【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4月14日提出
【計算期間】	第1期（自　2019年3月18日　至　2020年1月14日）
【ファンド名】	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①各ファンドは、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。

②各ファンドの信託金限度額は、各々5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

●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)にマザーファンド*を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

*マザーファンドについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご覧ください。

※各ファンドでは、主要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。

●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、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。

*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。

2 信託期間を3つの期間（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に分け、それぞれの期間に応じて、基準価額の目標変動リスク*を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

*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。

・ターゲットイヤーが異なる3つのファンドから選択できます。

	ターゲット・イヤー2040	ターゲット・イヤー2050	ターゲット・イヤー2060	目標変動リスク
資産育成期	設定日以降 2020年の決算日まで	設定日以降 2030年の決算日まで	設定日以降 2040年の決算日まで	6%程度
資産形成期	2020年の決算日翌日以降 2040年の決算日まで	2030年の決算日翌日以降 2050年の決算日まで	2040年の決算日翌日以降 2060年の決算日まで	6%程度から 2%程度へ 月次で逓減
資産安定期	2040年の決算日翌日以降	2050年の決算日翌日以降	2060年の決算日翌日以降	2%程度

※目標変動リスクは、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、上記数値は各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドの収益目標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。

運用プロセス

■資産育成期および資産形成期においては、**「基本配分戦略」**に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

- 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、その時点のファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド、および為替ヘッジ比率を決定します。
- 基本配分戦略は月次で行います。

※基本配分戦略に関して、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。

■資産安定期においては、**「基本配分戦略」**に加え、**「機動的配分戦略」**に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

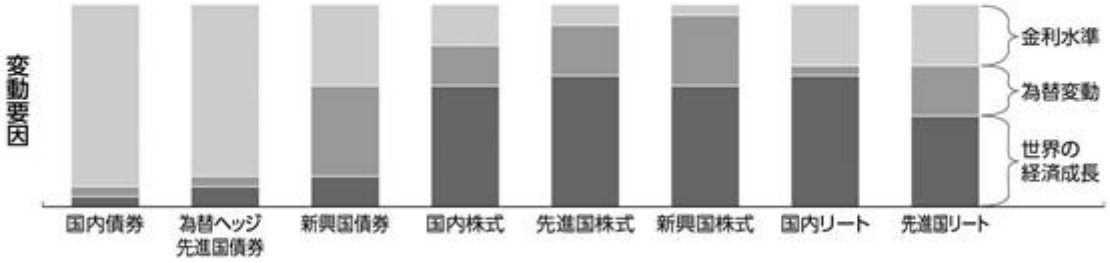
- 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（0%～100%）を変更します。
- 機動的配分戦略は日次で行います。

基本配分戦略
(月次戦略)

資産価格はさまざまな要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。
各ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、この比率を均等に配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分率を決定します。

基本配分比率決定のイメージ

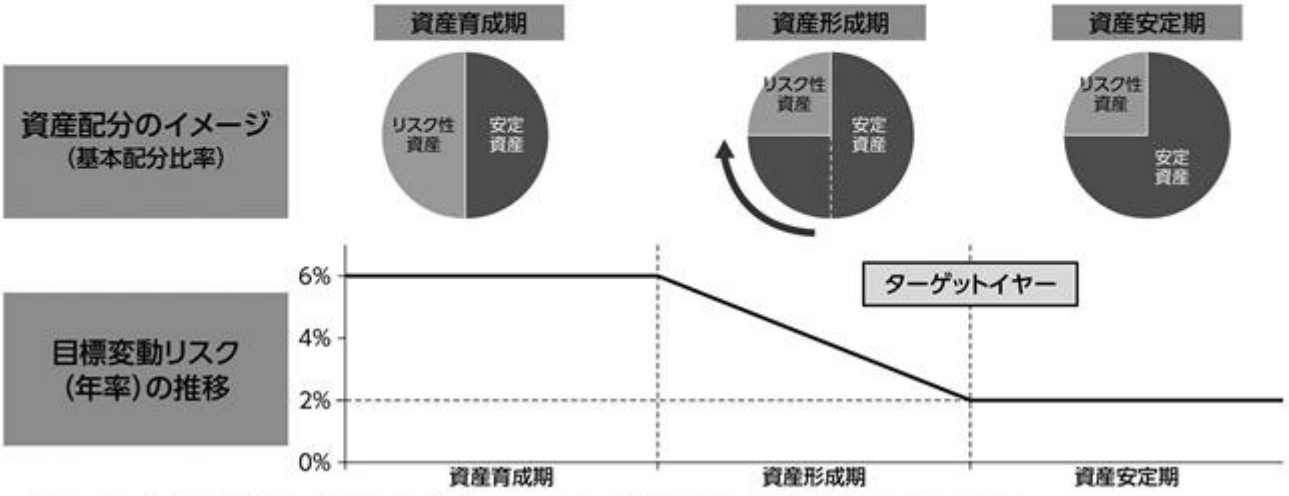
各資産における変動要因と要因の比率(例)



変動要因の比率を均等に配分

着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

変動要因の配分から目標変動リスクになるように最適と判断される資産配分の比率を決定



※上記はイメージであり、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。

機動的配分戦略
（日次戦略）

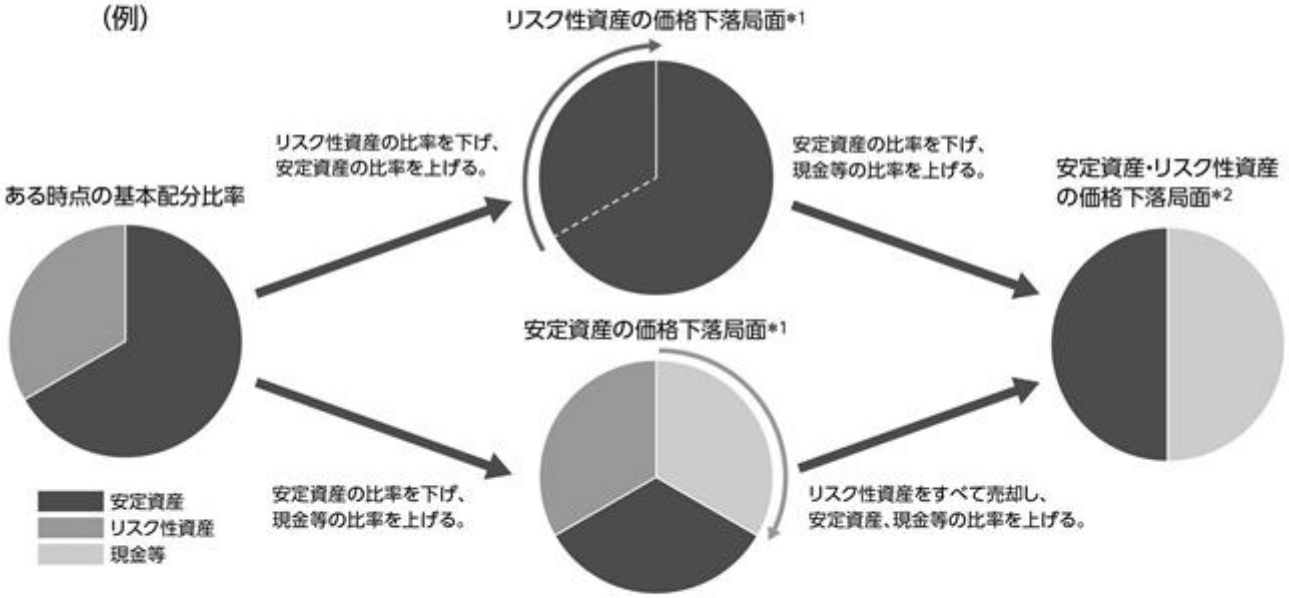
市場環境に応じて、組入資産を安定資産や現金等*に入れ替えます。

資産安定期において、リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、組入資産を安定資産や現金等に入れ替えることで基準価額の下落の抑制をめざします。

＊ 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。

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

価格下落局面における配分比率変更のイメージ



*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。

*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産をすべて売却し、基本配分比率の8資産の合計額のうち半分を現金等に入れ替えます。

※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合もあります。

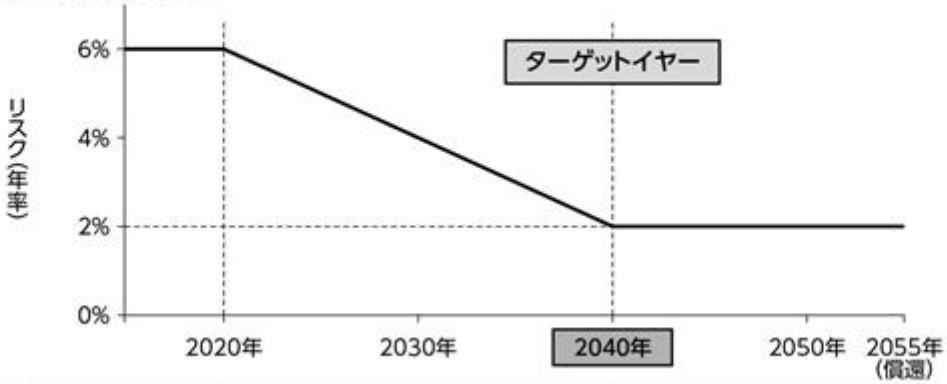
※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

運用期間中のポートフォリオ変化のイメージ

ターゲット・イヤー2040

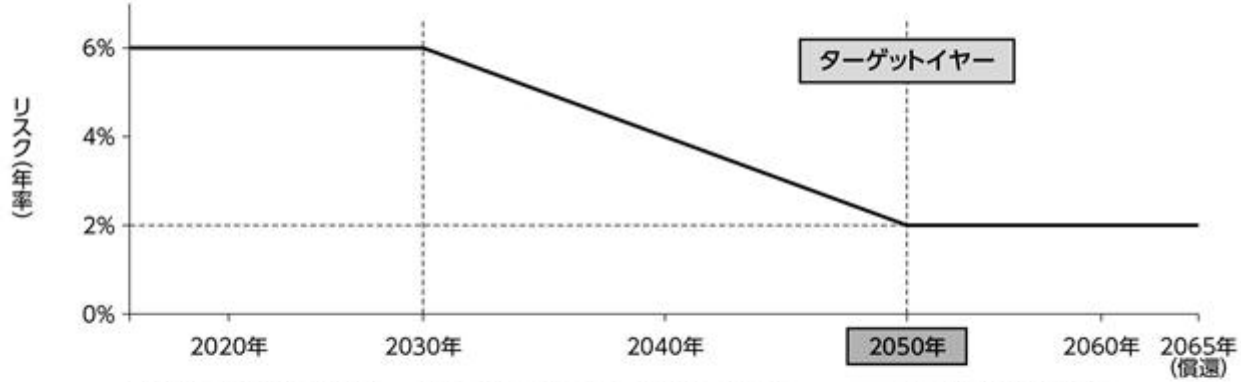
目標変動リスク（年率）の推移



	設定日～2020年決算日	2020年決算日翌日～2040年決算日	2040年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ（基本配分比率）			

ターゲット・イヤー2050

目標変動リスク（年率）の推移

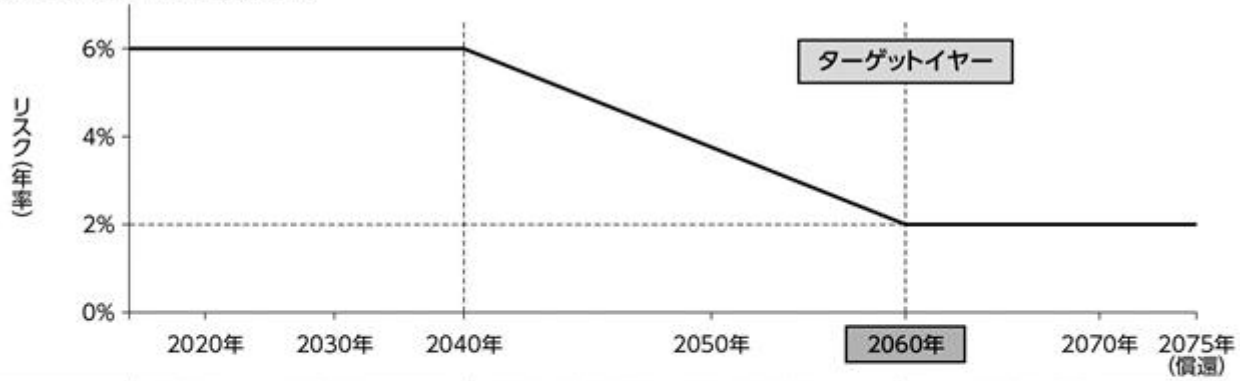


	設定日～2030年決算日	2030年決算日翌日～2050年決算日	2050年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ（基本配分比率）			

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

ターゲット・イヤー2060

目標変動リスク(年率)の推移



	設定日～2040年決算日	2040年決算日翌日～2060年決算日	2060年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ(基本配分比率)			

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

■分配方針

年1回の決算時(毎年1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

各ファンド

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

（注）各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

各ファンド

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

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

（注2）各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

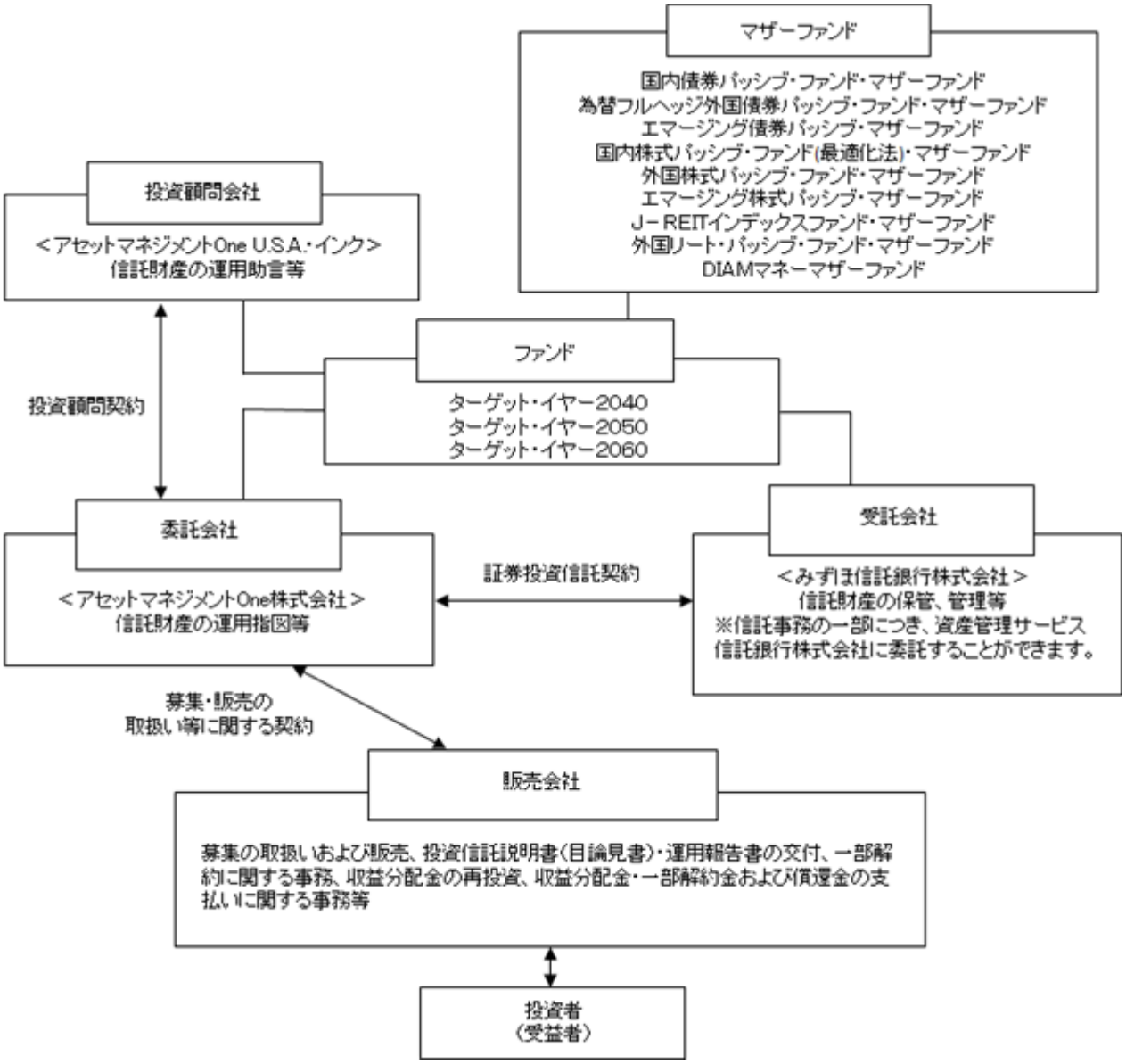
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

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

（2）【ファンドの沿革】

2019年3月18日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

※資産管理サービス信託銀行株式会社は、関係当局の許認可等を前提に、2020年7月27日付でJTCホールディングス株式会社および日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と合併し、株式会社日本カストディ銀行に商号を変更する予定です。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

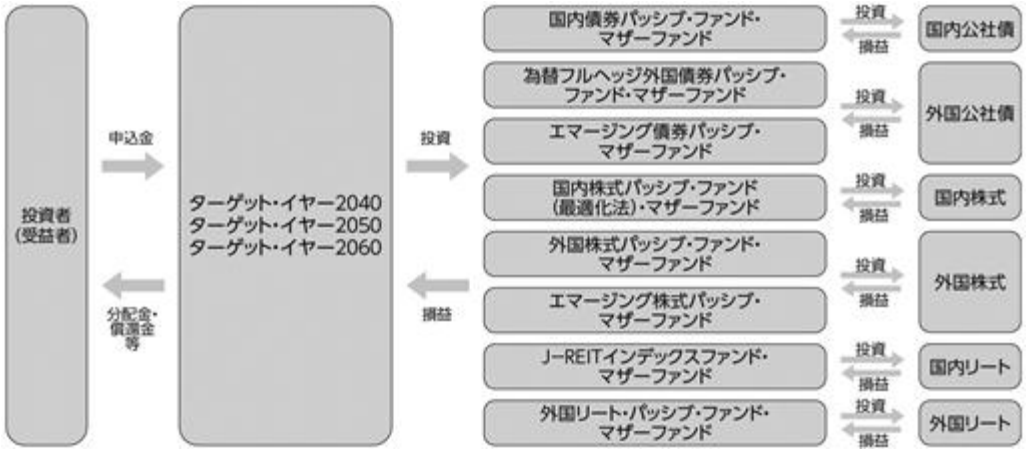
・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

●ファミリーファンド方式とは●

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



※各ファンドは、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）、ＤＩＡＭマネーマザーファンドおよび短期金融資産等に直接投資する場合もあります。

※投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額

20億円（2020年1月31日現在）

委託会社の沿革

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

2016年10月1日　ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2020年1月31日現在）

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

※1：Ａ種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

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）、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券および短期金融資産等に直接投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

・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）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

・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。）

・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、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。

＊一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクの軽減をめざします。

・上記のほか、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）、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」受益証券および短期金融資産等へ直接投資する場合もあります。

・投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

②信託期間中、次に掲げる各期（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に応じて、基準価額の目標変動リスク＊を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

＊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。

	ターゲット・イヤー２０４０	ターゲット・イヤー２０５０	ターゲット・イヤー２０６０	目標変動リスク
	期　　間			
資産育成期	設定日以降 2020年の決算日まで	設定日以降 2030年の決算日まで	設定日以降 2040年の決算日まで	6%程度
資産形成期	2020年の決算日翌日以降 2040年の決算日まで	2030年の決算日翌日以降 2050年の決算日まで	2040年の決算日翌日以降 2060年の決算日まで	6%程度から2%程度へ月次で逓減
資産安定期	2040年の決算日翌日以降	2050年の決算日翌日以降	2060年の決算日翌日以降	2%程度

※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、上記数値は各ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、各ファンドの収益目標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資産育成期および資産形成期においては、基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、ファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド受益証券、および為替ヘッジ比率を決定します。

・基本配分戦略は月次で行います。

④資産安定期においては、基本配分戦略に加え、機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（0%～100%）を変更します。

・機動的配分戦略は日次で行います。

⑤ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託である国内債券パッシブ・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の各受益証券を含む次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）

6．資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10.コマーシャル・ペーパー

11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの

13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

14.投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）

15.投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

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

18.預託証券または預託証書（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上記22.の有価証券の性質を有するもの

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

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

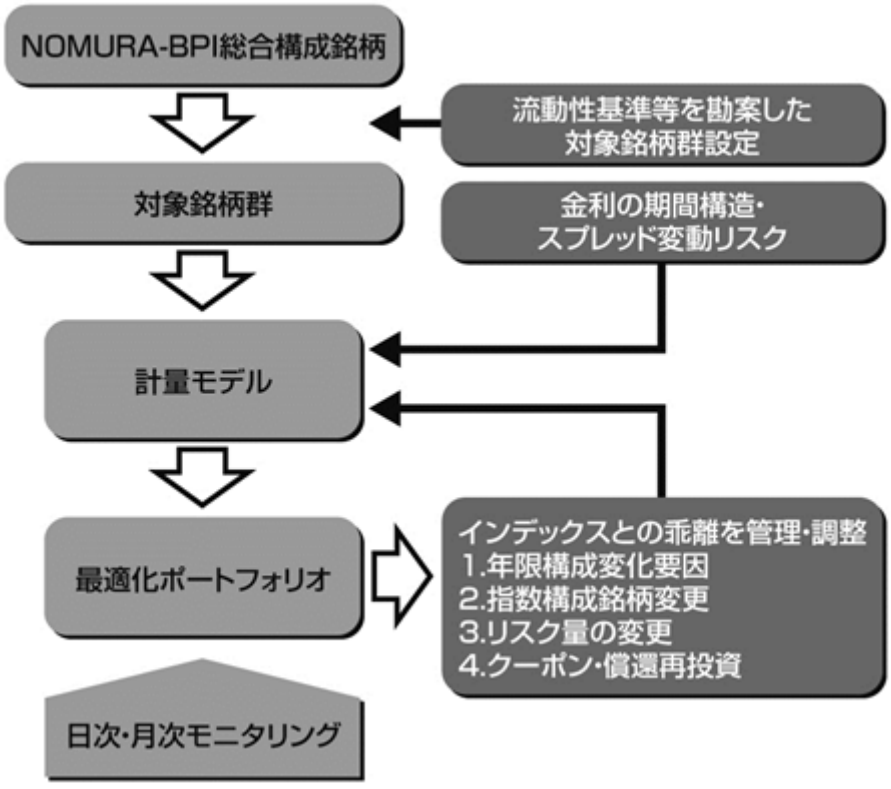
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

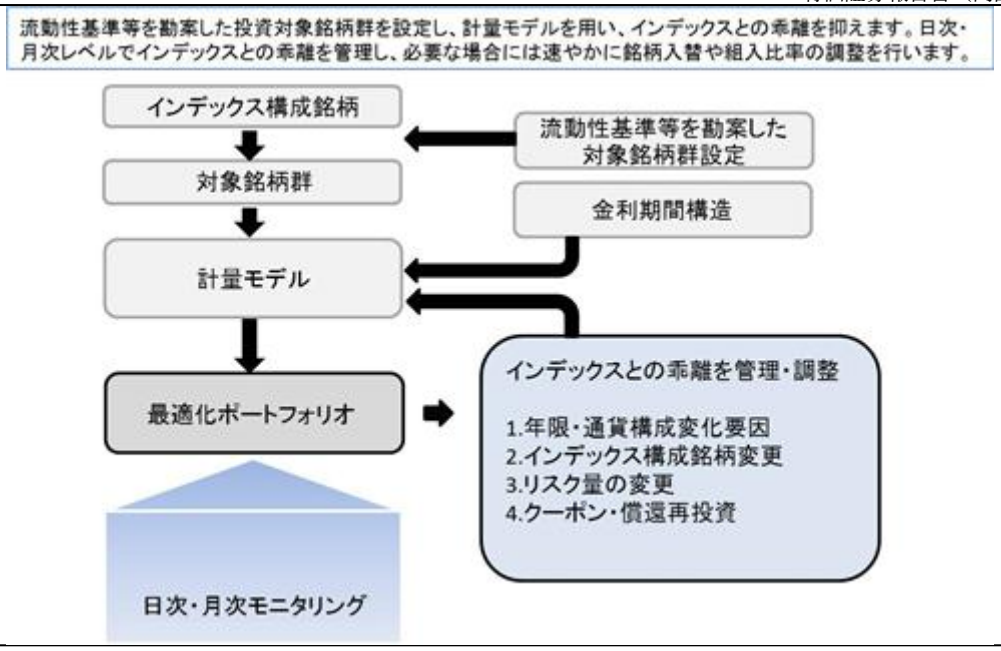
ファンド名	**国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**

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

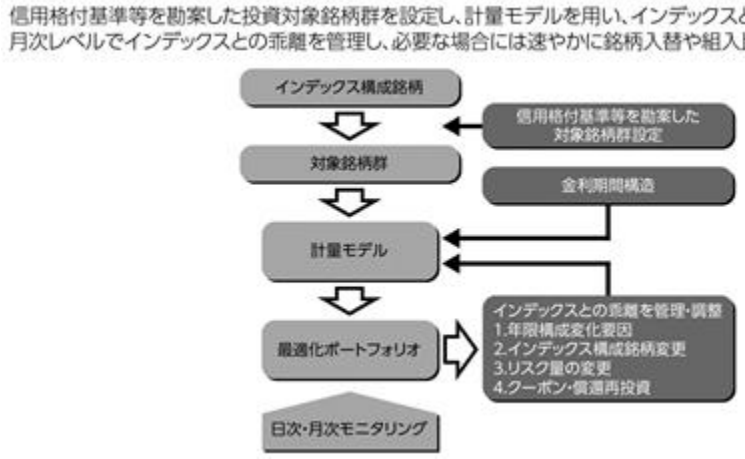
運用プロセス	**1.流動性基準等による対象銘柄群設定** **ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。** **2.最適化法によるポートフォリオの構築** **1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因** **2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因** **1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。** **3.インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **インデックスとの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

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

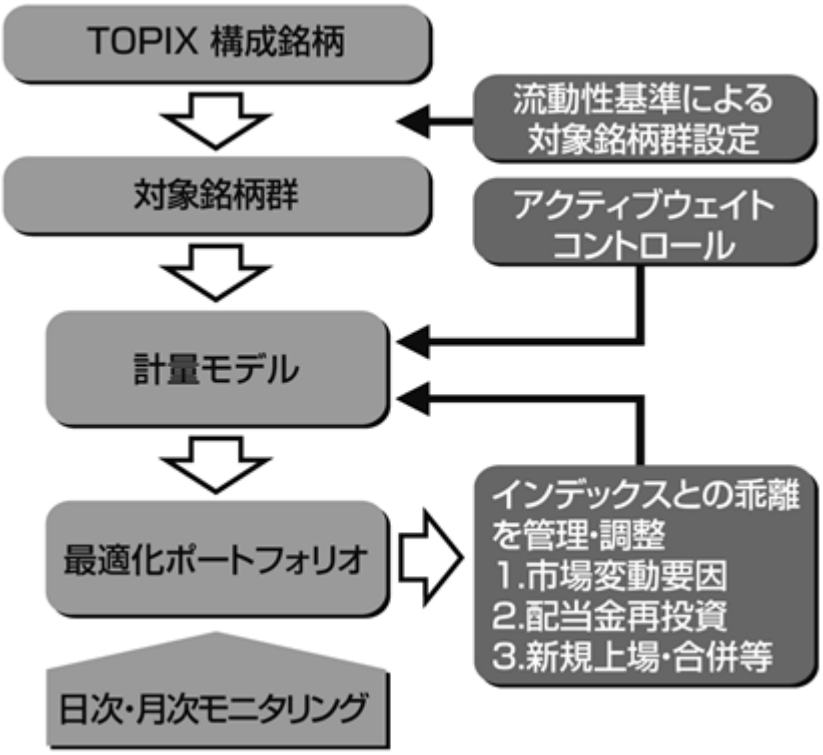
運用プロセス	
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・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	1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※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。
運用プロセス	
主な投資制限	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。 2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

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

運用プロセス	**1.流動性基準による対象銘柄群設定** **マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。** **2.最適化法によるポートフォリオの構築** **インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。** **3.インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。** **・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施** **・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定** **・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施** 

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

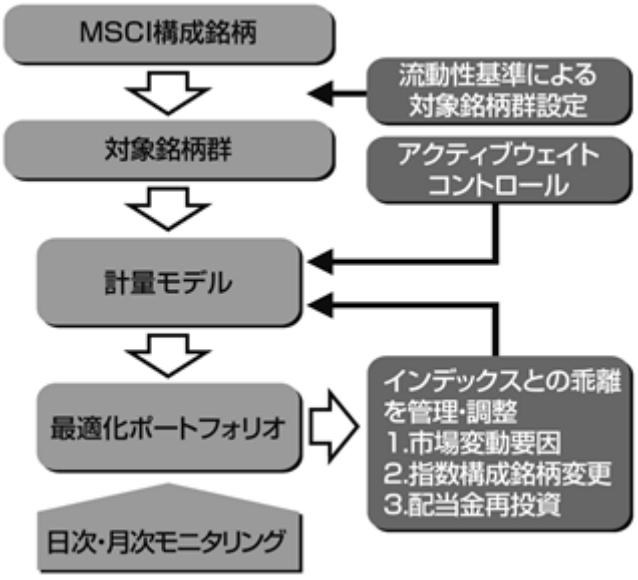
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

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

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

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

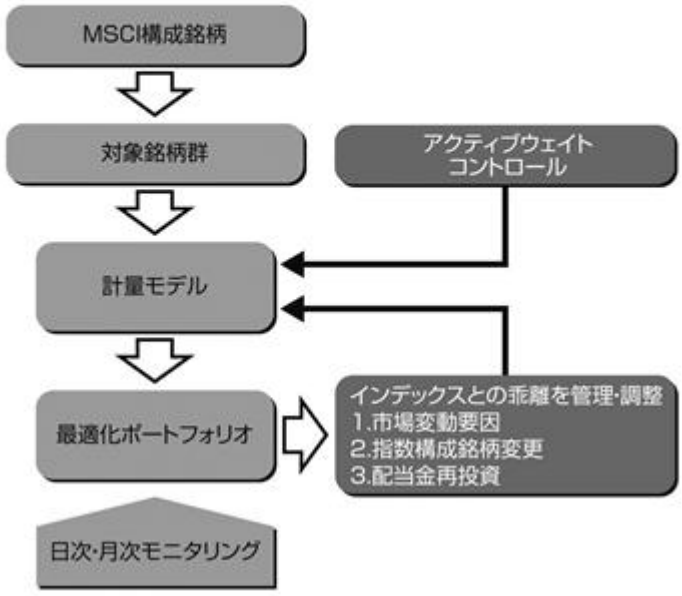
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

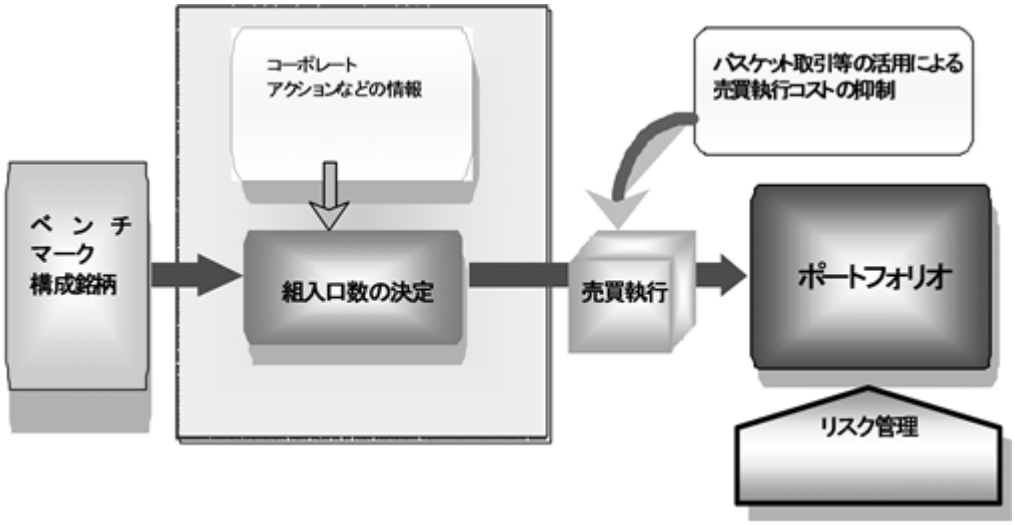
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

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

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

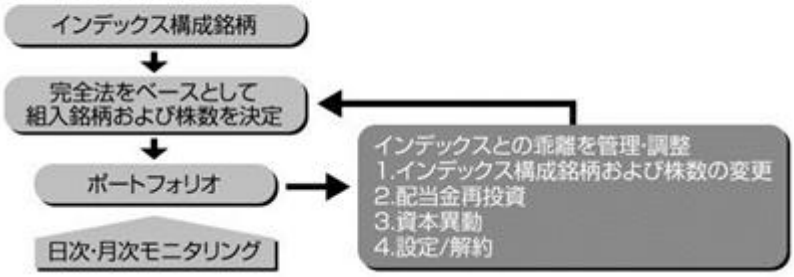
運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

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

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

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

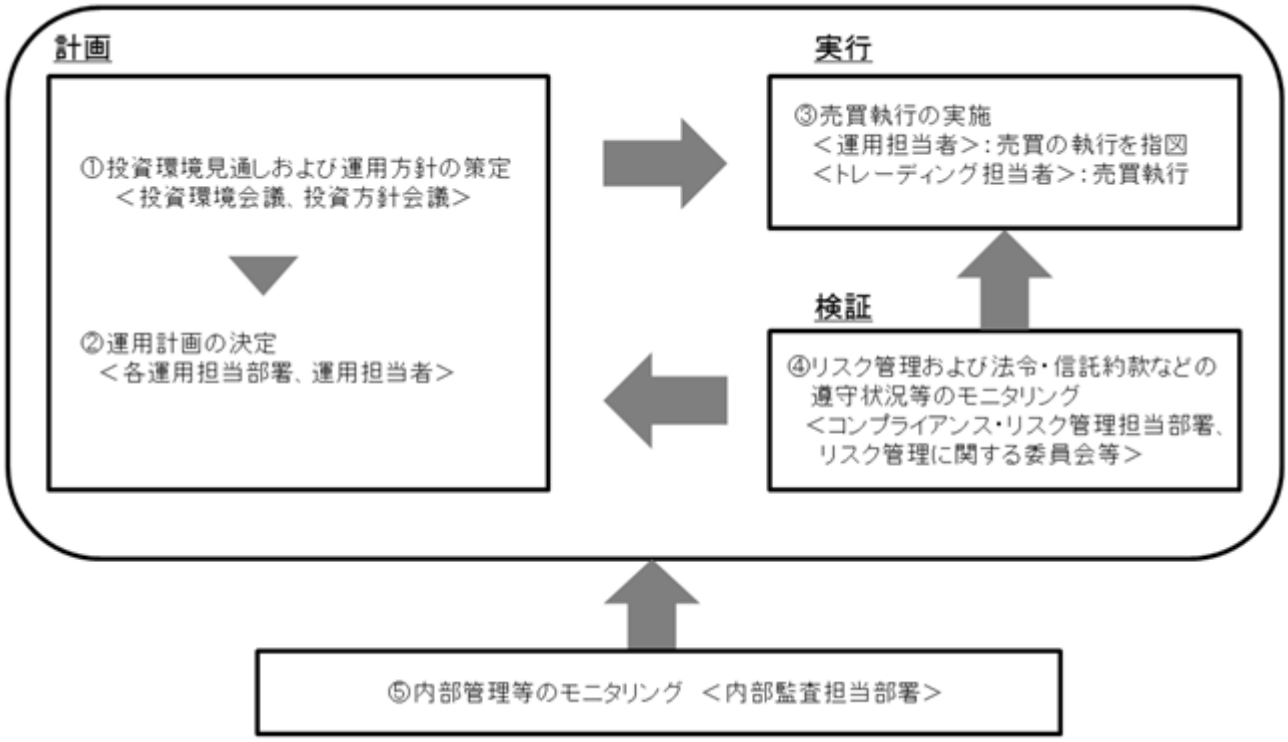
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2020年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1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。

②収益の分配方式

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

1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産

に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

①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）

②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）

③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）

④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）

⑤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）

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

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑧信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑨先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

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

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

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

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

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

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

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

⑩スワップ取引の運用指図（約款第24条）

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

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

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

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

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

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

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

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

⑭公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

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

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

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

⑮公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

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

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

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

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

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。

5）委託会社は、外国為替の売買の予約取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑱資金の借入れ（約款第37条）

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

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑲同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。

各ファンドは短期金融資産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随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。株式市場や各ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

各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場合、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。
為替ヘッジを行う場合、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。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があり、その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。各ファンドが実質的に投資を行う株式・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＞

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

○各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドの受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象イ

ンデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

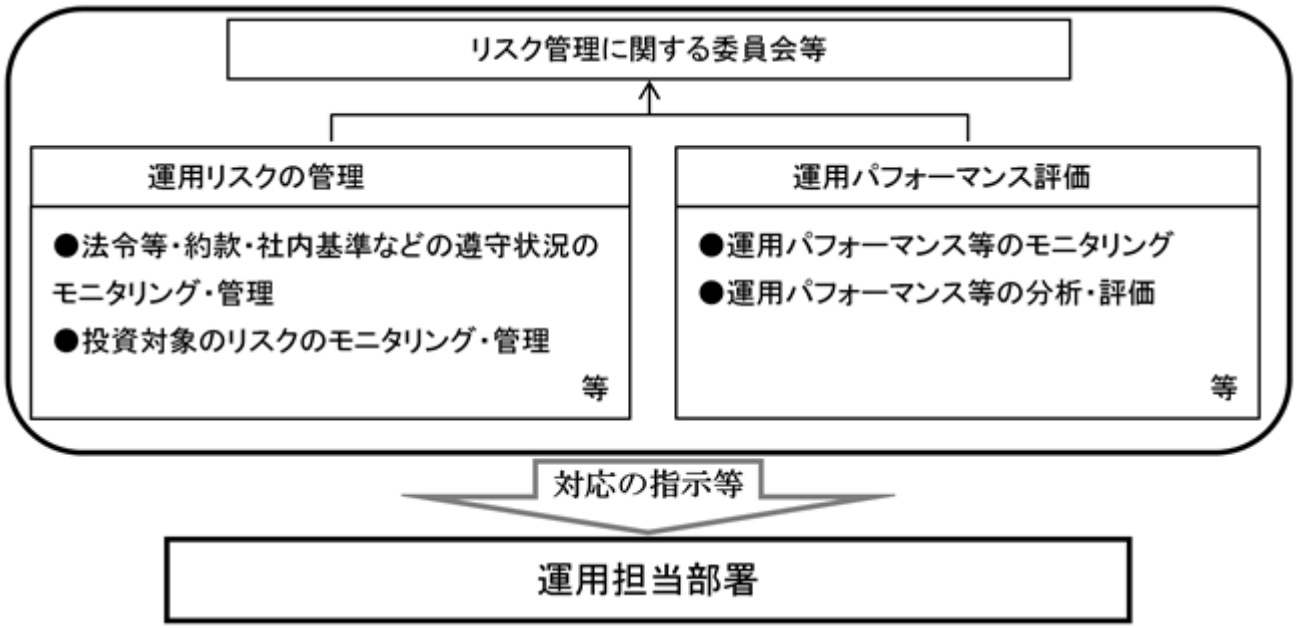
○注意事項

- **各ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券（リート）など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2020年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

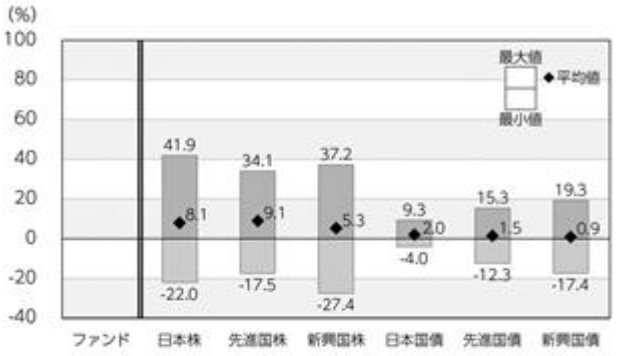
ターゲット・イヤー2040

ターゲット・イヤー2050

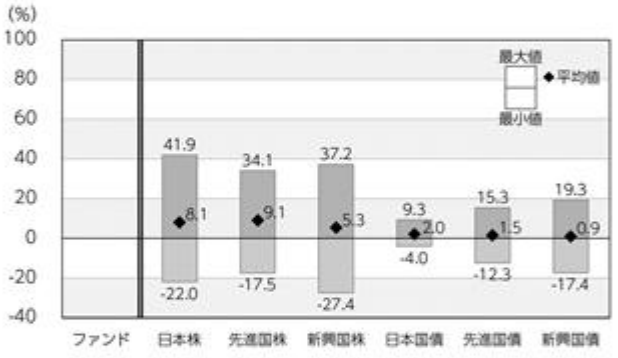
ターゲット・イヤー2060

*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。
*ファンドは2020年1月末現在、設定後1年を経過していないため、年間騰落率はありません。

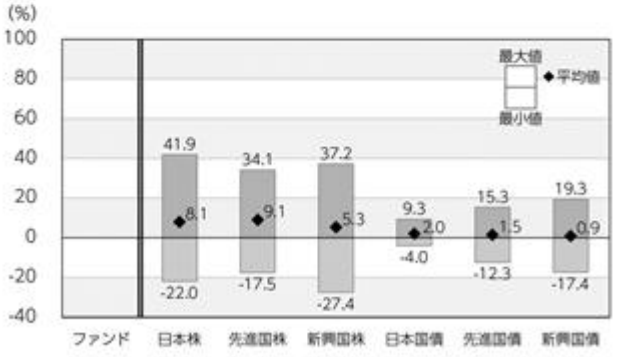
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2020年1月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2015年2月～2020年1月



ファンド:2020年1月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2015年2月～2020年1月



ファンド:2020年1月末現在、設定後1年を経過していないため、データはありません。
代表的な資産クラス:2015年2月～2020年1月

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

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額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が、2020年4月14日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

※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】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.649%～年率0.913%（税抜0.59%～税抜0.83%）

[ターゲット・イヤー２０４０]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期 年率0.913% （税抜0.83%）	0.40%	0.40%	0.03%
第2計算期から第11計算期まで 年率0.825% （税抜0.75%）	0.36%	0.36%	0.03%
第12計算期から第21計算期まで 年率0.737% （税抜0.67%）	0.32%	0.32%	0.03%
第22計算期から第36計算期まで 年率0.649% （税抜0.59%）	0.28%	0.28%	0.03%

[ターゲット・イヤー２０５０]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第11計算期まで 年率0.913% （税抜0.83%）	0.40%	0.40%	0.03%
第12計算期から第21計算期まで 年率0.825% （税抜0.75%）	0.36%	0.36%	0.03%
第22計算期から第31計算期まで 年率0.737% （税抜0.67%）	0.32%	0.32%	0.03%
第32計算期から第46計算期まで 年率0.649% （税抜0.59%）	0.28%	0.28%	0.03%

[ターゲット・イヤー２０６０]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第21計算期まで 年率0.913% （税抜0.83%）	0.40%	0.40%	0.03%
第22計算期から第31計算期まで 年率0.825% （税抜0.75%）	0.36%	0.36%	0.03%
第32計算期から第41計算期まで 年率0.737% （税抜0.67%）	0.32%	0.32%	0.03%
第42計算期から第56計算期まで 年率0.649% （税抜0.59%）	0.28%	0.28%	0.03%

支払先	主な役務
委託会社	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	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

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

※委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（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が含まれます。投資顧問報酬率は各計算期間における信託報酬率に応じて、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）	投資顧問報酬率（年率）
0.913%（税抜0.83%）	0.180%
0.825%（税抜0.75%）	0.162%
0.737%（税抜0.67%）	0.144%
0.649%（税抜0.59%）	0.126%

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

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

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、2020年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		18,254,172	97.42
	内　日本	18,254,172	97.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		483,731	2.58
純資産総額		18,737,903	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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		15,846,890	97.60
	内　日本	15,846,890	97.60
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		389,897	2.40
純資産総額		16,236,787	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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		18,474,800	98.14
	内　日本	18,474,800	98.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		350,537	1.86
純資産総額		18,825,337	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2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		175,553,547,600	78.46
	内　日本	175,553,547,600	78.46
地方債証券		18,589,796,000	8.31
	内　日本	18,589,796,000	8.31
特殊債券		16,613,194,413	7.43
	内　日本	16,613,194,413	7.43
社債券		10,565,044,450	4.72
	内　日本	10,159,954,450	4.54
	内　フランス	405,090,000	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,423,214,165	1.08
純資産総額		223,744,796,628	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		475,915,771,115	96.77
	内　アメリカ	233,155,432,020	47.41
	内　フランス	45,333,016,390	9.22
	内　イタリア	41,942,526,774	8.53
	内　イギリス	31,611,823,654	6.43
	内　ドイツ	29,253,320,256	5.95
	内　スペイン	26,242,352,952	5.34
	内　ベルギー	11,920,877,136	2.42
	内　オーストラリア	9,255,225,187	1.88
	内　オランダ	9,115,913,851	1.85
	内　カナダ	9,004,643,212	1.83
	内　オーストリア	7,177,981,581	1.46
	内　アイルランド	4,174,855,727	0.85
	内　メキシコ	4,114,892,991	0.84
	内　フィンランド	2,891,720,843	0.59
	内　ポーランド	2,137,755,889	0.43
	内　南アフリカ	2,048,596,775	0.42
	内　デンマーク	2,010,664,176	0.41
	内　シンガポール	1,573,591,238	0.32
	内　マレーシア	1,212,121,565	0.25
	内　スウェーデン	1,083,087,551	0.22
	内　ノルウェー	655,371,347	0.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		15,903,665,335	3.23
純資産総額		491,819,436,450	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2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		138,065,360,228	98.31
	内　メキシコ	21,768,004,097	15.50
	内　インドネシア	19,075,085,459	13.58
	内　ロシア	18,060,716,442	12.86
	内　ブラジル	15,067,812,153	10.73
	内　コロンビア	14,660,793,145	10.44
	内　フィリピン	12,989,750,003	9.25
	内　南アフリカ	7,141,532,372	5.09
	内　パナマ	7,138,624,240	5.08
	内　ハンガリー	7,018,329,235	5.00
	内　ペルー	6,428,753,248	4.58
	内　ルーマニア	5,122,254,587	3.65
	内　クロアチア	3,593,705,247	2.56
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,369,798,848	1.69
純資産総額		140,435,159,076	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2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		250,908,549,470	97.21
	内　日本	250,908,549,470	97.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,202,010,508	2.79
純資産総額		258,110,559,978	100.00

その他資産の投資状況

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		7,135,750,000	2.76
	内　日本	7,135,750,000	2.76

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		339,608,182,312	94.77
	内　アメリカ	225,402,988,084	62.90
	内　イギリス	19,528,877,131	5.45
	内　スイス	12,921,364,432	3.61
	内　カナダ	12,904,428,305	3.60
	内　フランス	12,473,196,865	3.48
	内　ドイツ	10,510,050,312	2.93
	内　オーストラリア	7,835,855,534	2.19
	内　オランダ	6,482,717,243	1.81

	内　アイルランド	6,438,181,460	1.80
	内　スペイン	3,500,998,102	0.98
	内　スウェーデン	3,037,849,651	0.85
	内　香港	2,939,768,419	0.82
	内　イタリア	2,433,208,187	0.68
	内　デンマーク	2,331,601,411	0.65
	内　フィンランド	1,436,579,570	0.40
	内　シンガポール	1,425,372,069	0.40
	内　バミューダ	1,350,700,776	0.38
	内　ベルギー	1,190,400,969	0.33
	内　ジャージィー	1,184,421,991	0.33
	内　ケイマン諸島	765,158,473	0.21
	内　イスラエル	742,565,541	0.21
	内　ノルウェー	742,135,994	0.21
	内　オランダ領キュラソー	395,716,109	0.11
	内　ニュージーランド	343,555,180	0.10
	内　ルクセンブルグ	320,707,279	0.09
	内　オーストリア	260,363,158	0.07
	内　ポルトガル	209,650,620	0.06
	内　リベリア	183,741,834	0.05
	内　パナマ	155,988,463	0.04
	内　マン島	62,921,285	0.02
	内　パプアニューギニア	55,577,954	0.02
	内　イギリス領バージン諸島	41,539,911	0.01
投資信託受益証券		805,689,639	0.22
	内　オーストラリア	616,716,869	0.17
	内　シンガポール	188,972,770	0.05
投資証券		8,812,493,088	2.46
	内　アメリカ	7,879,809,981	2.20
	内　イギリス	246,217,426	0.07
	内　フランス	221,498,709	0.06
	内　香港	175,801,438	0.05
	内　オランダ	163,157,608	0.05
	内　カナダ	126,007,926	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,112,669,706	2.54
純資産総額		358,339,034,745	100.00

