231,493.540	
STANDARD BANK GROUP LTD	87,634	176.660	15,481,422.440	
SPAR GROUP LTD/THE	12,986	201.480	2,616,419.280	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,051	59.600	4,294,239.600	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,788	113.200	3,258,801.600	
ABSA GROUP LTD	48,353	162.610	7,862,681.330	
TIGER BRANDS LTD	15,965	234.500	3,743,792.500	
SANLAM LTD	121,412	82.020	9,958,212.240	
INVESTEC LTD	21,242	85.840	1,823,413.280	
KUMBA IRON ORE LTD	5,327	365.140	1,945,100.780	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	61,447	24.110	1,481,487.170	
RMI HOLDINGS	55,570	31.220	1,734,895.400	
VODACOM GROUP PTY LTD	41,031	135.000	5,539,185.000	
NEPI ROCKCASTLE PLC	28,593	128.000	3,659,904.000	
OLD MUTUAL LTD	339,931	20.370	6,924,394.470	
REINET INVESTMENTS SCA	11,346	275.820	3,129,453.720	
MULTICHOICE GROUP LTD	28,769	133.500	3,840,661.500	
BID CORP LTD	21,757	349.170	7,596,891.690	
南アフリカ・ランド 小計	1,971,797		258,532,156.730 (1,897,626,030)	
合計	182,598,797		41,367,880,713 (41,367,880,713)	

## (2) 株式以外の有価証券

令和1年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	59,033.000	179,460.320	
		MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	35,209.800	
	タイ・パーツ 小計		68,498.000	214,670.120 (772,812)	
新株予約権証券 合計			68,498	772,812 (772,812)	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	12,400.000	834,520.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	27,800.000	1,295,202.000	
		ENERGISA SA	16,000.000	752,000.000	
		KLABIN SA	62,000.000	1,090,580.000	
		SUL AMERICA SA	17,869.000	903,099.260	
	ブラジル・リアル 小計		136,069.000	4,875,401.260 (127,686,759)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	923,875.000	6,735,048.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,700.000	4,396,378.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	132,100.000	23,400,194.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	147,200.000	6,503,296.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400.000	2,181,588.000	
メキシコ・ペソ 小計		1,270,275.000	43,216,504.750 (246,766,242)		
投資信託受益証券 合計			1,406,344	374,453,001 (374,453,001)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	207,200.000	6,004,656.000	
	メキシコ・ペソ 小計		207,200.000	6,004,656.000 (34,286,586)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD	117,482.000	2,449,499.700	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	184,218.000	4,253,593.620	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	279,940.000	2,281,511.000	
南アフリカ・ランド 小計		581,640.000	8,984,604.320 (65,946,995)		
投資証券 合計			788,840	100,233,581 (100,233,581)	
合計				475,459,394 (475,459,394)	



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

(注)

1. 各種通貨毎の小計の欄における( )内の金額は、邦貨換算額であります。

2. 合計欄における( )内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証券 時価比率 (%)	組入 投資信託 受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の 合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 59銘柄	10.84	-	-	-	13.10
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 8銘柄	0.51	-	-	-	0.61
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.05	-	-	-	0.06
インド・ルピー	株式 81銘柄	7.18	-	-	-	8.68
インドネシア・ルピア	株式 27銘柄	1.65	-	-	-	1.99
オフショア・人民元	株式 84銘柄	2.07	-	-	-	2.50
カタール・リアル	株式 11銘柄	0.77	-	-	-	0.93
コロンビア・ペソ	株式 9銘柄	0.34	-	-	-	0.41
サウジアラビア・リアル	株式 31銘柄	1.99	-	-	-	2.40
タイ・バーツ	株式 37銘柄 新株予約権証 券 2銘柄	2.27 -	- 0.00	- -	- -	2.75
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.11	-	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.68	-	-	-	0.83
トルコ・リラ	株式 16銘柄	0.43	-	-	-	0.52
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.24	-	-	-	0.29
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03	-	-	-	0.04
フィリピン・ペソ	株式 23銘柄	0.91	-	-	-	1.10
ブラジル・レアル	株式 50銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	5.77 -	- -	- 0.25	- -	7.28
ポーランド・ズロチ	株式 19銘柄	0.83	-	-	-	1.00
マレーシア・リンギット	株式 43銘柄	1.64	-	-	-	1.98
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄 投資証券 1銘柄	1.49 - -	- - -	- 0.49 -	- - 0.07	2.48
ユーロ	株式 9銘柄	0.25	-	-	-	0.30
韓国・ウォン	株式 114銘柄	10.19	-	-	-	12.31
香港・ドル	株式 207銘柄	17.86	-	-	-	21.58
台湾・ドル	株式 87銘柄	9.96	-	-	-	12.03
南アフリカ・ランド	株式 43銘柄 投資証券 3銘柄	3.75 -	- -	- -	- 0.13	4.69