その他資産の投資状況

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		9,705,343,760	2.71
	内　アメリカ	6,978,273,625	1.95
	内　ドイツ	1,584,449,646	0.44
	内　イギリス	564,427,936	0.16
	内　カナダ	362,054,847	0.10
	内　オーストラリア	216,137,706	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		48,980,603,570	87.82
	内　ケイマン諸島	9,084,261,183	16.29
	内　中国	5,961,945,655	10.69
	内　韓国	5,813,369,280	10.42
	内　台湾	5,582,661,051	10.01
	内　インド	4,502,170,093	8.07
	内　ブラジル	3,488,458,172	6.25
	内　南アフリカ	2,171,434,359	3.89
	内　ロシア	1,919,164,264	3.44
	内　香港	1,430,707,460	2.57
	内　サウジアラビア	1,286,062,378	2.31
	内　タイ	1,219,199,557	2.19
	内　インドネシア	988,838,735	1.77
	内　マレーシア	900,391,794	1.61
	内　メキシコ	896,557,071	1.61
	内　カタール	467,895,138	0.84
	内　フィリピン	459,958,546	0.82
	内　バミューダ	439,491,708	0.79
	内　ポーランド	421,942,138	0.76
	内　チリ	353,304,661	0.63
	内　アラブ首長国連邦	308,865,722	0.55
	内　トルコ	259,040,502	0.46
	内　コロンビア	181,572,122	0.33
	内　アメリカ	154,199,825	0.28
	内　ハンガリー	139,800,901	0.25
	内　ギリシャ	138,299,780	0.25
	内　エジプト	68,232,712	0.12
	内　ルクセンブルグ	66,824,517	0.12
	内　チェコ	64,758,849	0.12
	内　アルゼンチン	45,798,201	0.08
	内　オランダ	36,229,295	0.06
	内　ジャージィー	35,402,354	0.06
	内　マン島	26,105,752	0.05

	内　ペルー	21,134,890	0.04
	内　パキスタン	17,663,191	0.03
	内　シンガポール	16,741,015	0.03
	内　ベルギー	6,184,382	0.01
	内　スペイン	5,936,317	0.01
新株予約権証券		72,880	0.00
	内　タイ	72,880	0.00
投資信託受益証券		430,033,180	0.77
	内　メキシコ	277,274,487	0.50
	内　ブラジル	152,758,693	0.27
投資証券		114,467,520	0.21
	内　南アフリカ	68,720,464	0.12
	内　メキシコ	45,747,056	0.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		6,248,649,779	11.20
純資産総額		55,773,826,929	100.00

その他資産の投資状況

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		6,243,134,247	11.19
	内　アメリカ	6,243,134,247	11.19

（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2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		41,872,339,100	96.45
	内　日本	41,872,339,100	96.45
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,543,342,777	3.55
純資産総額		43,415,681,877	100.00

その他資産の投資状況

令和2年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		1,342,236,000	3.09
	内　日本	1,342,236,000	3.09

（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2年1月31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		4,421,772,230	10.48
	内　オーストラリア	2,728,907,421	6.47
	内　シンガポール	1,692,864,809	4.01
投資証券		37,524,137,042	88.96
	内　アメリカ	30,984,311,904	73.46
	内　イギリス	2,199,332,355	5.21
	内　カナダ	853,451,493	2.02
	内　フランス	829,724,378	1.97
	内　香港	757,277,553	1.80
	内　オランダ	675,399,419	1.60
	内　ベルギー	453,133,795	1.07
	内　スペイン	272,955,461	0.65
	内　ニュージーランド	181,357,176	0.43
	内　ドイツ	118,081,156	0.28
	内　ガーンジィ	82,262,869	0.20
	内　アイルランド	55,839,338	0.13
	内　イスラエル	32,323,450	0.08
	内　マン島	12,655,271	0.03
	内　イタリア	9,712,071	0.02
	内　韓国	6,319,353	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		234,301,102	0.56
純資産総額		42,180,210,374	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,152,173	1.4029 7,228,227	1.4294 7,364,516	－ －	39.30
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	1,336,127	2.0935 2,797,203	2.1083 2,816,956	－ －	15.03
3	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	923,394	2.7514 2,540,658	2.6665 2,462,230	－ －	13.14
4	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	1,243,500	1.4015 1,742,856	1.4072 1,749,853	－ －	9.34
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,200,224	1.2804 1,536,878	1.1890 1,427,066	－ －	7.62
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	708,019	1.3143 930,579	1.3233 936,921	－ －	5.00
7	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	346,586	2.3766 823,708	2.4694 855,859	－ －	4.57
8	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	158,493	4.1043 650,515	4.0429 640,771	－ －	3.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.42
合計	97.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	4,452,582	1.4024 6,244,443	1.4294 6,364,520	－ －	39.20
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	1,166,883	2.0936 2,443,054	2.1083 2,460,139	－ －	15.15
3	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	812,257	2.7517 2,235,103	2.6665 2,165,883	－ －	13.34
4	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	1,088,584	1.4013 1,525,474	1.4072 1,531,855	－ －	9.43
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,018,721	1.2820 1,306,102	1.1890 1,211,259	－ －	7.46
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	610,771	1.3140 802,567	1.3233 808,233	－ －	4.98
7	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	300,378	2.3752 713,481	2.4694 741,753	－ －	4.57
8	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	139,318	4.1018 571,467	4.0429 563,248	－ －	3.47

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.60
合計	97.60

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	5,162,442	1.4070 7,263,657	1.4294 7,379,194	－ －	39.20
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	1,347,212	2.0946 2,821,902	2.1083 2,840,327	－ －	15.09
3	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	946,057	2.7346 2,587,171	2.6665 2,522,660	－ －	13.40
4	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	1,272,397	1.4028 1,784,935	1.4072 1,790,517	－ －	9.51
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,244,247	1.2663 1,575,638	1.1890 1,479,409	－ －	7.86
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	708,717	1.3158 932,568	1.3233 937,845	－ －	4.98
7	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	348,619	2.3909 833,534	2.4694 860,879	－ －	4.57
8	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	164,231	4.0907 671,824	4.0429 663,969	－ －	3.53

（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2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	98.14
合計	98.14

（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。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	2,250,000,000	102.81 2,313,247,000	101.97 2,294,370,000	0.1 2028/3/20	1.03
2	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	100.35 2,207,722,000	0.1 2021/6/20	0.99
3	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	100.42 2,128,988,800	0.1 2021/9/20	0.95
4	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	101.70 2,013,699,600	0.1 2026/3/20	0.90
5	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	101.91 1,997,514,400	0.1 2026/12/20	0.89
6	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,930,000,000	101.93 1,967,394,000	101.84 1,965,569,900	0.1 2026/9/20	0.88
7	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	102.82 1,963,862,000	0.3 2025/12/20	0.88
8	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	103.26 1,962,073,000	0.4 2025/9/20	0.88
9	３３５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,900,000,000	103.62 1,968,797,000	103.14 1,959,812,000	0.5 2024/9/20	0.88
10	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	101.94 1,957,363,200	0.1 2027/3/20	0.87
11	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,860,000,000	102.06 1,898,426,000	101.90 1,895,414,400	0.1 2028/6/20	0.85
12	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,790,000,000	104.07 1,862,853,000	103.12 1,845,848,000	0.4 2025/6/20	0.82
13	３３４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,770,000,000	103.92 1,839,446,000	103.41 1,830,480,900	0.6 2024/6/20	0.82
14	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	103.31 1,828,587,000	0.8 2023/6/20	0.82
15	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,780,000,000	101.91 1,814,134,000	101.77 1,811,559,400	0.1 2026/6/20	0.81

16	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	101.99 1,795,059,200	0.1 2027/12/20	0.80
17	１３０回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,780,000,000	100.72 1,792,860,400	100.48 1,788,704,200	0.1 2021/12/20	0.80
18	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	102.97 1,781,415,600	0.4 2025/3/20	0.80
19	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,720,000,000	102.16 1,757,182,000	101.87 1,752,215,600	0.1 2028/9/20	0.78
20	３３３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,650,000,000	103.93 1,714,947,000	103.21 1,703,097,000	0.6 2024/3/20	0.76
21	３４８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,630,000,000	101.86 1,660,375,000	102.00 1,662,714,100	0.1 2027/9/20	0.74
22	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,560,000,000	101.80 1,588,156,800	101.97 1,590,856,800	0.1 2027/6/20	0.71
23	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	101.86 1,527,900,000	1.2 2021/6/20	0.68
24	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,500,000,000	101.42 1,521,300,000	101.83 1,527,540,000	0.1 2028/12/20	0.68
25	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	101.79 1,496,371,800	0.1 2029/3/20	0.67
26	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	101.74 1,475,346,000	0.1 2029/6/20	0.66
27	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	101.09 1,465,848,500	0.1 2023/12/20	0.66
28	３３２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,410,000,000	103.76 1,463,016,000	103.02 1,452,638,400	0.6 2023/12/20	0.65
29	１３１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,420,000,000	100.83 1,431,786,000	100.56 1,428,008,800	0.1 2022/3/20	0.64
30	１４１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,410,000,000	101.29 1,428,319,800	101.25 1,427,751,900	0.1 2024/9/20	0.64

（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2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	78.46
地方債証券	8.31
特殊債券	7.43
社債券	4.72
合計	98.92

（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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	US T N/B 1.5 11/30/21 アメリカ	国債証券	3,781,110,200	99.82 3,774,520,253	100.15 3,786,870,455	1.5 2021/11/30	0.77
2	US T N/B 1.375 10/15/22 アメリカ	国債証券	3,444,114,800	99.39 3,423,177,336	100.01 3,444,787,468	1.375 2022/10/15	0.70
3	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	2,642,523,800	110.77 2,927,182,435	113.09 2,988,529,259	3.125 2028/11/15	0.61
4	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	2,817,019,800	101.23 2,851,817,663	103.14 2,905,491,827	2 2025/8/15	0.59
5	US T N/B 1.625 12/15/22 アメリカ	国債証券	2,700,325,600	100.07 2,702,389,647	100.74 2,720,472,539	1.625 2022/12/15	0.55
6	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	2,623,983,600	101.22 2,656,072,431	103.00 2,702,908,092	2 2025/2/15	0.55
7	US T N/B 2.375 04/15/21 アメリカ	国債証券	2,640,342,600	100.92 2,664,797,743	101.06 2,668,499,371	2.375 2021/4/15	0.54
8	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,503,750,000	171.27 2,575,542,318	173.67 2,611,636,308	5.75 2032/10/25	0.53
9	ITALY BTPS 4.5 03/01/26 イタリア	国債証券	2,018,634,000	121.82 2,459,284,664	124.08 2,504,922,930	4.5 2026/3/1	0.51
10	US T N/B 2.125 05/31/21 アメリカ	国債証券	2,409,135,400	100.52 2,421,903,576	100.85 2,429,744,782	2.125 2021/5/31	0.49
11	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	2,402,591,800	100.03 2,403,358,204	100.71 2,419,766,557	1.625 2022/11/15	0.49
12	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	2,312,072,000	101.26 2,341,417,449	102.62 2,372,763,890	2 2024/5/31	0.48
13	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	2,181,039,000	107.18 2,337,687,969	108.61 2,368,835,182	0.75 2028/5/25	0.48
14	US T N/B 2.375 05/15/29 アメリカ	国債証券	2,150,663,200	104.75 2,252,930,644	107.17 2,305,074,084	2.375 2029/5/15	0.47
15	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証券	2,277,172,800	99.73 2,271,041,216	100.09 2,279,396,595	1.5 2021/9/30	0.46

16	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証券	2,208,465,000	101.40 2,239,516,017	103.03 2,275,409,094	2.125 2024/3/31	0.46
17	US T N/B 1.5 08/15/26 アメリカ	国債証券	2,077,593,000	98.45 2,045,400,298	100.28 2,083,598,530	1.5 2026/8/15	0.42
18	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	1,725,102,000	116.17 2,004,169,241	117.80 2,032,228,289	1.5 2031/5/25	0.41
19	US T N/B 2.5 01/31/21 アメリカ	国債証券	1,957,627,000	101.03 1,977,888,439	100.96 1,976,591,511	2.5 2021/1/31	0.40
20	ITALY BTPS 4.0 02/01/37 イタリア	国債証券	1,420,743,000	129.86 1,845,040,358	137.08 1,947,696,578	4 2037/2/1	0.40
21	US T N/B 2.625 07/15/21 アメリカ	国債証券	1,818,030,200	101.70 1,849,118,516	101.69 1,848,780,471	2.625 2021/7/15	0.38
22	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	997,287,000	184.73 1,842,334,803	184.43 1,839,332,316	4.5 2041/4/25	0.37
23	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,683,886,400	105.43 1,775,353,309	109.17 1,838,330,354	2.625 2029/2/15	0.37
24	US T N/B 1.625 08/15/29 アメリカ	国債証券	1,802,761,800	99.93 1,801,603,806	100.66 1,814,733,255	1.625 2029/8/15	0.37
25	US T N/B 2.625 06/15/21 アメリカ	国債証券	1,773,315,600	101.65 1,802,752,638	101.55 1,800,815,841	2.625 2021/6/15	0.37
26	US T N/B 3.75 11/15/43 アメリカ	国債証券	1,350,162,800	126.65 1,710,055,004	132.82 1,793,290,441	3.75 2043/11/15	0.36
27	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,629,356,400	105.78 1,723,614,667	109.46 1,783,508,781	2.75 2028/2/15	0.36
28	FRANCE OAT 2.25 10/25/22 フランス	国債証券	1,640,892,000	109.70 1,800,074,932	107.87 1,770,092,389	2.25 2022/10/25	0.36
29	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,643,534,200	102.09 1,677,933,370	105.23 1,729,562,941	2.25 2027/2/15	0.35
30	US T N/B 2.5 02/28/21 アメリカ	国債証券	1,711,151,400	101.11 1,730,196,515	101.04 1,728,998,160	2.5 2021/2/28	0.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	96.77
合計	96.77

（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2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,726,500,000	117.74 3,210,311,972	129.87 3,541,014,610	5.25 2047/6/23	2.52
2	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	2,410,226,000	105.94 2,553,438,139	108.12 2,606,056,862	4.25 2025/1/7	1.86
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,744,960,000	116.81 2,038,385,930	120.44 2,101,690,897	5 2045/6/15	1.50
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,515,934,000	127.52 1,933,208,466	134.34 2,036,573,952	6.05 2040/1/11	1.45
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,526,840,000	123.34 1,883,313,516	132.95 2,029,949,048	5.625 2042/4/4	1.45
6	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,788,584,000	108.23 1,935,945,872	112.92 2,019,751,327	4.75 2026/5/27	1.44
7	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,308,720,000	140.53 1,839,262,000	151.84 1,987,219,340	5.625 2050/11/18	1.42
8	BRAZIL 2.625 01/05/23 ブラジル	国債証券	1,941,268,000	100.40 1,949,033,072	101.32 1,966,989,801	2.625 2023/1/5	1.40
9	PERU 6.55 03/14/37 ペルー	国債証券	1,308,720,000	146.62 1,918,954,324	149.16 1,952,086,752	6.55 2037/3/14	1.39
10	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,505,028,000	112.20 1,688,657,775	123.84 1,863,894,401	5.75 2110/10/12	1.33
11	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	1,526,840,000	117.11 1,788,213,196	121.79 1,859,622,412	5.1 2035/3/28	1.32
12	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,592,276,000	112.94 1,798,355,776	116.71 1,858,496,585	5.625 2047/2/21	1.32
13	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,570,464,000	109.79 1,724,238,600	115.09 1,807,501,983	4.75 2044/3/8	1.29
14	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,690,430,000	106.11 1,793,737,085	106.59 1,801,989,927	4 2023/10/2	1.28
15	PHILIPPINES 4.2 01/21/24 フィリピン	国債証券	1,614,088,000	108.72 1,754,868,101	108.84 1,756,922,455	4.2 2024/1/21	1.25
16	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	1,068,788,000	163.11 1,743,388,663	163.49 1,747,388,808	9.5 2030/2/2	1.24
17	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,526,840,000	113.29 1,729,767,942	113.85 1,738,383,682	5.75 2023/11/22	1.24
18	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,526,840,000	110.55 1,687,921,620	112.05 1,710,839,488	4.5 2029/4/22	1.22

19	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,505,028,000	106.49 1,602,827,555	110.42 1,661,942,219	4.625 2028/1/13	1.18
20	CROATIA 6.375 03/24/21 クロアチア	国債証券	1,570,464,000	105.81 1,661,865,004	104.85 1,646,631,504	6.375 2021/3/24	1.17
21	INDONESIA 5.875 01/15/24 インドネシア	国債証券	1,439,592,000	112.92 1,625,657,957	113.72 1,637,145,927	5.875 2024/1/15	1.17
22	INDONESIA 4.125 01/15/25 インドネシア	国債証券	1,505,028,000	106.06 1,596,261,270	108.22 1,628,778,927	4.125 2025/1/15	1.16
23	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,199,660,000	131.15 1,573,354,090	134.32 1,611,449,293	6.125 2041/1/18	1.15
24	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,461,404,000	109.42 1,599,146,780	109.49 1,600,149,695	4.875 2023/9/16	1.14
25	COLOMBIA 3.875 04/25/27 コロンビア	国債証券	1,483,216,000	106.07 1,573,330,969	107.58 1,595,729,057	3.875 2027/4/25	1.14
26	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,079,694,000	138.89 1,499,639,345	143.00 1,543,962,420	6.7 2036/1/26	1.10
27	RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43 ロシア	国債証券	1,112,412,000	129.39 1,439,455,675	137.33 1,527,742,144	5.875 2043/9/16	1.09
28	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,352,344,000	108.77 1,470,946,750	112.51 1,521,569,566	4.375 2029/3/21	1.08
29	HUNGARY 5.375 02/21/23 ハンガリー	国債証券	1,374,156,000	110.10 1,512,995,923	110.27 1,515,347,780	5.375 2023/2/21	1.08
30	COLOMBIA 7.375 09/18/37 コロンビア	国債証券	1,025,164,000	140.96 1,445,088,624	146.46 1,501,552,584	7.375 2037/9/18	1.07

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.31
合計	98.31

（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2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,179,600	6,700.15 7,903,501,028	7,652.00 9,026,299,200	－ －	3.50
2	ソニー 日本	株式 電気機器	668,300	4,985.24 3,331,641,297	7,718.00 5,157,939,400	－ －	2.00

3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	7,177,700	572.93 4,112,381,218	568.50 4,080,522,450	－ －	1.58
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,386,700	2,370.94 3,287,796,006	2,786.50 3,864,039,550	－ －	1.50
5	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	823,100	4,891.88 4,026,506,884	4,524.00 3,723,704,400	－ －	1.44
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	879,600	4,395.64 3,866,410,259	4,227.00 3,718,069,200	－ －	1.44
7	キーエンス 日本	株式 電気機器	95,800	31,633.81 3,030,519,618	37,370.00 3,580,046,000	－ －	1.39
8	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	723,600	3,026.97 2,190,319,328	4,304.00 3,114,374,400	－ －	1.21
9	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	721,100	3,903.59 2,814,885,034	3,884.00 2,800,752,400	－ －	1.09
10	任天堂 日本	株式 その他製品	64,800	31,834.03 2,062,845,460	40,770.00 2,641,896,000	－ －	1.02
11	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	773,100	2,708.42 2,093,882,915	3,271.00 2,528,810,100	－ －	0.98
12	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	766,300	2,647.16 2,028,521,992	3,107.00 2,380,894,100	－ －	0.92
13	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	832,400	2,981.68 2,481,950,900	2,831.00 2,356,524,400	－ －	0.91
14	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	14,168,800	171.77 2,433,846,195	162.50 2,302,430,000	－ －	0.89
15	信越化学工業 日本	株式 化学	177,800	9,605.06 1,707,781,059	12,715.00 2,260,727,000	－ －	0.88
16	第一三共 日本	株式 医薬品	302,500	4,130.89 1,249,595,121	7,441.00 2,250,902,500	－ －	0.87
17	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	211,100	7,031.97 1,484,449,785	10,600.00 2,237,660,000	－ －	0.87
18	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	372,900	5,404.74 2,015,428,038	5,985.00 2,231,806,500	－ －	0.86
19	花王 日本	株式 化学	253,100	8,097.08 2,049,372,651	8,782.00 2,222,724,200	－ －	0.86
20	日立製作所 日本	株式 電気機器	508,000	3,637.05 1,847,624,082	4,230.00 2,148,840,000	－ －	0.83
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	134,700	12,185.70 1,641,414,471	15,635.00 2,106,034,500	－ －	0.82
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	730,600	3,091.88 2,258,932,834	2,823.00 2,062,483,800	－ －	0.80

23	ファナック 日本	株式 電気機器	100,400	18,988.00 1,906,395,215	20,320.00 2,040,128,000	－ －	0.79
24	村田製作所 日本	株式 電気機器	310,500	5,756.76 1,787,474,333	6,328.00 1,964,844,000	－ －	0.76
25	東海旅客鉄道 日本	株式 陸運業	87,900	23,386.14 2,055,641,956	21,585.00 1,897,321,500	－ －	0.74
26	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	728,300	2,070.05 1,507,617,481	2,568.00 1,870,274,400	－ －	0.72
27	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	929,900	1,662.45 1,545,915,216	1,950.50 1,813,769,950	－ －	0.70
28	東日本旅客鉄道 日本	株式 陸運業	186,100	10,153.51 1,889,568,462	9,700.00 1,805,170,000	－ －	0.70
29	三井物産 日本	株式 卸売業	915,200	1,761.49 1,612,118,072	1,960.50 1,794,249,600	－ －	0.70
30	日本電産 日本	株式 電気機器	127,200	13,459.68 1,712,071,776	14,040.00 1,785,888,000	－ －	0.69

（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2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.21
合計	97.21

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	14.13
情報・通信業		8.58
輸送用機器		7.43
化学		6.93
医薬品		5.94
銀行業		5.55
サービス業		5.05
機械		4.95
卸売業		4.91
小売業		4.43
陸運業		4.22
食料品		3.73
建設業		2.77
不動産業		2.48
精密機器		2.37
保険業		2.21
その他製品		2.20
電気・ガス業		1.44
その他金融業		1.19
証券、商品先物取引業		0.84
ガラス・土石製品		0.80
鉄鋼		0.73
非鉄金属		0.70
ゴム製品		0.66
繊維製品		0.56
金属製品		0.56
石油・石炭製品		0.46
空運業		0.46
鉱業		0.26
パルプ・紙		0.23
倉庫・運輸関連業		0.18
海運業		0.16
水産・農林業		0.09
合計		97.21

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	349,977	18,763.88 6,566,927,965	35,321.26 12,361,629,380	－ －	3.45

2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	561,788	11,793.27 6,625,317,753	18,843.38 10,585,988,583	－ －	2.95
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	32,549	178,164.28 5,799,069,341	204,016.36 6,640,528,527	－ －	1.85
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	186,156	18,012.35 3,353,108,056	22,851.34 4,253,914,384	－ －	1.19
5	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	24,252	122,670.00 2,974,992,891	158,773.91 3,850,584,875	－ －	1.07
6	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	247,652	11,227.83 2,780,596,928	14,820.16 3,670,243,106	－ －	1.02
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	23,132	123,526.04 2,857,404,557	158,600.50 3,668,746,881	－ －	1.02
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	204,338	14,643.05 2,992,132,406	16,398.26 3,350,787,978	－ －	0.94
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	133,771	15,714.56 2,102,153,216	22,707.38 3,037,589,277	－ －	0.85
10	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	230,364	9,967.43 2,296,137,669	12,115.26 2,790,921,689	－ －	0.78
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	193,908	10,826.48 2,099,341,108	13,736.10 2,663,541,036	－ －	0.74
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	102,032	22,144.57 2,259,455,242	24,852.59 2,535,759,748	－ －	0.71
13	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	684,479	3,101.95 2,123,224,467	3,651.32 2,499,257,885	－ －	0.70
14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	342,807	5,535.11 1,897,474,555	7,249.21 2,485,082,743	－ －	0.69

15	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	69,914	24,160.70 1,689,171,595	35,385.60 2,473,949,369	－ －	0.69
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	327,609	8,280.44 2,712,747,361	7,065.99 2,314,884,342	－ －	0.65
17	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	565,686	3,278.83 1,854,793,124	4,082.11 2,309,195,758	－ －	0.64
18	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	73,307	28,884.18 2,117,413,290	30,643.67 2,246,396,161	－ －	0.63
19	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	84,667	20,519.25 1,737,303,748	25,388.07 2,149,532,349	－ －	0.60
20	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	139,440	12,281.43 1,712,523,564	15,029.55 2,095,721,651	－ －	0.58
21	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	320,311	5,922.43 1,897,021,890	6,473.80 2,073,629,864	－ －	0.58
22	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	314,758	5,005.32 1,575,465,735	6,419.27 2,020,517,090	－ －	0.56
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,432	30,494.57 1,659,880,634	36,788.93 2,002,495,418	－ －	0.56
24	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	198,319	8,628.52 1,711,201,136	9,433.68 1,870,879,967	－ －	0.52
25	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	147,108	12,879.97 1,894,747,285	12,149.28 1,787,256,870	－ －	0.50
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	428,075	4,561.41 1,952,626,220	4,042.85 1,730,644,811	－ －	0.48
27	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	166,222	8,871.46 1,474,633,044	10,373.10 1,724,238,774	－ －	0.48
28	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	330,940	5,276.47 1,746,194,992	5,151.99 1,705,001,026	－ －	0.48
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	108,292	12,371.41 1,339,725,588	15,686.09 1,698,679,119	－ －	0.47
30	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	323,987	5,292.61 1,714,737,416	5,225.06 1,692,853,004	－ －	0.47

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	94.77
投資信託受益証券	0.22
投資証券	2.46
合計	97.46

（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2年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	7.25
ソフトウェア		5.75
医薬品		5.47
石油・ガス・消耗燃料		4.51
情報技術サービス		4.33
コンピュータ・周辺機器		3.72
保険		3.69
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.49
半導体・半導体製造装置		3.33
資本市場		2.96
ヘルスケア機器・用品		2.84
インターネット販売・通信販売		2.38
航空宇宙・防衛		2.28
電力		2.15
化学		2.08
各種電気通信サービス		1.96
飲料		1.93
食品		1.92
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.90
ホテル・レストラン・レジャー		1.72
バイオテクノロジー		1.71
専門小売り		1.64
機械		1.55
食品・生活必需品小売り		1.44
繊維・アパレル・贅沢品		1.41
家庭用品		1.33
娯楽		1.32
コングロマリット		1.27
金属・鉱業		1.26
メディア		1.20
総合公益事業		1.12
陸運・鉄道		1.00
各種金融サービス		0.97
タバコ		0.83
自動車		0.81
専門サービス		0.77
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.77
電気設備		0.72

通信機器	0.72
パーソナル用品	0.67
電子装置・機器・部品	0.50
商業サービス・用品	0.48
不動産管理・開発	0.48
航空貨物・物流サービス	0.48
複合小売り	0.47
消費者金融	0.46
家庭用耐久財	0.40
建設関連製品	0.39
建設・土木	0.31
容器・包装	0.28
建設資材	0.28
商社・流通業	0.27
無線通信サービス	0.26
自動車部品	0.25
エネルギー設備・サービス	0.24
運送インフラ	0.20
ガス	0.19
水道	0.13
旅客航空輸送業	0.10
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
紙製品・林産品	0.09
販売	0.06
海運業	0.05
レジャー用品	0.04
合計	94.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	128,237	20,310.43 2,604,548,866	22,747.73 2,917,101,267	－ －	5.23
2	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	434,300	5,298.92 2,301,324,446	5,265.00 2,286,589,500	－ －	4.10

3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,862,083	966.32 1,799,385,856	1,139.39 2,121,657,370	－ －	3.80
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	361,650	4,409.23 1,594,599,766	5,268.12 1,905,215,598	－ －	3.42
5	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,204,530	95.26 686,327,929	84.23 606,909,607	－ －	1.09
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	33,250	17,739.63 589,842,846	18,203.62 605,270,697	－ －	1.09
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	417,000	1,307.94 545,412,252	1,263.60 526,921,200	－ －	0.94
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	216,040	2,099.15 453,501,158	2,223.37 480,337,935	－ －	0.86
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	123,952	3,260.07 404,092,877	3,719.09 460,989,883	－ －	0.83
10	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	463,500	1,015.88 470,862,572	906.98 420,387,084	－ －	0.75
11	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	207,058	1,625.21 336,514,587	1,783.67 369,324,447	－ －	0.66
12	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	4,948,235	81.88 405,162,680	73.99 366,123,866	－ －	0.66
13	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	41,385	7,491.43 310,032,982	8,657.40 358,286,499	－ －	0.64
14	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	30,381	9,657.18 293,394,810	11,058.68 335,973,878	－ －	0.60
15	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	407,351	649.90 264,739,599	789.37 321,553,216	－ －	0.58
16	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	366,847	850.64 312,055,786	858.32 314,874,684	－ －	0.56

17	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	237,621	1,308.84 311,007,987	1,321.48 314,013,775	－ －	0.56
18	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	260,093	1,139.90 296,482,507	1,202.27 312,704,091	－ －	0.56
19	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	361,798	729.65 263,987,106	819.58 296,525,299	－ －	0.53
20	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	21,080	16,127.06 339,958,510	13,713.20 289,074,348	－ －	0.52
21	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	940,225	313.74 294,989,914	299.16 281,277,711	－ －	0.50
22	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	62,308	3,574.32 222,709,173	4,416.19 275,164,278	－ －	0.49
23	BANCO BRADESCO SA PREF ブラジル	株式 銀行	305,850	879.70 269,057,475	858.32 262,519,312	－ －	0.47
24	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,990,200	50.13 300,321,552	42.54 254,830,296	－ －	0.46
25	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,535,378	84.39 213,978,006	93.25 236,425,266	－ －	0.42
26	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	56,290	3,356.74 188,950,934	4,197.71 236,289,625	－ －	0.42
27	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	318,112	694.21 220,837,645	742.60 236,230,098	－ －	0.42
28	CNOOC LTD 香港	株式 石油・ガス・消耗燃料	1,357,000	193.74 262,910,417	168.48 228,627,360	－ －	0.41
29	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	68,609	3,318.48 227,678,149	3,292.28 225,880,656	－ －	0.40
30	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	340,494	552.84 188,240,207	609.52 207,538,175	－ －	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2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	87.82
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.77
投資証券	0.21
合計	88.80

（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2年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	14.50
インターネット販売・通信販売		7.43
石油・ガス・消耗燃料		6.24
半導体・半導体製造装置		5.55
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.43
コンピュータ・周辺機器		4.79
保険		3.45
金属・鉱業		3.09
無線通信サービス		2.47
不動産管理・開発		2.29
化学		2.13
電子装置・機器・部品		2.03
食品		1.70
自動車		1.47
情報技術サービス		1.43
食品・生活必需品小売り		1.43
各種電気通信サービス		1.23
資本市場		1.22
医薬品		1.13
コングロマリット		1.08
建設資材		0.91
飲料		0.90
電力		0.88
貯蓄・抵当・不動産金融		0.86
運送インフラ		0.84
娯楽		0.72
繊維・アパレル・贅沢品		0.71
各種金融サービス		0.68
ホテル・レストラン・レジャー		0.64
パーソナル用品		0.64
機械		0.63
各種消費者サービス		0.62
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.61
建設・土木		0.58
ガス		0.57

ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.55
複合小売り	0.55
専門小売り	0.50
自動車部品	0.44
家庭用品	0.39
タバコ	0.36
バイオテクノロジー	0.36
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.34
家庭用耐久財	0.31
電気設備	0.30
陸運・鉄道	0.30
消費者金融	0.29
水道	0.22
ソフトウェア	0.22
紙製品・林産品	0.21
旅客航空輸送業	0.20
メディア	0.18
航空貨物・物流サービス	0.18
商業サービス・用品	0.17
航空宇宙・防衛	0.15
通信機器	0.14
ヘルスケア機器・用品	0.12
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
エネルギー設備・サービス	0.09
海運業	0.08
レジャー用品	0.06
商社・流通業	0.05
総合公益事業	0.04
専門サービス	0.03
建設関連製品	0.02
販売	0.02
合計	87.82

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	3,565	781,705.73 2,786,780,948	878,000.00 3,130,070,000	－ －	7.21
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	3,682	693,392.81 2,553,072,351	791,000.00 2,912,462,000	－ －	6.71
3	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	11,886	181,478.39 2,157,052,242	190,800.00 2,267,848,800	－ －	5.22
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	5,540	267,571.44 1,482,345,801	312,000.00 1,728,480,000	－ －	3.98
5	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	7,336	216,765.01 1,590,188,185	229,300.00 1,682,144,800	－ －	3.87
6	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	6,959	224,298.28 1,560,891,739	231,700.00 1,612,400,300	－ －	3.71
7	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	8,267	194,808.80 1,610,484,392	194,300.00 1,606,278,100	－ －	3.70
8	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	4,964	278,811.23 1,384,018,954	289,500.00 1,437,078,000	－ －	3.31
9	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	9,170	131,094.64 1,202,137,924	145,300.00 1,332,401,000	－ －	3.07
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	3,492	335,305.30 1,170,886,134	341,500.00 1,192,518,000	－ －	2.75
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	2,331	483,927.50 1,128,035,021	501,000.00 1,167,831,000	－ －	2.69
12	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	1,845	515,115.40 950,387,918	577,000.00 1,064,565,000	－ －	2.45
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	10,765	87,386.10 940,711,402	93,000.00 1,001,145,000	－ －	2.31
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,139	796,747.90 907,495,863	870,000.00 990,930,000	－ －	2.28
15	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	16,150	62,381.62 1,007,463,183	54,900.00 886,635,000	－ －	2.04
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,223	638,786.66 781,236,087	719,000.00 879,337,000	－ －	2.03
17	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	11,861	85,342.27 1,012,244,748	73,100.00 867,039,100	－ －	2.00

18	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	4,742	147,618.81 700,008,438	166,800.00 790,965,600	－ －	1.82
19	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,236	164,375.86 696,296,183	181,700.00 769,681,200	－ －	1.77
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	850	797,591.64 677,952,902	870,000.00 739,500,000	－ －	1.70
21	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	2,406	261,306.50 628,703,457	293,400.00 705,920,400	－ －	1.63
22	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,406	170,239.21 579,834,750	196,200.00 668,257,200	－ －	1.54
23	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	3,131	191,710.27 600,244,877	200,900.00 629,017,900	－ －	1.45
24	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,196	443,341.42 530,236,341	508,000.00 607,568,000	－ －	1.40
25	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人 日本	投資証券	4,724	113,204.65 534,778,790	127,500.00 602,310,000	－ －	1.39
26	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,423	144,150.39 493,426,818	175,000.00 599,025,000	－ －	1.38
27	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,308	466,326.23 609,954,710	453,500.00 593,178,000	－ －	1.37
28	イオンリート投資法人 日本	投資証券	3,973	140,836.08 559,541,758	147,800.00 587,209,400	－ －	1.35
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	1,533	323,603.35 496,083,950	357,000.00 547,281,000	－ －	1.26
30	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 日本	投資証券	23,654	19,588.55 463,347,765	23,100.00 546,407,400	－ －	1.26

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	96.45
合計	96.45

（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2年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	177,313	9,240.21 1,638,410,963	10,492.66 1,860,485,483	－ －	4.41
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	23,982	61,724.65 1,480,280,595	65,763.17 1,577,132,582	－ －	3.74
3	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	86,305	16,954.52 1,463,260,133	14,881.23 1,284,325,159	－ －	3.04
4	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	114,139	9,432.55 1,076,622,620	9,313.72 1,063,059,143	－ －	2.52
5	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	42,260	26,144.04 1,104,847,507	24,440.34 1,032,849,021	－ －	2.45
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	39,221	23,013.57 902,615,585	23,776.17 932,525,187	－ －	2.21
7	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	98,035	8,969.46 879,321,499	9,157.76 897,781,805	－ －	2.13
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	58,623	13,568.92 795,451,020	13,713.20 803,909,181	－ －	1.91
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	91,347	8,125.16 742,209,200	8,613.55 786,822,755	－ －	1.87
10	VENTAS INC アメリカ	投資証券	104,491	7,562.22 790,183,984	6,318.93 660,271,983	－ －	1.57
11	LINK REIT 香港	投資証券	588,420	1,261.73 742,432,439	1,113.37 655,130,352	－ －	1.55
12	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	40,405	14,497.77 585,782,782	15,659.92 632,739,285	－ －	1.50
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	18,527	34,046.76 630,784,351	34,040.89 630,675,713	－ －	1.50
14	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	34,373	16,479.69 566,456,518	17,938.18 616,589,363	－ －	1.46
15	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD オランダ	投資証券	38,581	16,027.23 618,346,621	14,971.33 577,609,075	－ －	1.37
16	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	139,101	3,739.28 520,138,263	3,981.78 553,869,663	－ －	1.31
17	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	151,323	3,141.85 475,434,741	3,436.48 520,018,553	－ －	1.23
18	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	450,515	1,082.27 487,579,786	1,095.68 493,622,753	－ －	1.17
19	MID AMERICA アメリカ	投資証券	32,126	13,787.36 442,932,820	14,994.65 481,718,427	－ －	1.14
20	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	26,107	15,612.55 407,596,891	17,620.82 460,026,857	－ －	1.09
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	48,529	9,469.02 459,522,169	9,221.02 447,487,025	－ －	1.06
22	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	36,483	12,169.56 443,982,392	12,059.85 439,979,682	－ －	1.04

23	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,499,988	286.95 430,424,865	287.29 430,941,752	－ －	1.02
24	UDR INC アメリカ	投資証券	81,928	5,137.80 420,929,693	5,254.51 430,491,560	－ －	1.02
25	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	102,777	3,608.15 370,835,712	4,005.77 411,701,413	－ －	0.98
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	50,910	7,137.31 363,360,809	7,974.46 405,980,125	－ －	0.96
27	SEGRO PLC イギリス	投資証券	308,185	1,129.07 347,964,328	1,300.97 400,940,739	－ －	0.95
28	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	129,396	2,499.17 323,383,718	2,926.07 378,623,021	－ －	0.90
29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	200,555	1,887.90 378,628,965	1,804.94 361,990,343	－ －	0.86
30	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	145,259	2,087.55 303,235,560	2,451.66 356,126,958	－ －	0.84

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.48
投資証券	88.96
合計	99.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【投資不動産物件】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・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2年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０２０３月	買建	425	7,223,169,250	7,135,750,000	2.76

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Mar20	買建	389	6,893,260,265	6,978,273,625	1.95
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar20	買建	358	1,609,891,893	1,584,449,646	0.44
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar20	買建	54	575,908,255	564,427,936	0.16
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar20	買建	21	356,522,290	362,054,847	0.10
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar20	買建	17	212,095,763	216,137,706	0.06

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Mar20	買建	1,069	6,501,110,224	6,243,134,247	11.19

（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2年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０２０３月	買建	609	1,305,159,890	1,342,236,000	3.09

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

直近日（令和2年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末（令和2年1月14日）	17	17	1.0702	1.0702
平成31年3月末日	10	－	1.0094	－
4月末日	10	－	1.0157	－
令和1年5月末日	10	－	1.0095	－
6月末日	10	－	1.0289	－
7月末日	10	－	1.0416	－
8月末日	11	－	1.0477	－
9月末日	11	－	1.0573	－
10月末日	16	－	1.0589	－
11月末日	16	－	1.0642	－
12月末日	16	－	1.0638	－
令和2年1月末日	18	－	1.0737	－

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

直近日（令和2年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末（令和2年1月14日）	14	14	1.0698	1.0698
平成31年3月末日	10	－	1.0094	－
4月末日	10	－	1.0157	－
令和1年5月末日	10	－	1.0095	－
6月末日	10	－	1.0289	－
7月末日	10	－	1.0416	－
8月末日	10	－	1.0475	－
9月末日	10	－	1.0572	－
10月末日	13	－	1.0586	－
11月末日	13	－	1.0639	－
12月末日	14	－	1.0635	－
令和2年1月末日	16	－	1.0734	－

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

直近日（令和2年1月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末（令和2年1月14日）	14	14	1.0699	1.0699
平成31年3月末日	10	－	1.0094	－
4月末日	10	－	1.0157	－
令和1年5月末日	10	－	1.0095	－
6月末日	10	－	1.0289	－
7月末日	10	－	1.0416	－
8月末日	10	－	1.0476	－
9月末日	10	－	1.0571	－
10月末日	13	－	1.0586	－
11月末日	14	－	1.0639	－
12月末日	14	－	1.0635	－
令和2年1月末日	18	－	1.0734	－

②【分配の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

	収益率（%）
第1計算期間	7.0

（注）収益率は期間騰落率です。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

	収益率（%）
第1計算期間	7.0

（注）収益率は期間騰落率です。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

	収益率（%）
第1計算期間	7.0

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	15,978,994	0

（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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	13,549,161	0

（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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	13,529,038	0

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

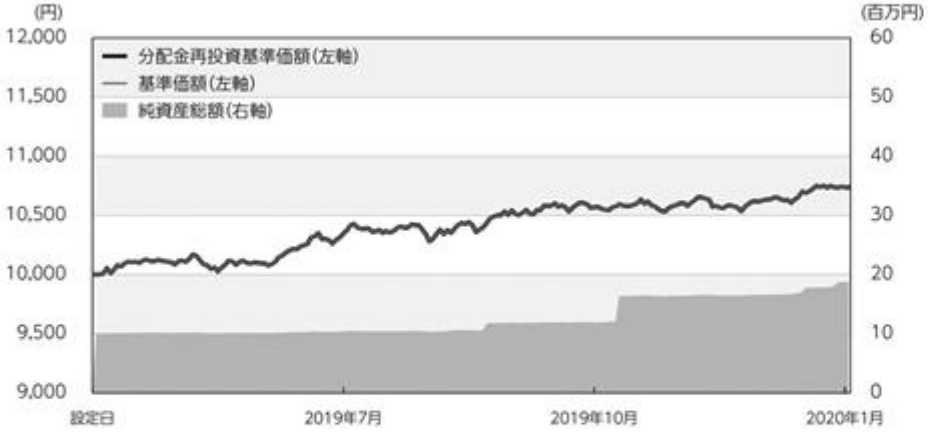
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2020年1月31日

ターゲット・イヤー2040

基準価額・純資産の推移 〈2019年3月18日～2020年1月31日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2019年3月18日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
設定来累計	0円

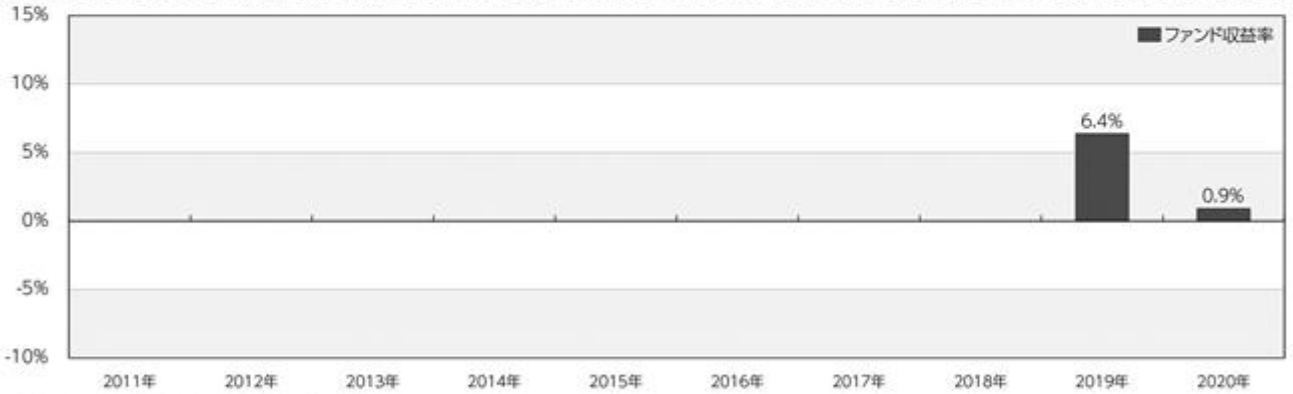
※分配金は1万口当たりです。

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	39.30
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	15.03
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	13.14
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.34
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7.62
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.00
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.57
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.42

年間収益率の推移(暦年ベース)



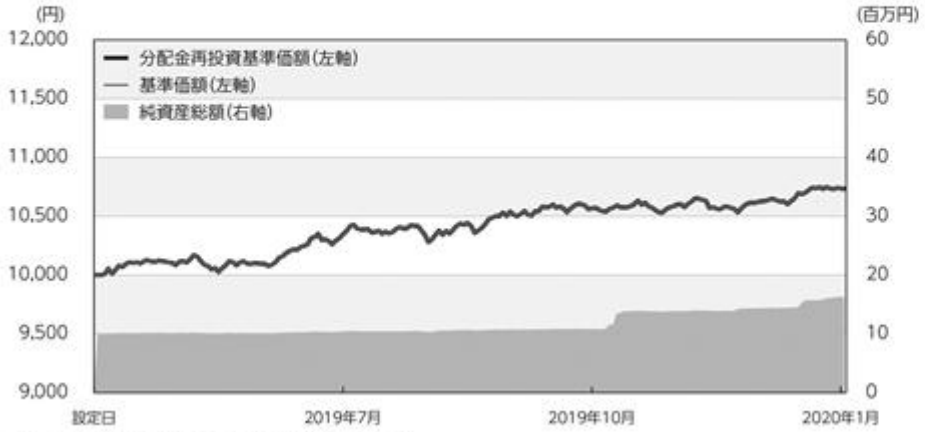
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2020年1月31日

ターゲット・イヤー2050

基準価額・純資産の推移 〈2019年3月18日～2020年1月31日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2019年3月18日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
設定来累計	0円

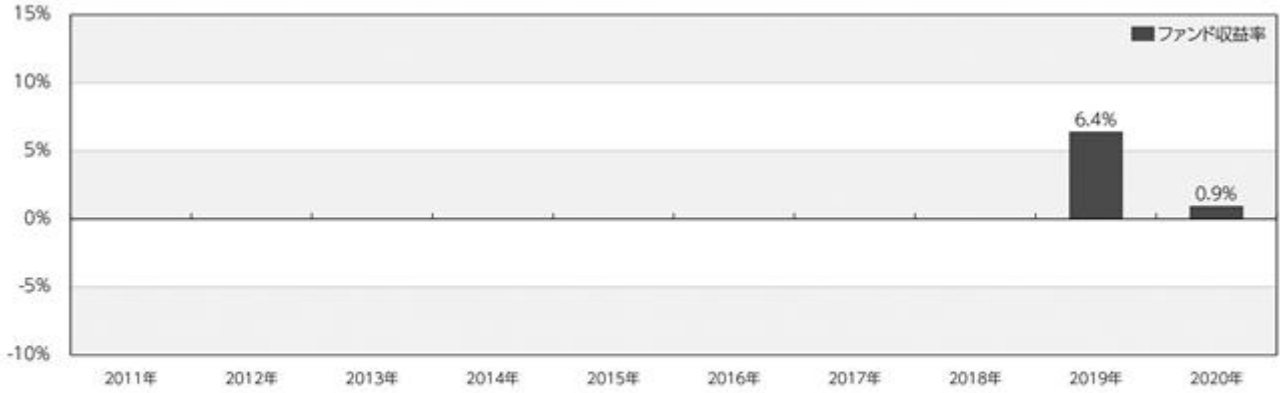
※分配金は1万口当たりです。

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	39.20
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	15.15
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	13.34
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.43
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7.46
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.98
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.57
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.47

年間収益率の推移(暦年ベース)



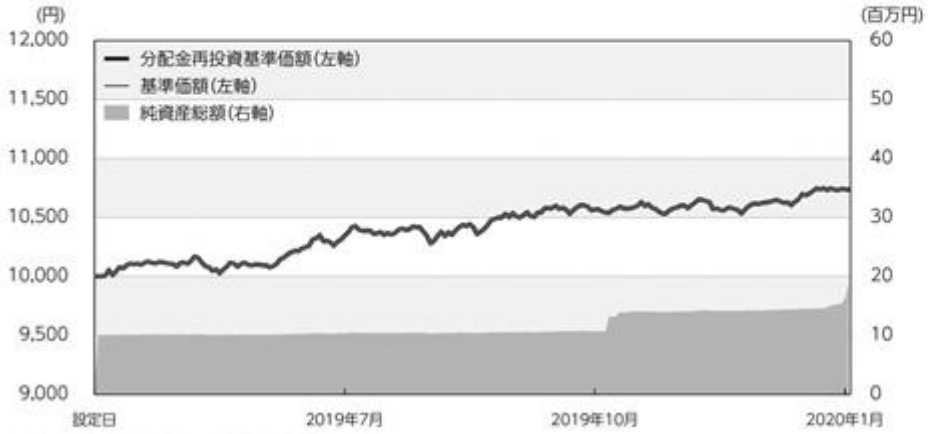
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2020年1月31日

ターゲット・イヤー2060

基準価額・純資産の推移 《2019年3月18日～2020年1月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2019年3月18日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
設定来累計	0円

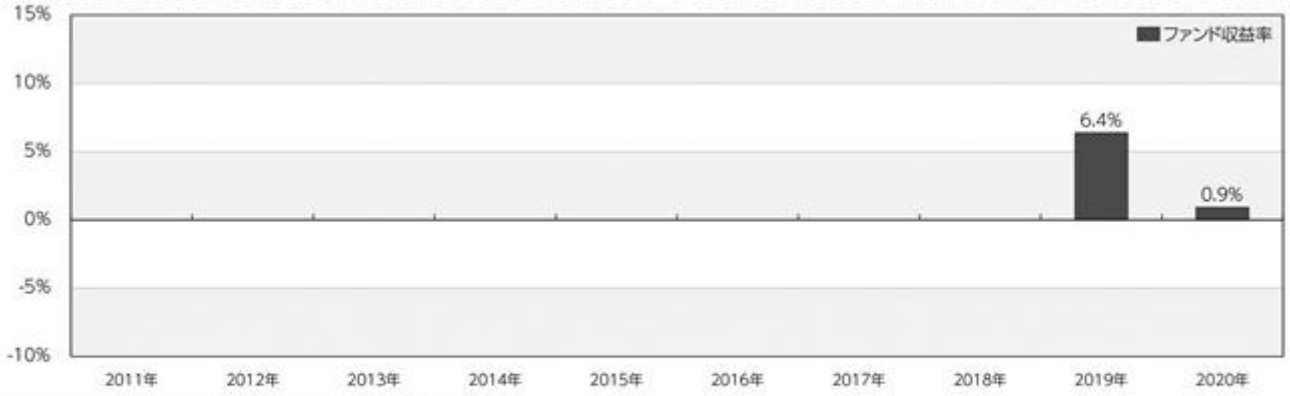
※分配金は1万口当たりです。

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	39.20
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	15.09
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	13.40
4	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.51
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7.86
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.98
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.57
8	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.53

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2020年1月31日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.03
2	128回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/6/20	0.99
3	129回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/9/20	0.95
4	342回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/3/20	0.90
5	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.89

■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 11/30/21	国債証券	アメリカ	1.5	2021/11/30	0.77
2	US T N/B 1.375 10/15/22	国債証券	アメリカ	1.375	2022/10/15	0.70
3	US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	アメリカ	3.125	2028/11/15	0.61
4	US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	アメリカ	2	2025/8/15	0.59
5	US T N/B 1.625 12/15/22	国債証券	アメリカ	1.625	2022/12/15	0.55

■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	2.52
2	BRAZIL 4.25 01/07/25	国債証券	ブラジル	4.25	2025/1/7	1.86
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.50
4	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.05	2040/1/11	1.45
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.45

■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	3.50
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.00
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.58
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.50
5	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.44

■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	3.45
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.95
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.85
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	ALPHABET INC-CL C	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	1.07

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

データの基準日:2020年1月31日

■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	5.23
2	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	4.10
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	3.80
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.42
5	CHINA CONSTRUCTION BANK	株式	中国	銀行	1.09

■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	7.21
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.71
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	5.22
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	3.98
5	オリックス不動産投資法人	投資証券	日本	3.87

■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	4.41
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	3.74
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.04
4	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.52
5	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.45

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

各ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、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1万口当りに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

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

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2020年4月14日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

※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。

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して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。

※各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

ターゲット・イヤー２０４０：2019年3月18日（設定日）から原則として2055年1月8日までです。

ターゲット・イヤー２０５０：2019年3月18日（設定日）から原則として2065年1月9日までです。

ターゲット・イヤー２０６０：2019年3月18日（設定日）から原則として2075年1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たときは、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1月12日から翌年1月11日までとします。

b.上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

り次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

f.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

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

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

i.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信

託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

h.委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

また、投資顧問契約について、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、各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。

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

- **委託会社は、毎年1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】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成31年3月18日から令和2年1月14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】

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 令和2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	511,081
親投資信託受益証券	16,750,624
派生商品評価勘定	18,908
流動資産合計	17,280,613
資産合計	17,280,613
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	135,633
未払受託者報酬	1,596
未払委託者報酬	42,946
その他未払費用	119
流動負債合計	180,294
負債合計	180,294
純資産の部	
元本等	
元本	15,978,994
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,121,325
（分配準備積立金）	796,447
元本等合計	17,100,319
純資産合計	17,100,319
負債純資産合計	17,280,613

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
営業収益	
有価証券売買等損益	960,624
為替差損益	△72,650
営業収益合計	887,974
営業費用	
支払利息	51
受託者報酬	3,250
委託者報酬	87,924
その他費用	302
営業費用合計	91,527
営業利益又は営業損失（△）	796,447
経常利益又は経常損失（△）	796,447
当期純利益又は当期純損失（△）	796,447
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（△）	－
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	324,878
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	324,878
剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,121,325

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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1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、当計算期間末日を令和2年1月14日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 令和2年1月14日現在
１．　期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	5,978,994円
期中一部解約元本額	－円
２．　受益権の総数	15,978,994口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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（255,578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（540,869円）、信託約款に規定される収益調整金（324,878円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,121,325円（1万口当たり701.74円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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	第1期 令和2年1月14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	第1期 令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	833,957
合計	833,957

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 令和2年1月14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	6,428,121	－	6,563,722	△135,601
アメリカ・ドル	453,855	－	461,580	△7,725
イギリス・ポンド	3,148,598	－	3,202,976	△54,378
オーストラリア・ドル	1,016,654	－	1,048,110	△31,456
カナダ・ドル	916,712	－	942,928	△26,216
ユーロ	892,302	－	908,128	△15,826
買建	1,240,074	－	1,258,950	18,876
アメリカ・ドル	21,810	－	21,980	170
イギリス・ポンド	270,172	－	271,681	1,509
オーストラリア・ドル	252,199	－	258,230	6,031
カナダ・ドル	404,493	－	412,531	8,038
ユーロ	291,400	－	294,528	3,128
合計	7,668,195	－	7,822,672	△116,725

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0702円 (10,702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2年1月14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	834,994	2,300,658	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	647,370	850,579	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	321,602	763,708	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	148,714	610,515	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,172,464	1,642,856	
	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	4,713,093	6,608,227	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	1,096,639	1,406,878	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,226,098	2,567,203	
親投資信託受益証券　合計		10,160,974	16,750,624	
合計			16,750,624	

（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。

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 令和2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	431,111
親投資信託受益証券	14,201,691
派生商品評価勘定	16,268
流動資産合計	14,649,070
資産合計	14,649,070
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,021
未払受託者報酬	1,366
未払委託者報酬	37,200
その他未払費用	119
流動負債合計	153,706
負債合計	153,706
純資産の部	
元本等	
元本	13,549,161
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	946,203
（分配準備積立金）	748,881
元本等合計	14,495,364
純資産合計	14,495,364
負債純資産合計	14,649,070

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
営業収益	
有価証券売買等損益	871,691
為替差損益	△37,735
営業収益合計	833,956
営業費用	
支払利息	45
受託者報酬	3,001
委託者報酬	81,727
その他費用	302
営業費用合計	85,075
営業利益又は営業損失（△）	748,881
経常利益又は経常損失（△）	748,881
当期純利益又は当期純損失（△）	748,881
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（△）	－
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	197,322
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	197,322
剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	946,203

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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1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、当計算期間末日を令和2年1月14日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 令和2年1月14日現在
１．　期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	3,549,161円
期中一部解約元本額	－円
２．　受益権の総数	13,549,161口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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（239,006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（509,875円）、信託約款に規定される収益調整金（197,322円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は946,203円（1万口当たり698.34円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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	第1期 令和2年1月14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	第1期 令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	759,315
合計	759,315

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 令和2年1月14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	5,510,767	－	5,625,780	△115,013
アメリカ・ドル	378,259	－	384,650	△6,391
イギリス・ポンド	2,713,336	－	2,759,707	△46,371
オーストラリア・ドル	869,611	－	896,210	△26,599
カナダ・ドル	777,687	－	799,805	△22,118
ユーロ	771,874	－	785,408	△13,534
買建	1,060,959	－	1,077,219	16,260
アメリカ・ドル	10,905	－	10,990	85
イギリス・ポンド	241,491	－	243,083	1,592
オーストラリア・ドル	215,098	－	220,255	5,157
カナダ・ドル	338,490	－	345,179	6,689
ユーロ	254,975	－	257,712	2,737
合計	6,571,726	－	6,702,999	△98,753

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0698円 (10,698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2年1月14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	709,579	1,955,103	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	542,330	712,567	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	270,974	643,481	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	127,023	521,467	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	995,914	1,395,474	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,982,914	5,584,443	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	932,343	1,196,102	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,047,404	2,193,054	
親投資信託受益証券　合計		8,608,481	14,201,691	
合計			14,201,691	

（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。

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 令和2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	422,245
親投資信託受益証券	14,191,229
派生商品評価勘定	15,889
流動資産合計	14,629,363
資産合計	14,629,363
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,342
未払受託者報酬	1,368
未払委託者報酬	37,484
その他未払費用	119
流動負債合計	154,313
負債合計	154,313
純資産の部	
元本等	
元本	13,529,038
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	946,012
（分配準備積立金）	748,872
元本等合計	14,475,050
純資産合計	14,475,050
負債純資産合計	14,629,363

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
営業収益	
有価証券売買等損益	871,229
為替差損益	△37,173
営業収益合計	834,056
営業費用	
支払利息	47
受託者報酬	3,003
委託者報酬	81,832
その他費用	302
営業費用合計	85,184
営業利益又は営業損失（△）	748,872
経常利益又は経常損失（△）	748,872
当期純利益又は当期純損失（△）	748,872
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（△）	－
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	197,140
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	197,140
剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
分配金	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	946,012

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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1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、当計算期間末日を令和2年1月14日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 令和2年1月14日現在
１．　期首元本額	10,000,000円
期中追加設定元本額	3,529,038円
期中一部解約元本額	－円
２．　受益権の総数	13,529,038口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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（238,841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（510,031円）、信託約款に規定される収益調整金（197,140円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は946,012円（1万口当たり699.24円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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	第1期 令和2年1月14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	第1期 令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	762,617
合計	762,617

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 令和2年1月14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	5,199,218	－	5,314,556	△115,338
アメリカ・ドル	367,071	－	373,660	△6,589
イギリス・ポンド	2,512,879	－	2,559,521	△46,642
オーストラリア・ドル	831,614	－	858,235	△26,621
カナダ・ドル	752,402	－	774,548	△22,146
ユーロ	735,252	－	748,592	△13,340
買建	1,045,753	－	1,061,638	15,885
アメリカ・ドル	21,810	－	21,980	170
イギリス・ポンド	227,521	－	228,784	1,263
オーストラリア・ドル	215,098	－	220,255	5,157
カナダ・ドル	338,490	－	345,179	6,689
ユーロ	242,834	－	245,440	2,606
合計	6,244,971	－	6,376,194	△99,453

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0699円 (10,699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2年1月14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	713,959	1,967,171	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	542,331	712,568	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	270,996	643,534	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	127,110	521,824	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	995,529	1,394,935	
	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3,975,221	5,573,657	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	931,981	1,195,638	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	1,042,078	2,181,902	
親投資信託受益証券　合計		8,599,205	14,191,229	
合計			14,191,229	

（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）

「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）」は、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。
同親投資信託の状況は以下の通りであります。
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,655,980,346
国債証券	172,221,307,500
地方債証券	18,564,022,500
特殊債券	16,545,386,712
社債券	10,541,432,740
未収入金	5,322,894,900
未収利息	414,515,298
前払費用	20,884,532
流動資産合計	225,286,424,528
資産合計	225,286,424,528
負債の部	
流動負債	
未払解約金	707,677,000
流動負債合計	707,677,000
負債合計	707,677,000
純資産の部	
元本等	
元本	170,923,484,775
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	53,655,262,753
元本等合計	224,578,747,528
純資産合計	224,578,747,528
負債純資産合計	225,286,424,528

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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	226,126,830,787円
同期中追加設定元本額	105,267,827,604円
同期中一部解約元本額	160,471,173,616円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	21,001,536,888円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	71,157,976円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	68,506,951円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	19,042,033円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	985,360,087円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	253,839,832円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,875,383円
たわらノーロード　国内債券	9,656,870,485円

たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	583,915,819円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	175,042,417円
たわらノーロード　バランス（標準型）	291,408,163円
たわらノーロード　バランス（積極型）	36,976,397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）	13,435,371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）	420,157,231円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	425,902,786円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	109,049,333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）	24,663,912円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	5,458,523円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	8,353,318円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,438,123円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,409,866円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	221,133円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,009,672,579円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	6,845,985,408円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	9,411,035,879円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,756,253,312円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,826,757,940円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,022,079,346円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	313,662,654円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	85,252,670円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,373,109,117円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	6,459,038円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	3,511,003,330円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	990,847,613円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	206,249,963円
投資のソムリエ	6,696,073,247円
クルーズコントロール	2,772,942,619円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	646,801,998円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	2,995,596,010円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	343,239,462円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	2,525,895円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	9,120,665円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	17,189,413円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	598,062,219円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	6,424,565,583円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	4,319,951円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	3,558,213円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,942,495円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	8,985,300円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	184,133,805円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,759,163,243円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,156,661,942円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	647,370円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	542,330円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	542,331円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	485,154円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,190,488,437円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	7,839,142,793円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	414,011,447円

ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンド（適格機関投資家限定）	5,071,969,240円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	5,050,603,156円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	5,102,756,119円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	5,076,506,178円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	5,113,422,319円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅥ（適格機関投資家限定）	223,167,454円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅦ（適格機関投資家限定）	170,577,343円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅧ（適格機関投資家限定）	61,717,869円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅨ（適格機関投資家限定）	149,099,794円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅩ（適格機関投資家限定）	73,771,910円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅪ（適格機関投資家限定）	30,044,426円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅫ（適格機関投資家限定）	80,718,622円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅬ（適格機関投資家限定）	167,859,728円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅭ（適格機関投資家限定）	4,674,455,144円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅮ（適格機関投資家限定）	2,614,559,772円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅯ（適格機関投資家限定）	4,996,458,712円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅰ（適格機関投資家限定）	529,172,657円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅱ（適格機関投資家限定）	244,545,493円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅲ（適格機関投資家限定）	2,873,345,395円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅳ（適格機関投資家限定）	256,408,719円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅴ（適格機関投資家限定）	14,008,431円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅵ（適格機関投資家限定）	59,724,434円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅶ（適格機関投資家限定）	2,644,569,344円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅷ（適格機関投資家限定）	76,101,841円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅸ（適格機関投資家限定）	542,859,017円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅹ（適格機関投資家限定）	935,154,369円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅺ（適格機関投資家限定）	5,607,727,769円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅻ（適格機関投資家限定）	394,177,784円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅼ（適格機関投資家限定）	112,665,586円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅽ（適格機関投資家限定）	346,002,770円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅾ（適格機関投資家限定）	739,037円
ＯｎｅＪＰＸ日経４００ファンドⅿ（適格機関投資家限定）	411,535円
計	170,923,484,775円
２．　受益権の総数	170,923,484,775口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△542,581,000
地方債証券	△135,153,000
特殊債券	△53,718,189
社債券	△98,436,560
合計	△829,888,749

（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2年1月14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2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3139円 (13,139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2年1月14日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	３９９回　利付国庫債券（２年）	1,000,000,000	1,002,720,000	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	2,200,000,000	2,207,216,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	2,120,000,000	2,128,374,000	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	1,780,000,000	1,788,081,200	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	1,420,000,000	1,427,114,200	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	1,200,000,000	1,206,720,000	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,187,292,400	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,187,799,800	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	1,040,000,000	1,047,290,400	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	1,250,000,000	1,259,462,500	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,411,116,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	1,450,000,000	1,462,006,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,311,167,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,311,258,000	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	1,410,000,000	1,422,577,200	
	２回　利付国庫債券（４０年）	280,000,000	414,926,400	
	３回　利付国庫債券（４０年）	290,000,000	433,465,900	
	４回　利付国庫債券（４０年）	430,000,000	649,037,700	
	５回　利付国庫債券（４０年）	480,000,000	701,928,000	
	６回　利付国庫債券（４０年）	450,000,000	649,597,500	
	７回　利付国庫債券（４０年）	480,000,000	667,603,200	
	８回　利付国庫債券（４０年）	520,000,000	677,216,800	
	９回　利付国庫債券（４０年）	780,000,000	761,935,200	
	１０回　利付国庫債券（４０年）	770,000,000	881,750,100	
	１１回　利付国庫債券（４０年）	580,000,000	645,081,800	

１２回　利付国庫債券（４０年）	380,000,000	382,504,200	
３１３回　利付国庫債券（１０年）	1,180,000,000	1,199,717,800	
３１４回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	811,480,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,528,410,000	
３１６回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,017,510,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	600,000,000	612,420,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,426,614,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	819,024,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,532,760,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	819,624,000	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	511,175,000	
３２３回　利付国庫債券（１０年）	750,000,000	768,712,500	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	1,050,000,000	1,073,646,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,332,149,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	512,050,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,232,436,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,090,000,000	1,114,830,200	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,770,000,000	1,825,719,600	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	450,000,000	465,124,500	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	650,000,000	667,049,500	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	1,410,000,000	1,449,494,100	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	1,650,000,000	1,698,774,000	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	1,770,000,000	1,825,082,400	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	1,350,000,000	1,387,746,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	700,000,000	720,622,000	

３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,090,000,000	1,111,320,400	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	1,730,000,000	1,774,530,200	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,838,330,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,953,143,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	1,910,000,000	1,954,388,400	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	1,980,000,000	2,002,730,400	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	1,780,000,000	1,801,271,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	1,930,000,000	1,953,314,400	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	1,960,000,000	1,984,578,400	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	1,920,000,000	1,944,230,400	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	1,560,000,000	1,579,796,400	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	1,630,000,000	1,650,749,900	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	1,760,000,000	1,782,422,400	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	2,250,000,000	2,277,697,500	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	1,360,000,000	1,376,088,800	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	1,370,000,000	1,385,494,700	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	1,650,000,000	1,667,704,500	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	1,470,000,000	1,484,847,000	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,463,659,000	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	1,330,000,000	1,342,222,700	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	126,918,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	124,048,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	246,936,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	261,774,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	254,750,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	243,142,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	241,916,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	253,294,000	

１３回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	125,583,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	381,625,500	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	266,748,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	200,773,500	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	265,708,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	421,456,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	264,238,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	271,168,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	300,000,000	398,790,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	436,688,000	
２３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	273,814,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	190,000,000	260,746,500	
２５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	268,552,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	545,216,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	582,960,000	
２８回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	670,089,600	
２９回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	775,555,200	
３０回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	783,094,500	
３１回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	817,152,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	760,000,000	1,055,184,000	
３３回　利付国庫債券（３０年）	740,000,000	988,795,400	
３４回　利付国庫債券（３０年）	670,000,000	927,152,700	
３５回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	1,106,007,800	
３６回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	1,083,896,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	890,000,000	1,192,377,500	

３８回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	753,631,200	
３９回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	646,689,600	
４０回　利付国庫債券（３０年）	450,000,000	597,253,500	
４１回　利付国庫債券（３０年）	460,000,000	601,095,800	
４２回　利付国庫債券（３０年）	510,000,000	667,926,600	
４３回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	655,585,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	490,000,000	643,928,600	
４５回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	634,015,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	630,000,000	799,470,000	
４７回　利付国庫債券（３０年）	540,000,000	699,240,600	
４８回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	735,960,100	
４９回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	699,776,000	
５０回　利付国庫債券（３０年）	540,000,000	594,702,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	520,000,000	507,566,800	
５２回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	594,697,200	
５３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	629,934,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	660,444,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	649,932,200	
５６回　利付国庫債券（３０年）	550,000,000	605,577,500	
５７回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	550,240,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	660,000,000	725,927,400	
５９回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	622,821,400	
６０回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	563,590,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	536,110,000	
６２回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	508,410,000	

６３回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	564,054,900	
６４回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	494,100,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	386,018,500	
７３回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	375,179,800	
７５回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	155,941,800	
７８回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	210,620,700	
８１回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	268,634,400	
８５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	499,835,600	
８８回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	404,075,000	
９０回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	807,443,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	1,002,135,600	
９３回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	287,525,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	520,794,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	412,083,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	587,405,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	527,431,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	710,820,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	434,275,200	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	474,140,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	417,917,500	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	475,848,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	468,692,000	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	220,000,000	258,588,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	330,000,000	393,944,100	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	350,146,000	

１１２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	658,883,500	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	926,063,600	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	664,015,000	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	243,444,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	549,616,500	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	787,286,500	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	373,478,700	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	355,194,000	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	465,276,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	646,806,600	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	415,502,500	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	526,096,400	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	303,152,500	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	445,766,400	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	413,450,200	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	301,230,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	664,856,500	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	347,269,200	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	696,237,800	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	356,649,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	524,532,800	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	686,245,800	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	627,842,800	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	418,365,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	236,656,000	

１３７回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	419,251,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	280,000,000	328,518,400	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	509,795,100	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	620,000,000	744,669,600	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	782,736,500	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	486,792,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	560,000,000	668,360,000	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	365,961,200	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	840,000,000	1,016,047,200	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	1,030,744,000	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,177,087,800	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	821,003,400	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,072,332,000	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,119,755,500	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	944,336,600	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	890,000,000	1,025,609,300	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	890,000,000	1,040,401,100	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	982,209,000	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	967,697,800	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	803,805,600	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	847,968,500	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	898,734,400	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	689,747,500	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	754,355,000	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	689,136,500	

	１６２回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	847,400,000	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	815,545,500	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	810,000,000	842,999,400	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	769,873,800	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	806,625,000	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	830,888,000	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	713,335,000	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	750,000,000	
	１７０回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	629,414,100	
国債証券　合計		156,590,000,000	172,221,307,500	
地方債証券	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	507,795,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	711,424,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	510,625,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	308,742,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	411,080,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,753,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	230,642,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	345,543,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	300,000,000	301,992,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	306,777,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	306,984,000	
	３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	204,092,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	306,270,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	309,771,000	
	２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	357,763,000	
	２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	204,342,000	
	１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	314,385,000	
	２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	203,838,000	
	８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	213,864,000	
	１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	112,196,000	
	２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	511,745,000	
	２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	308,451,000	
	３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	199,906,000	
	２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	203,192,000	
	２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	410,624,000	

	１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	354,210,000	
	２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	205,504,000	
	２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	352,851,000	
	２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	306,339,000	
	２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	205,918,000	
	１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	111,800,000	
	９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	711,669,000	
	１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,814,000	
	１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,775,000	
	１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	714,938,000	
	１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,120,000	
	１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,995,000	
	１２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,420,000	
	１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,365,000	
	１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,900,000	
	１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,124,000	
	１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	411,184,000	
	１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	514,430,000	
	１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,375,000	
	２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	201,300,000	
	４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	462,060,000	
	４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	116,380,000	
	３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	304,107,000	
	２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	458,464,500	
	２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	412,128,000	
	２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	205,348,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	201,550,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	117,730,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	203,428,000	
地方債証券　合計		17,950,000,000	18,564,022,500	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,016,000	

１９回　高速道路機構債	150,000,000	232,212,000	
２６回　高速道路機構債	200,000,000	278,246,000	
９６回　高速道路機構債	700,000,000	714,560,000	
１１６回　高速道路機構債	100,000,000	102,602,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	198,090,000	
９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,348,000	
１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	311,049,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	589,175,000	
１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	408,004,000	
１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	509,125,000	
１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	515,515,000	
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	340,830,600	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	340,521,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,690,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	243,984,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	807,872,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	211,176,000	
２８回　日本道路・機構承継債	400,000,000	538,264,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	234,076,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,890,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	237,582,000	
３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,480,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	236,192,000	
４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	410,244,000	
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	516,195,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	558,476,800	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,596,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	229,126,000	

	８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	400,496,000	
	１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	236,130,000	
	１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	214,766,000	
	３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	238,084,000	
	７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	421,904,000	
	２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,685,000	
	２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,123,000	
	６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	38,427,000	39,760,032	
	８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	26,904,000	27,928,773	
	９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	40,236,000	41,832,966	
	２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	42,813,000	44,876,158	
	１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,348,000	13,584,927	
	１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	67,195,000	68,202,925	
	４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,297,000	15,043,160	
	４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,308,000	56,752,403	
	５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,596,000	42,361,114	
	１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,705,000	70,059,102	
	２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	143,295,000	154,145,297	
	３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	244,704,000	259,635,838	
	１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	259,368,000	260,838,616	
	１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,135,000	276,095,783	
	１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,672,000	276,438,823	
	１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	278,106,000	280,636,764	
	１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,773,000	280,306,289	
	１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,453,000	289,449,342	
	い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,304,000	
	３２５回　利附信金中金債	400,000,000	400,152,000	
	２２０号　利附商工債（３年）	300,000,000	300,357,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	118,180,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	513,120,000	

特殊債券　合計		15,513,335,000	16,545,386,712	
社債券	１回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	200,000,000	199,508,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	204,690,000	
	３３７回　東京交通債	200,000,000	205,108,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	203,094,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,962,000	
	６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	103,304,000	
	１４回　ブリヂストン社債	200,000,000	200,782,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イーホールディングス社債	100,000,000	99,871,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	100,961,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	205,462,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	204,490,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	102,728,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	102,216,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	102,608,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	102,929,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	211,918,000	
	３２回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	306,309,000	
	９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	102,014,000	
	１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,292,000	
	１０回　セブン銀行社債	100,000,000	102,190,000	
	４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	204,474,000	
	５６回　三菱ＵＦＪリース社債	200,000,000	201,470,000	
	７２回　三菱地所社債	100,000,000	109,888,000	
	１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,638,000	
	８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	107,925,000	
	４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,957,000	
	１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,835,000	
	２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,165,000	
	３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	330,447,000	
	４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	221,834,000	
	９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	209,648,000	
	１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	321,120,000	
	６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,836,000	
	１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	309,207,000	
	１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	214,750,000	
	１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,576,000	
	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	136,738,800	
	５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,388,000	
	３７７回　中国電力社債	400,000,000	413,948,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	103,213,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	104,907,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	415,404,000	

	４７３回　東北電力社債	300,000,000	301,947,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	205,780,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	207,966,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	414,172,000	
	３２０回　北海道電力社債	200,000,000	201,762,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	165,755,940	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	302,439,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	219,136,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	309,432,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	309,093,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	104,005,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	102,682,000	
	7回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,458,000	
社債券　合計		10,181,000,000	10,541,432,740	
合計			217,872,149,452	

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。

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2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	64,446,175,091
コール・ローン	4,081,107,413
国債証券	466,521,787,178
派生商品評価勘定	217,115,182
未収利息	2,804,534,447
前払費用	364,174,621
流動資産合計	538,434,893,932
資産合計	538,434,893,932
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,690,247,683
未払金	54,643,975,710
未払解約金	658,793,000
流動負債合計	59,993,016,393
負債合計	59,993,016,393
純資産の部	
元本等	
元本	341,232,781,383
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	137,209,096,156
元本等合計	478,441,877,539
純資産合計	478,441,877,539
負債純資産合計	538,434,893,932

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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	261,839,617,699円
同期中追加設定元本額	332,792,098,347円
同期中一部解約元本額	253,398,934,663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＞	4,342,108,643円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	152,863,948円
たわらノーロード　バランス（標準型）	381,614,953円
たわらノーロード　バランス（積極型）	180,637,331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）	8,586,260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）	401,557,194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）	454,093,712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）	140,160,758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）	61,776,675円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	2,721,858円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	8,614,762円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	10,542,669円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,728,218円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,496,693円
投資のソムリエ	60,896,910,118円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	5,881,123,531円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	4,312,627,675円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	46,322,625,995円
ワールドアセットバランス（基本コース）	3,767,411,635円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	14,228,040,292円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	31,589,625円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	25,996,099円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	35,609,160円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	74,187,802円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	34,305,858,359円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	2,964,633,891円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	4,713,093円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	3,982,914円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	3,975,221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）	19,995,551,897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）	126,825,937,640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）	620,586,714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）	71,469,284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）	509,813,984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）	1,097,867,905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）	5,267,014,567円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	97,542,910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）	2,214,770,125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）	2,322,284,999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）	3,074,286,387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）	124,865,887円
計	341,232,781,383円
２．　受益権の総数	341,232,781,383口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	907,104,535
合計	907,104,535

（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2年1月14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2年1月14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	472,824,911,334	－	477,298,043,835	△4,473,132,501
アメリカ・ドル	228,276,713,149	－	231,474,087,186	△3,197,374,037
イギリス・ポンド	31,073,105,566	－	30,943,379,898	129,725,668
オーストラリア・ドル	9,429,615,479	－	9,417,630,675	11,984,804
カナダ・ドル	9,165,290,946	－	9,237,239,704	△71,948,758
シンガポール・ドル	1,595,580,341	－	1,616,444,256	△20,863,915
スウェーデン・クローナ	1,245,870,618	－	1,249,228,080	△3,357,462
デンマーク・クローネ	2,114,330,410	－	2,125,838,288	△11,507,878
ノルウェー・クローネ	753,572,940	－	755,457,312	△1,884,372
ポーランド・ズロチ	2,256,702,481	－	2,280,324,915	△23,622,434
マレーシア・リンギット	1,105,982,964	－	1,136,154,600	△30,171,636
メキシコ・ペソ	3,668,926,013	－	3,741,918,455	△72,992,442
ユーロ	179,468,583,044	－	180,676,437,120	△1,207,854,076
南アフリカ・ランド	2,670,637,383	－	2,643,903,346	26,734,037
合計	472,824,911,334	－	477,298,043,835	△4,473,132,501

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年1月14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2年1月14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	1,730,416.390	
		US T N/B 1.125 06/30/21	10,000,000.000	9,928,906.200	
		US T N/B 1.125 07/31/21	13,900,000.000	13,792,492.110	
		US T N/B 1.125 08/31/21	11,000,000.000	10,912,343.750	
		US T N/B 1.125 09/30/21	430,000.000	426,472.650	
		US T N/B 1.25 03/31/21	12,310,000.000	12,254,701.140	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,290,406.200	
		US T N/B 1.25 08/31/24	12,730,000.000	12,505,235.930	
		US T N/B 1.25 10/31/21	10,500,000.000	10,433,554.630	
		US T N/B 1.375 04/30/21	10,000,000.000	9,971,093.700	
		US T N/B 1.375 05/31/21	12,350,000.000	12,309,476.560	
		US T N/B 1.375 06/30/23	550,000.000	545,617.180	
		US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,419,843.750	
		US T N/B 1.375 08/31/26	9,740,000.000	9,510,957.750	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	8,923,359.330	
		US T N/B 1.375 10/15/22	31,580,000.000	31,391,259.910	
		US T N/B 1.5 08/15/26	19,050,000.000	18,750,855.360	
		US T N/B 1.5 09/15/22	8,410,000.000	8,389,960.480	
		US T N/B 1.5 09/30/21	20,880,000.000	20,840,034.210	
		US T N/B 1.5 09/30/24	13,510,000.000	13,416,063.210	
		US T N/B 1.5 10/31/21	9,100,000.000	9,082,581.960	
		US T N/B 1.5 10/31/24	12,710,000.000	12,620,632.810	
		US T N/B 1.5 11/30/21	34,670,000.000	34,606,347.960	
		US T N/B 1.5 11/30/24	15,140,000.000	15,034,729.610	
		US T N/B 1.625 02/15/26	14,190,000.000	14,102,421.020	
		US T N/B 1.625 04/30/23	9,800,000.000	9,805,359.320	
		US T N/B 1.625 05/15/26	14,030,000.000	13,925,871.010	
		US T N/B 1.625 05/31/23	1,460,000.000	1,461,254.680	
		US T N/B 1.625 06/30/21	3,190,000.000	3,190,373.800	
		US T N/B 1.625 08/15/29	15,590,000.000	15,292,815.620	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,280,000.000	3,283,331.230	
		US T N/B 1.625 09/30/26	9,910,000.000	9,828,706.980	
		US T N/B 1.625 10/31/23	1,780,000.000	1,779,582.800	
		US T N/B 1.625 10/31/26	9,350,000.000	9,268,187.500	
		US T N/B 1.625 11/15/22	22,030,000.000	22,048,071.420	
		US T N/B 1.625 11/30/26	11,220,000.000	11,119,195.250	
		US T N/B 1.625 12/15/22	24,760,000.000	24,780,310.870	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,216,426.520	
		US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,536,093.750	
		US T N/B 1.75 03/31/22	5,290,000.000	5,308,597.620	
		US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,254,443.350	

		US T N/B 1.75 05/15/23	14,390,000.000	14,456,328.830	
		US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,526,328.850	
		US T N/B 1.75 06/15/22	3,700,000.000	3,714,886.690	
		US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,181,365.590	
		US T N/B 1.75 06/30/24	7,510,000.000	7,542,856.250	
		US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	2,951,599.210	
		US T N/B 1.75 07/31/21	15,530,000.000	15,560,938.550	
		US T N/B 1.75 07/31/24	11,200,000.000	11,249,874.940	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,360,000.000	5,382,612.500	
		US T N/B 1.75 11/15/29	14,350,000.000	14,227,800.700	
		US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,383,881.250	
		US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,877,940.590	
		US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,454,106.250	
		US T N/B 1.875 03/31/22	13,300,000.000	13,381,046.870	
		US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,456,560.930	
		US T N/B 1.875 06/30/26	6,470,000.000	6,522,063.240	
		US T N/B 1.875 07/31/22	10,290,000.000	10,363,155.410	
		US T N/B 1.875 07/31/26	10,760,000.000	10,845,743.750	
		US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,393,771.830	
		US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	8,927,834.370	
		US T N/B 1.875 10/31/22	12,380,000.000	12,474,784.370	
		US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	10,083,203.100	
		US T N/B 2.0 02/15/23	14,000,000.000	14,165,156.180	
		US T N/B 2.0 02/15/25	24,060,000.000	24,450,975.000	
		US T N/B 2.0 04/30/24	850,000.000	862,550.770	
		US T N/B 2.0 05/31/21	11,560,000.000	11,620,960.830	
		US T N/B 2.0 05/31/24	21,200,000.000	21,518,000.000	
		US T N/B 2.0 06/30/24	7,540,000.000	7,653,689.010	
		US T N/B 2.0 07/31/22	12,300,000.000	12,423,960.870	
		US T N/B 2.0 08/15/25	25,830,000.000	26,247,719.390	
		US T N/B 2.0 08/31/21	7,060,000.000	7,102,746.030	
		US T N/B 2.0 10/31/22	4,280,000.000	4,327,481.250	
		US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	7,957,706.970	
		US T N/B 2.0 11/15/26	8,900,000.000	9,036,976.510	
		US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,156,164.000	
		US T N/B 2.125 02/29/24	3,330,000.000	3,394,518.750	
		US T N/B 2.125 03/31/24	20,250,000.000	20,645,507.800	
		US T N/B 2.125 05/15/22	12,700,000.000	12,854,285.060	
		US T N/B 2.125 05/15/25	12,390,000.000	12,661,031.250	
		US T N/B 2.125 05/31/21	22,090,000.000	22,242,731.580	
		US T N/B 2.125 05/31/26	6,070,000.000	6,211,317.180	
		US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,870,137.500	
		US T N/B 2.125 07/31/24	3,520,000.000	3,593,424.980	
		US T N/B 2.125 08/15/21	9,590,000.000	9,664,547.190	
		US T N/B 2.125 09/30/21	9,800,000.000	9,884,218.750	
		US T N/B 2.125 09/30/24	2,720,000.000	2,778,012.480	
		US T N/B 2.125 11/30/23	10,290,000.000	10,482,937.500	
		US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	4,056,533.570	
		US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	7,071,093.750	

		US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	13,706,718.750	
		US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	3,869,775.000	
		US T N/B 2.25 02/15/27	15,070,000.000	15,556,242.870	
		US T N/B 2.25 03/31/21	11,920,000.000	12,010,331.190	
		US T N/B 2.25 03/31/26	9,450,000.000	9,739,406.250	
		US T N/B 2.25 04/15/22	8,560,000.000	8,684,053.060	
		US T N/B 2.25 04/30/21	8,490,000.000	8,558,649.540	
		US T N/B 2.25 04/30/24	11,660,000.000	11,952,410.870	
		US T N/B 2.25 08/15/27	12,780,000.000	13,207,331.240	
		US T N/B 2.25 08/15/46	12,350,000.000	12,200,449.140	
		US T N/B 2.25 08/15/49	13,930,000.000	13,760,228.120	
		US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,685,756.220	
		US T N/B 2.25 11/15/24	12,600,000.000	12,946,500.000	
		US T N/B 2.25 11/15/25	9,160,000.000	9,434,800.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	12,870,000.000	13,303,356.960	
		US T N/B 2.25 12/31/23	9,550,000.000	9,773,081.980	
		US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,657,052.320	
		US T N/B 2.375 01/31/23	2,760,000.000	2,823,178.110	
		US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,969,921.840	
		US T N/B 2.375 03/15/22	15,120,000.000	15,375,740.580	
		US T N/B 2.375 04/15/21	24,210,000.000	24,434,131.580	
		US T N/B 2.375 04/30/26	8,680,000.000	9,012,281.250	
		US T N/B 2.375 05/15/27	11,010,000.000	11,465,882.810	
		US T N/B 2.375 05/15/29	19,720,000.000	20,630,509.260	
		US T N/B 2.375 08/15/24	12,610,000.000	13,012,928.830	
		US T N/B 2.375 11/15/49	8,280,000.000	8,404,200.000	
		US T N/B 2.5 01/15/22	14,320,000.000	14,572,278.010	
		US T N/B 2.5 01/31/21	17,950,000.000	18,114,775.250	
		US T N/B 2.5 01/31/24	10,750,000.000	11,111,972.600	
		US T N/B 2.5 01/31/25	2,980,000.000	3,100,829.670	
		US T N/B 2.5 02/15/22	7,160,000.000	7,292,292.160	
		US T N/B 2.5 02/15/45	9,480,000.000	9,825,131.230	
		US T N/B 2.5 02/15/46	10,730,000.000	11,129,860.090	
		US T N/B 2.5 02/28/21	15,690,000.000	15,843,222.570	
		US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,767,968.720	
		US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,907,424.960	
		US T N/B 2.5 05/15/24	12,970,000.000	13,434,082.810	
		US T N/B 2.5 05/15/46	8,840,000.000	9,170,118.740	
		US T N/B 2.5 08/15/23	6,700,000.000	6,905,710.900	
		US T N/B 2.625 01/31/26	8,050,000.000	8,467,593.750	
		US T N/B 2.625 02/15/29	15,440,000.000	16,466,518.650	
		US T N/B 2.625 02/28/23	12,400,000.000	12,783,624.990	
		US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,640,078.880	
		US T N/B 2.625 06/15/21	16,260,000.000	16,489,291.360	
		US T N/B 2.625 06/30/23	2,650,000.000	2,740,265.620	
		US T N/B 2.625 07/15/21	16,670,000.000	16,919,398.700	
		US T N/B 2.625 12/15/21	11,320,000.000	11,538,882.720	
		US T N/B 2.625 12/31/23	9,670,000.000	10,037,157.810	
		US T N/B 2.625 12/31/25	7,300,000.000	7,675,265.620	

		US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,452,869.460	
		US T N/B 2.75 02/15/28	14,940,000.000	16,009,143.750	
		US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,623,664.810	
		US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	11,058,454.680	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,880,000.000	4,023,984.350	
		US T N/B 2.75 06/30/25	8,100,000.000	8,546,765.620	
		US T N/B 2.75 07/31/23	10,070,000.000	10,462,572.600	
		US T N/B 2.75 08/15/21	12,560,000.000	12,782,253.090	
		US T N/B 2.75 08/15/42	3,830,000.000	4,148,069.510	
		US T N/B 2.75 08/15/47	7,440,000.000	8,116,575.000	
		US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,308,453.870	
		US T N/B 2.75 08/31/25	8,140,000.000	8,596,603.120	
		US T N/B 2.75 09/15/21	2,960,000.000	3,015,153.110	
		US T N/B 2.75 11/15/23	13,330,000.000	13,882,986.640	
		US T N/B 2.75 11/15/42	12,350,000.000	13,375,628.820	
		US T N/B 2.75 11/15/47	7,520,000.000	8,200,912.460	
		US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,475,507.790	
		US T N/B 2.875 05/15/28	13,610,000.000	14,733,888.200	
		US T N/B 2.875 05/15/43	12,240,000.000	13,536,675.000	
		US T N/B 2.875 05/15/49	11,920,000.000	13,369,956.170	
		US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,827,621.070	
		US T N/B 2.875 07/31/25	3,250,000.000	3,453,378.890	
		US T N/B 2.875 08/15/28	13,130,000.000	14,232,714.770	
		US T N/B 2.875 08/15/45	8,370,000.000	9,288,738.230	
		US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,160,839.800	
		US T N/B 2.875 10/15/21	13,100,000.000	13,384,003.800	
		US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	9,714,581.980	
		US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,632,867.160	
		US T N/B 2.875 11/15/46	6,810,000.000	7,589,425.740	
		US T N/B 2.875 11/30/23	9,810,000.000	10,267,544.480	
		US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	7,220,700.000	
		US T N/B 3.0 02/15/47	12,350,000.000	14,106,980.390	
		US T N/B 3.0 02/15/48	8,610,000.000	9,850,378.120	
		US T N/B 3.0 02/15/49	11,710,000.000	13,441,799.140	
		US T N/B 3.0 05/15/42	2,310,000.000	2,605,066.380	
		US T N/B 3.0 05/15/45	8,570,000.000	9,710,211.640	
		US T N/B 3.0 05/15/47	10,940,000.000	12,489,548.370	
		US T N/B 3.0 08/15/48	10,310,000.000	11,813,810.080	
		US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	7,953,002.300	
		US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	7,027,400.000	
		US T N/B 3.0 11/15/44	9,340,000.000	10,569,523.360	
		US T N/B 3.0 11/15/45	8,800,000.000	9,990,750.000	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,760,000.000	3,176,803.090	
		US T N/B 3.125 02/15/43	6,130,000.000	7,056,683.520	
		US T N/B 3.125 05/15/21	100,000.000	101,968.750	
		US T N/B 3.125 05/15/48	8,000,000.000	9,369,062.470	
		US T N/B 3.125 08/15/44	8,090,000.000	9,340,789.790	
		US T N/B 3.125 11/15/28	24,230,000.000	26,794,972.530	
		US T N/B 3.125 11/15/41	2,350,000.000	2,703,601.540	

	US T N/B 3.375 05/15/44	8,900,000.000	10,689,039.000	
	US T N/B 3.375 11/15/48	10,410,000.000	12,777,461.660	
	US T N/B 3.5 02/15/39	2,150,000.000	2,610,906.250	
	US T N/B 3.625 02/15/21	7,430,000.000	7,590,209.370	
	US T N/B 3.625 02/15/44	8,510,000.000	10,609,576.560	
	US T N/B 3.625 08/15/43	9,210,000.000	11,460,693.750	
	US T N/B 3.75 08/15/41	4,490,000.000	5,651,436.680	
	US T N/B 3.75 11/15/43	12,380,000.000	15,709,059.360	
	US T N/B 3.875 08/15/40	2,850,000.000	3,639,984.370	
	US T N/B 4.25 05/15/39	4,470,000.000	5,960,116.370	
	US T N/B 4.25 11/15/40	3,650,000.000	4,895,277.320	
	US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,629,151.560	
	US T N/B 4.375 05/15/40	4,250,000.000	5,782,324.170	
	US T N/B 4.375 05/15/41	3,150,000.000	4,301,226.560	
	US T N/B 4.375 11/15/39	2,340,000.000	3,173,990.600	
	US T N/B 4.5 02/15/36	2,180,000.000	2,919,156.250	
	US T N/B 4.5 05/15/38	2,250,000.000	3,076,171.870	
	US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,453,014.810	
	US T N/B 4.625 02/15/40	5,110,000.000	7,155,596.860	
	US T N/B 4.75 02/15/41	4,420,000.000	6,314,729.650	
	US T N/B 5.0 05/15/37	890,000.000	1,273,325.770	
	US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,068,300.770	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,176,796.870	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,300,000.000	3,109,042.930	
	US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,203,478.120	
	US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	998,187.490	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,703,597.630	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,210,000.000	1,712,244.500	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,393,171.870	
	US T N/B 6.5 11/15/26	500,000.000	653,828.120	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,341,746.040	
アメリカ・ドル　小計		1,994,400,000.000 (219,703,104,000)	2,077,917,845.890 (228,903,429,904)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,710,000.000	5,717,879.800	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	2,690,000.000	2,699,280.500	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,470,000.000	4,509,385.170	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	2,940,000.000	2,975,315.280	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	6,690,000.000	6,824,469.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	2,750,000.000	2,880,157.500	
	UK TREASURY 1.5 01/22/21	10,000.000	10,099.170	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,150,000.000	3,341,205.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	4,660,000.000	4,928,416.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	6,410,000.000	6,932,363.720	

		UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,420,000.000	1,590,925.400	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,690,000.000	3,221,504.170	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,730,000.000	3,058,692.000	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	3,600,000.000	4,244,040.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,920,000.000	6,122,049.600	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	4,350,000.000	4,758,900.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	3,330,000.000	3,608,721.000	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,820,000.000	4,063,316.420	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,940,000.000	5,830,654.690	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,756,400.000	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	5,070,000.000	7,165,938.000	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	6,320,000.000	9,363,080.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	4,350,000.000	8,145,810.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,670,000.000	6,175,142.000	
		UK TREASURY 3.75 09/07/21	6,840,000.000	7,206,272.410	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	3,180,000.000	6,080,160.000	
		UK TREASURY 4.0 03/07/22	3,350,000.000	3,603,561.500	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,590,000.000	6,747,300.000	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	5,850,000.000	8,148,465.000	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	4,750,000.000	7,310,725.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,290,000.000	4,215,148.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	4,010,000.000	6,259,209.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,750,000.000	6,315,000.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	4,430,000.000	7,756,487.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,870,000.000	7,344,486.000	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,320,000.000	4,897,000.000	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,840,000.000	6,344,448.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,700,000.000	3,818,070.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,470,000.000	5,599,192.000	

	UK TREASURY 5.0 03/07/25	4,180,000.000	5,126,310.200	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,118,377.500	
イギリス・ポンド　小計		160,060,000.000 (22,914,189,600)	209,813,956.030 (30,036,965,945)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 5.75 05/15/21	6,310,000.000	6,722,834.270	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,710,000.000	2,779,268.670	
	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	3,020,000.000	3,089,093.060	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	5,770,000.000	6,261,027.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	3,730,000.000	3,884,697.270	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	5,650,000.000	6,348,197.600	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	6,000,000.000	6,477,306.590	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,050,000.000	1,242,090.670	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,770,000.000	2,088,333.070	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	6,130,000.000	6,872,588.200	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	5,400,000.000	6,114,316.850	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,160,000.000	5,877,756.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,920,000.000	3,653,096.630	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	6,540,000.000	7,324,258.470	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	11,100,000.000	13,096,332.770	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,090,000.000	2,649,669.980	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	3,240,000.000	4,326,911.770	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	6,530,000.000	7,822,185.110	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,030,000.000	4,199,891.450	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	6,810,000.000	8,566,483.530	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	6,120,000.000	7,045,898.460	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	7,000,000.000	7,860,185.870	
オーストラリア・ドル　小計		108,080,000.000 (8,219,484,000)	124,302,423.290 (9,453,199,291)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	900,000.000	1,295,217.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	4,170,000.000	4,068,877.500	
	CANADA 0.75 09/01/21	5,860,000.000	5,772,275.800	
	CANADA 1.0 06/01/27	3,890,000.000	3,722,885.600	
	CANADA 1.0 09/01/22	4,680,000.000	4,600,299.600	
	CANADA 1.25 03/01/25	1,270,000.000	1,248,029.000	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,640,000.000	1,582,518.000	
	CANADA 1.25 11/01/21	2,020,000.000	2,004,688.400	
	CANADA 1.5 02/01/22	3,050,000.000	3,039,935.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,690,000.000	3,671,919.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,770,000.000	2,750,942.400	
	CANADA 1.5 08/01/21	2,740,000.000	2,731,588.200	
	CANADA 1.5 09/01/24	4,010,000.000	3,989,749.500	
	CANADA 1.75 03/01/23	4,050,000.000	4,061,380.500	
	CANADA 1.75 05/01/21	3,180,000.000	3,181,144.800	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,970,000.000	3,059,070.300	
	CANADA 2.0 09/01/23	2,820,000.000	2,856,293.400	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,090,000.000	2,247,230.700	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,190,000.000	3,272,078.700	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,110,000.000	3,212,070.200	