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和1年11月29日現在

資産総額	72,930,697,133円
負債総額	200,152,636円
純資産総額（ - ）	72,730,544,497円
発行済数量	69,559,764,281口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0456円

（参考）

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	242,307,845,030円
負債総額	4,109,823,500円
純資産総額（ - ）	238,198,021,530円
発行済数量	180,222,744,715口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3217円

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	256,278,158,475円
負債総額	413,349,042円
純資産総額（ - ）	255,864,809,433円
発行済数量	95,255,878,323口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6861円

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	458,570,285,409円
負債総額	4,376,605,753円
純資産総額（ - ）	454,193,679,656円
発行済数量	321,511,712,330口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4127円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	356,186,388,721円
負債総額	3,003,578,434円
純資産総額（ - ）	353,182,810,287円
発行済数量	90,116,498,464口
1口当たり純資産額（ / ）	3.9192円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	44,235,864,218円
負債総額	163,292,262円
純資産総額( - )	44,072,571,956円
発行済数量	17,943,356,084口
1口当たり純資産額( / )	2.4562円

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	57,069,387,496円
負債総額	142,405,451円
純資産総額( - )	56,926,982,045円
発行済数量	40,717,864,071口
1口当たり純資産額( / )	1.3981円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	155,101,158,970円
負債総額	12,102,444,749円
純資産総額( - )	142,998,714,221円
発行済数量	69,665,438,368口
1口当たり純資産額( / )	2.0526円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和1年11月29日現在

資産総額	51,597,435,435円
負債総額	414,160,905円
純資産総額( - )	51,183,274,530円
発行済数量	43,841,176,428口
1口当たり純資産額( / )	1.1675円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額(2019年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	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計		有価証券 評価差額金		
当期首残高	44,349,855	65,902,812	795,002	795,002	66,697,815
当期変動額					
剰余金の配当	12,520,000	12,520,000			12,520,000
当期純利益	14,119,516	14,119,516			14,119,516
別途積立金の積立	7,100,000	7,100,000			7,100,000
研究開発積立金の取崩	300,000	300,000			300,000
運用責任準備積立金の取崩	200,000	200,000			200,000
繰越利益剰余金の取崩	6,600,000	6,600,000			6,600,000
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)		-	51,753	51,753	51,753
当期変動額合計	1,599,516	1,599,516	51,753	51,753	1,651,270
当期末残高	45,949,372	67,502,329	846,755	846,755	68,349,085

## 重要な会計方針

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



## 表示方法の変更

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

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

## 注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 関係会社に対する事項

（千円）

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

2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

## 第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第33期(2018年3月31日現在)

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

## 第34期(2019年3月31日現在)

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

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 2. その他有価証券

第33期(2018年3月31日現在)

(千円)

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

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

第34期(2019年3月31日現在)

(千円)

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

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期(自2017年4月1日至2018年3月31日)

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

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

## 第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

## (5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

## 主要な数理計算上の計算基礎

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

## 3. 簡便法を適用した確定給付制度

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

(千円)

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

## (2) 退職給付費用

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

## 4. 確定拠出制度

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



## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

## (企業結合等関係)

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(\*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

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

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

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

## (2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

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

#### 5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1)受託会社

##### a.名称

みずほ信託銀行株式会社

##### b.資本金の額

2019年3月末日現在 247,369百万円

##### c.事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

#### (3)投資顧問会社<sup>\*</sup>

##### a.名称

アセットマネジメントOne U.S.A.・インク

##### b.資本金の額

2019年12月末日現在 400万米ドル

##### c.事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

\* 2020年4月15日に、委託会社と投資顧問会社との間で投資顧問契約を締結する予定です。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2)信託財産の計算
- (3)信託財産に関する報告書の作成
- (4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い
- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。  
2020年4月15日以降（予定）

### 3【資本関係】

委託会社は、アセットマネジメントOne U.S.A.・インク<sup>\*</sup>の株式を、100%保有しています。  
持株比率5%以上を記載します。

\* 2020年4月15日に、委託会社との間で投資顧問契約を締結する予定です。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

書 類 名	提 出 年 月 日
有価証券報告書	2019年2月12日
有価証券届出書の訂正届出書	2019年2月12日
半期報告書	2019年8月9日
有価証券届出書	2019年8月9日

## 独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

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

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

令和1年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 丘本 正彦 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの平成30年11月13日から令和1年11月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの令和1年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) 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。