	CANADA 2.25 06/01/29	2,890,000.000	3,051,117.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	3,600,000.000	3,734,640.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	3,350,000.000	3,434,319.500	
	CANADA 2.75 12/01/48	3,140,000.000	3,884,494.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	1,410,000.000	1,880,418.300	
	CANADA 3.25 06/01/21	3,240,000.000	3,307,327.200	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,910,000.000	5,361,040.100	
	CANADA 4.0 06/01/41	2,970,000.000	4,177,483.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	3,470,000.000	5,187,997.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	2,430,000.000	3,292,601.400	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,430,000.000	3,618,318.600	
カナダ・ドル　小計		94,940,000.000 (8,011,986,600)	103,297,950.400 (8,717,314,034)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,700,000.000	1,714,450.000	
	SINGAPORE 1.75 04/01/22	260,000.000	261,638.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	580,000.000	591,244.750	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	930,000.000	960,690.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	830,000.000	872,745.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	920,000.000	959,100.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	470,000.000	505,784.010	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,020,000.000	1,094,052.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,290,000.000	1,467,039.600	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,140,000.000	1,293,900.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,610,000.000	1,678,264.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	620,000.000	682,012.400	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	900,000.000	996,300.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,970,000.000	2,099,153.200	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,330,000.000	1,386,924.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,490,000.000	1,767,542.300	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,020,000.000	1,147,500.000	
シンガポール・ドル　小計		18,080,000.000 (1,480,028,800)	19,478,339.260 (1,594,496,852)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	11,190,000.000	11,828,416.330	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	10,070,000.000	10,631,704.600	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	15,310,000.000	16,381,700.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	20,890,000.000	22,267,969.150	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	15,290,000.000	17,448,229.370	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	9,980,000.000	15,247,943.000	
スウェーデン・クローナ　小計		82,730,000.000 (963,804,500)	93,805,962.450 (1,092,839,463)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	10,000.000	10,237.500	
	DENMARK 0.5 11/15/27	22,850,000.000	24,335,478.500	
	DENMARK 0.5 11/15/29	8,160,000.000	8,706,883.200	
	DENMARK 1.5 11/15/23	15,980,000.000	17,247,214.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	12,910,000.000	14,574,749.640	
	DENMARK 4.5 11/15/39	30,470,000.000	56,790,302.800	

デンマーク・クローネ　小計		90,380,000.000 (1,484,039,600)	121,664,865.640 (1,997,737,094)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	8,270,000.000	8,336,967.140	
	NORWAY 1.75 02/17/27	11,630,000.000	11,906,096.200	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,070,000.000	10,265,861.500	
	NORWAY 1.75 09/06/29	6,280,000.000	6,455,902.800	
	NORWAY 2.0 04/26/28	7,530,000.000	7,864,332.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	9,430,000.000	10,051,719.900	
ノルウェー・クローネ　小計		53,210,000.000 (659,804,000)	54,880,879.540 (680,522,906)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	6,730,000.000	6,823,731.400	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,690,000.000	2,718,744.790	
	POLAND 2.5 01/25/23	7,180,000.000	7,325,114.240	
	POLAND 2.5 04/25/24	8,470,000.000	8,659,534.010	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,420,000.000	9,573,431.060	
	POLAND 2.5 07/25/27	8,370,000.000	8,485,464.150	
	POLAND 2.75 04/25/28	4,340,000.000	4,475,730.440	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,630,000.000	4,791,642.060	
	POLAND 3.25 07/25/25	7,180,000.000	7,593,371.260	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,630,000.000	4,991,857.650	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,336,220.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,570,000.000	5,051,801.390	
	POLAND 5.75 10/25/21	2,690,000.000	2,886,999.460	
ポーランド・ズロチ　小計		72,700,000.000 (2,106,846,000)	75,713,641.910 (2,194,181,343)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	5,044,474.000	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	3,956,417.950	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,647,513.780	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,340,000.000	1,385,600.060	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,560,772.200	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,575,811.240	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,180,000.000	1,255,469.960	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,282,812.850	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	2,146,973.600	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,480,000.000	1,578,565.180	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	3,090,474.370	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	1,050,000.000	1,179,155.880	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	5,540,000.000	6,383,626.760	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	4,041,304.960	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,480,000.000	1,693,502.870	
マレーシア・リンギット　小計		41,940,000.000 (1,139,090,400)	44,822,475.660 (1,217,378,439)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	12,560,000.000	12,548,319.200	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	13,939,000.000	18,022,290.660	

	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	66,505,000.000	75,494,480.850	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	38,064,000.000	36,097,613.760	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	57,079,000.000	56,757,645.230	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	71,950,000.000	74,831,597.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	34,054,000.000	36,316,207.220	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	44,721,000.000	47,825,979.030	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	19,500,000.000	20,922,525.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	40,030,000.000	41,975,458.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	33,666,000.000	37,157,702.850	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	49,237,000.000	51,245,377.230	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	56,200,000.000	62,628,718.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	37,143,000.000	42,572,563.740	
メキシコ・ペソ　小計		574,648,000.000 (3,367,437,280)	614,396,478.270 (3,600,363,363)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	3,060,000.000	3,196,629.000	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,300,000.000	2,409,829.600	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	2,030,000.000	2,165,902.410	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,300,000.000	3,514,212.900	
	AUSTRIA 07/15/23	2,760,000.000	2,805,678.000	
	AUSTRIA 09/20/22	480,000.000	487,082.880	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,840,000.000	3,084,231.480	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,250,000.000	1,519,793.750	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	560,000.000	691,544.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,990,000.000	2,183,203.130	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	2,760,000.000	2,992,665.240	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,680,000.000	2,670,605.740	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,400,000.000	1,815,598.400	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,400,000.000	2,235,940.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	1,410,000.000	1,569,879.900	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	4,830,000.000	5,158,923.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	7,090,000.000	7,769,931.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	640,000.000	1,330,762.240	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	2,800,000.000	4,571,280.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,840,000.000	3,740,919.000	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,719,085.200	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	2,030,000.000	2,079,430.500	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	3,960,000.000	4,119,027.630	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	2,430,000.000	2,573,879.570	

		BELGIUM 0.8 06/22/27	2,050,000.000	2,187,493.500	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	3,390,000.000	3,631,368.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	2,330,000.000	2,512,569.480	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	3,770,000.000	4,061,224.960	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	3,220,000.000	3,509,742.040	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	2,000,000.000	2,243,974.000	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	1,000,000.000	1,144,852.000	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	2,230,000.000	2,636,804.160	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	1,180,000.000	1,416,741.040	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	1,220,000.000	1,493,652.100	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	1,130,000.000	1,550,190.500	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	2,950,000.000	3,231,695.500	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	1,630,000.000	2,236,697.410	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	2,630,000.000	2,981,499.500	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,410,000.000	1,930,811.240	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	2,450,000.000	4,116,347.900	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	1,090,000.000	1,200,805.040	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,550,000.000	2,254,250.250	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	3,930,000.000	6,675,879.990	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	7,470,000.000	8,090,234.100	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	4,100,000.000	4,637,165.600	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	2,220,000.000	2,874,931.080	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	4,250,000.000	7,101,613.140	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	7,880,000.000	11,486,853.290	
		BUNDESOBL 04/05/24	5,990,000.000	6,121,720.100	
		BUNDESOBL 04/08/22	2,500,000.000	2,533,525.000	
		BUNDESOBL 04/09/21	14,250,000.000	14,350,320.000	
		BUNDESOBL 04/14/23	2,960,000.000	3,014,851.760	
		BUNDESOBL 10/07/22	3,000,000.000	3,048,101.700	
		BUNDESOBL 10/08/21	3,400,000.000	3,435,088.000	
		BUNDESOBL 10/13/23	4,800,000.000	4,899,168.000	
		BUNDESOBL 10/18/24	4,040,000.000	4,133,998.680	
		BUNDESSCHAT 0.0 09/10/21	1,070,000.000	1,080,523.450	
		BUNDESSCHAT 06/11/21	2,650,000.000	2,671,870.450	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,020,000.000	912,761.280	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	6,050,000.000	6,315,474.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	4,420,000.000	4,618,135.340	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,890,000.000	4,066,800.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	3,440,000.000	3,612,825.600	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,250,000.000	6,605,312.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	6,940,000.000	7,398,456.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	4,490,000.000	4,779,200.900	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	4,380,000.000	4,493,999.120	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	5,620,000.000	5,726,611.400	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,100,000.000	3,316,132.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	7,080,000.000	7,660,984.800	

		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	4,950,000.000	6,186,193.200	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	3,100,000.000	3,300,568.760	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	3,070,000.000	3,284,123.290	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	5,360,000.000	5,834,397.520	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	3,300,000.000	3,483,328.200	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	4,200,000.000	4,595,977.250	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	9,530,000.000	10,084,783.220	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	8,030,000.000	8,448,523.600	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,900,000.000	3,168,963.400	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	2,700,000.000	2,826,360.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	6,440,000.000	9,858,545.200	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	7,650,000.000	11,944,006.200	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	2,990,000.000	3,159,383.500	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,010,000.000	5,016,917.500	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,500,000.000	7,472,871.000	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,740,000.000	6,691,795.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,800,000.000	2,574,882.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	4,120,000.000	6,970,751.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	2,980,000.000	5,735,486.800	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,740,000.000	9,340,931.600	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,440,000.000	5,089,136.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,502,753.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,312,436.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,533,306.500	
		FINLAND 0.0 09/15/24	1,080,000.000	1,099,107.360	
		FINLAND 0.5 04/15/26	910,000.000	951,945.540	
		FINLAND 0.5 09/15/27	1,160,000.000	1,215,218.320	
		FINLAND 0.5 09/15/28	830,000.000	869,441.600	
		FINLAND 0.5 09/15/29	880,000.000	920,882.160	
		FINLAND 0.75 04/15/31	990,000.000	1,059,492.550	
		FINLAND 0.875 09/15/25	780,000.000	831,550.200	
		FINLAND 04/15/22	10,000.000	10,126.850	
		FINLAND 09/15/23	2,090,000.000	2,126,420.340	
		FINLAND 1.125 04/15/34	900,000.000	1,005,473.700	
		FINLAND 1.375 04/15/47	760,000.000	917,403.600	
		FINLAND 1.5 04/15/23	2,950,000.000	3,143,520.000	
		FINLAND 2.0 04/15/24	1,770,000.000	1,954,037.520	

		FINLAND 2.625 07/04/42	870,000.000	1,274,224.620	
		FINLAND 2.75 07/04/28	1,180,000.000	1,462,558.080	
		FINLAND 3.5 04/15/21	1,290,000.000	1,356,437.580	
		FINLAND 4.0 07/04/25	2,070,000.000	2,566,851.750	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,922,744.960	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,580,000.000	2,557,087.020	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	6,490,000.000	6,676,905.510	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	7,840,000.000	8,187,406.080	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	5,170,000.000	5,406,408.590	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	6,690,000.000	6,972,886.650	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	18,130,000.000	19,338,364.500	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	6,690,000.000	7,133,640.660	
		FRANCE OAT 02/25/22	2,810,000.000	2,841,838.140	
		FRANCE OAT 03/25/23	5,720,000.000	5,814,906.240	
		FRANCE OAT 03/25/24	6,020,000.000	6,128,986.080	
		FRANCE OAT 03/25/25	6,250,000.000	6,351,528.750	
		FRANCE OAT 05/25/21	4,160,000.000	4,192,656.000	
		FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,572,121.500	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,010,000.000	5,426,080.500	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	8,080,000.000	8,681,748.300	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,080,000.000	4,581,608.250	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	5,580,000.000	6,241,230.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	14,340,000.000	16,467,554.100	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	5,130,000.000	5,907,836.250	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	7,450,000.000	8,019,679.150	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,710,000.000	3,379,250.760	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	4,200,000.000	5,085,654.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	9,220,000.000	10,176,436.700	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	5,910,000.000	7,592,285.020	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	8,220,000.000	9,186,474.720	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	13,640,000.000	14,705,938.720	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	8,110,000.000	10,108,279.670	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	10,570,000.000	12,936,728.700	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	13,130,000.000	14,203,403.760	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,110,000.000	9,574,919.900	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	7,090,000.000	7,577,550.940	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	7,840,000.000	9,680,048.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,480,000.000	6,615,480.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,500,000.000	6,948,914.000	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	6,560,000.000	10,602,698.400	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	10,990,000.000	12,974,398.360	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	8,290,000.000	14,637,735.900	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	7,370,000.000	12,134,336.500	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	7,930,000.000	11,978,447.390	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	12,500,000.000	21,195,438.740	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	3,030,633.000	
		IRISH 0.8 03/15/22	10,000.000	10,281.300	
		IRISH 0.9 05/15/28	1,970,000.000	2,117,553.000	
		IRISH 1.0 05/15/26	2,440,000.000	2,617,998.000	

		IRISH 1.1 05/15/29	1,740,000.000	1,902,344.930	
		IRISH 1.3 05/15/33	810,000.000	906,223.140	
		IRISH 1.35 03/18/31	680,000.000	762,817.880	
		IRISH 1.5 05/15/50	640,000.000	737,054.720	
		IRISH 1.7 05/15/37	1,140,000.000	1,355,437.200	
		IRISH 10/18/22	9,530,000.000	9,655,281.380	
		IRISH 2.0 02/18/45	1,890,000.000	2,417,877.000	
		IRISH 2.4 05/15/30	2,250,000.000	2,762,745.750	
		IRISH 3.4 03/18/24	990,000.000	1,146,863.320	
		IRISH 3.9 03/20/23	4,740,000.000	5,399,412.210	
		IRISH 5.4 03/13/25	1,700,000.000	2,197,008.600	
		ITALY BTPS 0.05 01/15/23	920,000.000	914,493.800	
		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	5,800,000.000	5,840,695.700	
		ITALY BTPS 0.45 06/01/21	3,750,000.000	3,781,200.000	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,870,000.000	1,891,318.000	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	3,000,000.000	3,058,500.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	5,120,000.000	5,227,085.820	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,700,000.000	2,757,780.000	
		ITALY BTPS 1.0 07/15/22	6,800,000.000	6,948,376.000	
		ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,767,770.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	3,500,000.000	3,572,870.000	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	3,330,000.000	3,320,263.080	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,084,747.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	5,980,000.000	6,202,162.980	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,282,486.380	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,800,000.000	2,911,260.800	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	7,430,000.000	7,725,327.640	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	3,300,000.000	3,448,500.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	4,320,000.000	4,373,559.360	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,140,000.000	4,354,232.580	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,959,600.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	7,300,000.000	7,801,240.630	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	2,900,000.000	3,096,894.620	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,700,000.000	6,104,359.140	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	12,350,000.000	13,258,243.700	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,010,000.000	2,093,616.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,500,000.000	2,703,750.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	2,400,000.000	2,522,400.000	
		ITALY BTPS 2.3 10/15/21	3,300,000.000	3,434,696.100	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	3,650,000.000	3,981,025.800	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	3,030,000.000	3,258,310.500	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,430,000.000	3,755,455.550	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,290,000.000	5,760,191.070	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	3,340,000.000	3,603,192.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,600,000.000	1,672,320.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,190,000.000	3,613,456.550	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,130,000.000	2,431,608.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	3,850,000.000	4,438,087.500	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,130,000.000	2,447,915.280	

		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,900,000.000	3,433,643.500	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,370,000.000	4,031,399.570	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	3,090,000.000	3,773,910.620	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,870,000.000	7,045,813.830	
		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	3,000,000.000	3,153,060.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	6,930,000.000	7,343,166.600	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	6,380,000.000	7,294,994.080	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	4,250,000.000	5,511,863.250	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	11,810,000.000	15,245,529.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,500,000.000	4,071,921.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	16,780,000.000	20,438,040.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	4,430,000.000	5,037,521.340	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	4,010,000.000	4,632,352.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	3,810,000.000	4,109,656.500	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	4,840,000.000	6,246,896.040	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,670,000.000	6,782,665.970	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	4,810,000.000	5,318,898.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	8,230,000.000	10,016,486.100	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	5,450,000.000	7,676,325.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,480,000.000	6,533,632.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,630,000.000	6,762,115.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,380,000.000	8,665,316.000	
		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,376,611.120	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	3,200,000.000	3,674,313.600	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,870,000.000	5,711,733.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,317,990.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,767,140.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	3,035,585.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,250,800.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,630,000.000	2,720,976.960	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,430,000.000	2,506,638.290	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,370,000.000	1,417,730.800	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,140,000.000	3,305,635.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,670,000.000	3,941,007.480	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	2,340,000.000	2,522,735.740	
		NETHERLANDS 01/15/22	5,180,000.000	5,239,787.560	
		NETHERLANDS 01/15/24	3,980,000.000	4,056,364.260	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	5,200,000.000	5,619,565.110	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,600,000.000	4,000,238.630	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	2,490,000.000	2,668,406.740	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,400,000.000	4,466,903.000	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,260,000.000	5,268,346.430	

	NETHERLANDS 3.25 07/15/21	5,250,000.000	5,554,493.430	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,889,438.000	
	NETHERLANDS 3.75 01/15/42	4,480,000.000	7,791,521.920	
	NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,080,000.000	5,039,496.000	
	NETHERLANDS 5.5 01/15/28	3,020,000.000	4,410,710.000	
	NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	735,140.000	
	SPAIN 0.05 10/31/21	6,080,000.000	6,126,116.800	
	SPAIN 0.25 07/30/24	6,840,000.000	6,938,346.880	
	SPAIN 0.35 07/30/23	3,280,000.000	3,342,995.680	
	SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,357,651.000	
	SPAIN 0.45 10/31/22	3,040,000.000	3,104,095.360	
	SPAIN 0.6 10/31/29	4,720,000.000	4,774,558.480	
	SPAIN 0.75 07/30/21	10,940,000.000	11,138,801.680	
	SPAIN 1.3 10/31/26	4,350,000.000	4,677,802.950	
	SPAIN 1.4 04/30/28	3,760,000.000	4,086,349.200	
	SPAIN 1.4 07/30/28	4,280,000.000	4,661,776.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	5,320,000.000	5,806,886.400	
	SPAIN 1.45 10/31/27	6,880,000.000	7,494,463.110	
	SPAIN 1.5 04/30/27	3,700,000.000	4,035,960.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	3,110,000.000	3,369,902.700	
	SPAIN 1.85 07/30/35	2,770,000.000	3,150,835.940	
	SPAIN 1.95 04/30/26	3,000,000.000	3,341,496.000	
	SPAIN 1.95 07/30/30	4,840,000.000	5,539,765.690	
	SPAIN 2.15 10/31/25	4,650,000.000	5,205,075.150	
	SPAIN 2.35 07/30/33	3,400,000.000	4,097,340.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	2,560,000.000	3,355,144.170	
	SPAIN 2.75 10/31/24	6,960,000.000	7,895,806.800	
	SPAIN 2.9 10/31/46	3,720,000.000	5,021,192.760	
	SPAIN 3.45 07/30/66	2,840,000.000	4,440,482.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	5,600,000.000	6,535,765.600	
	SPAIN 4.2 01/31/37	7,720,000.000	11,705,426.840	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,080,000.000	4,786,060.320	
	SPAIN 4.65 07/30/25	4,820,000.000	6,042,761.700	
	SPAIN 4.7 07/30/41	6,410,000.000	10,769,479.460	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,000,000.000	3,597,672.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,360,000.000	7,429,440.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	6,237,063.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	3,000,000.000	5,493,120.570	
	SPAIN 5.4 01/31/23	6,210,000.000	7,282,231.020	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,710,000.000	3,993,610.950	
	SPAIN 5.75 07/30/32	4,390,000.000	7,092,583.620	
	SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,690,961.600	
	SPAIN 5.9 07/30/26	4,440,000.000	6,094,210.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,240,655.000	
ユーロ　小計		1,196,690,000.000 (146,821,896,100)	1,426,094,965.200 (174,967,591,280)	

	南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	17,630,000.000	12,538,995.470	
		SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	21,670,000.000	14,953,569.850	
		SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	24,830,000.000	20,956,520.000	
		SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	35,500,000.000	33,071,222.730	
		SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	28,830,000.000	26,412,604.500	
		SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	36,310,000.000	31,891,286.100	
		SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	33,480,000.000	29,148,326.790	
		SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	56,400,000.000	48,852,568.900	
		SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	36,920,000.000	34,280,907.070	
		SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	19,430,000.000	17,576,409.070	
	南アフリカ・ランド　小計		311,000,000.000 (2,382,260,000)	269,682,410.480 (2,065,767,264)	
国債証券　合計			419,253,970,880 (419,253,970,880)	466,521,787,178 (466,521,787,178)	
合計				466,521,787,178 (466,521,787,178)	

（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	219銘柄	47.84	49.07
イギリス・ポンド	国債証券	41銘柄	6.28	6.44
オーストラリア・ドル	国債証券	22銘柄	1.98	2.03
カナダ・ドル	国債証券	31銘柄	1.82	1.87
シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	0.33	0.34
スウェーデン・クローナ	国債証券	6銘柄	0.23	0.23
デンマーク・クローネ	国債証券	6銘柄	0.42	0.43
ノルウェー・クローネ	国債証券	6銘柄	0.14	0.15
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.46	0.47
マレーシア・リンギット	国債証券	15銘柄	0.25	0.26
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.75	0.77
ユーロ	国債証券	291銘柄	36.57	37.50
南アフリカ・ランド	国債証券	10銘柄	0.43	0.44

（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2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,111,771,110
コール・ローン	462,426,420
国債証券	134,519,757,722
派生商品評価勘定	1
未収利息	1,303,897,041
前払費用	459,904,518
流動資産合計	140,857,756,812
資産合計	140,857,756,812
負債の部	
流動負債	
未払金	2,726,868,694
未払解約金	2,151,600
流動負債合計	2,729,020,294
負債合計	2,729,020,294
純資産の部	
元本等	
元本	65,968,862,023
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	72,159,874,495
元本等合計	138,128,736,518
純資産合計	138,128,736,518
負債純資産合計	140,857,756,812

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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	58,411,752,904円
同期中追加設定元本額	90,146,872,847円
同期中一部解約元本額	82,589,763,728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）	238,935,831円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	388,079,129円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	25,222,173円
たわらノーロード　バランス（標準型）	67,823,758円
たわらノーロード　バランス（積極型）	28,300,459円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	366,786円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,453,122円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,939,812円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	898,583円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	842,467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）	205,341,164円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	398,187,302円
投資のソムリエ	12,832,312,781円
クルーズコントロール	903,464,493円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,240,056,409円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	162,888,920円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	826,207円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,969,792円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	11,260,350円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	764,113,361円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	8,209,494,788円
ワールドアセットバランス（基本コース）	861,941,970円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,290,579,793円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	8,207,593円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	6,819,680円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	6,311,720円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	17,081,431円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,117,047,604円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	135,331,066円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,226,098円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	1,047,404円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	1,042,078円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	17,428,485,393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）	2,905,774,544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）	87,105,454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）	209,528,153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）	148,258,087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）	4,766,384,756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	65,968,862,023円
２．　受益権の総数	65,968,862,023口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	1,439,788,531
合計	1,439,788,531

（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2年1月14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2年1月14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	550,000,000	－	549,999,999	1
アメリカ・ドル	550,000,000	－	549,999,999	1
合計	550,000,000	－	549,999,999	1

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額	2.0938円
（1万口当たり純資産額）	(20,938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2年1月14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	17,800,000.000	17,915,700.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	22,100,000.000	23,601,916.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	4,000,000.000	4,282,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	13,800,000.000	14,983,488.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	11,390,706.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	11,100,000.000	12,595,114.500	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	14,600,000.000	16,730,797.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	5,800,000.000	6,801,254.000	

		BRAZIL 7.125 01/20/37	10,300,000.000	13,319,805.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,200,000.000	8,753,780.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,800,000.000	3,562,440.000	
		COLOMBIA 2.625 03/15/23	5,700,000.000	5,757,769.500	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	13,600,000.000	14,509,262.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	9,100,000.000	9,618,973.000	
		COLOMBIA 4.375 07/12/21	6,200,000.000	6,406,212.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	8,000,000.000	8,770,200.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	9,000,000.000	10,048,297.500	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	16,000,000.000	18,694,960.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	8,000,000.000	9,613,600.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	10,000,000.000	12,489,450.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,000,000.000	11,686,005.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	9,400,000.000	13,408,583.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	5,900,000.000	7,251,690.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	7,400,000.000	8,176,496.800	
		CROATIA 6.0 01/26/24	8,400,000.000	9,646,971.600	
		CROATIA 6.375 03/24/21	14,400,000.000	15,134,400.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	12,600,000.000	13,855,224.600	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	10,600,000.000	12,006,651.800	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	14,000,000.000	15,857,324.000	
		HUNGARY 6.375 03/29/21	10,000,000.000	10,551,390.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	6,400,000.000	10,644,928.000	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	7,700,000.000	7,960,474.750	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	4,000,000.000	4,170,284.720	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	5,200,000.000	5,441,324.460	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	7,600,000.000	8,106,160.000	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	7,000,000.000	7,619,184.900	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	13,800,000.000	14,868,346.030	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	7,000,000.000	7,696,147.900	
		INDONESIA 4.35 01/11/48	5,000,000.000	5,540,388.950	
		INDONESIA 4.625 04/15/43	5,400,000.000	6,066,501.310	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	9,800,000.000	10,935,029.630	
		INDONESIA 4.75 02/11/29	5,000,000.000	5,719,412.850	
		INDONESIA 4.875 05/05/21	7,100,000.000	7,388,374.450	
		INDONESIA 5.125 01/15/45	7,400,000.000	8,843,338.300	
		INDONESIA 5.25 01/08/47	3,400,000.000	4,187,601.840	
		INDONESIA 5.25 01/17/42	8,300,000.000	10,080,231.640	
		INDONESIA 5.35 02/11/49	6,000,000.000	7,712,975.640	
		INDONESIA 5.875 01/15/24	13,200,000.000	14,961,912.900	
		INDONESIA 5.95 01/08/46	5,200,000.000	6,938,189.070	
		INDONESIA 6.75 01/15/44	8,500,000.000	12,216,988.540	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	8,500,000.000	12,878,081.400	
		PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,540,210.000	
		PANAMA 3.875 03/17/28	6,100,000.000	6,652,873.500	
		PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	10,968,745.500	
		PANAMA 4.5 05/15/47	7,000,000.000	8,327,865.000	
		PANAMA 6.7 01/26/36	7,900,000.000	11,067,110.000	
		PANAMA 7.125 01/29/26	7,800,000.000	9,791,710.500	

		PANAMA 9.375 04/01/29	5,900,000.000	9,006,984.250	
		PERU 2.844 06/20/30	4,000,000.000	4,135,640.000	
		PERU 4.125 08/25/27	7,300,000.000	8,218,759.750	
		PERU 5.625 11/18/50	11,000,000.000	16,152,785.000	
		PERU 6.55 03/14/37	11,000,000.000	16,033,600.000	
		PERU 7.35 07/21/25	7,300,000.000	9,144,345.000	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	4,000,000.000	4,198,149.000	
		PHILIPPINES 3.7 02/02/42	10,000,000.000	11,393,794.100	
		PHILIPPINES 3.7 03/01/41	8,600,000.000	9,786,540.790	
		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,554,260.350	
		PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,831,388.980	
		PHILIPPINES 4.2 01/21/24	14,800,000.000	16,009,370.160	
		PHILIPPINES 5.0 01/13/37	7,800,000.000	9,989,472.700	
		PHILIPPINES 5.5 03/30/26	5,600,000.000	6,661,815.600	
		PHILIPPINES 6.375 01/15/32	6,600,000.000	9,021,273.420	
		PHILIPPINES 6.375 10/23/34	7,000,000.000	9,987,803.280	
		PHILIPPINES 7.75 01/14/31	7,100,000.000	10,551,087.980	
		PHILIPPINES 9.5 02/02/30	9,800,000.000	15,722,770.630	
		ROMANIA 4.375 08/22/23	11,000,000.000	11,805,420.000	
		ROMANIA 4.875 01/22/24	8,600,000.000	9,474,190.000	
		ROMANIA 5.125 06/15/48	5,600,000.000	6,528,032.000	
		ROMANIA 6.125 01/22/44	7,400,000.000	9,677,986.400	
		ROMANIA 6.75 02/07/22	8,500,000.000	9,307,449.000	
		RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	11,859,000.000	13,477,753.500	
		RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	10,400,000.000	11,384,984.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	10,400,000.000	11,562,720.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	10,800,000.000	11,358,468.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	16,400,000.000	18,337,873.200	
		RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	13,400,000.000	14,626,100.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	12,000,000.000	14,365,800.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	24,000,000.000	29,981,784.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	14,000,000.000	18,140,948.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	10,200,000.000	13,613,940.000	
		SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	9,200,000.000	9,039,000.000	

		SOUTH AFRICA 4.665 01/17/24	7,100,000.000	7,441,865.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	5,400,000.000	5,643,216.000	
		SOUTH AFRICA 5.0 10/12/46	4,800,000.000	4,437,057.600	
		SOUTH AFRICA 5.375 07/24/44	5,800,000.000	5,571,770.000	
		SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	3,200,000.000	3,143,212.800	
		SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	8,000,000.000	8,577,280.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	6,400,000.000	6,932,371.200	
		SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	10,164,298.000	
		SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,248,604.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	9,704,988.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	10,900,000.000	11,303,409.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	11,200,000.000	11,762,912.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	15,500,000.000	16,430,852.500	
		UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	12,000,000.000	12,915,120.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	13,348,724.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	7,000,000.000	7,419,545.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	12,000,000.000	13,248,120.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	11,000,000.000	12,055,395.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	10,400,000.000	11,423,724.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	14,400,000.000	16,026,264.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	10,400,000.000	12,905,828.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	13,800,000.000	16,417,653.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	13,900,000.000	18,173,346.500	
		UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	7,200,000.000	10,008,000.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,049,959,000.000 (115,663,483,440)	1,221,130,698.270 (134,519,757,722)	

国債証券　合計	115,663,483,440 (115,663,483,440)	134,519,757,722 (134,519,757,722)	
合計		134,519,757,722 (134,519,757,722)	

（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　115銘柄	97.39	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。

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2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,597,787,198
株式	263,713,974,995
派生商品評価勘定	10,291,620
未収入金	9,762,060
未収配当金	408,027,381
流動資産合計	267,739,843,254
資産合計	267,739,843,254
負債の部	
流動負債	
前受金	4,479,000
未払解約金	575,777,000
流動負債合計	580,256,000
負債合計	580,256,000
純資産の部	
元本等	
元本	96,962,453,569
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	170,197,133,685
元本等合計	267,159,587,254
純資産合計	267,159,587,254
負債純資産合計	267,739,843,254

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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	111,653,461,882円
同期中追加設定元本額	35,348,588,929円
同期中一部解約元本額	50,039,597,242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	13,611,439,882円

ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	2,270,735,109円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,904,248円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	5,009,685円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	7,851,874円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,350,508円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	18,818,754円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	10,006,146円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	523,357,696円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	295,462,995円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	9,601,347円
たわらノーロード　バランス（標準型）	60,374,344円
たわらノーロード　バランス（積極型）	93,549,661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）	535,925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）	49,914,981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）	122,493,668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）	88,836,746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）	159,069,186円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	186,722円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	792,245円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,727,305円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,645,595円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	3,643,346円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,342,904,749円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	981,597,148円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,221,491,403円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,307,425,309円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	347,631,640円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,182,324,299円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,111,146,502円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	40,311,204円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,120,067,435円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	25,180,737円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	306,668,101円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	234,064,434円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	404,786,916円
投資のソムリエ	7,752,648,884円
クルーズコントロール	1,460,334,094円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	749,048,710円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	254,343,105円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	301,867,978円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,325,386円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	14,417,185円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	27,147,531円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	405,673,887円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,361,214,519円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	5,602,955円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,636,868円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,311,705円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	10,798,340円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	34,196,244円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,235,209,579円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	204,093,997円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	834,994円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	709,579円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	713,959円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	189,185円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	78,739,020円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	60,924,956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）	619,149,099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）	89,946,801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）	206,404,283円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,789,652円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,075,805円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,232,103円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,898,566円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,025,819円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,091,785円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	847,524,247円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	842,970,799円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,416,784,905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）	170,583,328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）	47,266,489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）	462,442,535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）	123,979,136円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,256,332円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,787,888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）	479,569,491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）	36,811,782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）	131,239,904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）	339,216,777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）	1,627,526,351円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,780,766円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,343,327円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,767,270円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	101,694円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	119,842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）	380,720,505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）	1,210,952,937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）	1,605,155,025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）	65,047,821円
計	96,962,453,569円

２．	受益権の総数	96,962,453,569口

３．　差入代用有価証券 　　株式	 1,934,750,000円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14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2年1月14日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	24,642,201,754
合計	24,642,201,754

（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2年1月14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2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,486,080,000	－	1,496,400,000	10,320,000
合計	1,486,080,000	－	1,496,400,000	10,320,000

（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2年1月14日現在
1口当たり純資産額	2.7553円
（1万口当たり純資産額）	(27,553円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年1月14日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	2,913.00	14,856,300	
日本水産	145,800	626.00	91,270,800	
マルハニチロ	21,100	2,759.00	58,214,900	
ホウスイ	900	888.00	799,200	
カネコ種苗	4,500	1,439.00	6,475,500	
サカタのタネ	17,400	3,565.00	62,031,000	
ホクト	11,200	1,954.00	21,884,800	
ホクリヨウ	2,300	703.00	1,616,900	
ヒノキヤグループ	3,600	2,129.00	7,664,400	
ショーボンドホールディングス	20,800	4,650.00	96,720,000	
ミライト・ホールディングス	43,400	1,706.00	74,040,400	
タマホーム	6,900	1,540.00	10,626,000	
サンヨーホームズ	1,300	717.00	932,100	
日本アクア	5,800	601.00	3,485,800	
ファーストコーポレーション	4,500	593.00	2,668,500	
ベステラ	2,500	1,275.00	3,187,500	
ＴＡＴＥＲＵ	30,100	214.00	6,441,400	
スペースバリューホールディングス	18,000	584.00	10,512,000	
住石ホールディングス	29,500	147.00	4,336,500	
日鉄鉱業	3,300	4,775.00	15,757,500	
三井松島ホールディングス	5,700	1,208.00	6,885,600	
国際石油開発帝石	585,000	1,155.00	675,675,000	
石油資源開発	19,100	3,045.00	58,159,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,100	1,505.00	10,685,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,145.00	3,206,000	
第一カッター興業	1,800	1,843.00	3,317,400	
安藤・間	86,800	966.00	83,848,800	
東急建設	42,800	758.00	32,442,400	
コムシスホールディングス	51,700	3,195.00	165,181,500	

ビーアールホールディングス	15,900	487.00	7,743,300	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,788.00	25,370,800	
東建コーポレーション	4,500	7,550.00	33,975,000	
ソネック	1,500	824.00	1,236,000	
ヤマウラ	6,400	936.00	5,990,400	
大成建設	112,300	4,585.00	514,895,500	
大林組	336,700	1,231.00	414,477,700	
清水建設	341,800	1,134.00	387,601,200	
飛島建設	9,700	1,461.00	14,171,700	
長谷工コーポレーション	130,300	1,476.00	192,322,800	
松井建設	13,200	807.00	10,652,400	
錢高組	1,400	4,090.00	5,726,000	
鹿島建設	264,400	1,422.00	375,976,800	
不動テトラ	8,800	1,617.00	14,229,600	
大末建設	3,900	970.00	3,783,000	
鉄建建設	7,300	2,804.00	20,469,200	
西松建設	25,900	2,450.00	63,455,000	
三井住友建設	81,400	628.00	51,119,200	
大豊建設	7,600	2,787.00	21,181,200	
前田建設工業	84,300	1,016.00	85,648,800	
佐田建設	7,300	485.00	3,540,500	
ナカノフドー建設	9,100	493.00	4,486,300	
奥村組	18,300	2,975.00	54,442,500	
東鉄工業	14,500	3,170.00	45,965,000	
イチケン	2,500	1,800.00	4,500,000	
富士ピー・エス	5,000	579.00	2,895,000	
淺沼組	3,800	4,855.00	18,449,000	
戸田建設	139,700	715.00	99,885,500	
熊谷組	15,600	3,275.00	51,090,000	
北野建設	2,100	2,581.00	5,420,100	
植木組	1,500	2,546.00	3,819,000	
矢作建設工業	14,900	806.00	12,009,400	
ピーエス三菱	11,100	714.00	7,925,400	
日本ハウスホールディングス	23,000	489.00	11,247,000	
大東建託	40,300	13,020.00	524,706,000	
新日本建設	14,300	921.00	13,170,300	
ＮＩＰＰＯ	27,900	2,411.00	67,266,900	
東亜道路工業	2,100	3,540.00	7,434,000	
前田道路	35,700	2,653.00	94,712,100	
日本道路	3,300	6,650.00	21,945,000	
東亜建設工業	10,500	1,655.00	17,377,500	
日本国土開発	19,700	678.00	13,356,600	
若築建設	6,100	1,710.00	10,431,000	
東洋建設	37,800	512.00	19,353,600	
五洋建設	133,500	668.00	89,178,000	
世紀東急工業	16,200	915.00	14,823,000	
福田組	3,900	4,920.00	19,188,000	
日本ドライケミカル	2,600	1,923.00	4,999,800	
住友林業	85,300	1,581.00	134,859,300	
日本基礎技術	11,500	408.00	4,692,000	

巴コーポレーション	14,900	462.00	6,883,800	
大和ハウス工業	333,200	3,446.00	1,148,207,200	
ライト工業	19,300	1,560.00	30,108,000	
積水ハウス	368,500	2,391.50	881,267,750	
日特建設	8,800	854.00	7,515,200	
北陸電気工事	5,900	1,157.00	6,826,300	
ユアテック	19,400	691.00	13,405,400	
四電工	1,700	2,893.00	4,918,100	
中電工	13,600	2,505.00	34,068,000	
関電工	48,000	1,018.00	48,864,000	
きんでん	80,000	1,658.00	132,640,000	
東京エネシス	11,200	899.00	10,068,800	
トーエネック	3,400	3,830.00	13,022,000	
住友電設	9,500	2,755.00	26,172,500	
日本電設工業	18,500	2,210.00	40,885,000	
協和エクシオ	51,100	2,790.00	142,569,000	
新日本空調	8,900	2,135.00	19,001,500	
日本工営	6,900	3,520.00	24,288,000	
九電工	23,700	3,235.00	76,669,500	
三機工業	24,300	1,529.00	37,154,700	
日揮ホールディングス	103,600	1,706.00	176,741,600	
中外炉工業	3,600	1,815.00	6,534,000	
ヤマト	10,800	774.00	8,359,200	
太平電業	8,200	2,294.00	18,810,800	
高砂熱学工業	29,300	1,916.00	56,138,800	
三晃金属工業	1,400	2,627.00	3,677,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	10,000	4,120.00	41,200,000	
朝日工業社	2,200	3,470.00	7,634,000	
明星工業	21,700	956.00	20,745,200	
大氣社	16,400	3,705.00	60,762,000	
ダイダン	8,000	2,667.00	21,336,000	
日比谷総合設備	10,800	1,923.00	20,768,400	
日本製粉	31,600	1,702.00	53,783,200	
日清製粉グループ本社	121,800	1,887.00	229,836,600	
日東富士製粉	700	6,320.00	4,424,000	
昭和産業	9,900	3,080.00	30,492,000	
鳥越製粉	9,700	848.00	8,225,600	
中部飼料	13,100	1,615.00	21,156,500	
フィード・ワン	72,500	180.00	13,050,000	
東洋精糖	1,700	1,222.00	2,077,400	
日本甜菜製糖	5,700	1,981.00	11,291,700	
三井製糖	9,500	2,227.00	21,156,500	
塩水港精糖	11,100	226.00	2,508,600	
日新製糖	5,000	2,043.00	10,215,000	
ＬＩＦＵＬＬ	35,800	554.00	19,833,200	
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,896.00	13,082,400	
日本M&Aセンター	77,500	3,900.00	302,250,000	
メンバーズ	3,000	2,173.00	6,519,000	
中広	1,100	545.00	599,500	
ＵＴグループ	12,100	3,300.00	39,930,000	

アイティメディア	3,100	909.00	2,817,900	
タケエイ	9,800	1,233.00	12,083,400	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,200	1,840.00	2,208,000	
ビーネックスグループ	11,300	1,313.00	14,836,900	
コシダカホールディングス	24,700	1,565.00	38,655,500	
アルトナー	2,500	840.00	2,100,000	
パソナグループ	12,500	1,565.00	19,562,500	
ＣＤＳ	2,500	1,620.00	4,050,000	
リンクアンドモチベーション	22,700	604.00	13,710,800	
ＧＣＡ	12,300	998.00	12,275,400	
エス・エム・エス	31,900	3,050.00	97,295,000	
サニーサイドアップグループ	2,300	1,102.00	2,534,600	
パーソルホールディングス	102,600	2,090.00	214,434,000	
リニカル	4,900	1,146.00	5,615,400	
クックパッド	35,900	357.00	12,816,300	
エスクリ	3,300	780.00	2,574,000	
アイ・ケイ・ケイ	5,100	743.00	3,789,300	
森永製菓	25,300	5,320.00	134,596,000	
中村屋	2,700	4,310.00	11,637,000	
江崎グリコ	32,000	4,915.00	157,280,000	
名糖産業	5,200	1,368.00	7,113,600	
井村屋グループ	4,600	1,950.00	8,970,000	
不二家	6,000	2,148.00	12,888,000	
山崎製パン	80,800	2,049.00	165,559,200	
第一屋製パン	1,800	954.00	1,717,200	
モロゾフ	1,800	5,100.00	9,180,000	
亀田製菓	6,200	5,020.00	31,124,000	
寿スピリッツ	10,400	8,780.00	91,312,000	
カルビー	49,100	3,660.00	179,706,000	
森永乳業	19,900	4,325.00	86,067,500	
六甲バター	7,200	1,692.00	12,182,400	
ヤクルト本社	74,100	6,110.00	452,751,000	
明治ホールディングス	71,300	7,570.00	539,741,000	
雪印メグミルク	26,000	2,539.00	66,014,000	
プリマハム	16,900	2,555.00	43,179,500	
日本ハム	41,200	4,680.00	192,816,000	
林兼産業	3,700	678.00	2,508,600	
丸大食品	11,500	2,216.00	25,484,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,600	3,060.00	26,316,000	
柿安本店	3,700	3,200.00	11,840,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	69,500	712.00	49,484,000	
学情	3,600	2,412.00	8,683,200	
スタジオアリス	5,200	1,959.00	10,186,800	
クロスキャット	2,800	1,179.00	3,301,200	
シミックホールディングス	5,700	1,775.00	10,117,500	
エプコ	1,600	1,439.00	2,302,400	
システナ	37,600	1,943.00	73,056,800	
ＮＪＳ	2,200	1,830.00	4,026,000	
デジタルアーツ	5,200	6,050.00	31,460,000	
日鉄ソリューションズ	15,800	3,820.00	60,356,000	

綜合警備保障	40,800	6,050.00	246,840,000	
キューブシステム	5,600	810.00	4,536,000	
いちご	134,800	460.00	62,008,000	
エイジア	1,900	1,474.00	2,800,600	
日本駐車場開発	116,800	147.00	17,169,600	
コア	4,500	1,511.00	6,799,500	
カカクコム	76,800	2,997.00	230,169,600	
アイロムグループ	3,600	1,427.00	5,137,200	
セントケア・ホールディング	6,800	485.00	3,298,000	
サイネックス	1,700	705.00	1,198,500	
ルネサンス	5,700	1,725.00	9,832,500	
ディップ	14,500	3,495.00	50,677,500	
ＳＢＳホールディングス	9,300	1,871.00	17,400,300	
オプトホールディング	5,600	1,641.00	9,189,600	
新日本科学	11,100	633.00	7,026,300	
ツクイ	24,200	596.00	14,423,200	
キャリアデザインセンター	2,600	1,404.00	3,650,400	
ベネフィット・ワン	28,000	2,297.00	64,316,000	
エムスリー	226,200	3,365.00	761,163,000	
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	584.00	3,912,800	
ブラス	800	857.00	685,600	
アウトソーシング	58,700	1,106.00	64,922,200	
ウェルネット	9,800	717.00	7,026,600	
ワールドホールディングス	3,400	1,768.00	6,011,200	
ディー・エヌ・エー	50,300	1,810.00	91,043,000	
博報堂ＤＹホールディングス	142,700	1,742.00	248,583,400	
ぐるなび	17,900	1,024.00	18,329,600	
タカミヤ	11,000	681.00	7,491,000	
ジャパンベストレスキューシステム	7,000	1,203.00	8,421,000	
ファンコミュニケーションズ	28,300	477.00	13,499,100	
ライク	4,100	1,622.00	6,650,200	
ビジネス・ブレークスルー	4,300	423.00	1,818,900	
エスプール	19,800	832.00	16,473,600	
ＷＤＢホールディングス	4,700	2,751.00	12,929,700	
ティア	6,100	598.00	3,647,800	
ＣＤＧ	1,100	1,427.00	1,569,700	
バリューコマース	5,700	2,544.00	14,500,800	
インフォマート	112,400	1,018.00	114,423,200	
サッポロホールディングス	36,800	2,652.00	97,593,600	
アサヒグループホールディングス	225,800	4,973.00	1,122,903,400	
キリンホールディングス	457,100	2,446.50	1,118,295,150	
宝ホールディングス	80,700	1,004.00	81,022,800	
オエノンホールディングス	28,500	400.00	11,400,000	
養命酒製造	3,300	1,988.00	6,560,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	75,700	2,881.00	218,091,700	
サントリー食品インターナショナル	72,100	4,620.00	333,102,000	
ダイドーグループホールディングス	5,500	4,545.00	24,997,500	
伊藤園	32,700	5,580.00	182,466,000	
キーコーヒー	10,700	2,285.00	24,449,500	

ユニカフェ	2,900	979.00	2,839,100	
ジャパンフーズ	1,500	1,293.00	1,939,500	
日清オイリオグループ	13,900	3,815.00	53,028,500	
不二製油グループ本社	26,300	2,986.00	78,531,800	
かどや製油	1,100	3,845.00	4,229,500	
Ｊ－オイルミルズ	5,600	4,300.00	24,080,000	
ローソン	26,800	6,330.00	169,644,000	
サンエー	8,800	4,620.00	40,656,000	
カワチ薬品	8,200	2,161.00	17,720,200	
エービーシー・マート	16,500	7,010.00	115,665,000	
ハードオフコーポレーション	4,200	828.00	3,477,600	
高千穂交易	4,100	1,217.00	4,989,700	
アスクル	11,100	3,410.00	37,851,000	
ゲオホールディングス	19,000	1,300.00	24,700,000	
アダストリア	14,600	2,328.00	33,988,800	
ジーフット	6,600	620.00	4,092,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	689.00	1,033,500	
伊藤忠食品	2,400	5,170.00	12,408,000	
くら寿司	5,500	5,370.00	29,535,000	
キャンドゥ	5,100	1,681.00	8,573,100	
エレマテック	9,900	1,154.00	11,424,600	
パルグループホールディングス	5,400	3,635.00	19,629,000	
ＪＡＬＵＸ	3,000	2,488.00	7,464,000	
エディオン	48,600	1,202.00	58,417,200	
あらた	8,400	4,525.00	38,010,000	
サーラコーポレーション	21,600	626.00	13,521,600	
ワッツ	4,800	638.00	3,062,400	
トーメンデバイス	1,600	3,670.00	5,872,000	
ハローズ	4,000	2,603.00	10,412,000	
ＪＰホールディングス	32,300	324.00	10,465,200	
フジオフードシステム	9,000	1,803.00	16,227,000	
あみやき亭	2,300	3,690.00	8,487,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,800	2,785.00	10,583,000	
ひらまつ	19,500	283.00	5,518,500	
フィールズ	8,100	642.00	5,200,200	
双日	584,200	347.00	202,717,400	
アルフレッサ　ホールディングス	117,600	2,218.00	260,836,800	
大黒天物産	2,600	3,330.00	8,658,000	
ハニーズホールディングス	9,300	1,543.00	14,349,900	
ファーマライズホールディングス	2,600	649.00	1,687,400	
キッコーマン	77,600	5,430.00	421,368,000	
味の素	238,100	1,820.50	433,461,050	
キユーピー	60,000	2,426.00	145,560,000	
ハウス食品グループ本社	40,300	3,750.00	151,125,000	
カゴメ	40,900	2,628.00	107,485,200	
焼津水産化学工業	5,300	1,034.00	5,480,200	
アリアケジャパン	9,800	7,860.00	77,028,000	
ピエトロ	1,400	1,635.00	2,289,000	
エバラ食品工業	2,500	2,221.00	5,552,500	
やまみ	500	2,378.00	1,189,000	

ニチレイ	51,300	2,646.00	135,739,800	
横浜冷凍	29,800	985.00	29,353,000	
東洋水産	55,500	4,575.00	253,912,500	
イートアンド	3,800	1,840.00	6,992,000	
大冷	1,400	1,964.00	2,749,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,900	1,221.00	7,203,900	
日清食品ホールディングス	45,800	8,160.00	373,728,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,170.00	11,501,000	
一正蒲鉾	3,900	1,005.00	3,919,500	
フジッコ	11,700	1,992.00	23,306,400	
ロック・フィールド	11,600	1,554.00	18,026,400	
日本たばこ産業	622,300	2,429.00	1,511,566,700	
ケンコーマヨネーズ	6,100	2,457.00	14,987,700	
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,912.00	13,575,200	
なとり	6,100	1,710.00	10,431,000	
イフジ産業	1,900	761.00	1,445,900	
ピックルスコーポレーション	2,400	2,614.00	6,273,600	
北の達人コーポレーション	37,600	738.00	27,748,800	
ユーグレナ	46,000	790.00	36,340,000	
スター・マイカ・ホールディングス	5,500	1,679.00	9,234,500	
片倉工業	15,300	1,302.00	19,920,600	
グンゼ	7,700	4,815.00	37,075,500	
ヒューリック	226,200	1,317.00	297,905,400	
神栄	1,500	733.00	1,099,500	
ラサ商事	5,600	1,024.00	5,734,400	
アルペン	8,100	1,746.00	14,142,600	
ハブ	3,000	1,089.00	3,267,000	
ラクーンホールディングス	5,100	922.00	4,702,200	
クオールホールディングス	15,600	1,480.00	23,088,000	
アルコニックス	11,200	1,409.00	15,780,800	
神戸物産	36,500	4,035.00	147,277,500	
ソリトンシステムズ	4,600	1,352.00	6,219,200	
ジンズホールディングス	5,600	7,770.00	43,512,000	
ビックカメラ	62,700	1,290.00	80,883,000	
ＤＣＭホールディングス	57,100	1,043.00	59,555,300	
ペッパーフードサービス	8,400	1,081.00	9,080,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	75,200	2,766.00	208,003,200	
東京一番フーズ	2,600	633.00	1,645,800	
ＤＤホールディングス	4,200	1,481.00	6,220,200	
あい　ホールディングス	15,100	1,966.00	29,686,600	
ディーブイエックス	3,700	935.00	3,459,500	
きちりホールディングス	2,800	787.00	2,203,600	
アークランドサービスホールディングス	7,700	2,046.00	15,754,200	
Ｊ．フロント　リテイリング	126,200	1,550.00	195,610,000	
ドトール・日レスホールディングス	16,900	2,132.00	36,030,800	
マツモトキヨシホールディングス	43,700	4,405.00	192,498,500	
ブロンコビリー	5,500	2,787.00	15,328,500	
ＺＯＺＯ	72,700	1,985.00	144,309,500	
トレジャー・ファクトリー	3,100	965.00	2,991,500	

物語コーポレーション	2,600	8,940.00	23,244,000	
ココカラファイン	11,000	6,610.00	72,710,000	
三越伊勢丹ホールディングス	184,800	1,003.00	185,354,400	
東洋紡	41,500	1,578.00	65,487,000	
ユニチカ	31,000	351.00	10,881,000	
富士紡ホールディングス	5,100	3,505.00	17,875,500	
日清紡ホールディングス	71,500	1,047.00	74,860,500	
倉敷紡績	10,800	2,431.00	26,254,800	
ダイワボウホールディングス	9,000	6,470.00	58,230,000	
シキボウ	5,600	1,076.00	6,025,600	
日東紡績	16,000	5,120.00	81,920,000	
トヨタ紡織	31,300	1,714.00	53,648,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,200	1,853.00	46,695,600	
Ｈａｍｅｅ	3,200	1,586.00	5,075,200	
ラクト・ジャパン	3,900	3,790.00	14,781,000	
ウエルシアホールディングス	31,500	6,830.00	215,145,000	
クリエイトＳＤホールディングス	15,600	2,822.00	44,023,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,000	1,034.00	20,680,000	
八洲電機	8,300	915.00	7,594,500	
メディアスホールディングス	6,000	880.00	5,280,000	
レスターホールディングス	11,000	2,071.00	22,781,000	
ジューテックホールディングス	2,300	1,170.00	2,691,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,200	367.00	4,477,400	
大光	4,600	666.00	3,063,600	
ＯＣＨＩホールディングス	3,000	1,474.00	4,422,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	55,900	1,073.00	59,980,700	
黒谷	1,900	521.00	989,900	
ミサワ	2,200	747.00	1,643,400	
ティーライフ	1,400	887.00	1,241,800	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,800	829.00	1,492,200	
エー・ピーカンパニー	2,100	675.00	1,417,500	
三洋貿易	5,300	2,530.00	13,409,000	
チムニー	3,200	2,345.00	7,504,000	
シュッピン	7,200	1,304.00	9,388,800	
ビューティガレージ	1,700	2,452.00	4,168,400	
ウイン・パートナーズ	7,600	1,285.00	9,766,000	
ネクステージ	15,100	1,211.00	18,286,100	
ジョイフル本田	31,000	1,341.00	41,571,000	
鳥貴族	3,500	2,380.00	8,330,000	
キリン堂ホールディングス	4,200	1,993.00	8,370,600	
ホットランド	7,100	1,284.00	9,116,400	
すかいらーくホールディングス	118,500	2,174.00	257,619,000	
ＳＦＰホールディングス	4,500	2,517.00	11,326,500	
綿半ホールディングス	4,000	1,803.00	7,212,000	
日本毛織	34,600	1,120.00	38,752,000	
ダイトウボウ	18,400	86.00	1,582,400	
トーア紡コーポレーション	4,000	530.00	2,120,000	
ダイドーリミテッド	14,200	279.00	3,961,800	
ヨシックス	1,700	2,802.00	4,763,400	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,800	971.00	29,906,800	
三栄建築設計	4,300	1,599.00	6,875,700	
野村不動産ホールディングス	64,200	2,738.00	175,779,600	
三重交通グループホールディングス	21,500	608.00	13,072,000	
サムティ	15,000	1,823.00	27,345,000	
ディア・ライフ	13,600	607.00	8,255,200	
コーセーアールイー	3,100	929.00	2,879,900	
エー・ディー・ワークス	197,900	29.00	5,739,100	
日本商業開発	6,700	1,703.00	11,410,100	
プレサンスコーポレーション	17,300	1,356.00	23,458,800	
ユニゾホールディングス	16,000	5,160.00	82,560,000	
ＴＨＥグローバル社	5,600	464.00	2,598,400	
ハウスコム	1,400	1,570.00	2,198,000	
日本管理センター	7,000	1,277.00	8,939,000	
サンセイランディック	3,100	919.00	2,848,900	
エストラスト	1,400	839.00	1,174,600	
フージャースホールディングス	21,100	706.00	14,896,600	
オープンハウス	30,700	3,030.00	93,021,000	
東急不動産ホールディングス	288,000	738.00	212,544,000	
飯田グループホールディングス	88,400	1,956.00	172,910,400	
イーグランド	1,700	879.00	1,494,300	
ムゲンエステート	7,300	764.00	5,577,200	
帝国繊維	11,800	2,272.00	26,809,600	
日本コークス工業	91,800	79.00	7,252,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	663.00	3,248,700	
ミタチ産業	3,200	766.00	2,451,200	
ＢＥＥＮＯＳ	3,990	1,296.00	5,171,040	
あさひ	7,900	1,369.00	10,815,100	
日本調剤	3,200	3,820.00	12,224,000	
コスモス薬品	4,700	24,610.00	115,667,000	
シップヘルスケアホールディングス	17,000	5,020.00	85,340,000	
トーエル	5,200	789.00	4,102,800	
ソフトクリエイトホールディングス	4,600	1,703.00	7,833,800	
オンリー	1,900	811.00	1,540,900	
セブン&アイ・ホールディングス	413,800	4,285.00	1,773,133,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	28,500	2,044.00	58,254,000	
明治電機工業	3,300	1,608.00	5,306,400	
ツルハホールディングス	23,000	13,900.00	319,700,000	
デリカフーズホールディングス	3,900	729.00	2,843,100	
スターティアホールディングス	2,400	815.00	1,956,000	
サンマルクホールディングス	8,400	2,324.00	19,521,600	
フェリシモ	2,300	1,045.00	2,403,500	
トリドールホールディングス	13,100	2,863.00	37,505,300	
帝人	85,800	2,036.00	174,688,800	
東レ	761,700	748.20	569,903,940	
クラレ	165,700	1,313.00	217,564,100	
旭化成	697,200	1,200.50	836,988,600	
サカイオーベックス	2,800	1,891.00	5,294,800	

ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9,600	594.00	5,702,400	
稲葉製作所	6,100	1,420.00	8,662,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	1,972.00	6,310,400	
トーカロ	29,500	1,117.00	32,951,500	
アルファ	3,800	1,362.00	5,175,600	
ＳＵＭＣＯ	127,100	1,904.00	241,998,400	
川田テクノロジーズ	2,200	6,580.00	14,476,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,000	3,515.00	10,545,000	
信和	4,600	1,147.00	5,276,200	
ビーロット	2,500	1,878.00	4,695,000	
ファーストブラザーズ	2,400	1,380.00	3,312,000	
ハウスドゥ	5,900	1,443.00	8,513,700	
シーアールイー	2,600	1,192.00	3,099,200	
プロパティエージェント	1,700	1,185.00	2,014,500	
ケイアイスター不動産	3,300	2,032.00	6,705,600	
アグレ都市デザイン	1,500	592.00	888,000	
グッドコムアセット	2,500	2,000.00	5,000,000	
ジェイ・エス・ビー	1,100	5,840.00	6,424,000	
テンポイノベーション	2,400	977.00	2,344,800	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	636.00	1,081,200	
住江織物	3,000	2,693.00	8,079,000	
日本フエルト	5,600	499.00	2,794,400	
イチカワ	1,500	1,519.00	2,278,500	
エコナックホールディングス	18,800	142.00	2,669,600	
日東製網	1,200	1,787.00	2,144,400	
芦森工業	2,200	1,414.00	3,110,800	
アツギ	8,800	851.00	7,488,800	
ウイルプラスホールディングス	1,700	891.00	1,514,700	
ジャパンミート	5,300	2,282.00	12,094,600	
コメダホールディングス	23,000	2,223.00	51,129,000	
サツドラホールディングス	1,500	1,846.00	2,769,000	
アレンザホールディングス	5,300	995.00	5,273,500	
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,331.00	3,729,600	
バロックジャパンリミテッド	7,400	1,026.00	7,592,400	
クスリのアオキホールディングス	10,500	6,910.00	72,555,000	
ダイニック	3,800	790.00	3,002,000	
共和レザー	5,800	819.00	4,750,200	
力の源ホールディングス	4,800	1,148.00	5,510,400	
スシローグローバルホールディングス	11,600	9,960.00	115,536,000	
ＬＩＸＩＬビバ	10,400	1,980.00	20,592,000	
アセンテック	800	2,339.00	1,871,200	
セーレン	25,900	1,508.00	39,057,200	
ソトー	3,700	973.00	3,600,100	
東海染工	1,400	1,131.00	1,583,400	
小松マテーレ	17,200	788.00	13,553,600	
ワコールホールディングス	27,400	2,994.00	82,035,600	
ホギメディカル	12,000	3,605.00	43,260,000	
レナウン	27,600	113.00	3,118,800	
クラウディアホールディングス	2,800	482.00	1,349,600	
ＴＳＩホールディングス	35,400	538.00	19,045,200	

マツオカコーポレーション	3,000	2,274.00	6,822,000	
ワールド	14,900	2,645.00	39,410,500	
ＴＩＳ	35,100	6,660.00	233,766,000	
ネオス	4,200	803.00	3,372,600	
電算システム	4,000	3,075.00	12,300,000	
グリー	72,600	483.00	35,065,800	
コーエーテクモホールディングス	21,500	2,959.00	63,618,500	
三菱総合研究所	4,500	4,365.00	19,642,500	
ボルテージ	1,900	605.00	1,149,500	
電算	1,200	2,232.00	2,678,400	
ＡＧＳ	5,800	824.00	4,779,200	
ファインデックス	8,900	1,296.00	11,534,400	
ブレインパッド	2,200	5,950.00	13,090,000	
ＫＬａｂ	20,300	839.00	17,031,700	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,700	969.00	12,306,300	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	2,034.00	3,051,000	
ネクソン	300,000	1,563.00	468,900,000	
アイスタイル	27,200	595.00	16,184,000	
エムアップ	3,000	3,015.00	9,045,000	
エイチーム	7,200	1,077.00	7,754,400	
エニグモ	7,500	942.00	7,065,000	
テクノスジャパン	8,300	502.00	4,166,600	
ｅｎｉｓｈ	4,700	811.00	3,811,700	
コロプラ	34,500	1,191.00	41,089,500	
オルトプラス	7,800	923.00	7,199,400	
ブロードリーフ	52,200	639.00	33,355,800	
クロス・マーケティンググループ	4,800	385.00	1,848,000	
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,078.00	6,036,800	
システム情報	5,300	1,101.00	5,835,300	
メディアドゥホールディングス	3,300	4,045.00	13,348,500	
じげん	26,100	541.00	14,120,100	
ブイキューブ	6,500	654.00	4,251,000	
エンカレッジ・テクノロジ	1,700	938.00	1,594,600	
サイバーリンクス	1,600	1,268.00	2,028,800	
ディー・エル・イー	7,700	200.00	1,540,000	
フィックスターズ	11,200	1,679.00	18,804,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,100	1,144.00	5,834,400	
オプティム	2,800	4,055.00	11,354,000	
セレス	3,500	1,236.00	4,326,000	
ＳＨＩＦＴ	2,800	9,430.00	26,404,000	
特種東海製紙	6,700	4,000.00	26,800,000	
ティーガイア	9,300	2,680.00	24,924,000	
セック	1,500	4,095.00	6,142,500	
日本アジアグループ	11,100	376.00	4,173,600	
豆蔵ホールディングス	7,200	1,507.00	10,850,400	
テクマトリックス	7,400	2,493.00	18,448,200	
プロシップ	3,000	1,605.00	4,815,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,400	2,239.00	56,870,600	

GMOペイメントゲートウェイ	17,300	8,030.00	138,919,000	
ザッパラス	5,500	405.00	2,227,500	
システムリサーチ	2,800	1,845.00	5,166,000	
インターネットイニシアティブ	15,600	2,961.00	46,191,600	
さくらインターネット	11,300	739.00	8,350,700	
ヴィンクス	3,000	1,262.00	3,786,000	
GMOクラウド	2,000	2,635.00	5,270,000	
ＳＲＡホールディングス	5,600	2,600.00	14,560,000	
システムインテグレータ	3,300	911.00	3,006,300	
朝日ネット	7,500	642.00	4,815,000	
ｅＢＡＳＥ	6,300	1,470.00	9,261,000	
アバント	7,500	1,091.00	8,182,500	
アドソル日進	3,700	2,285.00	8,454,500	
フリービット	6,300	1,014.00	6,388,200	
コムチュア	11,800	2,480.00	29,264,000	
サイバーコム	1,900	2,366.00	4,495,400	
アステリア	6,400	617.00	3,948,800	
アイル	3,800	2,138.00	8,124,400	
王子ホールディングス	439,500	588.00	258,426,000	
日本製紙	46,500	1,841.00	85,606,500	
三菱製紙	12,100	480.00	5,808,000	
北越コーポレーション	69,700	550.00	38,335,000	
中越パルプ工業	4,500	1,639.00	7,375,500	
巴川製紙所	3,200	924.00	2,956,800	
大王製紙	46,200	1,480.00	68,376,000	
阿波製紙	2,700	542.00	1,463,400	
マークラインズ	5,300	2,134.00	11,310,200	
メディカル・データ・ビジョン	8,000	862.00	6,896,000	
ｇｕｍｉ	13,500	854.00	11,529,000	
ショーケース	2,400	694.00	1,665,600	
モバイルファクトリー	2,400	1,385.00	3,324,000	
テラスカイ	3,800	2,573.00	9,777,400	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,789.00	8,408,300	
ＰＣＩホールディングス	2,100	2,303.00	4,836,300	
パイプドＨＤ	1,400	2,096.00	2,934,400	
アイビーシー	1,900	1,439.00	2,734,100	
ネオジャパン	2,000	1,107.00	2,214,000	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	900	2,668.00	2,401,200	
ランドコンピュータ	1,600	1,144.00	1,830,400	
ダブルスタンダード	1,300	4,900.00	6,370,000	
オープンドア	5,200	1,489.00	7,742,800	
マイネット	3,400	702.00	2,386,800	
アカツキ	3,700	5,900.00	21,830,000	
ベネフィットジャパン	800	1,874.00	1,499,200	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	1,371.00	3,153,300	
ＬＩＮＥ	24,100	5,390.00	129,899,000	
カナミックネットワーク	6,500	846.00	5,499,000	
ノムラシステムコーポレーション	2,300	543.00	1,248,900	
レンゴー	99,400	828.00	82,303,200	

トーモク	6,500	1,841.00	11,966,500	
ザ・パック	8,000	3,930.00	31,440,000	
チェンジ	2,100	3,045.00	6,394,500	
シンクロ・フード	4,500	589.00	2,650,500	
オークネット	6,500	1,310.00	8,515,000	
セグエグループ	1,700	960.00	1,632,000	
エイトレッド	1,300	1,738.00	2,259,400	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,600	743.00	7,875,800	
マクロミル	18,800	1,050.00	19,740,000	
ビーグリー	2,100	1,233.00	2,589,300	
オロ	2,800	3,840.00	10,752,000	
テモナ	1,300	554.00	720,200	
ニーズウェル	1,200	792.00	950,400	
サインポスト	1,600	2,007.00	3,211,200	
昭和電工	74,900	2,763.00	206,948,700	
住友化学	772,900	485.00	374,856,500	
住友精化	4,700	3,380.00	15,886,000	
日産化学	58,800	4,730.00	278,124,000	
ラサ工業	3,700	1,516.00	5,609,200	
クレハ	9,000	6,700.00	60,300,000	
多木化学	3,100	4,645.00	14,399,500	
テイカ	7,800	2,012.00	15,693,600	
石原産業	18,900	1,009.00	19,070,100	
片倉コープアグリ	2,900	1,209.00	3,506,100	
日本曹達	15,600	3,000.00	46,800,000	
東ソー	162,600	1,678.00	272,842,800	
トクヤマ	30,300	2,825.00	85,597,500	
セントラル硝子	21,500	2,534.00	54,481,000	
東亞合成	66,100	1,239.00	81,897,900	
大阪ソーダ	10,800	3,010.00	32,508,000	
関東電化工業	25,000	979.00	24,475,000	
デンカ	38,400	3,155.00	121,152,000	
イビデン	65,800	2,746.00	180,686,800	
信越化学工業	180,600	12,365.00	2,233,119,000	
日本カーバイド工業	3,600	1,482.00	5,335,200	
堺化学工業	6,800	2,411.00	16,394,800	
第一稀元素化学工業	11,500	906.00	10,419,000	
エア・ウォーター	88,400	1,600.00	141,440,000	
大陽日酸	101,100	2,471.00	249,818,100	
日本化学工業	3,300	3,105.00	10,246,500	
東邦アセチレン	1,500	1,325.00	1,987,500	
日本パーカライジング	53,200	1,134.00	60,328,800	
高圧ガス工業	16,900	827.00	13,976,300	
チタン工業	1,300	2,579.00	3,352,700	
四国化成工業	16,300	1,344.00	21,907,200	
戸田工業	2,500	2,169.00	5,422,500	
ステラ　ケミファ	5,700	3,165.00	18,040,500	
保土谷化学工業	3,900	4,170.00	16,263,000	
日本触媒	16,400	6,600.00	108,240,000	
大日精化工業	9,400	3,045.00	28,623,000	

カネカ	27,300	3,495.00	95,413,500	
協和キリン	108,000	2,663.00	287,604,000	
三菱瓦斯化学	99,300	1,663.00	165,135,900	
三井化学	95,600	2,630.00	251,428,000	
ＪＳＲ	98,100	2,061.00	202,184,100	
東京応化工業	18,100	4,400.00	79,640,000	
大阪有機化学工業	9,700	1,738.00	16,858,600	
三菱ケミカルホールディングス	703,400	817.50	575,029,500	
ＫＨネオケム	18,500	2,288.00	42,328,000	
ダイセル	144,000	1,032.00	148,608,000	
住友ベークライト	16,600	4,140.00	68,724,000	
積水化学工業	226,200	1,887.00	426,839,400	
日本ゼオン	94,900	1,334.00	126,596,600	
アイカ工業	31,600	3,585.00	113,286,000	
宇部興産	53,100	2,329.00	123,669,900	
積水樹脂	18,900	2,240.00	42,336,000	
タキロンシーアイ	22,700	718.00	16,298,600	
旭有機材	6,000	1,717.00	10,302,000	
日立化成	48,600	4,595.00	223,317,000	
ニチバン	5,500	1,847.00	10,158,500	
リケンテクノス	26,800	520.00	13,936,000	
大倉工業	5,000	1,868.00	9,340,000	
積水化成品工業	14,200	794.00	11,274,800	
群栄化学工業	2,400	2,665.00	6,396,000	
タイガースポリマー	5,600	596.00	3,337,600	
ミライアル	3,700	1,377.00	5,094,900	
ダイキアクシス	3,700	905.00	3,348,500	
ダイキョーニシカワ	22,200	822.00	18,248,400	
竹本容器	3,800	965.00	3,667,000	
森六ホールディングス	5,700	2,310.00	13,167,000	
日本化薬	65,100	1,351.00	87,950,100	
カーリットホールディングス	11,400	618.00	7,045,200	
ＥＰＳホールディングス	15,400	1,376.00	21,190,400	
ソルクシーズ	4,500	1,023.00	4,603,500	
レッグス	2,500	1,626.00	4,065,000	
プレステージ・インターナショナル	38,400	998.00	38,323,200	
フェイス	3,700	795.00	2,941,500	
プロトコーポレーション	9,500	1,276.00	12,122,000	
ハイマックス	1,200	2,072.00	2,486,400	
アミューズ	5,600	3,030.00	16,968,000	
野村総合研究所	176,100	2,374.00	418,061,400	
ドリームインキュベータ	3,100	1,574.00	4,879,400	
サイバネットシステム	7,500	936.00	7,020,000	
クイック	6,400	1,594.00	10,201,600	
ＴＡＣ	6,600	227.00	1,498,200	
ＣＥホールディングス	6,200	509.00	3,155,800	
ケネディクス	97,700	559.00	54,614,300	
日本システム技術	1,700	1,546.00	2,628,200	
電通グループ	105,800	3,800.00	402,040,000	
インテージホールディングス	13,100	930.00	12,183,000	

テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	1,152.00	4,492,800	
東邦システムサイエンス	2,800	931.00	2,606,800	
ぴあ	2,800	4,605.00	12,894,000	
イオンファンタジー	4,000	2,641.00	10,564,000	
ソースネクスト	50,000	590.00	29,500,000	
シーティーエス	11,600	747.00	8,665,200	
ネクシィーズグループ	3,600	1,805.00	6,498,000	
インフォコム	11,500	2,843.00	32,694,500	
メディカルシステムネットワーク	10,300	546.00	5,623,800	
日本精化	8,600	1,255.00	10,793,000	
扶桑化学工業	10,700	3,185.00	34,079,500	
トリケミカル研究所	2,300	9,850.00	22,655,000	
ラクスル	5,600	3,725.00	20,860,000	
ＦＩＧ	11,400	310.00	3,534,000	
システムサポート	900	2,139.00	1,925,100	
ＡＤＥＫＡ	48,500	1,593.00	77,260,500	
日油	39,600	3,515.00	139,194,000	
ミヨシ油脂	4,300	1,226.00	5,271,800	
新日本理化	17,900	208.00	3,723,200	
ハリマ化成グループ	8,800	1,170.00	10,296,000	
イーソル	3,800	2,364.00	8,983,200	
アルテリア・ネットワークス	11,700	1,889.00	22,101,300	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,400	1,511.00	3,626,400	
花王	257,100	9,131.00	2,347,580,100	
第一工業製薬	3,900	4,400.00	17,160,000	
石原ケミカル	2,900	2,022.00	5,863,800	
日華化学	3,700	870.00	3,219,000	
ニイタカ	1,700	1,786.00	3,036,200	
三洋化成工業	6,300	5,260.00	33,138,000	
武田薬品工業	893,500	4,408.00	3,938,548,000	
アステラス製薬	944,600	1,895.50	1,790,489,300	
大日本住友製薬	79,600	2,166.00	172,413,600	
塩野義製薬	137,300	6,928.00	951,214,400	
田辺三菱製薬	131,000	2,004.00	262,524,000	
わかもと製薬	12,700	265.00	3,365,500	
あすか製薬	12,200	1,281.00	15,628,200	
日本新薬	28,100	10,120.00	284,372,000	
ビオフェルミン製薬	1,700	2,385.00	4,054,500	
中外製薬	112,000	10,450.00	1,170,400,000	
科研製薬	18,400	5,980.00	110,032,000	
エーザイ	128,500	8,106.00	1,041,621,000	
理研ビタミン	5,100	3,980.00	20,298,000	
ロート製薬	55,100	3,445.00	189,819,500	
小野薬品工業	246,600	2,599.50	641,036,700	
久光製薬	28,400	5,940.00	168,696,000	
有機合成薬品工業	8,300	289.00	2,398,700	
持田製薬	14,900	4,375.00	65,187,500	
参天製薬	200,000	2,161.00	432,200,000	
扶桑薬品工業	3,800	2,025.00	7,695,000	

日本ケミファ	1,400	2,903.00	4,064,200	
ツムラ	33,300	3,175.00	105,727,500	
日医工	30,400	1,325.00	40,280,000	
テルモ	303,900	3,932.00	1,194,934,800	
みらかホールディングス	28,700	2,671.00	76,657,700	
キッセイ薬品工業	19,000	3,075.00	58,425,000	
生化学工業	20,800	1,233.00	25,646,400	
栄研化学	18,900	2,143.00	40,502,700	
日水製薬	4,600	1,277.00	5,874,200	
鳥居薬品	6,700	3,195.00	21,406,500	
ＪＣＲファーマ	7,600	9,330.00	70,908,000	
東和薬品	13,700	2,810.00	38,497,000	
富士製薬工業	7,300	1,281.00	9,351,300	
沢井製薬	22,000	7,090.00	155,980,000	
ゼリア新薬工業	19,500	2,078.00	40,521,000	
第一三共	307,300	7,200.00	2,212,560,000	
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,934.00	45,835,800	
大幸薬品	4,300	3,535.00	15,200,500	
ダイト	6,300	3,170.00	19,971,000	
大塚ホールディングス	204,600	4,948.00	1,012,360,800	
大正製薬ホールディングス	22,700	8,130.00	184,551,000	
ペプチドリーム	54,300	5,740.00	311,682,000	
大日本塗料	12,000	1,169.00	14,028,000	
日本ペイントホールディングス	86,800	5,760.00	499,968,000	
関西ペイント	118,200	2,742.00	324,104,400	
神東塗料	8,600	221.00	1,900,600	
中国塗料	30,000	1,029.00	30,870,000	
日本特殊塗料	7,900	1,399.00	11,052,100	
藤倉化成	14,500	576.00	8,352,000	
太陽ホールディングス	7,800	4,585.00	35,763,000	
ＤＩＣ	44,500	3,020.00	134,390,000	
サカタインクス	23,000	1,163.00	26,749,000	
東洋インキＳＣホールディングス	22,300	2,546.00	56,775,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,400	1,028.00	8,635,200	
アルプス技研	9,000	2,021.00	18,189,000	
サニックス	18,100	353.00	6,389,300	
ダイオーズ	2,100	1,383.00	2,904,300	
日本空調サービス	10,700	820.00	8,774,000	
オリエンタルランド	109,100	16,010.00	1,746,691,000	
フォーカスシステムズ	6,500	1,002.00	6,513,000	
ダスキン	26,300	3,065.00	80,609,500	
パーク２４	56,900	2,599.00	147,883,100	
明光ネットワークジャパン	12,100	1,020.00	12,342,000	
ファルコホールディングス	5,700	1,800.00	10,260,000	
クレスコ	3,200	3,905.00	12,496,000	
フジ・メディア・ホールディングス	101,500	1,551.00	157,426,500	
秀英予備校	2,300	468.00	1,076,400	
田谷	2,000	619.00	1,238,000	
ラウンドワン	28,700	1,056.00	30,307,200	
リゾートトラスト	47,100	1,808.00	85,156,800	

オービック	36,500	15,780.00	575,970,000	
ジャストシステム	17,100	6,320.00	108,072,000	
ＴＤＣソフト	9,200	1,148.00	10,561,600	
Ｚホールディングス	1,447,000	470.00	680,090,000	
ビー・エム・エル	13,200	3,015.00	39,798,000	
ワタベウェディング	1,600	564.00	902,400	
トレンドマイクロ	46,800	5,710.00	267,228,000	
りらいあコミュニケーションズ	18,600	1,432.00	26,635,200	
ＩＤホールディングス	4,000	1,643.00	6,572,000	
リソー教育	47,000	377.00	17,719,000	
日本オラクル	21,400	10,110.00	216,354,000	
早稲田アカデミー	3,400	1,179.00	4,008,600	
アルファシステムズ	3,300	2,851.00	9,408,300	
フューチャー	12,700	1,943.00	24,676,100	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,800	1,524.00	10,363,200	
ＳＢテクノロジー	3,800	2,262.00	8,595,600	
トーセ	2,900	912.00	2,644,800	
ユー・エス・エス	114,900	2,035.00	233,821,500	
オービックビジネスコンサルタント	10,800	5,100.00	55,080,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,000	3,270.00	156,960,000	
アイティフォー	12,800	900.00	11,520,000	
東京個別指導学院	3,600	682.00	2,455,200	
東計電算	1,500	3,680.00	5,520,000	
サイバーエージェント	59,000	3,935.00	232,165,000	
楽天	478,300	918.00	439,079,400	
エックスネット	1,600	993.00	1,588,800	
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,138.00	6,031,400	
テー・オー・ダブリュー	9,000	969.00	8,721,000	
大塚商会	57,000	4,485.00	255,645,000	
サイボウズ	12,300	1,713.00	21,069,900	
ソフトブレーン	6,200	651.00	4,036,200	
山田コンサルティンググループ	5,000	1,613.00	8,065,000	
セントラルスポーツ	3,800	3,170.00	12,046,000	
パラカ	2,700	2,041.00	5,510,700	
電通国際情報サービス	6,500	4,585.00	29,802,500	
デジタルガレージ	18,900	4,560.00	86,184,000	
イーエムシステムズ	14,800	991.00	14,666,800	
ウェザーニューズ	3,600	3,745.00	13,482,000	
ＣＩＪ	7,800	950.00	7,410,000	
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,165.00	3,798,000	
日本エンタープライズ	11,000	248.00	2,728,000	
WOWOW	5,100	2,700.00	13,770,000	
スカラ	7,500	793.00	5,947,500	
インテリジェント　ウェイブ	4,000	813.00	3,252,000	
フルキャストホールディングス	10,300	2,564.00	26,409,200	
エン・ジャパン	18,200	4,945.00	89,999,000	
富士フイルムホールディングス	205,900	5,792.00	1,192,572,800	
コニカミノルタ	234,700	716.00	168,045,200	
資生堂	213,400	7,963.00	1,699,304,200	
ライオン	139,600	2,107.00	294,137,200	

高砂香料工業	6,800	2,496.00	16,972,800	
マンダム	24,100	3,020.00	72,782,000	
ミルボン	14,400	6,270.00	90,288,000	
ファンケル	43,500	3,110.00	135,285,000	
コーセー	20,200	17,420.00	351,884,000	
コタ	5,600	1,608.00	9,004,800	
シーボン	1,200	2,510.00	3,012,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	45,800	2,644.00	121,095,200	
ノエビアホールディングス	10,300	5,900.00	60,770,000	
アジュバンコスメジャパン	2,300	1,007.00	2,316,100	
エステー	6,900	1,715.00	11,833,500	
アグロ　カネショウ	3,400	1,477.00	5,021,800	
コニシ	17,700	1,529.00	27,063,300	
長谷川香料	14,300	2,146.00	30,687,800	
星光ＰＭＣ	6,200	959.00	5,945,800	
小林製薬	30,100	9,270.00	279,027,000	
荒川化学工業	9,700	1,585.00	15,374,500	
メック	7,400	1,490.00	11,026,000	
日本高純度化学	3,100	2,641.00	8,187,100	
タカラバイオ	28,100	2,145.00	60,274,500	
ＪＣＵ	13,000	3,235.00	42,055,000	
新田ゼラチン	6,900	685.00	4,726,500	
ＯＡＴアグリオ	1,900	1,604.00	3,047,600	
デクセリアルズ	27,800	1,087.00	30,218,600	
アース製薬	8,100	5,670.00	45,927,000	
北興化学工業	11,200	558.00	6,249,600	
大成ラミック	3,200	2,946.00	9,427,200	
クミアイ化学工業	44,500	989.00	44,010,500	
日本農薬	19,400	579.00	11,232,600	
富士興産	3,200	663.00	2,121,600	
ニチレキ	12,700	1,343.00	17,056,100	
ユシロ化学工業	6,000	1,429.00	8,574,000	
ビーピー・カストロール	3,800	1,460.00	5,548,000	
富士石油	28,900	238.00	6,878,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,000	1,415.00	5,660,000	
出光興産	120,800	2,958.00	357,326,400	
ＪＸＴＧホールディングス	1,615,300	492.90	796,181,370	
コスモエネルギーホールディングス	31,100	2,470.00	76,817,000	
横浜ゴム	62,200	2,049.00	127,447,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	61,700	1,458.00	89,958,600	
ブリヂストン	330,100	3,990.00	1,317,099,000	
住友ゴム工業	96,500	1,284.00	123,906,000	
藤倉コンポジット	9,600	474.00	4,550,400	
オカモト	6,500	4,000.00	26,000,000	
アキレス	7,400	1,803.00	13,342,200	
フコク	4,700	739.00	3,473,300	
ニッタ	12,100	3,100.00	37,510,000	
クリエートメディック	3,600	1,052.00	3,787,200	
住友理工	20,900	911.00	19,039,900	
三ツ星ベルト	14,100	2,010.00	28,341,000	

バンドー化学	18,900	887.00	16,764,300	
ＡＧＣ	106,200	3,870.00	410,994,000	
日本板硝子	51,300	675.00	34,627,500	
石塚硝子	1,900	2,527.00	4,801,300	
有沢製作所	17,000	1,024.00	17,408,000	
日本山村硝子	4,500	1,297.00	5,836,500	
日本電気硝子	43,100	2,352.00	101,371,200	
オハラ	4,300	1,425.00	6,127,500	
住友大阪セメント	20,300	4,630.00	93,989,000	
太平洋セメント	67,800	3,035.00	205,773,000	
リソルホールディングス	1,000	4,145.00	4,145,000	
日本ヒューム	10,800	818.00	8,834,400	
日本コンクリート工業	23,300	282.00	6,570,600	
三谷セキサン	4,900	3,825.00	18,742,500	
アジアパイルホールディングス	15,300	582.00	8,904,600	
東海カーボン	112,500	1,036.00	116,550,000	
日本カーボン	5,500	4,015.00	22,082,500	
東洋炭素	6,300	2,310.00	14,553,000	
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	4,495.00	26,520,500	
ＴＯＴＯ	76,700	4,780.00	366,626,000	
日本碍子	131,000	1,985.00	260,035,000	
日本特殊陶業	83,600	2,136.00	178,569,600	
ダントーホールディングス	7,800	116.00	904,800	
ＭＡＲＵＷＡ	4,100	8,770.00	35,957,000	
品川リフラクトリーズ	2,800	3,240.00	9,072,000	
黒崎播磨	2,100	6,410.00	13,461,000	
ヨータイ	8,500	720.00	6,120,000	
イソライト工業	5,500	645.00	3,547,500	
東京窯業	13,800	340.00	4,692,000	
ニッカトー	4,900	752.00	3,684,800	
フジミインコーポレーテッド	9,600	3,075.00	29,520,000	
クニミネ工業	4,400	1,316.00	5,790,400	
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,510.00	2,718,000	
ニチアス	29,400	2,758.00	81,085,200	
日本製鉄	475,300	1,680.50	798,741,650	
神戸製鋼所	194,300	579.00	112,499,700	
中山製鋼所	14,800	530.00	7,844,000	
合同製鐵	5,700	2,738.00	15,606,600	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	286,800	1,485.00	425,898,000	
東京製鐵	51,800	770.00	39,886,000	
共英製鋼	12,000	2,096.00	25,152,000	
大和工業	22,600	2,676.00	60,477,600	
東京鐵鋼	4,400	1,482.00	6,520,800	
大阪製鐵	5,700	1,526.00	8,698,200	
淀川製鋼所	14,400	1,956.00	28,166,400	
丸一鋼管	34,500	3,095.00	106,777,500	
モリ工業	3,100	2,592.00	8,035,200	
大同特殊鋼	17,400	4,705.00	81,867,000	
日本高周波鋼業	4,300	424.00	1,823,200	

日本冶金工業	8,800	2,302.00	20,257,600	
山陽特殊製鋼	7,700	1,540.00	11,858,000	
愛知製鋼	6,000	3,760.00	22,560,000	
日立金属	114,400	1,662.00	190,132,800	
日本金属	2,500	919.00	2,297,500	
大平洋金属	7,200	2,582.00	18,590,400	
新日本電工	68,700	167.00	11,472,900	
栗本鐵工所	5,200	2,107.00	10,956,400	
虹　技	1,600	1,454.00	2,326,400	
日本鋳鉄管	1,100	1,605.00	1,765,500	
日本製鋼所	32,200	2,170.00	69,874,000	
三菱製鋼	8,000	1,051.00	8,408,000	
日亜鋼業	15,900	341.00	5,421,900	
日本精線	1,700	3,280.00	5,576,000	
エンビプロ・ホールディングス	4,000	818.00	3,272,000	
大紀アルミニウム工業所	17,500	765.00	13,387,500	
日本軽金属ホールディングス	268,700	224.00	60,188,800	
三井金属鉱業	28,700	2,910.00	83,517,000	
東邦亜鉛	5,400	2,077.00	11,215,800	
三菱マテリアル	70,200	2,931.00	205,756,200	
住友金属鉱山	135,800	3,563.00	483,855,400	
ＤＯＷＡホールディングス	26,900	4,195.00	112,845,500	
古河機械金属	18,900	1,415.00	26,743,500	
エス・サイエンス	48,900	47.00	2,298,300	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	1,512.00	16,783,200	
東邦チタニウム	19,000	937.00	17,803,000	
ＵＡＣＪ	16,100	2,418.00	38,929,800	
ＣＫサンエツ	1,900	3,445.00	6,545,500	
古河電気工業	33,000	2,752.00	90,816,000	
住友電気工業	396,900	1,637.00	649,725,300	
フジクラ	128,200	446.00	57,177,200	
昭和電線ホールディングス	12,300	1,463.00	17,994,900	
東京特殊電線	1,600	2,371.00	3,793,600	
タツタ電線	21,100	629.00	13,271,900	
カナレ電気	1,700	1,822.00	3,097,400	
平河ヒューテック	4,000	1,700.00	6,800,000	
リョービ	13,100	1,937.00	25,374,700	
アーレスティ	13,900	558.00	7,756,200	
アサヒホールディングス	18,600	2,736.00	50,889,600	
東洋製罐グループホールディングス	67,700	1,941.00	131,405,700	
ホッカンホールディングス	5,900	2,046.00	12,071,400	
コロナ	6,000	1,051.00	6,306,000	
横河ブリッジホールディングス	19,800	1,880.00	37,224,000	
ＯＳＪＢホールディングス	53,000	266.00	14,098,000	
駒井ハルテック	1,900	1,908.00	3,625,200	
高田機工	900	2,666.00	2,399,400	
三和ホールディングス	101,900	1,230.00	125,337,000	
文化シヤッター	31,300	910.00	28,483,000	
三協立山	14,700	1,473.00	21,653,100	
アルインコ	7,700	1,269.00	9,771,300	

東洋シヤッター	2,500	703.00	1,757,500	
ＬＩＸＩＬグループ	156,700	1,919.00	300,707,300	
日本フイルコン	8,300	560.00	4,648,000	
ノーリツ	22,000	1,436.00	31,592,000	
長府製作所	10,800	2,337.00	25,239,600	
リンナイ	20,700	8,460.00	175,122,000	
ユニプレス	20,800	1,506.00	31,324,800	
ダイニチ工業	5,600	695.00	3,892,000	
日東精工	14,700	637.00	9,363,900	
三洋工業	1,400	2,010.00	2,814,000	
岡部	21,500	902.00	19,393,000	
ジーテクト	13,200	1,714.00	22,624,800	
東プレ	19,800	1,737.00	34,392,600	
高周波熱錬	20,500	884.00	18,122,000	
東京製綱	7,600	1,227.00	9,325,200	
サンコール	6,000	573.00	3,438,000	
モリテックスチール	8,400	397.00	3,334,800	
パイオラックス	15,700	2,089.00	32,797,300	
エイチワン	10,400	808.00	8,403,200	
日本発条	113,900	983.00	111,963,700	
中央発條	1,200	3,005.00	3,606,000	
アドバネクス	1,300	1,710.00	2,223,000	
三浦工業	46,000	3,840.00	176,640,000	
タクマ	36,000	1,244.00	44,784,000	
テクノプロ・ホールディングス	20,600	7,550.00	155,530,000	
アトラ	2,300	335.00	770,500	
インターワークス	1,900	534.00	1,014,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	5,320.00	22,344,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,800	1,365.00	5,187,000	
ファーストロジック	2,300	602.00	1,384,600	
三機サービス	2,200	1,088.00	2,393,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	7,200	1,478.00	10,641,600	
デザインワン・ジャパン	2,000	302.00	604,000	
イー・ガーディアン	5,200	2,019.00	10,498,800	
リブセンス	6,600	292.00	1,927,200	
ジャパンマテリアル	31,600	1,923.00	60,766,800	
ベクトル	12,800	1,256.00	16,076,800	
ウチヤマホールディングス	5,300	544.00	2,883,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,600	988.00	7,508,800	
ライクキッズ	2,500	815.00	2,037,500	
キャリアリンク	3,300	616.00	2,032,800	
ＩＢＪ	7,000	1,369.00	9,583,000	
アサンテ	4,100	2,020.00	8,282,000	
Ｎ・フィールド	7,100	644.00	4,572,400	
バリューＨＲ	2,000	3,165.00	6,330,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	7,300	4,720.00	34,456,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	2,109.00	8,225,100	
ＥＲＩホールディングス	2,900	770.00	2,233,000	

アビスト	1,600	2,720.00	4,352,000	
シグマクシス	7,000	2,133.00	14,931,000	
ウィルグループ	6,700	1,276.00	8,549,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	232.00	3,294,400	
リクルートホールディングス	735,100	4,214.00	3,097,711,400	
エラン	6,100	1,651.00	10,071,100	
ツガミ	22,000	1,210.00	26,620,000	
オークマ	12,400	5,540.00	68,696,000	
東芝機械	12,000	2,964.00	35,568,000	
アマダホールディングス	135,000	1,261.00	170,235,000	
アイダエンジニアリング	27,800	950.00	26,410,000	
滝澤鉄工所	3,300	1,389.00	4,583,700	
ＦＵＪＩ	45,600	2,042.00	93,115,200	
牧野フライス製作所	12,400	4,795.00	59,458,000	
オーエスジー	49,100	2,015.00	98,936,500	
ダイジェット工業	1,200	1,462.00	1,754,400	
旭ダイヤモンド工業	27,900	636.00	17,744,400	
ＤＭＧ森精機	67,200	1,677.00	112,694,400	
ソディック	24,900	970.00	24,153,000	
ディスコ	14,400	26,990.00	388,656,000	
日東工器	5,800	2,312.00	13,409,600	
日進工具	3,100	2,831.00	8,776,100	
パンチ工業	9,600	519.00	4,982,400	
冨士ダイス	4,500	773.00	3,478,500	
土木管理総合試験所	4,400	452.00	1,988,800	
ネットマーケティング	3,700	957.00	3,540,900	
日本郵政	841,200	1,030.50	866,856,600	
ベルシステム２４ホールディングス	17,200	1,650.00	28,380,000	
鎌倉新書	7,600	1,730.00	13,148,000	
ＳＭＮ	1,600	908.00	1,452,800	
一蔵	1,100	806.00	886,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	3,500	2,596.00	9,086,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,600	773.00	1,236,800	
エアトリ	4,600	1,957.00	9,002,200	
アトラエ	2,700	3,860.00	10,422,000	
ストライク	3,900	5,420.00	21,138,000	
ソラスト	28,300	1,237.00	35,007,100	
セラク	3,200	881.00	2,819,200	
インソース	5,000	3,485.00	17,425,000	
豊田自動織機	86,900	6,330.00	550,077,000	
豊和工業	5,800	858.00	4,976,400	
ＯＫＫ	4,400	659.00	2,899,600	
石川製作所	2,600	1,776.00	4,617,600	
東洋機械金属	7,600	548.00	4,164,800	
津田駒工業	2,100	1,260.00	2,646,000	
エンシュウ	2,600	1,344.00	3,494,400	
島精機製作所	17,100	2,390.00	40,869,000	
オプトラン	11,800	3,205.00	37,819,000	
ＮＣホールディングス	3,300	695.00	2,293,500	
イワキ	5,100	1,277.00	6,512,700	

フリュー	10,400	1,183.00	12,303,200	
ヤマシンフィルタ	23,100	861.00	19,889,100	
日阪製作所	13,100	959.00	12,562,900	
やまびこ	20,600	1,131.00	23,298,600	
平田機工	5,000	7,260.00	36,300,000	
ペガサスミシン製造	10,700	501.00	5,360,700	
マルマエ	4,400	970.00	4,268,000	
タツモ	5,000	1,408.00	7,040,000	
ナブテスコ	62,600	3,465.00	216,909,000	
三井海洋開発	11,300	2,658.00	30,035,400	
レオン自動機	10,400	1,583.00	16,463,200	
ＳＭＣ	33,700	53,950.00	1,818,115,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	622.00	5,784,600	
ホソカワミクロン	3,700	4,765.00	17,630,500	
ユニオンツール	4,000	3,320.00	13,280,000	
オイレス工業	13,800	1,648.00	22,742,400	
日精エー・エス・ビー機械	3,600	4,410.00	15,876,000	
サトーホールディングス	15,100	3,340.00	50,434,000	
技研製作所	9,300	4,680.00	43,524,000	
日本エアーテック	3,400	805.00	2,737,000	
カワタ	3,100	1,107.00	3,431,700	
日精樹脂工業	8,900	1,008.00	8,971,200	
オカダアイヨン	3,400	1,281.00	4,355,400	
ワイエイシイホールディングス	4,600	738.00	3,394,800	
小松製作所	486,400	2,642.00	1,285,068,800	
住友重機械工業	61,500	3,140.00	193,110,000	
日立建機	43,000	3,360.00	144,480,000	
日工	14,700	807.00	11,862,900	
巴工業	4,600	2,217.00	10,198,200	
井関農機	10,800	1,614.00	17,431,200	
ＴＯＷＡ	10,800	1,175.00	12,690,000	
丸山製作所	2,200	1,186.00	2,609,200	
北川鉄工所	4,800	2,338.00	11,222,400	
シンニッタン	16,600	463.00	7,685,800	
ローツェ	4,700	4,660.00	21,902,000	
タカキタ	3,600	620.00	2,232,000	
クボタ	569,700	1,722.00	981,023,400	
荏原実業	2,700	2,304.00	6,220,800	
東洋エンジニアリング	14,100	663.00	9,348,300	
三菱化工機	3,700	1,913.00	7,078,100	
月島機械	19,800	1,627.00	32,214,600	
帝国電機製作所	8,800	1,467.00	12,909,600	
東京機械製作所	4,600	365.00	1,679,000	
新東工業	25,400	999.00	25,374,600	
澁谷工業	9,400	3,050.00	28,670,000	
アイチコーポレーション	18,600	757.00	14,080,200	
小森コーポレーション	27,200	1,105.00	30,056,000	
鶴見製作所	8,400	1,933.00	16,237,200	
住友精密工業	1,600	3,315.00	5,304,000	

日本ギア工業	3,600	407.00	1,465,200	
酒井重工業	2,000	2,806.00	5,612,000	
荏原製作所	44,400	3,385.00	150,294,000	
石井鐵工所	1,400	2,688.00	3,763,200	
西島製作所	10,900	913.00	9,951,700	
北越工業	11,100	1,327.00	14,729,700	
ダイキン工業	136,800	15,580.00	2,131,344,000	
オルガノ	3,900	7,670.00	29,913,000	
トーヨーカネツ	4,700	2,279.00	10,711,300	
栗田工業	58,100	3,310.00	192,311,000	
椿本チエイン	15,300	3,820.00	58,446,000	
大同工業	5,200	806.00	4,191,200	
日機装	32,200	1,430.00	46,046,000	
木村化工機	8,900	692.00	6,158,800	
レイズネクスト	18,100	1,346.00	24,362,600	
アネスト岩田	16,700	1,042.00	17,401,400	
ダイフク	54,900	7,210.00	395,829,000	
サムコ	3,000	1,924.00	5,772,000	
加藤製作所	5,900	1,617.00	9,540,300	
油研工業	1,700	1,763.00	2,997,100	
タダノ	51,800	989.00	51,230,200	
フジテック	39,000	1,736.00	67,704,000	
ＣＫＤ	29,900	2,022.00	60,457,800	
キトー	8,100	1,672.00	13,543,200	
平和	30,000	2,273.00	68,190,000	
理想科学工業	9,500	1,894.00	17,993,000	
ＳＡＮＫＹＯ	23,900	3,770.00	90,103,000	
日本金銭機械	11,800	894.00	10,549,200	
マースグループホールディングス	6,800	2,028.00	13,790,400	
フクシマガリレイ	6,600	4,085.00	26,961,000	
オーイズミ	4,500	603.00	2,713,500	
ダイコク電機	4,900	1,655.00	8,109,500	
竹内製作所	17,900	1,895.00	33,920,500	
アマノ	28,100	3,285.00	92,308,500	
ＪＵＫＩ	14,900	855.00	12,739,500	
サンデンホールディングス	14,100	774.00	10,913,400	
蛇の目ミシン工業	9,900	417.00	4,128,300	
ブラザー工業	131,100	2,318.00	303,889,800	
マックス	16,400	2,133.00	34,981,200	
モリタホールディングス	18,800	1,720.00	32,336,000	
グローリー	27,600	3,380.00	93,288,000	
新晃工業	10,000	1,860.00	18,600,000	
大和冷機工業	15,600	1,183.00	18,454,800	
セガサミーホールディングス	106,500	1,597.00	170,080,500	
日本ピストンリング	3,900	1,567.00	6,111,300	
リケン	5,000	3,955.00	19,775,000	
ＴＰＲ	14,400	2,039.00	29,361,600	
ツバキ・ナカシマ	21,900	1,435.00	31,426,500	
ホシザキ	31,400	9,990.00	313,686,000	
大豊工業	8,900	810.00	7,209,000	

日本精工	202,100	1,028.00	207,758,800	
ＮＴＮ	248,500	343.00	85,235,500	
ジェイテクト	103,000	1,285.00	132,355,000	
不二越	10,000	4,685.00	46,850,000	
ミネベアミツミ	199,300	2,405.00	479,316,500	
日本トムソン	31,800	490.00	15,582,000	
ＴＨＫ	62,500	3,170.00	198,125,000	
ユーシン精機	8,300	1,044.00	8,665,200	
前澤給装工業	3,900	2,264.00	8,829,600	
イーグル工業	13,200	1,064.00	14,044,800	
前澤工業	7,200	404.00	2,908,800	
日本ピラー工業	10,900	1,544.00	16,829,600	
キッツ	43,600	746.00	32,525,600	
日立製作所	516,000	4,587.00	2,366,892,000	
三菱電機	1,073,800	1,532.50	1,645,598,500	
富士電機	64,700	3,330.00	215,451,000	
東洋電機製造	4,300	1,559.00	6,703,700	
安川電機	115,600	4,475.00	517,310,000	
シンフォニア　テクノロジー	13,900	1,356.00	18,848,400	
明電舎	19,700	2,337.00	46,038,900	
オリジン	2,900	1,686.00	4,889,400	
山洋電気	5,200	5,530.00	28,756,000	
デンヨー	9,200	2,078.00	19,117,600	
ベイカレント・コンサルティング	6,200	5,810.00	36,022,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,000	1,205.00	2,410,000	
アイモバイル	3,200	776.00	2,483,200	
キャリアインデックス	4,300	423.00	1,818,900	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,300	1,583.00	5,223,900	
船場	1,700	1,081.00	1,837,700	
グレイステクノロジー	4,700	2,889.00	13,578,300	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,800	2,764.00	29,851,200	
フルテック	1,200	1,349.00	1,618,800	
グリーンズ	3,900	1,141.00	4,449,900	
ツナググループ・ホールディングス	1,200	807.00	968,400	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	2,200	775.00	1,705,000	
ソウルドアウト	1,600	1,958.00	3,132,800	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,400	1,023.00	1,432,200	
日総工産	6,800	1,171.00	7,962,800	
キュービーネットホールディングス	6,300	2,444.00	15,397,200	
ＲＰＡホールディングス	5,800	1,034.00	5,997,200	
三櫻工業	13,600	1,203.00	16,360,800	
マキタ	140,000	4,105.00	574,700,000	
東芝テック	13,400	4,545.00	60,903,000	
芝浦メカトロニクス	1,900	3,970.00	7,543,000	
マブチモーター	29,700	4,220.00	125,334,000	
日本電産	129,200	15,540.00	2,007,768,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,600	492.00	3,247,200	
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,719.00	10,657,800	

東光高岳	6,000	1,194.00	7,164,000	
ダブル・スコープ	16,400	1,041.00	17,072,400	
宮越ホールディングス	4,000	1,095.00	4,380,000	
ダイヘン	11,800	3,500.00	41,300,000	
ヤーマン	15,600	737.00	11,497,200	
ＪＶＣケンウッド	87,700	265.00	23,240,500	
ミマキエンジニアリング	9,600	527.00	5,059,200	
第一精工	3,900	2,644.00	10,311,600	
日新電機	25,200	1,337.00	33,692,400	
大崎電気工業	21,400	687.00	14,701,800	
オムロン	96,300	6,540.00	629,802,000	
日東工業	15,800	2,559.00	40,432,200	
ＩＤＥＣ	15,500	2,264.00	35,092,000	
正興電機製作所	2,500	995.00	2,487,500	
不二電機工業	1,200	1,302.00	1,562,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	35,800	2,400.00	85,920,000	
サクサホールディングス	2,500	2,020.00	5,050,000	
メルコホールディングス	3,700	3,005.00	11,118,500	
テクノメディカ	2,400	2,054.00	4,929,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,800	965.00	1,737,000	
日本電気	130,300	5,080.00	661,924,000	
富士通	103,500	11,245.00	1,163,857,500	
沖電気工業	43,600	1,488.00	64,876,800	
岩崎通信機	4,700	846.00	3,976,200	
電気興業	5,200	3,360.00	17,472,000	
サンケン電気	11,700	3,385.00	39,604,500	
ナカヨ	1,900	1,651.00	3,136,900	
アイホン	6,100	1,817.00	11,083,700	
ルネサスエレクトロニクス	512,800	811.00	415,880,800	
セイコーエプソン	133,200	1,631.00	217,249,200	
ワコム	72,200	461.00	33,284,200	
アルバック	21,400	4,305.00	92,127,000	
アクセル	4,500	1,035.00	4,657,500	
ＥＩＺＯ	8,300	3,885.00	32,245,500	
ジャパンディスプレイ	310,500	76.00	23,598,000	
日本信号	27,300	1,440.00	39,312,000	
京三製作所	25,100	627.00	15,737,700	
能美防災	14,200	2,429.00	34,491,800	
ホーチキ	7,800	1,665.00	12,987,000	
星和電機	5,300	581.00	3,079,300	
エレコム	11,600	4,580.00	53,128,000	
パナソニック	1,226,900	1,058.50	1,298,673,650	
シャープ	124,200	1,711.00	212,506,200	
アンリツ	69,100	2,222.00	153,540,200	
富士通ゼネラル	29,100	2,590.00	75,369,000	
ソニー	678,900	8,036.00	5,455,640,400	
ＴＤＫ	51,800	12,590.00	652,162,000	
帝国通信工業	4,700	1,234.00	5,799,800	
タムラ製作所	35,900	730.00	26,207,000	

アルプスアルパイン	95,100	2,565.00	243,931,500	
池上通信機	3,500	1,204.00	4,214,000	
日本電波工業	9,800	553.00	5,419,400	
鈴木	5,800	815.00	4,727,000	
日本トリム	1,500	4,765.00	7,147,500	
ローランド　ディー．ジー．	5,900	2,097.00	12,372,300	
フォスター電機	11,300	1,960.00	22,148,000	
ＳＭＫ	2,800	3,180.00	8,904,000	
ヨコオ	7,000	3,360.00	23,520,000	
ティアック	8,100	216.00	1,749,600	
ホシデン	29,400	1,392.00	40,924,800	
ヒロセ電機	16,600	14,260.00	236,716,000	
日本航空電子工業	24,600	2,292.00	56,383,200	
ＴＯＡ	11,500	1,135.00	13,052,500	
マクセルホールディングス	23,100	1,499.00	34,626,900	
古野電気	13,800	1,356.00	18,712,800	
ユニデンホールディングス	3,000	1,989.00	5,967,000	
スミダコーポレーション	8,300	1,247.00	10,350,100	
アイコム	5,900	2,737.00	16,148,300	
リオン	4,500	3,710.00	16,695,000	
本多通信工業	9,200	585.00	5,382,000	
船井電機	10,900	689.00	7,510,100	
横河電機	98,500	2,044.00	201,334,000	
新電元工業	3,800	3,770.00	14,326,000	
アズビル	67,800	3,040.00	206,112,000	
東亜ディーケーケー	5,300	1,038.00	5,501,400	
日本光電工業	44,400	3,045.00	135,198,000	
チノー	3,700	1,435.00	5,309,500	
共和電業	11,300	435.00	4,915,500	
日本電子材料	4,300	1,192.00	5,125,600	
堀場製作所	21,300	7,330.00	156,129,000	
アドバンテスト	79,800	6,330.00	505,134,000	
小野測器	4,100	560.00	2,296,000	
エスペック	9,500	2,266.00	21,527,000	
キーエンス	97,300	40,470.00	3,937,731,000	
日置電機	5,600	3,850.00	21,560,000	
シスメックス	76,700	7,700.00	590,590,000	
日本マイクロニクス	18,700	1,429.00	26,722,300	
メガチップス	10,000	1,895.00	18,950,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,600	3,750.00	21,000,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,000	610.00	5,490,000	
澤藤電機	1,300	2,310.00	3,003,000	
デンソー	236,400	4,885.00	1,154,814,000	
原田工業	5,100	1,020.00	5,202,000	
コーセル	13,100	1,204.00	15,772,400	
イリソ電子工業	9,000	4,750.00	42,750,000	
オプテックスグループ	17,600	1,558.00	27,420,800	
千代田インテグレ	5,000	2,171.00	10,855,000	
アイ・オー・データ機器	4,000	1,070.00	4,280,000	
レーザーテック	44,000	5,930.00	260,920,000	

スタンレー電気	75,500	3,150.00	237,825,000	
岩崎電気	4,200	1,507.00	6,329,400	
ウシオ電機	62,400	1,761.00	109,886,400	
岡谷電機産業	8,500	388.00	3,298,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	10,000	468.00	4,680,000	
エノモト	3,200	1,380.00	4,416,000	
日本セラミック	10,900	2,705.00	29,484,500	
遠藤照明	5,500	722.00	3,971,000	
古河電池	7,700	835.00	6,429,500	
双信電機	5,300	496.00	2,628,800	
山一電機	7,800	1,729.00	13,486,200	
図研	7,000	2,636.00	18,452,000	
日本電子	21,200	3,610.00	76,532,000	
カシオ計算機	95,000	2,293.00	217,835,000	
ファナック	102,000	20,915.00	2,133,330,000	
日本シイエムケイ	25,300	607.00	15,357,100	
エンプラス	5,500	3,370.00	18,535,000	
大真空	3,900	1,910.00	7,449,000	
ローム	47,700	9,030.00	430,731,000	
浜松ホトニクス	77,000	4,575.00	352,275,000	
三井ハイテック	11,900	1,724.00	20,515,600	
新光電気工業	36,000	1,373.00	49,428,000	
京セラ	151,100	7,721.00	1,166,643,100	
協栄産業	1,200	1,490.00	1,788,000	
太陽誘電	47,700	3,610.00	172,197,000	
村田製作所	315,500	6,870.00	2,167,485,000	
双葉電子工業	17,000	1,350.00	22,950,000	
日東電工	74,100	6,220.00	460,902,000	
北陸電気工業	4,300	1,336.00	5,744,800	
東海理化電機製作所	28,300	2,083.00	58,948,900	
ニチコン	36,400	1,078.00	39,239,200	
日本ケミコン	8,200	2,018.00	16,547,600	
ＫＯＡ	16,200	1,386.00	22,453,200	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	38,800	949.00	36,821,200	
日立造船	85,200	410.00	34,932,000	
三菱重工業	180,000	4,300.00	774,000,000	
川崎重工業	83,600	2,405.00	201,058,000	
ＩＨＩ	77,400	2,890.00	223,686,000	
名村造船所	34,600	258.00	8,926,800	
サノヤスホールディングス	13,400	180.00	2,412,000	
スプリックス	3,500	1,142.00	3,997,000	
マネジメントソリューションズ	1,100	3,155.00	3,470,500	
日本車輌製造	3,900	3,190.00	12,441,000	
三菱ロジスネクスト	14,200	1,510.00	21,442,000	
近畿車輌	1,700	1,651.00	2,806,700	
ＦＰＧ	32,700	1,034.00	33,811,800	
島根銀行	2,100	657.00	1,379,700	
じもとホールディングス	72,000	112.00	8,064,000	
全国保証	29,800	4,745.00	141,401,000	
めぶきフィナンシャルグループ	550,100	265.00	145,776,500	

東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,300	1,424.00	20,363,200	
九州フィナンシャルグループ	173,800	466.00	80,990,800	
かんぽ生命保険	37,600	1,934.00	72,718,400	
ゆうちょ銀行	300,200	1,033.00	310,106,600	
富山第一銀行	25,400	332.00	8,432,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	622,800	436.00	271,540,800	
ジェイリース	3,100	390.00	1,209,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,100	794.00	57,247,400	
マーキュリアインベストメント	4,700	751.00	3,529,700	
イントラスト	3,700	774.00	2,863,800	
日本モーゲージサービス	2,100	1,866.00	3,918,600	
ＣＡＳＡ	3,700	1,482.00	5,483,400	
アルヒ	16,900	2,290.00	38,701,000	
プレミアグループ	5,700	2,257.00	12,864,900	
日産自動車	1,266,700	618.00	782,820,600	
いすゞ自動車	311,200	1,243.00	386,821,600	
トヨタ自動車	1,198,265	7,739.00	9,273,372,835	代用有価証券 250,000株
日野自動車	134,100	1,149.00	154,080,900	
三菱自動車工業	397,400	452.00	179,624,800	
エフテック	7,500	818.00	6,135,000	
レシップホールディングス	4,300	677.00	2,911,100	
ＧＭＢ	2,000	801.00	1,602,000	
ファルテック	1,900	1,158.00	2,200,200	
武蔵精密工業	23,900	1,463.00	34,965,700	
日産車体	21,000	1,057.00	22,197,000	
新明和工業	28,900	1,469.00	42,454,100	
極東開発工業	19,900	1,551.00	30,864,900	
日信工業	21,800	2,231.00	48,635,800	
トピー工業	8,800	1,951.00	17,168,800	
ティラド	3,900	1,956.00	7,628,400	
曙ブレーキ工業	59,000	247.00	14,573,000	
タチエス	17,600	1,407.00	24,763,200	
ＮＯＫ	57,700	1,615.00	93,185,500	
フタバ産業	29,900	718.00	21,468,200	
ＫＹＢ	12,000	3,160.00	37,920,000	
市光工業	16,100	720.00	11,592,000	
大同メタル工業	20,600	728.00	14,996,800	
プレス工業	53,300	405.00	21,586,500	
ミクニ	13,700	347.00	4,753,900	
太平洋工業	22,500	1,494.00	33,615,000	
ケーヒン	24,700	2,574.00	63,577,800	
河西工業	14,500	823.00	11,933,500	
アイシン精機	88,400	3,905.00	345,202,000	
マツダ	315,900	959.00	302,948,100	
今仙電機製作所	10,000	951.00	9,510,000	
本田技研工業	845,500	3,074.00	2,599,067,000	
スズキ	212,900	4,637.00	987,217,300	

ＳＵＢＡＲＵ	333,400	2,677.00	892,511,800	
安永	5,200	1,219.00	6,338,800	
ヤマハ発動機	140,000	2,129.00	298,060,000	
ショーワ	25,300	2,278.00	57,633,400	
小糸製作所	64,300	5,040.00	324,072,000	
ＴＢＫ	12,800	494.00	6,323,200	
エクセディ	14,600	2,414.00	35,244,400	
ミツバ	19,700	687.00	13,533,900	
豊田合成	34,700	2,758.00	95,702,600	
愛三工業	16,900	748.00	12,641,200	
盟和産業	1,600	1,139.00	1,822,400	
日本プラスト	8,400	721.00	6,056,400	
ヨロズ	10,000	1,460.00	14,600,000	
エフ・シー・シー	17,500	2,342.00	40,985,000	
新家工業	2,400	1,473.00	3,535,200	
シマノ	40,200	17,390.00	699,078,000	
テイ・エス　テック	24,900	3,330.00	82,917,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	62,200	666.00	41,425,200	
三十三フィナンシャルグループ	9,800	1,653.00	16,199,400	
第四北越フィナンシャルグループ	18,400	2,909.00	53,525,600	
ジャムコ	5,400	1,467.00	7,921,800	
小野建	9,500	1,403.00	13,328,500	
はるやまホールディングス	4,400	876.00	3,854,400	
南陽	2,100	1,912.00	4,015,200	
ノジマ	18,800	2,217.00	41,679,600	
佐鳥電機	7,800	922.00	7,191,600	
カッパ・クリエイト	14,900	1,503.00	22,394,700	
エコートレーディング	2,300	572.00	1,315,600	
伯東	6,500	1,341.00	8,716,500	
コンドーテック	8,200	1,160.00	9,512,000	
中山福	6,100	549.00	3,348,900	
ライトオン	7,900	584.00	4,613,600	
ナガイレーベン	15,300	2,345.00	35,878,500	
ジーンズメイト	3,300	310.00	1,023,000	
三菱食品	11,600	3,165.00	36,714,000	
良品計画	140,400	2,128.00	298,771,200	
三城ホールディングス	11,300	302.00	3,412,600	
松田産業	7,800	1,593.00	12,425,400	
第一興商	15,700	5,620.00	88,234,000	
メディパルホールディングス	114,200	2,438.00	278,419,600	
アドヴァン	16,200	1,222.00	19,796,400	
ＳＰＫ	2,200	2,870.00	6,314,000	
萩原電気ホールディングス	4,000	2,750.00	11,000,000	
アルビス	4,000	2,249.00	8,996,000	
アズワン	6,900	10,050.00	69,345,000	
スズデン	3,700	1,479.00	5,472,300	
尾家産業	3,000	1,467.00	4,401,000	
シモジマ	6,500	1,191.00	7,741,500	
ドウシシャ	10,000	1,702.00	17,020,000	
小津産業	2,300	1,804.00	4,149,200	

コナカ	12,600	420.00	5,292,000	
高速	6,300	1,242.00	7,824,600	
ハウス　オブ　ローゼ	1,300	1,667.00	2,167,100	
Ｇ－７ホールディングス	6,200	2,488.00	15,425,600	
たけびし	3,400	1,480.00	5,032,000	
イオン北海道	10,700	793.00	8,485,100	
コジマ	18,200	551.00	10,028,200	
ヒマラヤ	3,400	848.00	2,883,200	
コーナン商事	15,000	2,455.00	36,825,000	
ネットワンシステムズ	40,200	2,854.00	114,730,800	
エコス	3,900	1,727.00	6,735,300	
ワタミ	12,500	1,289.00	16,112,500	
マルシェ	2,800	782.00	2,189,600	
リックス	2,300	1,737.00	3,995,100	
システムソフト	25,800	104.00	2,683,200	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	253,500	1,867.00	473,284,500	
丸文	9,400	632.00	5,940,800	
西松屋チェーン	23,200	937.00	21,738,400	
ゼンショーホールディングス	50,700	2,503.00	126,902,100	
ハピネット	8,900	1,398.00	12,442,200	
幸楽苑ホールディングス	6,700	2,218.00	14,860,600	
ハークスレイ	2,000	1,324.00	2,648,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	1,910.00	4,011,000	
日本ライフライン	31,300	1,494.00	46,762,200	
サイゼリヤ	17,400	2,639.00	45,918,600	
タカショー	5,300	525.00	2,782,500	
エクセル	3,000	1,592.00	4,776,000	
ＶＴホールディングス	44,000	471.00	20,724,000	
マルカ	3,700	2,290.00	8,473,000	
アルゴグラフィックス	8,900	3,415.00	30,393,500	
魚力	2,900	1,588.00	4,605,200	
ＩＤＯＭ	28,600	576.00	16,473,600	
日本エム・ディ・エム	6,200	2,595.00	16,089,000	
ポプラ	2,700	507.00	1,368,900	
フジ・コーポレーション	2,800	2,198.00	6,154,400	
ユナイテッドアローズ	11,100	2,920.00	32,412,000	
進和	6,300	2,366.00	14,905,800	
エスケイジャパン	2,200	481.00	1,058,200	
ダイトロン	4,500	1,979.00	8,905,500	
ハイデイ日高	15,300	2,013.00	30,798,900	
シークス	13,400	1,463.00	19,604,200	
京都きもの友禅	6,900	352.00	2,428,800	
コロワイド	35,200	2,305.00	81,136,000	
ピーシーデポコーポレーション	14,000	587.00	8,218,000	
田中商事	3,400	779.00	2,648,600	
オーハシテクニカ	6,000	1,635.00	9,810,000	
壱番屋	7,400	5,930.00	43,882,000	
白銅	3,800	1,543.00	5,863,400	
トップカルチャー	4,100	337.00	1,381,700	

ＰＬＡＮＴ	2,900	620.00	1,798,000	
スギホールディングス	21,100	5,680.00	119,848,000	
薬王堂ホールディングス	4,600	2,320.00	10,672,000	
島津製作所	128,300	3,395.00	435,578,500	
ＪＭＳ	9,100	787.00	7,161,700	
クボテック	2,700	406.00	1,096,200	
長野計器	7,800	940.00	7,332,000	
ブイ・テクノロジー	5,000	5,390.00	26,950,000	
スター精密	16,500	1,536.00	25,344,000	
東京計器	6,800	1,082.00	7,357,600	
愛知時計電機	1,300	4,405.00	5,726,500	
インターアクション	5,800	3,070.00	17,806,000	
オーバル	10,200	256.00	2,611,200	
東京精密	19,400	4,310.00	83,614,000	
マニー	42,800	3,035.00	129,898,000	
ニコン	173,700	1,387.00	240,921,900	
トプコン	54,100	1,688.00	91,320,800	
オリンパス	594,200	1,733.50	1,030,045,700	
理研計器	9,500	2,241.00	21,289,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18,600	8,150.00	151,590,000	
キヤノン電子	11,300	2,074.00	23,436,200	
タムロン	8,700	2,609.00	22,698,300	
ＨＯＹＡ	214,500	10,730.00	2,301,585,000	
シード	4,600	1,114.00	5,124,400	
ノーリツ鋼機	7,200	1,490.00	10,728,000	
エー・アンド・デイ	9,800	1,056.00	10,348,800	
朝日インテック	91,200	3,300.00	300,960,000	
キヤノン	578,100	3,079.00	1,779,969,900	
リコー	273,200	1,265.00	345,598,000	
シチズン時計	125,700	581.00	73,031,700	
リズム時計工業	3,400	953.00	3,240,200	
大研医器	7,500	721.00	5,407,500	
メニコン	14,700	4,760.00	69,972,000	
シンシア	1,100	640.00	704,000	
中本パックス	2,700	1,652.00	4,460,400	
スノーピーク	5,000	1,117.00	5,585,000	
パラマウントベッドホールディングス	11,300	4,635.00	52,375,500	
トランザクション	6,900	1,121.00	7,734,900	
粧美堂	3,100	395.00	1,224,500	
ニホンフラッシュ	5,000	2,870.00	14,350,000	
前田工繊	11,800	2,199.00	25,948,200	
永大産業	14,300	350.00	5,005,000	
アートネイチャー	11,500	854.00	9,821,000	
バンダイナムコホールディングス	111,000	6,695.00	743,145,000	
アイフィスジャパン	2,800	757.00	2,119,600	
共立印刷	18,400	172.00	3,164,800	
ＳＨＯＥＩ	5,200	5,130.00	26,676,000	
フランスベッドホールディングス	15,300	971.00	14,856,300	
マーベラス	16,100	723.00	11,640,300	
パイロットコーポレーション	17,500	4,450.00	77,875,000	

萩原工業	6,000	1,660.00	9,960,000	
エイベックス	18,100	1,244.00	22,516,400	
トッパン・フォームズ	23,000	1,171.00	26,933,000	
フジシールインターナショナル	24,100	2,373.00	57,189,300	
タカラトミー	48,200	1,289.00	62,129,800	
廣済堂	7,500	805.00	6,037,500	
エステールホールディングス	2,700	687.00	1,854,900	
アーク	40,700	94.00	3,825,800	
レック	11,500	1,294.00	14,881,000	
タカノ	4,100	800.00	3,280,000	
三光合成	12,500	377.00	4,712,500	
プロネクサス	9,200	1,247.00	11,472,400	
ホクシン	7,100	159.00	1,128,900	
ウッドワン	3,400	1,262.00	4,290,800	
大建工業	7,200	1,924.00	13,852,800	
きもと	18,600	179.00	3,329,400	
凸版印刷	151,500	2,228.00	337,542,000	
大日本印刷	140,500	2,977.00	418,268,500	
共同印刷	3,300	3,000.00	9,900,000	
ＮＩＳＳＨＡ	22,100	1,099.00	24,287,900	
光村印刷	900	1,772.00	1,594,800	
藤森工業	9,700	3,500.00	33,950,000	
ヴィア・ホールディングス	13,000	677.00	8,801,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,200	1,728.00	8,985,600	
前澤化成工業	6,900	1,194.00	8,238,600	
未来工業	5,800	2,171.00	12,591,800	
アシックス	88,600	1,620.00	143,532,000	
ツツミ	3,400	2,161.00	7,347,400	
ウェーブロックホールディングス	3,800	835.00	3,173,000	
ＪＳＰ	6,300	1,903.00	11,988,900	
ニチハ	15,000	2,513.00	37,695,000	
エフピコ	11,800	6,600.00	77,880,000	
小松ウオール工業	3,300	2,211.00	7,296,300	
ヤマハ	63,900	6,150.00	392,985,000	
河合楽器製作所	3,300	3,895.00	12,853,500	
クリナップ	10,100	737.00	7,443,700	
ピジョン	64,900	4,200.00	272,580,000	
天馬	7,200	1,999.00	14,392,800	
オリバー	2,300	3,615.00	8,314,500	
兼松サステック	700	1,814.00	1,269,800	
キングジム	9,000	882.00	7,938,000	
象印マホービン	31,500	2,201.00	69,331,500	
リンテック	25,500	2,401.00	61,225,500	
信越ポリマー	19,300	1,045.00	20,168,500	
東リ	26,900	300.00	8,070,000	
イトーキ	22,900	504.00	11,541,600	
任天堂	65,800	43,200.00	2,842,560,000	
三菱鉛筆	17,700	1,658.00	29,346,600	
松風	4,900	1,908.00	9,349,200	
タカラスタンダード	22,200	1,935.00	42,957,000	

コクヨ	51,500	1,658.00	85,387,000	
ナカバヤシ	10,600	623.00	6,603,800	
ニフコ	39,400	2,977.00	117,293,800	
立川ブラインド工業	4,700	1,329.00	6,246,300	
グローブライド	4,800	2,544.00	12,211,200	
オカムラ	37,500	1,095.00	41,062,500	
バルカー	8,700	2,525.00	21,967,500	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,400	1,697.00	2,375,800	
伊藤忠商事	739,800	2,580.50	1,909,053,900	
丸紅	1,100,800	821.80	904,637,440	
スクロール	16,200	384.00	6,220,800	
高島	1,600	2,003.00	3,204,800	
ヨンドシーホールディングス	10,800	2,506.00	27,064,800	
三陽商会	5,500	1,340.00	7,370,000	
長瀬産業	59,600	1,596.00	95,121,600	
ナイガイ	3,900	462.00	1,801,800	
蝶理	6,800	2,138.00	14,538,400	
豊田通商	118,000	3,795.00	447,810,000	
オンワードホールディングス	63,100	631.00	39,816,100	
三共生興	16,100	598.00	9,627,800	
兼松	39,400	1,445.00	56,933,000	
美津濃	9,800	2,709.00	26,548,200	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,123.00	2,021,400	
ファミリーマート	84,500	2,738.00	231,361,000	
ルックホールディングス	3,600	1,177.00	4,237,200	
三井物産	929,700	1,972.50	1,833,833,250	
日本紙パルプ商事	6,000	4,160.00	24,960,000	
東京エレクトロン	71,600	25,300.00	1,811,480,000	
日立ハイテクノロジーズ	36,700	7,890.00	289,563,000	
カメイ	13,800	1,215.00	16,767,000	
東都水産	1,400	2,741.00	3,837,400	
ＯＵＧホールディングス	1,600	2,687.00	4,299,200	
スターゼン	3,900	4,315.00	16,828,500	
セイコーホールディングス	15,200	2,956.00	44,931,200	
山善	41,200	1,064.00	43,836,800	
椿本興業	2,000	4,225.00	8,450,000	
住友商事	667,300	1,623.50	1,083,361,550	
日本ユニシス	32,900	3,500.00	115,150,000	
内田洋行	4,500	7,840.00	35,280,000	
三菱商事	742,200	2,907.00	2,157,575,400	
第一実業	5,200	3,665.00	19,058,000	
キヤノンマーケティングジャパン	30,200	2,549.00	76,979,800	
西華産業	6,000	1,348.00	8,088,000	
佐藤商事	8,700	985.00	8,569,500	
菱洋エレクトロ	10,700	2,070.00	22,149,000	
東京産業	9,600	635.00	6,096,000	
ユアサ商事	10,000	3,585.00	35,850,000	
神鋼商事	2,600	2,738.00	7,118,800	
小林産業	6,200	302.00	1,872,400	
阪和興業	19,800	2,829.00	56,014,200	

正栄食品工業	6,800	3,995.00	27,166,000	
カナデン	8,600	1,401.00	12,048,600	
菱電商事	7,600	1,676.00	12,737,600	
ニプロ	74,400	1,286.00	95,678,400	
フルサト工業	5,900	1,739.00	10,260,100	
岩谷産業	23,500	3,675.00	86,362,500	
すてきナイスグループ	4,500	1,274.00	5,733,000	
昭光通商	3,500	722.00	2,527,000	
ニチモウ	1,700	1,993.00	3,388,100	
極東貿易	3,000	2,180.00	6,540,000	
イワキ	14,000	499.00	6,986,000	
兼松エレクトロニクス	5,700	3,595.00	20,491,500	
三愛石油	26,000	1,139.00	29,614,000	
稲畑産業	23,200	1,579.00	36,632,800	
ＧＳＩクレオス	2,600	1,309.00	3,403,400	
明和産業	9,800	607.00	5,948,600	
クワザワ	3,800	711.00	2,701,800	
キムラタン	56,800	29.00	1,647,200	
ゴールドウイン	19,100	8,040.00	153,564,000	
ユニ・チャーム	207,000	3,839.00	794,673,000	
デサント	20,500	2,037.00	41,758,500	
キング	5,000	558.00	2,790,000	
ワキタ	22,600	1,089.00	24,611,400	
ヤマトインターナショナル	6,200	407.00	2,523,400	
東邦ホールディングス	34,000	2,424.00	82,416,000	
サンゲツ	29,100	2,036.00	59,247,600	
ミツウロコグループホールディングス	15,600	1,178.00	18,376,800	
シナネンホールディングス	4,400	1,934.00	8,509,600	
伊藤忠エネクス	23,500	907.00	21,314,500	
サンリオ	29,700	2,154.00	63,973,800	
サンワ　テクノス	7,500	1,144.00	8,580,000	
リョーサン	11,700	2,730.00	31,941,000	
新光商事	16,700	905.00	15,113,500	
トーホー	4,800	1,949.00	9,355,200	
三信電気	5,700	1,770.00	10,089,000	
東陽テクニカ	12,200	1,315.00	16,043,000	
モスフードサービス	13,900	2,999.00	41,686,100	
加賀電子	10,500	2,519.00	26,449,500	
三益半導体工業	9,500	2,291.00	21,764,500	
ソーダニッカ	10,600	632.00	6,699,200	
立花エレテック	7,800	1,831.00	14,281,800	
木曽路	13,800	2,946.00	40,654,800	
ＳＲＳホールディングス	12,500	1,049.00	13,112,500	
千趣会	19,100	469.00	8,957,900	
タカキュー	8,700	186.00	1,618,200	
ケーヨー	21,700	551.00	11,956,700	
上新電機	12,500	2,484.00	31,050,000	
日本瓦斯	16,700	3,295.00	55,026,500	
ロイヤルホールディングス	18,500	2,452.00	45,362,000	
東天紅	800	1,313.00	1,050,400	

いなげや	13,100	1,461.00	19,139,100	
島忠	19,900	3,265.00	64,973,500	
チヨダ	11,100	1,549.00	17,193,900	
ライフコーポレーション	8,000	2,430.00	19,440,000	
リンガーハット	13,000	2,546.00	33,098,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	14,600	473.00	6,905,800	
テンアライド	9,600	444.00	4,262,400	
ＡＯＫＩホールディングス	21,200	1,075.00	22,790,000	
オークワ	16,600	1,462.00	24,269,200	
コメリ	16,300	2,234.00	36,414,200	
青山商事	21,900	1,514.00	33,156,600	
しまむら	12,300	8,190.00	100,737,000	
はせがわ	5,200	402.00	2,090,400	
高島屋	77,100	1,220.00	94,062,000	
松屋	21,300	834.00	17,764,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	50,100	1,194.00	59,819,400	
近鉄百貨店	3,900	3,825.00	14,917,500	
パルコ	10,100	1,848.00	18,664,800	
丸井グループ	96,900	2,737.00	265,215,300	
クレディセゾン	74,200	1,899.00	140,905,800	
アクシアル　リテイリング	8,800	3,770.00	33,176,000	
井筒屋	6,000	256.00	1,536,000	
イオン	407,000	2,339.00	951,973,000	
イズミ	21,500	3,830.00	82,345,000	
フォーバル	4,700	1,195.00	5,616,500	
平和堂	21,500	2,032.00	43,688,000	
フジ	12,800	1,833.00	23,462,400	
ヤオコー	12,000	5,520.00	66,240,000	
ゼビオホールディングス	12,800	1,252.00	16,025,600	
ケーズホールディングス	102,000	1,418.00	144,636,000	
ＰＡＬＴＡＣ	17,000	5,540.00	94,180,000	
三谷産業	14,200	341.00	4,842,200	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,500	643.00	3,536,500	
日産東京販売ホールディングス	16,100	285.00	4,588,500	
新生銀行	77,800	1,632.00	126,969,600	
あおぞら銀行	63,100	2,930.00	184,883,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,291,100	579.00	4,221,546,900	
りそなホールディングス	1,162,300	468.30	544,305,090	
三井住友トラスト・ホールディングス	200,200	4,219.00	844,643,800	
三井住友フィナンシャルグループ	732,500	3,998.00	2,928,535,000	
千葉銀行	364,200	633.00	230,538,600	
群馬銀行	208,000	371.00	77,168,000	
武蔵野銀行	15,800	1,782.00	28,155,600	
千葉興業銀行	29,000	375.00	10,875,000	
筑波銀行	44,100	225.00	9,922,500	
七十七銀行	35,700	1,721.00	61,439,700	
青森銀行	8,200	2,781.00	22,804,200	
秋田銀行	6,800	2,118.00	14,402,400	
山形銀行	11,900	1,520.00	18,088,000	
岩手銀行	7,000	2,716.00	19,012,000	

東邦銀行	94,800	255.00	24,174,000	
東北銀行	5,100	1,033.00	5,268,300	
みちのく銀行	6,900	1,479.00	10,205,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	89,200	2,040.00	181,968,000	
静岡銀行	262,200	794.00	208,186,800	
十六銀行	13,300	2,418.00	32,159,400	
スルガ銀行	108,400	457.00	49,538,800	
八十二銀行	255,500	447.00	114,208,500	
山梨中央銀行	12,300	1,113.00	13,689,900	
大垣共立銀行	21,000	2,286.00	48,006,000	
福井銀行	9,000	1,805.00	16,245,000	
北國銀行	10,900	3,250.00	35,425,000	
清水銀行	4,400	2,170.00	9,548,000	
富山銀行	2,000	2,287.00	4,574,000	
滋賀銀行	21,200	2,689.00	57,006,800	
南都銀行	17,600	2,673.00	47,044,800	
百五銀行	95,400	332.00	31,672,800	
京都銀行	37,900	4,575.00	173,392,500	
紀陽銀行	37,500	1,591.00	59,662,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	70,400	1,100.00	77,440,000	
広島銀行	156,400	510.00	79,764,000	
山陰合同銀行	62,800	633.00	39,752,400	
中国銀行	91,100	1,037.00	94,470,700	
鳥取銀行	3,700	1,362.00	5,039,400	
伊予銀行	151,000	597.00	90,147,000	
百十四銀行	11,300	2,046.00	23,119,800	
四国銀行	16,100	986.00	15,874,600	
阿波銀行	17,300	2,338.00	40,447,400	
大分銀行	6,100	2,676.00	16,323,600	
宮崎銀行	7,000	2,563.00	17,941,000	
佐賀銀行	6,400	1,648.00	10,547,200	
沖縄銀行	9,700	3,490.00	33,853,000	
琉球銀行	24,400	1,120.00	27,328,000	
セブン銀行	353,800	337.00	119,230,600	
みずほフィナンシャルグループ	14,393,200	166.60	2,397,907,120	
高知銀行	3,900	877.00	3,420,300	
山口フィナンシャルグループ	132,200	697.00	92,143,400	
芙蓉総合リース	11,100	7,220.00	80,142,000	
みずほリース	16,300	3,380.00	55,094,000	
東京センチュリー	21,300	5,740.00	122,262,000	
ＳＢＩホールディングス	118,300	2,417.00	285,931,100	
日本証券金融	46,700	520.00	24,284,000	
アイフル	161,700	300.00	48,510,000	
日本アジア投資	9,100	276.00	2,511,600	
長野銀行	3,500	1,619.00	5,666,500	
名古屋銀行	8,600	3,180.00	27,348,000	
北洋銀行	159,500	226.00	36,047,000	
愛知銀行	3,800	3,645.00	13,851,000	
中京銀行	4,400	2,210.00	9,724,000	
大光銀行	3,700	1,688.00	6,245,600	

愛媛銀行	14,800	1,126.00	16,664,800	
トマト銀行	4,100	1,064.00	4,362,400	
京葉銀行	45,100	598.00	26,969,800	
栃木銀行	51,000	223.00	11,373,000	
北日本銀行	3,300	2,230.00	7,359,000	
東和銀行	18,600	840.00	15,624,000	
福島銀行	10,200	264.00	2,692,800	
大東銀行	5,500	636.00	3,498,000	
リコーリース	8,300	4,220.00	35,026,000	
イオンフィナンシャルサービス	64,800	1,717.00	111,261,600	
アコム	212,800	514.00	109,379,200	
ジャックス	11,700	2,761.00	32,303,700	
オリエントコーポレーション	286,700	171.00	49,025,700	
日立キャピタル	24,900	3,035.00	75,571,500	
アプラスフィナンシャル	51,700	97.00	5,014,900	
オリックス	662,500	1,853.00	1,227,612,500	
三菱ＵＦＪリース	268,800	697.00	187,353,600	
ジャフコ	16,300	4,230.00	68,949,000	
九州リースサービス	4,900	601.00	2,944,900	
トモニホールディングス	81,900	400.00	32,760,000	
大和証券グループ本社	849,700	577.70	490,871,690	
野村ホールディングス	1,863,600	580.70	1,082,192,520	
岡三証券グループ	90,200	391.00	35,268,200	
丸三証券	31,400	489.00	15,354,600	
東洋証券	38,200	148.00	5,653,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	121,500	346.00	42,039,000	
光世証券	2,500	655.00	1,637,500	
水戸証券	31,000	219.00	6,789,000	
いちよし証券	19,800	648.00	12,830,400	
松井証券	60,500	888.00	53,724,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	199,200	4,213.00	839,229,600	
だいこう証券ビジネス	5,100	672.00	3,427,200	
日本取引所グループ	304,000	2,017.00	613,168,000	
マネックスグループ	80,000	284.00	22,720,000	
極東証券	14,300	762.00	10,896,600	
岩井コスモホールディングス	9,900	1,300.00	12,870,000	
藍澤證券	19,000	730.00	13,870,000	
フィデアホールディングス	103,000	131.00	13,493,000	
池田泉州ホールディングス	122,200	201.00	24,562,200	
アニコム　ホールディングス	8,800	3,685.00	32,428,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	277,000	3,670.00	1,016,590,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	87,000	2,639.00	229,593,000	
マネーパートナーズグループ	11,600	246.00	2,853,600	
スパークス・グループ	36,600	275.00	10,065,000	
小林洋行	3,100	268.00	830,800	
第一生命ホールディングス	599,300	1,747.00	1,046,977,100	
東京海上ホールディングス	378,700	6,147.00	2,327,868,900	

アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	1,015.00	5,278,000	
イー・ギャランティ	11,400	1,276.00	14,546,400	
アサックス	5,600	748.00	4,188,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,300	2,504.00	10,767,200	
Ｔ＆Ｄホールディングス	316,500	1,321.00	418,096,500	
アドバンスクリエイト	2,400	1,833.00	4,399,200	
三井不動産	522,400	2,767.00	1,445,480,800	
三菱地所	742,200	2,097.50	1,556,764,500	
平和不動産	19,400	3,065.00	59,461,000	
東京建物	115,700	1,723.00	199,351,100	
ダイビル	27,300	1,295.00	35,353,500	
京阪神ビルディング	17,200	1,385.00	23,822,000	
住友不動産	238,100	3,830.00	911,923,000	
太平洋興発	4,000	810.00	3,240,000	
テーオーシー	20,800	909.00	18,907,200	
東京楽天地	1,400	6,180.00	8,652,000	
レオパレス２１	138,800	388.00	53,854,400	
スターツコーポレーション	14,400	2,722.00	39,196,800	
フジ住宅	12,400	694.00	8,605,600	
空港施設	10,900	552.00	6,016,800	
明和地所	5,900	634.00	3,740,600	
ゴールドクレスト	8,400	2,108.00	17,707,200	
リログループ	56,100	3,015.00	169,141,500	
エスリード	4,100	2,068.00	8,478,800	
日神グループホールディングス	15,600	547.00	8,533,200	
日本エスコン	19,100	933.00	17,820,300	
タカラレーベン	48,500	490.00	23,765,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,000	1,045.00	6,270,000	
イオンモール	53,100	1,869.00	99,243,900	
毎日コムネット	2,300	944.00	2,171,200	
ファースト住建	4,500	1,245.00	5,602,500	
ランド	578,000	12.00	6,936,000	
カチタス	13,100	4,685.00	61,373,500	
東祥	6,400	2,401.00	15,366,400	
トーセイ	14,600	1,420.00	20,732,000	
穴吹興産	2,200	1,738.00	3,823,600	
サンフロンティア不動産	14,700	1,313.00	19,301,100	
エフ・ジェー・ネクスト	9,300	1,125.00	10,462,500	
インテリックス	3,100	756.00	2,343,600	
ランドビジネス	4,200	729.00	3,061,800	
日本社宅サービス	2,700	1,134.00	3,061,800	
グランディハウス	8,400	499.00	4,191,600	
東武鉄道	113,300	3,975.00	450,367,500	
相鉄ホールディングス	34,300	2,952.00	101,253,600	
東急	270,900	1,971.00	533,943,900	
京浜急行電鉄	137,900	2,111.00	291,106,900	
小田急電鉄	159,700	2,549.00	407,075,300	
京王電鉄	55,700	6,550.00	364,835,000	
京成電鉄	74,700	4,350.00	324,945,000	
富士急行	14,600	4,080.00	59,568,000	

新京成電鉄	2,800	2,371.00	6,638,800	
東日本旅客鉄道	189,000	9,958.00	1,882,062,000	
西日本旅客鉄道	95,700	9,455.00	904,843,500	
東海旅客鉄道	89,300	21,945.00	1,959,688,500	
西武ホールディングス	144,200	1,834.00	264,462,800	
鴻池運輸	17,100	1,606.00	27,462,600	
西日本鉄道	29,800	2,483.00	73,993,400	
ハマキョウレックス	8,200	3,510.00	28,782,000	
サカイ引越センター	5,600	6,670.00	37,352,000	
近鉄グループホールディングス	101,700	6,000.00	610,200,000	
阪急阪神ホールディングス	135,600	4,705.00	637,998,000	
南海電気鉄道	48,200	2,982.00	143,732,400	
京阪ホールディングス	45,300	5,350.00	242,355,000	
神戸電鉄	2,400	3,985.00	9,564,000	
名古屋鉄道	83,700	3,395.00	284,161,500	
山陽電気鉄道	7,300	2,190.00	15,987,000	
トランコム	2,800	8,020.00	22,456,000	
日本通運	35,900	6,370.00	228,683,000	
ヤマトホールディングス	178,300	1,861.00	331,816,300	
山九	28,300	5,590.00	158,197,000	
日新	8,800	1,814.00	15,963,200	
丸運	5,800	337.00	1,954,600	
丸全昭和運輸	8,300	3,095.00	25,688,500	
センコーグループホールディングス	56,100	910.00	51,051,000	
トナミホールディングス	2,400	5,090.00	12,216,000	
ニッコンホールディングス	36,400	2,640.00	96,096,000	
日本石油輸送	1,100	2,912.00	3,203,200	
福山通運	13,000	3,940.00	51,220,000	
セイノーホールディングス	76,200	1,438.00	109,575,600	
エスライン	3,000	1,022.00	3,066,000	
神奈川中央交通	2,500	4,030.00	10,075,000	
日立物流	18,700	3,205.00	59,933,500	
丸和運輸機関	10,700	2,411.00	25,797,700	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10,300	1,366.00	14,069,800	
日本郵船	85,000	1,932.00	164,220,000	
商船三井	64,300	2,938.00	188,913,400	
川崎汽船	31,300	1,693.00	52,990,900	
ＮＳユナイテッド海運	5,600	2,134.00	11,950,400	
明治海運	10,000	380.00	3,800,000	
飯野海運	48,000	361.00	17,328,000	
共栄タンカー	1,800	994.00	1,789,200	
九州旅客鉄道	90,700	3,665.00	332,415,500	
ＳＧホールディングス	106,800	2,438.00	260,378,400	
日本航空	183,100	3,445.00	630,779,500	
ＡＮＡホールディングス	185,900	3,590.00	667,381,000	
パスコ	2,000	2,065.00	4,130,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,900	3,615.00	6,868,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,310.00	2,079,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5,200	2,314.00	12,032,800	

国際紙パルプ商事	25,200	296.00	7,459,200	
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	1,354.00	2,437,200	
総合メディカルホールディングス	9,200	2,063.00	18,979,600	
ブックオフグループホールディングス	6,200	990.00	6,138,000	
三菱倉庫	32,300	2,804.00	90,569,200	
三井倉庫ホールディングス	11,600	1,980.00	22,968,000	
住友倉庫	37,400	1,495.00	55,913,000	
澁澤倉庫	5,600	2,325.00	13,020,000	
ヤマタネ	5,300	1,596.00	8,458,800	
東陽倉庫	18,500	331.00	6,123,500	
乾汽船	5,900	1,152.00	6,796,800	
日本トランスシティ	22,400	534.00	11,961,600	
ケイヒン	1,800	1,338.00	2,408,400	
中央倉庫	6,300	1,195.00	7,528,500	
川西倉庫	1,900	1,042.00	1,979,800	
安田倉庫	8,400	1,042.00	8,752,800	
ファイズホールディングス	2,200	529.00	1,163,800	
東洋埠頭	3,000	1,400.00	4,200,000	
宇徳	8,500	584.00	4,964,000	
上組	58,300	2,375.00	138,462,500	
サンリツ	2,300	736.00	1,692,800	
キムラユニティー	2,700	1,142.00	3,083,400	
キユーソー流通システム	2,600	1,875.00	4,875,000	
近鉄エクスプレス	21,600	1,882.00	40,651,200	
東海運	5,700	292.00	1,664,400	
エーアイテイー	7,200	1,058.00	7,617,600	
内外トランスライン	3,600	1,387.00	4,993,200	
ショーエイコーポレーション	1,200	788.00	945,600	
日本コンセプト	3,200	1,551.00	4,963,200	
東京放送ホールディングス	64,100	1,895.00	121,469,500	
日本テレビホールディングス	87,900	1,465.00	128,773,500	
朝日放送グループホールディングス	10,400	760.00	7,904,000	
テレビ朝日ホールディングス	28,900	2,024.00	58,493,600	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	69,300	476.00	32,986,800	
テレビ東京ホールディングス	8,600	2,444.00	21,018,400	
日本ＢＳ放送	3,600	1,165.00	4,194,000	
ビジョン	9,800	1,850.00	18,130,000	
スマートバリュー	3,100	806.00	2,498,600	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,000	1,782.00	7,128,000	
ワイヤレスゲート	5,000	720.00	3,600,000	
コネクシオ	6,000	1,710.00	10,260,000	
日本通信	81,400	239.00	19,454,600	
クロップス	1,900	726.00	1,379,400	
日本電信電話	1,408,600	2,792.00	3,932,811,200	
ＫＤＤＩ	785,300	3,283.00	2,578,139,900	
ソフトバンク	957,800	1,485.50	1,422,811,900	
光通信	10,900	27,820.00	303,238,000	
ＮＴＴドコモ	778,400	3,110.00	2,420,824,000	
エムティーアイ	10,200	736.00	7,507,200	

GMOインターネット	41,500	2,239.00	92,918,500	
ファイバーゲート	2,000	1,403.00	2,806,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	711.00	2,204,100	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	28,400	2,073.00	58,873,200	
学研ホールディングス	3,500	7,370.00	25,795,000	
ゼンリン	21,000	1,731.00	36,351,000	
昭文社	5,100	392.00	1,999,200	
インプレスホールディングス	8,600	187.00	1,608,200	
東京電力ホールディングス	857,200	435.00	372,882,000	
中部電力	328,700	1,449.00	476,286,300	
関西電力	407,000	1,229.50	500,406,500	
中国電力	148,600	1,411.00	209,674,600	
北陸電力	98,300	763.00	75,002,900	
東北電力	268,500	1,020.00	273,870,000	
四国電力	96,800	1,014.00	98,155,200	
九州電力	221,400	895.00	198,153,000	
北海道電力	100,600	508.00	51,104,800	
沖縄電力	19,900	1,986.00	39,521,400	
電源開発	85,500	2,572.00	219,906,000	
エフオン	5,100	760.00	3,876,000	
イーレックス	15,300	1,815.00	27,769,500	
レノバ	17,800	1,136.00	20,220,800	
東京瓦斯	206,600	2,582.00	533,441,200	
大阪瓦斯	208,400	1,981.00	412,840,400	
東邦瓦斯	52,800	4,360.00	230,208,000	
北海道瓦斯	5,800	1,622.00	9,407,600	
広島ガス	22,600	357.00	8,068,200	
西部瓦斯	12,100	2,491.00	30,141,100	
静岡ガス	30,500	934.00	28,487,000	
メタウォーター	5,200	4,285.00	22,282,000	
アイネット	5,400	1,645.00	8,883,000	
松竹	7,000	16,650.00	116,550,000	
東宝	63,000	4,550.00	286,650,000	
エイチ・アイ・エス	16,000	3,020.00	48,320,000	
東映	3,900	16,390.00	63,921,000	
ラックランド	2,100	2,219.00	4,659,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	280,600	1,546.00	433,807,600	
共立メンテナンス	17,000	5,020.00	85,340,000	
イチネンホールディングス	11,500	1,571.00	18,066,500	
建設技術研究所	7,100	2,320.00	16,472,000	
スペース	6,700	1,258.00	8,428,600	
長　大	3,800	1,312.00	4,985,600	
アインホールディングス	14,200	6,590.00	93,578,000	
燦ホールディングス	4,500	1,433.00	6,448,500	
ピー・シー・エー	1,400	5,250.00	7,350,000	
スバル興業	600	10,120.00	6,072,000	
東京テアトル	4,100	1,386.00	5,682,600	
タナベ経営	1,900	1,284.00	2,439,600	
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,533.00	4,559,400	

ナガワ	3,300	7,880.00	26,004,000	
よみうりランド	2,200	4,510.00	9,922,000	
東京都競馬	6,700	3,310.00	22,177,000	
常磐興産	4,200	1,682.00	7,064,400	
カナモト	16,800	2,789.00	46,855,200	
東京ドーム	41,600	1,082.00	45,011,200	
ＤＴＳ	23,500	2,545.00	59,807,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,900	5,680.00	255,032,000	
シーイーシー	11,300	2,244.00	25,357,200	
カプコン	49,700	3,120.00	155,064,000	
西尾レントオール	10,400	3,035.00	31,564,000	
アイ・エス・ビー	2,000	2,168.00	4,336,000	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	67,700	33.00	2,234,100	
日本空港ビルデング	33,800	5,760.00	194,688,000	
トランス・コスモス	9,800	2,820.00	27,636,000	
乃村工藝社	44,000	1,321.00	58,124,000	
ジャステック	6,700	1,181.00	7,912,700	
ＳＣＳＫ	24,300	5,910.00	143,613,000	
藤田観光	4,500	2,796.00	12,582,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,400	1,485.00	9,504,000	
日本管財	11,000	1,969.00	21,659,000	
トーカイ	9,900	2,643.00	26,165,700	
白洋舎	1,100	2,833.00	3,116,300	
セコム	108,900	9,734.00	1,060,032,600	
日本システムウエア	3,500	2,602.00	9,107,000	
セントラル警備保障	4,900	6,120.00	29,988,000	
アイネス	10,400	1,415.00	14,716,000	
丹青社	19,400	1,318.00	25,569,200	
メイテック	12,700	6,310.00	80,137,000	
ＴＫＣ	8,900	5,250.00	46,725,000	
富士ソフト	13,500	4,380.00	59,130,000	
応用地質	11,000	1,443.00	15,873,000	
船井総研ホールディングス	21,200	2,673.00	56,667,600	
ＮＳＤ	34,600	1,772.00	61,311,200	
進学会ホールディングス	4,000	531.00	2,124,000	
丸紅建材リース	1,000	1,821.00	1,821,000	
オオバ	8,000	895.00	7,160,000	
コナミホールディングス	38,300	4,460.00	170,818,000	
いであ	1,900	2,715.00	5,158,500	
学究社	3,000	1,425.00	4,275,000	
ベネッセホールディングス	34,200	2,959.00	101,197,800	
イオンディライト	12,600	3,795.00	47,817,000	
ナック	5,700	1,021.00	5,819,700	
福井コンピュータホールディングス	4,100	3,655.00	14,985,500	
ニチイ学館	14,600	1,589.00	23,199,400	
ダイセキ	17,200	3,065.00	52,718,000	
ステップ	3,800	1,593.00	6,053,400	
日鉄物産	7,500	5,120.00	38,400,000	

泉州電業	3,200	3,490.00	11,168,000	
元気寿司	2,700	2,983.00	8,054,100	
トラスコ中山	22,000	2,794.00	61,468,000	
ヤマダ電機	322,300	573.00	184,677,900	
オートバックスセブン	39,300	1,674.00	65,788,200	
モリト	7,800	771.00	6,013,800	
アークランドサカモト	16,500	1,242.00	20,493,000	
ニトリホールディングス	45,800	17,320.00	793,256,000	
グルメ杵屋	7,600	1,217.00	9,249,200	
愛眼	8,100	249.00	2,016,900	
ケーユーホールディングス	5,400	935.00	5,049,000	
吉野家ホールディングス	34,800	2,736.00	95,212,800	
加藤産業	16,500	3,365.00	55,522,500	
北恵	2,100	928.00	1,948,800	
イノテック	6,300	1,277.00	8,045,100	
イエローハット	20,000	1,863.00	37,260,000	
松屋フーズホールディングス	5,100	4,865.00	24,811,500	
ＪＢＣＣホールディングス	7,100	1,924.00	13,660,400	
ＪＫホールディングス	9,600	726.00	6,969,600	
サガミホールディングス	14,100	1,372.00	19,345,200	
日伝	9,600	2,051.00	19,689,600	
関西スーパーマーケット	8,800	1,045.00	9,196,000	
ミロク情報サービス	9,300	3,325.00	30,922,500	
北沢産業	7,600	277.00	2,105,200	
杉本商事	5,700	2,039.00	11,622,300	
因幡電機産業	30,100	2,692.00	81,029,200	
王将フードサービス	7,800	6,650.00	51,870,000	
プレナス	11,900	1,921.00	22,859,900	
ミニストップ	7,800	1,538.00	11,996,400	
アークス	21,600	2,081.00	44,949,600	
バローホールディングス	23,400	2,059.00	48,180,600	
東テク	3,500	2,721.00	9,523,500	
ミスミグループ本社	132,500	2,982.00	395,115,000	
藤久	900	728.00	655,200	
アルテック	8,400	235.00	1,974,000	
ベルク	5,200	5,500.00	28,600,000	
大　庄	5,700	1,665.00	9,490,500	
タキヒヨー	3,000	1,885.00	5,655,000	
ファーストリテイリング	14,100	63,340.00	893,094,000	
ソフトバンクグループ	836,100	5,049.00	4,221,468,900	
蔵王産業	2,100	1,496.00	3,141,600	
スズケン	44,800	4,450.00	199,360,000	
サンドラッグ	39,800	3,985.00	158,603,000	
サックスバー　ホールディングス	9,000	911.00	8,199,000	
ジェコス	7,300	1,098.00	8,015,400	
ヤマザワ	2,000	1,658.00	3,316,000	
やまや	2,200	2,240.00	4,928,000	
グローセル	9,200	467.00	4,296,400	
ベルーナ	22,700	689.00	15,640,300	
合計	127,314,555		263,713,974,995	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,360,917,161
コール・ローン	140,441,841
株式	345,244,652,440
投資信託受益証券	815,940,135
投資証券	8,754,940,233
派生商品評価勘定	107,289,274
未収配当金	363,651,961
差入委託証拠金	2,491,070,209
流動資産合計	362,278,903,254
資産合計	362,278,903,254
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,803,728
未払解約金	571,557,000
流動負債合計	574,360,728
負債合計	574,360,728
純資産の部	
元本等	
元本	88,107,131,248
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	273,597,411,278
元本等合計	361,704,542,526
純資産合計	361,704,542,526
負債純資産合計	362,278,903,254

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年1月14日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	101,067,540,943円
同期中追加設定元本額	20,444,921,249円
同期中一部解約元本額	33,405,330,944円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,162,706,135円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,302,789円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,656,001円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	9,940,477円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	31,881,982円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	25,017,559円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	12,623,238円
たわらノーロード　先進国株式	11,809,238,051円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	150,071,838円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	1,596,535,622円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	200,508,862円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	18,782,937円
たわらノーロード　バランス（標準型）	153,344,523円
たわらノーロード　バランス（積極型）	191,257,433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）	543,342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）	61,618,843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）	150,020,802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）	108,189,218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）	197,605,673円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	62,885円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	962,323円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,165,079円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,943,824円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,194,798円
たわらノーロード　全世界株式	40,296,163円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	41,971,548,421円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	158,390,449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	890,094,905円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,074,127,877円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	121,293,280円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	351,391,297円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	303,037,953円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	28,528,935円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	792,953,460円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	188,130,353円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	210,547,152円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	158,784,063円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	276,422,391円
投資のソムリエ	1,339,864,604円
クルーズコントロール	508,131,840円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	129,857,747円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	177,362,285円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	97,150,357円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	463,021円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	3,355,822円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	6,339,563円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	61,454,097円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	661,708,981円
ワールドアセットバランス（基本コース）	439,823,625円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,692,948,609円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	985,886円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	830,800円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	503,436円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,464,149円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	11,605,153円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	485,574,541円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	139,394,788円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	148,714円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	127,023円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	127,110円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	64,132円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	58,135,690円
ＭＳＣＩコクサイ・インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（適格機関投資家限定）	260,647,287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）	85,332,913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）	2,005,373,363円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	9,251,704,867円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	205,978,288円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,613,255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）	60,719,983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）	139,335,187円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,633,928円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,694,438円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,799,444円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,904,235円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,569,194円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,798,349円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	381,320,695円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	497,918,493円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,631,582,946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）	584,384,254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）	97,183,743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）	624,789,738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）	27,858,453円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,958,579円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,944,125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）	215,784,254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）	24,850,534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）	88,595,498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）	152,634,896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）	1,099,344,567円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,166,364円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	206,560円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	242,312円
計	88,107,131,248円
２．　受益権の総数	88,107,131,248口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	50,309,168,879
投資信託受益証券	55,553,307
投資証券	861,754,954
合計	51,226,477,140

（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2年1月14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2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,322,060,164	－	1,324,852,920	△2,792,756
アメリカ・ドル	952,606,640	－	954,504,350	△1,897,710
イギリス・ポンド	74,585,242	－	74,581,150	4,092
オーストラリア・ドル	30,362,947	－	30,492,040	△129,093
カナダ・ドル	53,890,610	－	54,003,200	△112,590
ユーロ	210,614,725	－	211,272,180	△657,455
合計	1,322,060,164	－	1,324,852,920	△2,792,756

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	令和2年1月14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	5,901,082,012	－	6,008,360,314	107,278,302
合計	5,901,082,012	－	6,008,360,314	107,278,302

（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2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.1053円 (41,053円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年1月14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	32,549	1,891.300	61,559,923.700	
	ABBOTT LABORATORIES	136,553	85.120	11,623,391.360	
	AES CORP	47,598	20.310	966,715.380	
	ABIOMED INC	3,574	168.100	600,789.400	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,481	136.600	9,354,504.600	
	ADVANCED MICRO DEVICES	79,023	48.745	3,851,976.130	
	ADOBE INC	37,540	345.630	12,974,950.200	
	CHUBB LTD	35,214	150.900	5,313,792.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,359	236.860	4,111,652.740	
	ALLEGHANY CORP	1,094	791.700	866,119.800	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	124.630	754,260.760	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	119.850	410,126.700	
	ALLSTATE CORP	25,832	114.480	2,957,247.360	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,687	181.270	10,094,382.490	
	AMGEN INC	46,484	236.920	11,012,989.280	
	HESS CORP	21,367	69.300	1,480,733.100	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,474	128.540	7,002,087.960	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,277	94.630	3,716,782.510	
	AFLAC INC	57,028	52.500	2,993,970.000	
	AMERICAN INTL GROUP	68,037	52.620	3,580,106.940	
	AMERCO	585	381.270	223,042.950	
	ANALOG DEVICES	29,105	119.060	3,465,241.300	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	113.920	2,072,432.640	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	60,452	41.160	2,488,204.320	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	171.270	699,980.490	
	VALERO ENERGY CORP	31,433	96.250	3,025,426.250	
	APACHE CORP	31,470	32.010	1,007,354.700	
	ANSYS INC	6,770	264.050	1,787,618.500	
	APPLE INC	349,977	316.960	110,928,709.920	
	APPLIED MATERIALS INC	71,121	61.810	4,395,989.010	
	ALBEMARLE CORP	7,634	75.860	579,115.240	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,146	44.420	1,872,125.320	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,813	91.230	712,779.990	
AMEREN CORP	19,487	77.630	1,512,775.810	
ARROW ELECTRONICS INC	5,795	84.880	491,879.600	
AUTOLIV INC	5,913	78.340	463,224.420	
AUTODESK INC	17,235	192.450	3,316,875.750	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,493	172.360	5,772,853.480	
AUTOZONE INC	1,917	1,128.370	2,163,085.290	
AVERY DENNISON CORP	6,549	130.950	857,591.550	
BALL CORP	25,262	67.500	1,705,185.000	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,032	228.450	23,309,210.400	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,637	50.880	3,390,490.560	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,097	89.370	3,315,358.890	
BECTON DICKINSON & CO	20,772	276.200	5,737,226.400	
AMETEK INC	17,821	100.830	1,796,891.430	
VERIZON COMM INC	320,311	59.150	18,946,395.650	
WR BERKLEY CORP	12,201	68.110	831,010.110	
BEST BUY CO INC	18,720	91.260	1,708,387.200	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,524	384.140	585,429.360	
YUM! BRANDS INC	23,110	100.340	2,318,857.400	
FIRSTENERGY CORP	43,584	47.770	2,082,007.680	
BOEING CO	41,369	330.220	13,660,871.180	
ROBERT HALF INTL INC	8,324	62.480	520,083.520	
BORGWARNER INC	17,210	41.380	712,149.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,658	45.470	4,849,739.260	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,988	80.460	803,634.480	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,766	128.450	1,125,992.700	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	822.570	1,586,737.530	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	181,488	66.150	12,005,431.200	
INGREDION INC	5,305	91.910	487,582.550	
ONEOK INC	32,427	76.240	2,472,234.480	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	109.920	648,528.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	157.440	973,136.640	
SEMPRA ENERGY	21,599	151.170	3,265,120.830	
FEDEX CORP	19,368	159.280	3,084,935.040	
VERISIGN INC	8,048	211.750	1,704,164.000	
AMPHENOL CORP	22,763	109.110	2,483,670.930	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	68.080	1,659,858.480	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	7.050	883,040.700	

CSX CORP	59,540	74.690	4,447,042.600	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.190	540,041.040	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	47.720	670,466.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,052	60.990	1,222,971.480	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,820	188.440	2,415,800.800	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	50.440	1,157,598.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	49.360	1,577,644.320	
CATERPILLAR INC	43,258	146.820	6,351,139.560	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	113.440	1,119,085.600	
CITRIX SYSTEMS INC	9,464	115.140	1,089,684.960	
CENTURYLINK INC	80,424	13.090	1,052,750.160	
CERNER CORP	25,143	73.070	1,837,199.010	
JPMORGAN CHASE & CO	247,652	137.200	33,977,854.400	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	70.820	1,409,034.720	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,222	105.090	1,179,319.980	
CINTAS CORP	6,604	282.850	1,867,941.400	
CISCO SYSTEMS INC	330,940	47.970	15,875,191.800	
CLOROX COMPANY	9,876	156.200	1,542,631.200	
COCA-COLA CO/THE	314,758	56.130	17,667,366.540	
COPART INC	16,749	96.260	1,612,258.740	
COGNEX CORP	12,284	56.540	694,537.360	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,779	70.140	4,403,319.060	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,145	146.800	3,250,886.000	
COMERICA INC	11,985	68.750	823,968.750	
NRG ENERGY, INC.	21,039	36.920	776,759.880	
COMCAST CORP-CL A	351,108	45.800	16,080,746.400	
CONAGRA BRANDS INC	35,802	32.030	1,146,738.060	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,220	87.790	2,214,063.800	
CMS ENERGY CORP	22,937	63.690	1,460,857.530	
COOPER COS INC	3,936	333.550	1,312,852.800	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	13,220	55.390	732,255.800	
CORNING INC	58,376	30.400	1,774,630.400	
SEALED AIR CORP	13,870	38.640	535,936.800	
HEICO CORP-CL A	5,292	97.000	513,324.000	
CUMMINS INC	11,963	172.490	2,063,497.870	
DR HORTON INC	28,355	53.570	1,518,977.350	
DANAHER CORP	48,299	159.570	7,707,071.430	
MOODY'S CORP	12,922	251.490	3,249,753.780	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	42,370	61.160	2,591,349.200	
TARGET CORP	39,421	123.870	4,883,079.270	
DEERE & CO	23,824	174.740	4,163,005.760	
MORGAN STANLEY	95,198	52.780	5,024,550.440	
REPUBLIC SERVICES INC	18,081	91.830	1,660,378.230	
COSTAR GROUP INC	2,785	642.740	1,790,030.900	

THE WALT DISNEY CO	139,440	143.880	20,062,627.200	
DOLLAR TREE INC	18,697	90.770	1,697,126.690	
DOVER CORP	11,113	117.130	1,301,665.690	
OMNICOM GROUP	17,365	79.680	1,383,643.200	
DTE ENERGY CO	14,817	129.590	1,920,135.030	
DUKE ENERGY CORP	56,801	91.240	5,182,523.240	
FLOWSERVE CORP	9,882	49.890	493,012.980	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	113.250	1,098,525.000	
EBAY INC	63,771	34.730	2,214,766.830	
BANK OF AMERICA CORP	684,479	35.060	23,997,833.740	
CITIGROUP INC	174,672	80.650	14,087,296.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,423	76.190	717,938.370	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,104	46.760	799,783.040	
EATON CORP PLC	31,818	94.860	3,018,255.480	
EATON VANCE CORP	9,184	47.550	436,699.200	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	73.390	1,660,668.920	
DISH NETWORK CORP	17,749	36.060	640,028.940	
ECOLAB INC	20,479	191.410	3,919,885.390	
PERKINELMER INC	8,338	100.630	839,052.940	
ELECTRONIC ARTS INC	22,491	109.820	2,469,961.620	
SALESFORCE.COM INC	64,404	183.850	11,840,675.400	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	165.580	371,395.940	
EMERSON ELECTRIC CO	46,705	77.390	3,614,499.950	
ATMOS ENERGY CORP	8,650	112.540	973,471.000	
ENTERGY CORP	15,031	121.520	1,826,567.120	
EOG RESOURCES INC	44,603	85.520	3,814,448.560	
EQUIFAX INC	9,161	148.590	1,361,232.990	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,346	213.470	3,702,850.620	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,515	77.615	971,351.720	
EXXON MOBIL CORP	327,609	69.800	22,867,108.200	
FMC CORP	10,209	98.870	1,009,363.830	
NEXTERA ENERGY INC	37,404	246.400	9,216,345.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,875	266.990	767,596.250	
ASSURANT INC	4,594	132.470	608,567.180	
FASTENAL CO	45,891	36.590	1,679,151.690	
FIFTH THIRD BANCORP	58,144	29.860	1,736,179.840	
M&T BANK CORP	9,999	166.850	1,668,333.150	
FISERV INC	44,349	118.530	5,256,686.970	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	54.540	633,918.420	
FORD MOTOR CO	310,836	9.240	2,872,124.640	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	25.510	604,918.630	
FREEPORT-MCMORAN INC	114,993	13.530	1,555,855.290	
FLEX LTD	35,127	13.190	463,325.130	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	95.370	1,360,929.900	
GAP INC/THE	18,295	17.980	328,944.100	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	58.110	1,068,410.460	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,821	181.130	3,409,047.730	
GENERAL MILLS INC	46,141	53.060	2,448,241.460	

GENUINE PARTS CO	11,605	99.700	1,157,018.500	
GILEAD SCIENCES INC	97,831	64.310	6,291,511.610	
GARTNER INC	7,384	160.930	1,188,307.120	
MCKESSON CORP	14,558	143.650	2,091,256.700	
NVIDIA CORP	44,712	251.980	11,266,529.760	
GENERAL ELECTRIC CO	674,757	12.120	8,178,054.840	
WW GRAINGER INC	3,762	344.440	1,295,783.280	
HALLIBURTON CO	66,843	23.750	1,587,521.250	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,728	65.530	2,144,665.840	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,900	245.210	6,105,729.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	35.370	456,308.370	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,586	212.600	3,738,783.600	
HASBRO INC	9,473	104.860	993,338.780	
HENRY SCHEIN INC	11,516	66.220	762,589.520	
HEICO CORP	2,278	122.130	278,212.140	
HERSHEY FOODS CORP	11,292	149.690	1,690,299.480	
HP INC	117,482	21.460	2,521,163.720	
F5 NETWORKS INC	4,874	136.200	663,838.800	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	72.520	759,429.440	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	24.540	685,623.060	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	48.330	572,952.150	
HOLOGIC INC	19,688	52.910	1,041,692.080	
UNUM GROUP	15,185	29.030	440,820.550	
HOME DEPOT INC	84,667	223.340	18,909,527.780	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,185	88.270	1,163,839.950	
HORMEL FOODS CORP	24,161	45.900	1,108,989.900	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	26.280	990,177.840	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	245.670	715,636.710	
HUMANA INC	10,384	356.880	3,705,841.920	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,000	118.500	711,000.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	14.460	1,149,815.820	
BIOGEN INC	14,119	293.900	4,149,574.100	
IDEX CORP	6,154	173.340	1,066,734.360	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,755	179.820	4,451,444.100	
INTUIT INC	20,054	276.040	5,535,706.160	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	282.290	1,917,031.390	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	62.780	688,068.800	
INGERSOLL-RAND PLC	18,244	131.350	2,396,349.400	
INTEL CORP	342,807	59.590	20,427,869.130	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	127.360	1,014,422.400	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	44.440	1,307,024.840	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	23.360	674,216.320	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,108	91.140	921,243.120	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	147.190	885,936.610	
INCYTE CORP	13,798	77.100	1,063,825.800	
JOHNSON & JOHNSON	204,338	145.700	29,772,046.600	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,753	59.500	1,710,803.500	
KLA CORPORATION	12,724	175.100	2,227,972.400	
DEVON ENERGY CORP	33,312	25.360	844,792.320	
KELLOGG CO	19,181	69.710	1,337,107.510	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	47.390	547,828.400	
KEYCORP	79,497	19.480	1,548,601.560	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,125	140.900	3,681,012.500	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,929	523.110	4,670,849.190	
KOHLS CORP	11,910	46.310	551,552.100	
KROGER CO	63,944	28.420	1,817,288.480	
LAM RESEARCH CORP	11,139	297.290	3,311,513.310	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,716	369.880	1,004,594.080	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	107.340	766,729.620	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	94.680	1,254,888.720	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	50.510	551,973.280	
LENNAR CORP	22,753	60.550	1,377,694.150	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	21.820	453,746.900	
ELI LILLY & CO	67,242	138.940	9,342,603.480	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	59.170	907,904.480	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	53,913	116.750	6,294,342.750	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,662	87.460	2,069,478.520	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,676	419.020	8,244,637.520	
LOEWS CORP	21,759	52.100	1,133,643.900	
LOWE'S COS INC	59,941	121.050	7,255,858.050	
DOMINION ENERGY INC	63,796	82.050	5,234,461.800	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	33.370	1,287,181.010	
MCCORMICK & CO INC	9,935	165.300	1,642,255.500	
MCDONALD'S CORPORATION	58,712	206.510	12,124,615.120	
S&P GLOBAL INC	19,018	294.240	5,595,856.320	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	275.960	859,339.440	
MANPOWERGROUP INC	4,555	97.170	442,609.350	
MARKEL CORPORATION	1,065	1,169.170	1,245,166.050	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,561	233.400	3,865,337.400	
MARSH & MCLENNAN COS	38,872	112.000	4,353,664.000	
MASCO CORP	21,216	47.760	1,013,276.160	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	272.150	1,302,509.900	
METLIFE INC	61,260	52.580	3,221,050.800	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	61.835	1,322,403.310	
MEDTRONIC PLC	103,771	118.010	12,246,015.710	
ACTIVISION BLIZZARD INC	60,243	59.240	3,568,795.320	
CVS HEALTH CORP	100,451	72.760	7,308,814.760	
MERCK & CO.INC.	198,319	89.510	17,751,533.690	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	25.320	827,609.520	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	179.220	1,442,541.780	
MICROSOFT CORP	561,788	163.280	91,728,744.640	
MICRON TECH INC	84,794	57.450	4,871,415.300	
MIDDLEBY CORP	4,188	109.990	460,638.120	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,473	111.210	2,054,382.330	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	27.520	1,340,636.800	
3M CO	44,296	180.920	8,014,032.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	129.920	646,481.920	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,593	170.870	2,151,765.910	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	160.150	1,219,382.100	
MYLAN NV	43,574	20.780	905,467.720	
ILLUMINA INC	11,619	323.150	3,754,679.850	
XCEL ENERGY INC	38,963	63.370	2,469,085.310	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,545	103.070	674,593.150	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	27,194	23.580	641,234.520	
NETAPP INC	17,963	64.110	1,151,607.930	
NEWELL BRANDS INC	33,317	19.570	652,013.690	
NEWMONT CORP	63,869	42.450	2,711,239.050	
NVR INC	263	3,809.510	1,001,901.130	
NIKE INC-CL B	96,700	102.160	9,878,872.000	
NOBLE ENERGY INC	39,436	22.260	877,845.360	
NORDSTROM INC	9,487	41.670	395,323.290	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,260	200.280	4,057,672.800	
EVERSOURCE ENERGY	24,768	85.150	2,108,995.200	
NISOURCE INC	31,548	27.860	878,927.280	
TAPESTRY INC	21,790	28.100	612,299.000	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	108.680	1,734,424.120	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,194	376.830	4,595,065.020	
WELLS FARGO & CO	323,987	52.110	16,882,962.570	
NUCOR CORP	24,042	53.370	1,283,121.540	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	63.950	1,226,241.250	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,969	101.910	3,665,600.790	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,550	46.570	3,238,943.500	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	200.610	1,044,977.490	
OGE ENERGY CORP	16,028	44.690	716,291.320	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,822	435.500	2,535,481.000	
ORACLE CORP	180,697	54.580	9,862,442.260	
PACCAR INC	27,394	78.060	2,138,375.640	
PTC INC	7,766	77.220	599,690.520	
EXELON CORP	73,721	46.190	3,405,172.990	
PARKER HANNIFIN CORP	10,092	208.080	2,099,943.360	
PAYCHEX INC	25,329	86.260	2,184,879.540	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,163	298.070	1,837,005.410	
PPL CORPORATION	53,724	35.430	1,903,441.320	
PEPSICO INC	108,292	136.530	14,785,106.760	
PENTAIR PLC	12,511	45.950	574,880.450	
PFIZER INC	428,075	39.410	16,870,435.750	
AQUA AMERICA INC	15,516	47.600	738,561.600	
CONOCOPHILLIPS	85,896	65.130	5,594,406.480	
PVH CORP	5,205	100.250	521,801.250	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,908	146.780	1,894,636.240	
ALTRIA GROUP INC	144,297	50.760	7,324,515.720	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,494	159.440	5,499,723.360	
BROWN & BROWN INC	17,294	40.380	698,331.720	
POLARIS INC	4,095	94.640	387,550.800	
GARMIN LTD	10,774	97.590	1,051,434.660	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	129.220	2,459,185.820	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	137.080	357,504.640	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,984	299.870	10,190,782.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,483	131.030	2,421,827.490	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	106.560	1,159,692.480	
PROCTER & GAMBLE CO	193,908	124.880	24,215,231.040	
PROGRESSIVE CORP	46,127	74.920	3,455,834.840	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,039	58.250	2,274,021.750	
PULTE GROUP INC	21,209	40.430	857,479.870	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,692	193.300	4,579,663.600	
QUALCOMM INC	93,982	90.970	8,549,542.540	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	93.840	974,809.920	
EXACT SCIENCES CORP	11,306	90.160	1,019,348.960	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,161	190.240	601,348.640	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,116	378.930	2,317,535.880	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	157.330	793,257.860	

RESMED INC	11,116	158.270	1,759,329.320	
US BANCORP	115,614	56.710	6,556,469.940	
SEATTLE GENETICS INC /WA	9,150	105.470	965,050.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	43.690	1,376,235.000	
ROSS STORES INC	28,814	119.970	3,456,815.580	
ROLLINS INC	12,378	34.980	432,982.440	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,949	374.090	2,973,641.410	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,251	206.580	1,911,071.580	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	133.110	1,873,523.250	
RPM INTERNATIONAL INC	11,141	74.220	826,885.020	
RAYTHEON COMPANY	21,972	227.150	4,990,939.800	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	112.420	432,592.160	
ACCENTURE PLC-CL A	49,357	209.590	10,344,733.630	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,385	54.590	6,080,507.150	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,190	205.000	2,088,950.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,563	136.260	2,665,654.380	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	47,412	142.730	6,767,114.760	
BOOKING HOLDINGS INC	3,283	2,080.500	6,830,281.500	
SCHLUMBERGER LTD	106,593	39.230	4,181,643.390	
SCHWAB (CHARLES) CORP	89,867	48.020	4,315,413.340	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,590	149.020	2,323,221.800	
BUNGE LTD	10,622	55.780	592,495.160	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	66.170	704,909.010	
ANTHEM INC	19,728	296.740	5,854,086.720	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	86.150	1,098,326.350	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	56.050	1,242,908.750	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,367	574.860	3,660,133.620	
CENTENE CORP	33,216	63.400	2,105,894.400	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	253.850	1,026,569.400	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	271.090	1,694,854.680	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	48.540	550,977.540	
ACUITY BRANDS INC	3,087	120.300	371,366.100	
SNAP-ON INC	3,981	167.480	666,737.880	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,388	95.070	2,984,057.160	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	145.260	769,442.220	
EDISON INTERNATIONAL	26,652	75.370	2,008,761.240	
SOUTHERN CO	80,067	64.540	5,167,524.180	
TRUIST FINANCIAL CORP	103,681	56.220	5,828,945.820	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	53.990	612,894.480	
AT&T INC	565,686	38.100	21,552,636.600	
CHEVRON CORP	147,108	116.660	17,161,619.280	

STANLEY BLACK & DECKER INC	11,776	165.300	1,946,572.800	
STATE STREET CORP	29,590	82.080	2,428,747.200	
STARBUCKS CORP	92,312	91.080	8,407,776.960	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	33.250	583,437.750	
STRYKER CORP	25,850	206.890	5,348,106.500	
NETFLIX INC	33,860	338.920	11,475,831.200	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	26.600	1,302,203.000	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	37.450	366,747.850	
SYNOPSYS INC	11,855	149.930	1,777,420.150	
SYSCO CORP	38,229	83.720	3,200,531.880	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,850	603.120	5,337,612.000	
TELEFLEX INC	3,455	378.180	1,306,611.900	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	9.170	809,912.740	
TERADYNE INC	12,162	69.270	842,461.740	
TEXAS INSTRUMENTS INC	72,056	129.950	9,363,677.200	
TEXTRON INC	16,304	45.040	734,332.160	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,995	332.020	10,290,959.900	
TIFFANY & CO	8,733	133.860	1,168,999.380	
GLOBE LIFE INC	7,282	104.090	757,983.380	
DAVITA INC	8,159	76.920	627,590.280	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	90.390	865,303.470	
TRIMBLE INC	20,073	42.770	858,522.210	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,851	309.620	882,726.620	
TYSON FOODS INC	22,736	93.460	2,124,906.560	
UGI CORP	14,797	44.360	656,394.920	
MARATHON OIL CORP	58,418	13.190	770,533.420	
UNION PACIFIC CORP	54,482	179.900	9,801,311.800	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	63,451	152.050	9,647,724.550	
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,307	285.850	20,954,805.950	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	144.880	891,446.640	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	146.440	1,058,175.440	
VF CORP	26,750	95.930	2,566,127.500	
VIACOMCBS INC	45,361	40.800	1,850,728.800	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,829	226.490	4,491,070.210	
VULCAN MATERIALS CO	9,794	142.220	1,392,902.680	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,250	54.060	3,257,115.000	
WALMART INC	110,464	115.880	12,800,568.320	
WASTE MANAGEMENT INC	32,300	117.660	3,800,418.000	
WATERS CORP	5,468	228.820	1,251,187.760	
ALLERGAN PLC	25,262	191.380	4,834,641.560	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,240	155.940	817,125.600	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	105.240	965,682.240	
VAIL RESORTS INC	3,109	254.780	792,111.020	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	69.130	1,560,056.710	
WABTEC CORP	14,964	78.440	1,173,776.160	
WHIRLPOOL CORP	4,614	152.780	704,926.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	124.510	1,730,938.020	
WYNN RESORTS LTD	7,970	147.210	1,173,263.700	
NASDAQ INC	9,020	107.090	965,951.800	
CME GROUP INC	27,673	204.140	5,649,166.220	
WILLIAMS COS INC	90,718	23.780	2,157,274.040	
LKQ CORP	22,196	34.130	757,549.480	
ALLIANT ENERGY CORP	17,221	55.580	957,143.180	
WEC ENERGY GROUP INC	23,839	93.650	2,232,522.350	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	50.270	1,096,891.400	
CARMAX INC	12,081	91.030	1,099,733.430	
XILINX INC	18,997	98.950	1,879,753.150	
TJX COMPANIES INC	93,010	62.520	5,814,985.200	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,128	248.580	1,026,138.240	
ZIONS BANCORP NA	13,142	51.020	670,504.840	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	5.690	155,906.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	5.660	432,424.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	55.830	876,531.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	31.110	531,981.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,178	114.650	937,607.700	
SIGNATURE BANK	4,171	137.640	574,096.440	
CBRE GROUP INC	23,613	60.660	1,432,364.580	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	20.765	264,379.980	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	3,819	332.460	1,269,664.740	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	16.440	1,257,331.200	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	284.000	924,704.000	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	68.920	206,760.000	
T-MOBILE US INC	25,675	79.400	2,038,595.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	72.160	2,003,089.440	
MOSAIC CO/THE	28,249	21.050	594,641.450	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,892	368.600	1,065,991.200	
CELANESE CORP	10,326	118.130	1,219,810.380	
DEXCOM INC	7,216	235.840	1,701,821.440	
DISCOVERY INC-A	10,423	31.790	331,347.170	
EXPEDIA GROUP INC	11,527	110.590	1,274,770.930	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	45.340	837,656.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,312	169.730	1,750,255.760	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	20.000	680,460.000	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,248	95.030	4,204,887.440	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	20.170	296,418.320	
LIVE NATION	11,339	72.360	820,490.040	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,040	863.000	1,760,520.000	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	86.890	391,700.120	
TRANSDIGM GROUP INC	3,681	604.570	2,225,422.170	
MASTERCARD INC	69,914	315.210	22,037,591.940	
HANESBRANDS INC	27,619	14.140	390,532.660	
WESTERN UNION CO	35,222	26.500	933,383.000	
OWENS CORNING	7,756	65.070	504,682.920	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	101.150	1,124,079.950	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	61.290	539,781.030	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,067	67.760	478,859.920	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	23.840	413,624.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	128.490	1,179,024.240	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,545	16.425	485,276.620	
DELTA AIR LINES INC	11,158	59.490	663,789.420	
INSULET CORP	4,781	184.450	881,855.450	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	33.400	201,669.200	
DISCOVER FINANCIAL	23,978	82.880	1,987,296.640	
TE CONNECTIVITY LTD	25,641	97.920	2,510,766.720	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	88.800	1,418,136.000	
WABCO HOLDING INC	4,076	135.520	552,379.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,255	245.180	2,023,960.900	
VMWARE INC	6,532	152.000	992,864.000	
MERCADOLIBRE INC	3,500	691.100	2,418,850.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	275.700	1,261,878.900	
INVESCO LTD	33,443	18.060	603,980.580	
MSCI INC	6,714	271.990	1,826,140.860	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	120,348	87.820	10,568,961.360	
VISA INC	133,771	195.330	26,129,489.430	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	123.740	1,798,684.640	
DISCOVERY INC-C	30,421	29.810	906,850.010	

MARATHON PETROLEUM CORP	51,474	59.620	3,068,879.880	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	68.100	791,594.400	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	160,064	21.550	3,449,379.200	
XYLEM INC	13,237	81.280	1,075,903.360	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	91.200	1,903,891.200	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	274.820	956,098.780	
SPLUNK INC	11,194	156.460	1,751,413.240	
EPAM SYSTEMS INC	4,023	228.560	919,496.880	
HCA HEALTHCARE INC	20,649	147.160	3,038,706.840	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	158.020	1,946,806.400	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	145.850	623,217.050	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	299.400	2,061,369.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	12,453	115.450	1,437,698.850	
NXP SEMICONDUCTOR NV	21,318	131.980	2,813,549.640	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	9,833	78.410	771,005.530	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	40.160	764,566.080	
LEAR CORP	4,681	136.230	637,692.630	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	115.090	992,305.980	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	62.610	1,081,149.480	
DOLLAR GENERAL CORP	20,252	154.120	3,121,238.240	
FORTINET INC	11,150	116.690	1,301,093.500	
AON PLC	18,189	209.070	3,802,774.230	
TESLA INC	10,548	524.860	5,536,223.280	
GENERAL MOTORS CO	100,695	34.980	3,522,311.100	
XPO LOGISTICS INC	7,614	79.480	605,160.720	
TRIPADVISOR INC	9,263	30.610	283,540.430	
ALLY FINANCIAL INC	31,871	30.010	956,448.710	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	36.340	441,094.920	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	62.350	640,521.550	
APTIV PLC	18,920	88.870	1,681,420.400	
PHILLIPS 66	34,235	105.300	3,604,945.500	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,885	113.370	667,182.450	
FACEBOOK INC	186,156	221.910	41,309,877.960	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	158.150	2,127,591.950	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,424	90.480	1,033,643.520	
SERVICENOW INC	14,406	303.850	4,377,263.100	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,272	240.920	1,751,970.240	
WORKDAY INC	12,224	181.920	2,223,790.080	
ABBVIE INC	114,434	88.520	10,129,697.680	
ZOETIS INC	36,825	136.510	5,026,980.750	

NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	57.840	977,438.160	
COTY INC	23,813	10.460	249,083.980	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	14.570	440,931.910	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	40.040	563,563.000	
CDW CORP	11,406	143.350	1,635,050.100	
SPRINT CORP	63,882	4.890	312,382.980	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	27.390	279,350.610	
ARCONIC INC	30,749	29.450	905,558.050	
TWILIO INC	9,190	120.340	1,105,924.600	
SNAP INC	57,130	18.000	1,028,340.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,304	45.600	652,262.400	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	47.910	239,837.460	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	48.240	685,249.200	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	18.040	277,996.400	
OKTA INC	8,816	131.160	1,156,306.560	
BLACK KNIGHT INC	12,700	66.020	838,454.000	
BAKER HUGHES CO	51,005	24.410	1,245,032.050	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,669	91.230	973,332.870	
ALTICE USA INC-A	13,887	28.970	402,306.390	
TECHNIPFMC LTD	31,257	21.340	667,024.380	
BROADCOM INC	30,762	301.180	9,264,899.160	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,725	186.690	1,068,800.250	
MONGODB INC	3,423	152.910	523,410.930	
BURLINGTON STORES INC	5,095	231.320	1,178,575.400	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29,578	28.410	840,310.980	
VEEVA SYSTEMS INC	9,733	148.660	1,446,907.780	
TWITTER INC	57,562	32.690	1,881,701.780	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	52.030	687,524.420	
EVERGY INC	18,388	65.230	1,199,449.240	
ALLEGION PLC	7,469	124.650	931,010.850	
STERIS PLC	6,658	151.540	1,008,953.320	
DOCUSIGN INC	7,220	74.150	535,363.000	
WIX.COM LTD	4,000	142.430	569,720.000	
DROPBOX INC	17,573	17.860	313,853.780	
KKR & CO INC	37,307	30.000	1,119,210.000	
PERRIGO CO PLC	10,553	50.540	533,348.620	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,655	109.290	2,257,384.950	
ARAMARK	18,144	45.130	818,838.720	
CIGNA CORP	29,083	203.510	5,918,681.330	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	49.830	645,796.800	
DOW INC	56,434	52.350	2,954,319.900	
AMCOR PLC	130,000	10.690	1,389,700.000	
PINTEREST INC	13,183	19.620	258,650.460	
XEROX HOLDINGS CORP	17,455	37.040	646,533.200	

FOX CORP-A	26,257	36.990	971,246.430	
FOX CORP-B	13,009	36.300	472,226.700	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,312	34.140	454,471.680	
CORTEVA INC	59,322	28.580	1,695,422.760	
BLACKSTONE GROUP INC	50,889	58.430	2,973,444.270	
GRUBHUB INC	8,158	53.690	438,003.020	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,923	295.430	1,158,971.890	
SABRE CORP	19,809	22.480	445,306.320	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	211.150	937,717.150	
IHS MARKIT LTD	29,796	79.930	2,381,594.280	
FNF GROUP	21,372	46.320	989,951.040	
SYNCHRONY FINANCIAL	43,986	35.410	1,557,544.260	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	39.860	1,427,785.200	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	141.000	487,437.000	
CDK GLOBAL INC	9,969	56.420	562,450.980	
WAYFAIR INC	5,091	101.000	514,191.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,954	101.800	1,420,517.200	
QORVO INC	8,871	115.740	1,026,729.540	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,888	34.670	585,506.960	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	130.210	1,081,654.470	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	31.220	531,301.960	
GODADDY INC	12,328	72.660	895,752.480	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	19.860	520,411.440	
TRANSUNION	15,000	91.180	1,367,700.000	
SQUARE INC	26,487	68.660	1,818,597.420	
DUPONT DE NEMOURS INC	58,757	60.400	3,548,922.800	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	51.170	988,655.570	
WESTROCK CO	18,284	42.530	777,618.520	
KRAFT HEINZ CO	51,163	31.160	1,594,239.080	
FORTIVE CORP	22,500	78.800	1,773,000.000	
MATCH GROUP INC	4,599	89.580	411,978.420	
WASTE CONNECTIONS INC	20,417	95.060	1,940,840.020	
ALPHABET INC-CL A	23,132	1,440.030	33,310,773.960	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	104,040	15.550	1,617,822.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	86,404	115.280	9,960,653.120	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	35,471	26.130	926,857.230	
DXC TECHNOLOGY CO	20,848	35.550	741,146.400	
ZILLOW GROUP INC-C	8,166	46.580	380,372.280	
ALPHABET INC-CL C	24,252	1,439.230	34,904,205.960	
BEIGENE LTD ADR	3,159	163.800	517,444.200	
LINDE PLC	41,798	211.800	8,852,816.400	
ATHENE HOLDING LTD	11,847	47.860	566,997.420	

	ROKU INC	6,674	133.930	893,848.820	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	11,986	510.150	6,114,657.900	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	22.530	675,900.000	
アメリカ・ドル　小計		23,278,667		2,171,093,076.830 (239,167,613,342)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	9.708	308,694.980	
	ASHTEAD GROUP	36,689	24.690	905,851.410	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	25.180	458,704.060	
	BHP GROUP PLC	161,284	18.046	2,910,531.060	
	BARCLAYS PLC	1,342,831	1.816	2,438,581.090	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	7.684	632,262.570	
	BT GROUP PLC	630,777	1.894	1,194,691.630	
	BUNZL PLC	27,838	20.810	579,308.780	
	EASYJET PLC	13,628	14.920	203,329.760	
	AVIVA PLC	314,691	4.116	1,295,268.150	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	51.150	531,499.650	
	DIAGEO PLC	182,812	32.325	5,909,397.900	
	SCHRODERS PLC	10,932	32.600	356,383.200	
	DCC PLC	7,898	65.440	516,845.120	
	NATIONAL GRID PLC	264,642	9.413	2,491,075.140	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.140	354,555.200	
	BAE SYSTEMS PLC	248,672	6.140	1,526,846.080	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	177,272	34.950	6,195,656.400	
	HALMA PLC	27,901	21.150	590,106.150	
	NEXT PLC	10,018	67.280	674,011.040	
	IMPERIAL BRANDS PLC	71,656	19.724	1,413,342.940	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	29.830	447,957.110	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,981	21.855	1,726,129.750	
	COMPASS GROUP PLC	119,560	19.300	2,307,508.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,561,212	5.908	9,223,640.490	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	452,758	3.022	1,368,234.670	
	CENTRICA PLC	471,340	0.875	412,422.500	
	UNILEVER PLC	85,586	43.430	3,716,999.980	
	MEGGITT PLC	62,181	6.972	433,525.930	
	MORRISON SUPERMARKETS	168,676	1.889	318,628.960	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	9.710	529,068.770	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.652	457,043.320	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,547	25.750	657,835.250	
	PEARSON PLC	65,009	6.256	406,696.300	
	PERSIMMON PLC	26,085	27.350	713,424.750	
	PRUDENTIAL PLC	204,940	14.715	3,015,692.100	
	RIO TINTO PLC	87,436	45.550	3,982,709.800	

VODAFONE GROUP PLC	2,043,718	1.516	3,098,276.480	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,464	60.880	3,315,768.320	
RELX PLC	147,523	19.465	2,871,535.190	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	4.517	635,166.980	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	6.756	940,894.600	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	2.320	922,046.880	
ST JAMES'S PLACE PLC	37,685	11.200	422,072.000	
SSE PLC	74,684	14.445	1,078,810.380	
BP PLC	1,574,009	4.971	7,824,398.730	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	7.358	640,962.730	
SMITHS GROUP PLC	31,720	17.470	554,148.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	90.150	497,447.700	
STANDARD CHARTERED PLC	218,329	7.140	1,558,869.060	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,393,991	0.587	3,166,272.710	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	2.020	509,619.740	
TESCO PLC	757,316	2.486	1,882,687.570	
3I GROUP PLC	76,643	11.035	845,755.500	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	18.690	1,271,424.630	
GLAXOSMITHKLINE PLC	386,219	18.092	6,987,474.140	
WEIR GROUP	19,161	15.090	289,139.490	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,660	75.660	1,865,775.600	
WPP PLC	95,148	10.625	1,010,947.500	
ASTRAZENECA PLC	101,556	76.500	7,769,034.000	
WHITBREAD PLC	9,814	47.100	462,239.400	
CARNIVAL PLC	13,350	35.620	475,527.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.895	334,903.350	
INTERTEK GROUP PLC	12,083	58.480	706,613.840	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	22.420	710,400.120	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,460	50.510	629,354.600	
ITV PLC	254,308	1.477	375,612.910	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.205	302,559.070	
G4S PLC	122,250	2.055	251,223.750	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	23.060	366,492.580	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	8,233	48.480	399,135.840	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	333,687	22.680	7,568,021.160	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	286,367	22.800	6,529,167.600	
TUI AG-DI	29,824	9.200	274,380.800	
AVEVA GROUP PLC	5,704	48.300	275,503.200	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	201,144	3.120	627,569.280	
EXPERIAN PLC	69,842	25.660	1,792,145.720	

	MONDI PLC	39,767	16.730	665,301.910	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	18.300	382,964.100	
	OCADO GROUP PLC	31,011	12.800	396,940.800	
	INFORMA PLC	102,475	8.434	864,274.150	
	GLENCORE PLC	866,421	2.423	2,099,338.080	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	9.226	457,775.660	
	EVRAZ PLC	48,765	4.125	201,155.620	
	NMC HEALTH PLC	8,149	12.565	102,392.180	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.287	370,425.170	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	26.800	407,574.400	
	FERGUSON PLC	17,128	71.660	1,227,392.480	
	M&G PLC	204,940	2.426	497,184.440	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,086	8.408	269,779.080	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	10.874	283,811.400	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.750	439,001.000	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	2.363	861,868.800	
イギリス・ポンド　小計		23,261,639		142,771,017.810 (20,439,098,910)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	79,754	28.800	2,296,915.200	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	106,399	24.780	2,636,567.220	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	560.000	985,600.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.700	1,603,503.800	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	16.210	800,952.310	
	NICE LTD	4,902	564.600	2,767,669.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	92.840	969,620.960	
	AZRIELI GROUP	2,291	256.400	587,412.400	
イスラエル・シュケル　小計		357,095		12,648,241.090 (402,087,584)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,432	74.680	928,421.760	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,180	25.010	5,456,681.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	265,407	24.590	6,526,358.130	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	10.790	1,247,992.980	
	TELSTRA CORP LTD	296,965	3.840	1,140,345.600	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.040	391,700.560	
	AMP LTD	302,414	1.870	565,514.180	
	ASX LTD	15,573	82.020	1,277,297.460	
	BHP GROUP LTD	228,136	39.530	9,018,216.080	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	35.440	742,326.240	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,867	4.380	65,117.460	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	17.550	667,602.000	

CSL LIMITED	35,166	294.500	10,356,387.000	
REA GROUP LTD	4,119	109.340	450,371.460	
TRANSURBAN GROUP	206,475	15.490	3,198,297.750	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	11.580	562,799.580	
COCHLEAR LTD	4,381	232.150	1,017,049.150	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	8.580	1,139,938.800	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,026	82.480	11,301,904.480	
BORAL LIMITED	86,101	4.880	420,172.880	
RIO TINTO LIMITED	28,081	102.080	2,866,508.480	
APA GROUP	94,106	11.340	1,067,162.040	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	35.660	1,616,218.180	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	7.650	1,381,383.450	
TPG TELECOM LTD	28,719	6.910	198,448.290	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	44.520	145,803.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	29.370	996,406.620	
ORICA LTD	27,865	22.610	630,027.650	
CIMIC GROUP LTD	8,709	32.510	283,129.590	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	18.370	789,432.380	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	15.490	572,216.090	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.760	745,738.800	
MACQUARIE GROUP LTD	24,765	139.500	3,454,717.500	
WORLEY LTD	27,772	15.910	441,852.520	
SUNCORP GROUP LTD	104,783	13.260	1,389,422.580	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	24.930	5,644,675.530	
NEWCREST MINING LTD	62,080	30.750	1,908,960.000	
OIL SEARCH LTD	105,470	7.790	821,611.300	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.240	442,020.240	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	7.020	437,219.640	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	13.140	1,416,754.800	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	8.290	378,911.030	
SANTOS LTD	132,862	8.830	1,173,171.460	
SONIC HEALTHCARE	34,684	30.330	1,051,965.720	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	4,466	21.820	97,448.120	
TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	4.690	696,629.150	
WESFARMERS LTD	86,051	43.600	3,751,823.600	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.290	422,763.770	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	75,944	35.430	2,690,695.920	
WOOLWORTHS GROUP LTD	95,647	37.430	3,580,067.210	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	62.390	623,588.050	
SEEK LTD	25,899	23.180	600,338.820	

	AUSNET SERVICES	165,066	1.735	286,389.510	
	AGL ENERGY LTD	49,644	20.470	1,016,212.680	
	BRAMBLES LTD	126,693	12.070	1,529,184.510	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.320	404,847.520	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.500	825,825.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	17.020	981,492.340	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	3.220	666,250.200	
	SOUTH32 LTD(AUD)	357,525	2.790	997,494.750	
	COLES GROUP LTD	81,608	15.470	1,262,475.760	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	24.650	197,200.000	
オーストラリア・ドル　小計		5,776,333		106,958,979.150 (8,134,230,364)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,302	75.940	1,237,973.880	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	68,496	43.050	2,948,752.800	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	22.780	3,210,909.340	
	ATCO LTD	7,193	50.220	361,232.460	
	BANK OF MONTREAL	50,286	102.200	5,139,229.200	
	BANK OF NOVA SCOTIA	94,561	72.280	6,834,869.080	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,548	72.470	1,851,463.560	
	BCE INC	11,673	60.920	711,119.160	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	68,751	77.910	5,356,390.410	
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,415	36.690	749,026.350	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.780	269,874.700	
	SAPUTO INC	18,601	39.230	729,717.230	
	BLACKBERRY LTD	39,652	8.700	344,972.400	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	36,321	18.830	683,924.430	
	CGI INC	18,686	112.660	2,105,164.760	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	56.910	645,359.400	
	CAE INC	23,000	38.750	891,250.000	
	CAMECO CORP	32,627	11.860	386,956.220	
	ROGERS COMM-CL B	27,696	64.910	1,797,747.360	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,111	108.150	3,689,104.650	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,493	41.370	3,785,065.410	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	141.710	688,994.020	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	39.530	360,474.070	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,493	121.900	6,764,596.700	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	37.470	596,185.170	
	OPEN TEXT CORP	21,795	60.020	1,308,135.900	
	EMPIRE CO LTD	15,093	30.460	459,732.780	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	5.690	567,526.290	
	FORTIS INC	32,312	55.010	1,777,483.120	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	13.280	734,330.880	

TELUS CORP	15,945	50.360	802,990.200	
GREAT WEST LIFECO INC	20,722	33.800	700,403.600	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	35.060	755,262.520	
ENBRIDGE INC	156,599	52.530	8,226,145.470	
IGM FINANCIAL INC	2,953	38.810	114,605.930	
MANULIFE FINANCIAL CORP	147,054	27.550	4,051,337.700	
LOBLAW CO LTD	15,354	66.990	1,028,564.460	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,909	69.250	1,655,698.250	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,241	62.550	2,767,274.550	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	610.800	1,265,577.600	
METRO INC	19,949	53.980	1,076,847.020	
HUSKY ENERGY INC	28,749	9.730	279,727.770	
EMERA INC	19,138	56.830	1,087,612.540	
METHANEX CORP	5,281	50.950	269,066.950	
ONEX CORP	6,646	87.850	583,851.100	
POWER CORP OF CANADA	23,792	33.250	791,084.000	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	34.630	750,639.880	
QUEBECOR INC-B	11,331	32.730	370,863.630	
ROYAL BANK OF CANADA	111,311	104.710	11,655,374.810	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,747	342.740	3,683,426.780	
SHAW COMM INC-B	35,431	26.400	935,378.400	
SUNCOR ENERGY INC	119,141	44.400	5,289,860.400	
LUNDIN MINING CORP	43,480	8.020	348,709.600	
ENCANA CORP	96,391	5.680	547,500.880	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	20.630	846,160.080	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	99.400	1,629,563.600	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	140,924	73.140	10,307,181.360	
TC ENERGY CORP	71,704	68.770	4,931,084.080	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	58.250	331,792.000	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	103.350	639,116.400	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	144.310	1,585,822.590	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	35.840	1,253,073.920	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,565	1,369.560	2,143,361.400	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	132.310	1,974,329.820	
CI FINANCIAL CORP	20,695	23.100	478,054.500	
KEYERA CORP	16,668	34.530	575,546.040	
PARKLAND FUEL CORP	10,583	47.940	507,349.020	
ALTAGAS LTD	23,944	19.380	464,034.720	
PEMBINA PIPELINE CORP	42,684	50.200	2,142,736.800	
DOLLARAMA INC	23,536	44.850	1,055,589.600	
STARS GROUP INC	18,529	32.940	610,345.260	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	12.630	1,019,506.230	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,250	57.100	870,775.000	

	INTER PIPELINE LTD	27,946	22.260	622,077.960	
	NUTRIEN LTD	44,453	62.720	2,788,092.160	
	CRONOS GROUP INC	16,000	9.800	156,800.000	
	WSP GLOBAL INC	8,400	93.620	786,408.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	73.150	592,807.600	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	15.170	226,958.370	
	AIR CANADA	10,722	52.090	558,508.980	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	19,685	82.040	1,614,957.400	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	2.220	147,767.640	
	SHOPIFY INC	7,605	575.140	4,373,939.700	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	30.120	561,256.080	
	HYDRO ONE LTD	27,340	25.370	693,615.800	
カナダ・ドル　小計		3,169,775		152,513,977.880 (12,870,654,593)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.030	503,750.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.300	187,220.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.180	269,666.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	141,900	26.100	3,703,590.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	11.330	412,412.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	30.420	180,816.480	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	5.090	243,302.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	8.730	601,497.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.930	803,743.950	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.920	383,088.000	
	KEPPEL CORP LTD	101,100	6.850	692,535.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.280	405,612.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	251,553	11.060	2,782,176.180	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	607,122	3.270	1,985,288.940	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	8.950	425,125.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	95,200	26.820	2,553,264.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.380	339,390.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.540	347,340.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	4.350	619,005.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.160	219,008.000	
シンガポール・ドル　小計		2,924,934		17,657,829.550 (1,445,469,927)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	191,483	13.500	2,585,020.500	
	NESTLE SA-REGISTERED	230,364	103.540	23,851,888.560	
	CIE FINANC RICHEMONT	40,915	75.560	3,091,537.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	54,432	319.150	17,371,972.800	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,896	248.000	718,208.000	
	SIKA INHABER	10,209	175.250	1,789,127.250	
	SGS SA-REG	424	2,625.000	1,113,000.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	166,222	91.050	15,134,513.100	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,252	175.800	571,701.600	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,118.000	561,270.000	
	CLARIANT AG-REG	12,282	21.450	263,448.900	
	SWISSCOM AG-REG	1,960	519.200	1,017,632.000	
	ABB LTD	140,852	23.190	3,266,357.880	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	61.040	790,101.760	
	GEBERIT AG	2,901	537.200	1,558,417.200	
	LONZA GROUP AG-REG	5,793	360.200	2,086,638.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	7,890.000	623,310.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	88,200.000	793,800.000	
	GIVAUDAN-REG	742	3,006.000	2,230,452.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,558	398.100	4,601,239.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	37,997	52.540	1,996,362.380	
	TEMENOS GROUP	4,730	152.100	719,433.000	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	222.900	1,021,773.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	164.100	659,353.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	986.800	783,519.200	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	268.000	571,912.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	50.350	231,207.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	239.000	397,457.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,458	486.100	1,194,833.800	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	180.350	624,912.750	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	624.000	394,992.000	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	114.500	685,855.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	80.600	241,800.000	
	DUFRY GROUP	3,138	96.040	301,373.520	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	914.600	1,376,473.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	49.270	879,420.230	
	SWISS RE LTD	22,597	107.900	2,438,216.300	
	ALCON INC	32,032	56.700	1,816,214.400	
	UBS GROUP AG	301,686	12.620	3,807,277.320	
スイス・フラン　小計		1,344,447		104,162,023.850 (11,821,348,087)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	383.200	20,035,228.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	28,768	335.800	9,660,294.400	
	ERICSSON LM-B SHS	236,160	83.560	19,733,529.600	
	LUNDBERGS B	7,382	424.400	3,132,920.800	
	SKF AB-B SHS	28,812	187.100	5,390,725.200	
	SANDVIK AB	87,784	182.500	16,020,580.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	89.620	11,724,715.740	

	SKANSKA AB-B SHS	24,400	221.900	5,414,360.000	
	SWEDBANK AB	71,958	137.000	9,858,246.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	112,106	98.420	11,033,472.520	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	155.800	18,575,566.600	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	532.400	6,889,788.400	
	TELE2 AB-B SHS	34,618	141.200	4,888,061.600	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	228.500	2,605,585.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	234.900	4,507,965.900	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	161.850	3,900,261.300	
	INVESTOR AB-B SHS	35,180	520.600	18,314,708.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	60,283	185.180	11,163,205.940	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	223.300	18,106,950.400	
	TELIA CO AB	231,855	40.570	9,406,357.350	
	LUNDIN PETROLEUM AB	12,146	328.000	3,983,888.000	
	BOLIDEN AB	21,855	252.500	5,518,387.500	
	ALFA LAVAL AB	23,343	239.300	5,585,979.900	
	KINNEVIK AB-B	18,310	227.200	4,160,032.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,844	446.200	3,499,992.800	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	409.400	2,423,648.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	79.240	2,669,754.080	
	HEXAGON AB	21,145	535.800	11,329,491.000	
	EPIROC AB-A	48,955	117.600	5,757,108.000	
	EPIROC AB-B	30,899	114.250	3,530,210.750	
	ESSITY AB-B	46,640	315.600	14,719,584.000	
	NORDEA BANK ABP	259,268	76.150	19,743,258.200	
スウェーデン・クローナ　小計		1,940,382		293,283,858.280 (3,416,756,949)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	1,006.000	8,491,646.000	
	A P MOLLER A/S	491	9,046.000	4,441,586.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,550.000	2,334,150.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	107.350	5,478,499.900	
	GENMAB A/S	5,014	1,508.000	7,561,112.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,533	320.000	4,970,560.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	136,925	397.050	54,366,071.250	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13,963	634.800	8,863,712.400	
	COLOPLAST-B	9,729	821.000	7,987,509.000	
	DSV PANALPINA A S	17,626	753.000	13,272,378.000	
	DEMANT A/S	7,244	212.100	1,536,452.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	266.000	1,287,440.000	
	TRYG A/S	11,107	201.600	2,239,171.200	
	PANDORA A/S	8,251	341.000	2,813,591.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,539	531.000	4,003,209.000	
	ISS A/S	11,107	169.000	1,877,083.000	
	ORSTED A/S	15,090	659.600	9,953,364.000	
デンマーク・クローネ　小計		324,207		141,477,535.150	

				(2,323,061,127)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	8.850	754,418.250	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	16.200	484,282.800	
	A2 MILK CO LTD	55,091	14.750	812,592.250	
	FISHER & PAYKEL	43,184	21.380	923,273.920	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	5.220	334,622.880	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.540	724,688.420	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.195	320,708.130	
	MERIDIAN ENERGY LTD	75,656	5.060	382,819.360	
ニュージーランド・ドル　小計		574,531		4,737,406.010 (345,735,891)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	229.000	8,056,907.000	
	DNB ASA	71,352	164.050	11,705,295.600	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	32.420	3,019,566.380	
	TELENOR ASA	54,766	159.550	8,737,915.300	
	ORKLA ASA	64,938	87.920	5,709,348.960	
	EQUINOR ASA	81,022	180.900	14,656,879.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,171	349.800	4,257,415.800	
	AKER BP ASA	8,552	293.000	2,505,736.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	183.800	3,066,335.400	
	SCHIBSTED ASA	7,445	256.200	1,907,409.000	
ノルウェー・クローネ　小計		445,251		63,622,809.240 (788,922,835)	
ユーロ	CRH PLC	61,990	35.400	2,194,446.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	107.550	671,757.300	
	KERRY GROUP PLC-A	12,258	113.600	1,392,508.800	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	53.650	631,353.200	
	UMICORE	14,115	43.360	612,026.400	
	AIR LIQUIDE	36,317	126.250	4,585,021.250	
	AIRBUS SE	45,122	135.120	6,096,884.640	
	AXA	148,160	25.335	3,753,633.600	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	24.380	1,083,666.620	
	ADIDAS AG	13,900	309.150	4,297,185.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	18.400	1,601,352.000	
	DASSAULT AVIATION SA	163	1,112.000	181,256.000	
	DANONE	48,833	72.260	3,528,672.580	
	SAFRAN SA	25,898	137.450	3,559,680.100	
	INTESA SANPAOLO	1,157,631	2.341	2,710,014.170	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,251	73.630	1,859,231.130	
	ACCOR SA	12,277	40.340	495,254.180	
	BOUYGUES	17,572	37.890	665,803.080	
	BNP PARIBAS	86,434	51.930	4,488,517.620	
	THALES SA	8,549	96.780	827,372.220	
	CAPGEMINI SA	12,515	111.900	1,400,428.500	

CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	38.410	163,780.240	
INGENICO GROUP	4,334	97.580	422,911.720	
UNICREDIT SPA	155,718	13.290	2,069,492.220	
NATIXIS	70,166	3.919	274,980.550	
KONINKLIJKE DSM NV	13,716	111.100	1,523,847.600	
COMMERZBANK AG	83,118	5.673	471,528.410	
EIFFAGE	6,461	103.700	670,005.700	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,463	49.570	1,559,620.910	
UNITED INTERNET	9,882	30.960	305,946.720	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	45.720	253,563.120	
PUBLICIS GROUPE	15,198	43.080	654,729.840	
FAURECIA	6,117	46.760	286,030.920	
IBERDROLA SA	468,590	9.000	4,217,310.000	
ENI SPA	197,838	14.040	2,777,645.520	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.125	295,194.620	
KBC GROUPE	18,577	67.220	1,248,745.940	
HANNOVER RUECK SE	4,868	172.500	839,730.000	
WARTSILA OYJ	34,935	10.265	358,607.770	
L'OREAL	19,554	262.500	5,132,925.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,486	426.750	9,169,150.500	
GEA GROUP AG	11,838	29.000	343,302.000	
BOLLORE	71,347	3.848	274,543.250	
MEDIOBANCA SPA	41,639	9.844	409,894.310	
MICHELIN(CGDE)-B	12,422	110.800	1,376,357.600	
CONTINENTAL AG	8,312	115.900	963,360.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	76,032	33.725	2,564,179.200	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	14.730	233,986.050	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	26.500	249,073.500	
OMV AG	12,817	50.740	650,334.580	
VERBUND AG	4,908	44.560	218,700.480	
PERNOD-RICARD	16,719	162.800	2,721,853.200	
PEUGEOT SA	43,905	20.690	908,394.450	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,649	69.520	879,358.480	
RENAULT SA	14,917	40.660	606,525.220	
REPSOL SA	111,616	14.245	1,589,969.920	
REMY COINTREAU	1,860	112.000	208,320.000	
MERCK KGAA	9,850	113.400	1,116,990.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,436	35.670	1,406,682.120	
RWE AG	46,489	29.320	1,363,057.480	
SEB SA	1,551	138.000	214,038.000	
SOCIETE GENERALE-A	61,181	31.435	1,923,224.730	
VINCI S.A.	39,237	99.740	3,913,498.380	
SODEXO	7,075	99.800	706,085.000	
SOLVAY SA	5,563	100.850	561,028.550	

SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,656	91.860	4,010,240.160	
VIVENDI SA	67,989	25.700	1,747,317.300	
SAP SE	76,071	123.760	9,414,546.960	
TELEFONICA S.A	367,755	6.097	2,242,202.230	
TOTAL SA	186,020	49.560	9,219,151.200	
VALEO	19,653	31.660	622,213.980	
E.ON SE	181,317	9.711	1,760,769.380	
VOEST-ALPINE AG	9,875	24.760	244,505.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,585	85.050	645,104.250	
SIEMENS AG-REG	59,113	115.760	6,842,920.880	
UPM-KYMMENE OYJ	39,909	30.000	1,197,270.000	
ING GROEP NV-CVA	304,508	10.732	3,267,979.850	
PUMA AG	7,351	73.400	539,563.400	
BAYER AG	72,011	74.730	5,381,382.030	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41,915	12.170	510,105.550	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	93.020	1,279,862.180	
DAIMLER AG	69,481	48.895	3,397,273.490	
BASF SE	70,554	65.790	4,641,747.660	
BEIERSDORF AG	8,371	107.300	898,208.300	
HOCHTIEF AG	1,707	113.800	194,256.600	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	64.080	770,946.480	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,214	66.300	1,074,988.200	
ORANGE	151,246	13.055	1,974,516.530	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	39.770	1,437,327.570	
RANDSTAD NV	9,074	55.040	499,432.960	
ALLIANZ SE	32,944	219.650	7,236,149.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	3.893	784,852.150	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,026	22.245	1,980,383.370	
HERMES INTL	2,483	689.600	1,712,276.800	
ENDESA S.A.	23,417	23.570	551,938.690	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	15.500	249,488.000	
ERSTE GROUP BANK AG	20,943	34.290	718,135.470	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,091	267.600	2,967,951.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	46,714	15.224	711,173.930	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,953	154.500	1,537,738.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	34.210	688,886.770	
HEINEKEN NV	19,582	98.160	1,922,169.120	
AKZO NOBEL	17,491	88.490	1,547,778.590	
ASML HOLDING NV	33,053	269.050	8,892,909.650	
AEGON NV	150,349	4.007	602,448.440	
BANKINTER S.A.	57,960	6.380	369,784.800	
VOLKSWAGEN AG	2,645	181.800	480,861.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	185.280	2,668,217.280	

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523,594	4.922	2,577,129.660	
KERING	5,830	593.800	3,461,854.000	
CNP ASSURANCES	13,987	17.210	240,716.270	
FORTUM OYJ	37,452	21.730	813,831.960	
AGEAS	14,365	52.180	749,565.700	
UCB SA	9,095	78.920	717,777.400	
THYSSENKRUPP AG	27,110	12.145	329,250.950	
CARREFOUR SA	51,094	15.050	768,964.700	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	22.490	531,033.880	
ATOS SE	7,304	78.220	571,318.880	
NOKIA OYJ	430,800	3.669	1,580,605.200	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,925	44.350	3,189,873.750	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,687	66.300	1,371,548.100	
SANOFI	87,169	92.070	8,025,649.830	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	24.950	1,387,494.450	
ELISA OYJ	10,787	49.710	536,221.770	
BANCO SANTANDER SA	1,264,063	3.692	4,666,920.590	
METSO OYJ	8,585	35.060	300,990.100	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	17.350	600,240.600	
QIAGEN N.V.	17,974	31.460	565,462.040	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	7.580	1,132,330.720	
BMW VORZUG	4,116	56.050	230,701.800	
ENEL SPA	632,333	7.400	4,679,264.200	
COLRUYT NV	4,673	45.380	212,060.740	
VOPAK (KON.)	5,364	49.320	264,552.480	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,592	14.652	3,862,149.980	
SARTORIUS AG	2,712	203.600	552,163.200	
LEONARDO SPA	28,316	11.310	320,253.960	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,935	65.680	389,810.800	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	21.655	2,145,317.540	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	117.200	441,961.200	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.670	777,047.430	
EUROFINS SCIENTIFIC	899	491.200	441,588.800	
TELEPERFORMANCE	4,383	222.400	974,779.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,525	143.250	2,080,706.250	
EURAZEO	2,748	58.850	161,719.800	
BANCO SABADELL	413,631	1.025	423,971.770	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	94.580	632,645.620	
FRAPORT AG	3,149	72.060	226,916.940	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	88.750	868,951.250	
INDITEX	83,883	31.590	2,649,863.970	
JC DECAUX SA	6,058	26.540	160,779.320	
ANDRITZ AG	6,265	38.100	238,696.500	
MAPFRE SA	84,474	2.407	203,328.910	
ESSILORLUXOTTICA	21,761	138.800	3,020,426.800	
SNAM SPA	169,163	4.762	805,554.200	

CREDIT AGRICOLE SA	86,205	12.855	1,108,165.270	
ENAGAS	18,095	22.870	413,832.650	
WENDEL	2,220	120.300	267,066.000	
WIRECARD AG	8,963	113.600	1,018,196.800	
TENARIS SA	36,959	10.380	383,634.420	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.512	390,489.600	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.500	248,798.000	
ATLANTIA SPA	37,365	21.150	790,269.750	
ILIAD SA	2,102	118.500	249,087.000	
PROXIMUS	14,283	24.900	355,646.700	
SES FDR	28,847	12.735	367,366.540	
TERNA SPA	113,654	5.984	680,105.530	
BIOMERIEUX	3,248	84.050	272,994.400	
GRIFOLS SA	23,518	32.640	767,627.520	
FERROVIAL SA	38,666	27.810	1,075,301.460	
LANXESS AG	6,856	57.200	392,163.200	
NESTE OYJ	32,931	32.450	1,068,610.950	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	22.460	216,536.860	
RECORDATI SPA	6,859	38.760	265,854.840	
GALAPAGOS NV	3,426	188.250	644,944.500	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	39,752	8.115	322,587.480	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	270.000	1,125,360.000	
KONE OYJ	26,502	58.720	1,556,197.440	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	154.400	290,889.600	
ENGIE	139,272	14.800	2,061,225.600	
ALSTOM	15,712	43.550	684,257.600	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	39.800	144,633.200	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	14.430	180,981.060	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	9.858	530,360.400	
IPSEN SA	3,646	77.500	282,565.000	
DEUTSCHE WOHNEN	26,947	36.370	980,062.390	
ARKEMA SA	5,033	89.180	448,842.940	
LEGRAND SA	20,673	72.040	1,489,282.920	
UNILEVER NV	113,134	50.260	5,686,114.840	
ADP	2,313	175.600	406,162.800	
ORION OYJ	8,051	42.470	341,925.970	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	15.565	623,969.720	
SYMRISE AG	9,988	89.600	894,924.800	
SCOR SE	10,116	37.660	380,968.560	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	33.500	582,799.500	
PRYSMIAN SPA	21,452	20.990	450,277.480	
CAIXABANK	297,224	2.779	825,985.490	
BUREAU VERITAS SA	23,179	24.320	563,713.280	
GETLINK	37,646	15.200	572,219.200	
SUEZ SA	26,620	13.850	368,687.000	

	AMADEUS IT GROUP SA	33,891	74.440	2,522,846.040	
	BRENNTAG AG	12,353	48.820	603,073.460	
	EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	26.570	454,772.120	
	EDENRED	19,188	47.500	911,430.000	
	BANKIA SA	100,675	1.816	182,825.800	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.715	167,083.810	
	KION GROUP AG	4,567	60.980	278,495.660	
	VONOVIA SE	38,617	49.210	1,900,342.570	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	4.718	388,083.800	
	KNORR-BREMSE AG	4,492	92.700	416,408.400	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	43.075	493,984.100	
	FERRARI NV	8,934	155.650	1,390,577.100	
	METRO AG	10,774	13.365	143,994.510	
	CNH INDUSTRIAL NV	77,951	9.820	765,478.820	
	AROUNDTOWN SA	71,783	8.090	580,724.470	
	AIB GROUP PLC	41,352	3.060	126,537.120	
	MONCLER SPA	14,353	40.800	585,602.400	
	PROSUS NV	36,871	71.650	2,641,807.150	
	IBERDROLA SA-RTS	468,590	0.165	77,317.350	
	REPSOL SA-RTS	111,606	0.429	47,878.970	
	WORLDLINE SA	7,758	65.100	505,045.800	
	NN GROUP NV	21,720	33.490	727,402.800	
	FINECOBANK SPA	45,048	11.035	497,104.680	
	ZALANDO SE	9,964	44.940	447,782.160	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	79,084	12.750	1,008,321.000	
	AENA SME SA	5,338	172.000	918,136.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	19,780	41.090	812,760.200	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	16.335	559,490.080	
	EXOR NV	7,971	70.300	560,361.300	
	ALTICE EUROPE NV	56,763	6.004	340,805.050	
	COVESTRO AG	12,708	40.710	517,342.680	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	58,731	72.660	4,267,394.460	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	10.150	406,152.250	
	AMUNDI SA	4,119	70.200	289,153.800	
	ADYEN NV	818	756.800	619,062.400	
	PIRELLI & C SPA	34,086	5.254	179,087.840	
	UNIPER SE	14,252	28.660	408,462.320	
	DELIVERY HERO SE	8,081	65.680	530,760.080	
ユーロ　小計		15,804,769		326,101,112.910 (40,009,345,543)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	19,100	114.800	2,192,680.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.540	3,040,560.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	17.640	1,832,090.400	
	CLP HOLDINGS LTD	121,000	82.700	10,006,700.000	
	PCCW LTD	331,000	4.710	1,559,010.000	

	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	57.600	2,851,200.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,440	280.200	26,462,088.000	
	MTR CORP	126,000	47.100	5,934,600.000	
	HANG SENG BANK LTD	57,700	166.500	9,607,050.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	38.400	4,433,280.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	58.400	5,927,600.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	776,755	15.460	12,008,632.300	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	157,000	61.050	9,584,850.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	25.000	1,837,500.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	275,000	28.100	7,727,500.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	11.740	1,584,900.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	24.150	1,219,575.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	10.940	5,297,870.040	
	SINO LAND CO	255,400	11.500	2,937,100.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	125,000	121.300	15,162,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,500	74.750	2,279,875.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	64.250	7,292,375.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	28.350	1,984,500.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	52.200	3,340,800.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.950	1,552,200.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	19.880	2,473,072.000	
	AIA GROUP LTD	935,627	86.650	81,072,079.550	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	11.520	3,329,280.000	
	SANDS CHINA LTD	199,200	42.950	8,555,640.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	26.300	2,740,460.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	46.600	4,461,950.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.880	1,812,400.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	101,900	24.600	2,506,740.000	
	WH GROUP LTD	742,500	8.700	6,459,750.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,832	74.900	15,641,516.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	198,332	56.700	11,245,424.400	
香港・ドル　小計		7,279,712		287,955,348.490 (4,080,327,288)	
合計		86,481,742		345,244,652,440 (345,244,652,440)	

（２）株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	84,575.000	1,021,666.000	
		GOODMAN GROUP	132,051.000	1,859,278.080	
		GPT GROUP	158,232.000	925,657.200	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	1,077,196.860	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,668,463.960	
		STOCKLAND	194,018.000	939,047.120	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	676,107.500	
	オーストラリア・ドル　小計		1,589,005.000	8,167,416.720 (621,132,042)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	618,482.480	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	431,167.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	507,450.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	465,366.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	357,306.000	
	シンガポール・ドル　小計		990,506.000	2,379,771.480 (194,808,093)	
投資信託受益証券　合計			2,579,511	815,940,135 (815,940,135)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	806,680.230	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,646.000	1,390,103.880	
		AMERICAN TOWER CORP	34,213.000	8,054,082.330	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	1,035,923.790	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,491.000	2,213,810.820	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,644,932.790	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	862,634.000	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	31,583.000	4,525,528.070	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,605.000	1,903,341.850	
		DUKE REALTY TRUST	27,278.000	964,822.860	
		EQUINIX INC	6,522.000	3,880,329.120	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	967,718.520	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,869.000	2,293,061.320	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,075.000	1,550,412.500	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,261.000	1,001,299.320	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	760,980.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,162.000	1,418,923.460	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	973,899.720	
	INVITATION HOMES INC	42,384.000	1,279,572.960	
	IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	739,450.680	
	KIMCO REALTY	32,980.000	651,355.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	11,649.000	720,607.140	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	39,953.000	866,580.570	
	MID AMERICA	8,834.000	1,179,604.020	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	736,909.510	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	767,174.070	
	PROLOGIS INC	48,216.000	4,426,228.800	
	PUBLIC STORAGE	12,188.000	2,642,114.640	
	REALTY INCOME CORP	23,491.000	1,760,885.360	
	REGENCY CENTERS CORP	11,403.000	708,354.360	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,778.000	2,194,938.900	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,306.000	3,386,128.740	
	SL GREEN	7,097.000	652,356.240	
	SUN COMMUNITIES INC	7,418.000	1,135,992.520	
	UDR INC	22,345.000	1,041,053.550	
	VENTAS INC	29,505.000	1,693,291.950	
	VEREIT INC	82,604.000	773,173.440	
	VICI PROPERTIES INC	34,200.000	866,970.000	
	VORNADO REALTY TRUST	12,472.000	835,748.720	
	WELLTOWER INC	32,099.000	2,698,562.930	
	WEYERHAEUSER CO	57,621.000	1,743,035.250	
	WP CAREY INC	13,039.000	1,085,496.750	
アメリカ・ドル　小計		1,081,503.000	70,834,070.680 (7,803,081,226)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	410,116.800	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	532,295.470	
	SEGRO PLC	87,247.000	762,189.790	
イギリス・ポンド　小計		212,909.000	1,704,602.060 (244,030,831)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,819.000	414,328.810	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,676.000	360,060.120	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	225,600.520	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	361,454.280	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	96,641.170	
カナダ・ドル　小計		52,777.000	1,458,084.900 (123,047,785)	
ユーロ	COVIVIO	4,265.000	437,162.500	
	GECINA SA	3,670.000	601,513.000	

		ICADE	2,234.000	217,703.300	
		KLEPIERRE	17,042.000	560,511.380	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,438,536.000	
	ユーロ　小計		38,109.000	3,255,426.180 (399,408,238)	
	香港・ドル	LINK REIT	157,900.000	13,082,015.000	
	香港・ドル　小計		157,900.000	13,082,015.000 (185,372,153)	
投資証券　合計			1,543,198	8,754,940,233 (8,754,940,233)	
合計				9,570,880,368 (9,570,880,368)	

（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	66.12	－	－	69.61
	投資証券	42銘柄	－	－	2.16	
イギリス・ポンド	株式	93銘柄	5.65	－	－	5.83
	投資証券	3銘柄	－	－	0.07	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.11	－	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	62銘柄	2.25	－	－	2.47
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.17	－	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.56	－	－	3.66
	投資証券	5銘柄	－	－	0.03	
シンガポール・ドル	株式	20銘柄	0.40	－	－	0.46
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.27	－	－	3.33
スウェーデン・クローナ	株式	32銘柄	0.94	－	－	0.96
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.64	－	－	0.65
ニュージーランド・ドル	株式	8銘柄	0.10	－	－	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.22	－	－	0.22
ユーロ	株式	237銘柄	11.06	－	－	11.39
	投資証券	5銘柄	－	－	0.11	
香港・ドル	株式	36銘柄	1.13	－	－	1.20
	投資証券	1銘柄	－	－	0.05	

（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2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	11,340,163,905
コール・ローン	35,914,299
株式	46,798,421,986
新株予約権証券	104,047
投資信託受益証券	402,719,202
投資証券	102,465,104
派生商品評価勘定	454,370,960
未収入金	1,948,394
未収配当金	55,833,993
差入委託証拠金	2,000,804,769
流動資産合計	61,192,746,659
資産合計	61,192,746,659
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	158,438
未払金	11,002
未払解約金	14,280,000
流動負債合計	14,449,440
負債合計	14,449,440
純資産の部	
元本等	
元本	47,688,669,927
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	13,489,627,292
元本等合計	61,178,297,219
純資産合計	61,178,297,219
負債純資産合計	61,192,746,659

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年1月14日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	49,530,533,028円
同期中追加設定元本額	47,601,644,928円
同期中一部解約元本額	49,443,508,029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＞	5,719,998,358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）	544,648,507円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,908,111円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	7,260,061円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	8,596,952円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,421,819円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	27,008,214円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	10,892,741円
たわらノーロード　新興国株式	5,535,853,929円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,028,623,684円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	651,314,093円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	5,290,743円
たわらノーロード　バランス（標準型）	19,005,777円
たわらノーロード　バランス（積極型）	31,769,994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）	293,572円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	31,688,232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）	73,307,342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）	49,785,741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）	89,780,866円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	347,151円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,623,743円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,203,180円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,349,759円
たわらノーロード　全世界株式	19,817,522円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	869,397円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	427,674,355円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	350,917,341円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	344,598,722円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	679,488,887円
投資のソムリエ	10,026,770,001円
クルーズコントロール	1,678,815,178円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	968,603,743円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	299,779,433円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,523,360円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	27,708,745円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	52,242,534円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	492,518,284円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,293,585,817円
ワールドアセットバランス（基本コース）	1,472,750,905円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	5,759,678,172円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	7,376,463円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	6,092,969円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,073,248円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	14,362,046円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,913,100,332円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	225,504,688円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,096,639円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	932,343円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	931,981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）	150,579,268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）	350,443,551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）	247,861,434円
計	47,688,669,927円
２．　受益権の総数	47,688,669,927口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	3,659,705,693
新株予約権証券	△13,539
投資信託受益証券	32,961,950
投資証券	△2,781,749
合計	3,689,872,355

（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2年1月14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2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,015,477,721	－	1,015,621,992	△144,271
アメリカ・ドル	1,014,239,502	－	1,014,391,910	△152,408
コロンビア・ペソ	64,628	－	64,820	△192
ブラジル・レアル	1,173,591	－	1,165,262	8,329
買建	1,238,219	－	1,232,381	△5,838
アメリカ・ドル	1,238,219	－	1,232,381	△5,838
合計	1,016,715,940	－	1,016,854,373	△150,109

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	令和2年1月14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	12,386,154,657	－	12,840,517,288	454,362,631
合計	12,386,154,657	－	12,840,517,288	454,362,631

（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2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2829円 (12,829円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年1月14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	TRIP.COM GROUP LTD ADR	29,012	37.650	1,092,301.800	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	14,930	13.430	200,509.900	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	51,423	5.990	308,023.770	
	CREDICORP LTD	4,478	211.560	947,365.680	
	SINA CORP	3,696	44.520	164,545.920	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	40,229	10.410	418,783.890	
	NETEASE INC-ADR	4,683	349.530	1,636,848.990	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA SA ADR	8,958	15.620	139,923.960	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,523	44.410	245,276.430	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	7,366	11.010	81,099.660	
	YPF SA ADR	8,927	10.650	95,072.550	
	LUKOIL SPON ADR	26,632	106.100	2,825,655.200	
	GAZPROM PAO ADR	356,701	8.140	2,903,546.140	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	102,425	5.140	526,464.500	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	66,800	0.845	56,446.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,736	0.988	85,695.160	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	46,584	8.745	407,377.080	
	51JOB INC ADR	1,814	90.850	164,801.900	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	8,930	35.860	320,229.800	
	NOVATEK PJSC GDR	6,150	213.000	1,309,950.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	18,363	142.260	2,612,320.380	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	12,150	23.900	290,385.000	
	BANCO MACRO SA ADR	3,717	34.540	128,385.180	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	44,004	33.590	1,478,094.360	
	ROSNEFT OIL CO GDR	85,291	7.806	665,781.540	

	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	9,695	134.710	1,306,013.450	
	SEVERSTAL GDR	17,178	15.610	268,148.580	
	TATNEFT ADR	17,282	79.000	1,365,278.000	
	MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	15,136	9.490	143,640.640	
	VTB BANK OJSC GDR	122,000	1.543	188,246.000	
	DP WORLD PLC	12,841	12.950	166,290.950	
	MAGNIT PJSC GDR	27,856	12.300	342,628.800	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,862	15.260	470,954.120	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	25,287	55.100	1,393,313.700	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	2,188	39.250	85,879.000	
	SBERBANK ADR	182,508	17.260	3,150,088.080	
	PHOSAGRO PJSC GDR	13,784	13.000	179,192.000	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	8,822	38.990	343,969.780	
	JOYY INC-ADR	4,178	66.650	278,463.700	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	4,404	52.430	230,901.720	
	BEST INC ADR	12,772	6.390	81,613.080	
	HUYA INC ADR	4,702	21.040	98,930.080	
	NIO INC ADR	39,903	3.700	147,641.100	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	6,256	14.000	87,584.000	
	58.COM INC ADR	6,021	68.990	415,388.790	
	AUTOHOME INC ADR	3,720	91.540	340,528.800	
	WEIBO CORP ADR	4,093	51.690	211,567.170	
	JD.COM INC ADR	49,593	40.310	1,999,093.830	
	GLOBANT SA	2,096	111.790	234,311.840	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	113,651	230.480	26,194,282.480	
	MOMO INC SPON ADR	10,966	40.640	445,658.240	
	BAOZUN INC-SPN ADR	3,717	36.890	137,120.130	
	PINDUODUO INC ADR	12,456	39.350	490,143.600	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	23,488	48.130	1,130,477.440	
	IQIYI INC ADR	9,440	23.980	226,371.200	
	POLYUS PJSC GDR	4,556	60.950	277,688.200	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	4,363	27.460	119,807.980	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	22,411	23.600	528,899.600	
アメリカ・ドル 小計		1,873,747		62,185,000.870 (6,850,299,696)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	136,145	5.580	759,689.100	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	103,132	16.440	1,695,490.080	

	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	177,861	8.000	1,422,888.000	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	172,490	15.340	2,645,996.600	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	266,090	4.090	1,088,308.100	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	286,768	2.160	619,418.880	
	EMAAR MALLS PJSC	178,166	1.890	336,733.740	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,320,652		8,568,524.500 (256,712,994)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,843	12.355	195,740.260	
イギリス・ポンド　小計		15,843		195,740.260 (28,022,176)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	190,485	1,543.700	294,051,694.500	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	46,257	470.750	21,775,482.750	
	ASIAN PAINTS LTD	18,318	1,804.900	33,062,158.200	
	EICHER MOTORS LTD	1,004	20,280.000	20,361,120.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	18,384	759.600	13,964,486.400	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	49,933	554.950	27,710,318.350	
	SHREE CEMENT LTD	459	23,829.200	10,937,602.800	
	ICICI BANK LTD	315,598	538.600	169,981,082.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	46,395	252.350	11,707,778.250	
	STATE BANK OF INDIA LTD	116,610	330.750	38,568,757.500	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,991	561.800	7,298,343.800	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	15,777	453.500	7,154,869.500	
	TATA STEEL LTD	18,608	495.750	9,224,916.000	
	TATA MOTORS LTD	111,599	196.250	21,901,303.750	
	JSW STEEL LTD	48,246	278.600	13,441,335.600	
	TATA POWER CO LTD	100,483	59.400	5,968,690.200	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,615	3,045.100	11,008,036.500	
	NESTLE INDIA LTD	1,484	14,658.250	21,752,843.000	
	GAIL INDIA LTD	129,311	128.900	16,668,187.900	
	VEDANTA LTD	133,208	160.450	21,373,223.600	
	AXIS BANK LTD	137,028	737.400	101,044,447.200	
	TITAN COMPANY LTD	20,828	1,158.950	24,138,610.600	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	157,916	125.450	19,810,562.200	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	4,725	1,477.550	6,981,423.750	
	LUPIN LTD	13,661	748.600	10,226,624.600	
	BAJAJ FINANCE LTD	12,001	4,164.500	49,978,164.500	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	108,925	2,462.550	268,233,258.750	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	55,233	265.100	14,642,268.300	

INFOSYS LTD	226,164	773.550	174,949,162.200	
WIPRO LTD	82,231	254.800	20,952,458.800	
INDIAN OIL CORP LTD	115,396	126.950	14,649,522.200	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	42,696	1,994.850	85,172,115.600	
HCL TECHNOLOGIES LTD	76,918	586.500	45,112,407.000	
DABUR INDIA LTD	39,114	478.700	18,723,871.800	
HERO MOTOCORP LTD	7,538	2,366.750	17,840,561.500	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,489	2,954.700	22,127,748.300	
BHARTI AIRTEL LTD	131,117	468.900	61,480,761.300	
UNITED SPIRITS LTD	16,100	583.550	9,395,155.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	57,096	444.600	25,384,881.600	
DIVI'S LABORATORIES LTD	5,865	1,878.850	11,019,455.250	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,796	7,352.700	49,968,949.200	
AUROBINDO PHARMA LTD	22,361	460.600	10,299,476.600	
HAVELLS INDIA LTD	18,543	651.200	12,075,201.600	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	75,825	145.850	11,059,076.250	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	9,782	1,168.100	11,426,354.200	
PETRONET LNG LTD	40,593	273.350	11,096,096.550	
CIPLA LTD/INDIA	26,157	477.650	12,493,891.050	
LARSEN & TOUBRO LTD	33,228	1,334.700	44,349,411.600	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,693	4,468.700	29,909,009.100	
ASHOK LEYLAND LTD	64,420	81.650	5,259,893.000	
BOSCH LTD	529	14,791.300	7,824,597.700	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	59,765	2,190.350	130,906,267.750	
NTPC LTD	159,661	121.750	19,438,726.750	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,293	1,437.150	7,606,834.950	
AMBUJA CEMENTS LTD	54,234	211.500	11,470,491.000	
BHARAT FORGE LTD	10,594	515.600	5,462,266.400	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	73,359	211.200	15,493,420.800	
ITC LTD	236,170	239.250	56,503,672.500	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,127	1,425.500	13,010,538.500	
UNITED PHOSPHORUS LTD	35,623	591.950	21,087,034.850	
SIEMENS INDIA LTD	5,659	1,501.800	8,498,686.200	
INFO EDGE INDIA LTD	4,773	2,529.350	12,072,587.550	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,056	742.800	20,097,196.800	
TECH MAHINDRA LTD	30,130	785.850	23,677,660.500	
MARICO LTD	37,213	343.450	12,780,804.850	
PAGE INDUSTRIES LTD	355	23,156.550	8,220,575.250	
DLF LTD	47,634	252.800	12,041,875.200	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	111,822	194.800	21,782,925.600	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	46,478	390.350	18,142,687.300	

	REC LTD	55,173	143.400	7,911,808.200	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,275	9,455.250	21,510,693.750	
	BAJAJ AUTO LTD	5,142	3,094.050	15,909,605.100	
	COAL INDIA LTD	78,544	211.550	16,615,983.200	
	MAHINDRA & MAHINDRA FINANCIAL SERVICES LTD	23,268	342.850	7,977,433.800	
	BHARTI INFRATEL LTD	13,969	246.450	3,442,660.050	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	63.250	147,562.250	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	32,930	625.400	20,594,422.000	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,868	3,062.100	8,782,102.800	
	BANDHAN BANK LTD	26,000	514.000	13,364,000.000	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	18,694	508.900	9,513,376.600	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,108	1,914.650	15,523,982.200	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	13,328	1,353.750	18,042,780.000	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	25,623	496.950	12,733,349.850	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,373	1,424.150	7,651,957.950	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	24,908	989.850	24,655,183.800	
インド・ルピー　小計		4,295,215		2,608,208,803.000 (4,094,887,821)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	1,499,800	1,210.000	1,814,758,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	100,801	23,050.000	2,323,463,050.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	347,600	8,150.000	2,832,940,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	460,500	8,400.000	3,868,200,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,279,900	6,925.000	8,863,307,500.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	3,160,500	4,030.000	12,736,815,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	526,000	7,000.000	3,682,000,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,000	58,325.000	1,866,400,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	795,500	2,320.000	1,845,560,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	139,600	18,400.000	2,568,640,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	256,700	8,150.000	2,092,105,000.000	
	BUKIT ASAM TBK PT	230,000	2,830.000	650,900,000.000	
	BANK MANDIRI	1,246,000	7,725.000	9,625,350,000.000	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA TBK PT	86,800	11,375.000	987,350,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,567,500	4,510.000	16,089,425,000.000	

	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	806,800	2,090.000	1,686,212,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	491,500	7,775.000	3,821,412,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,024,700	1,600.000	1,639,520,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	219,900	12,175.000	2,677,282,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	647,200	33,725.000	21,826,820,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	299,400	3,310.000	991,014,000.000	
	JASA MARGA PERSERO TBK PT	145,625	5,225.000	760,890,625.000	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	746,500	1,255.000	936,857,500.000	
	ADARO ENERGY PT	1,016,200	1,565.000	1,590,353,000.000	
	PAKUWON JATI TBK	1,659,900	585.000	971,041,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,800	11,550.000	1,914,990,000.000	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	526,900	2,150.000	1,132,835,000.000	
	ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	510,400	1,490.000	760,496,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		21,990,026		112,556,938,175.000 (911,711,199)	
オフショア・人民元	UNISPLENDOUR CORP LTD	15,600	33.920	529,152.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	7,200	69.100	497,520.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	1,000	493.860	493,860.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	29,800	19.870	592,126.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	16,000	39.770	636,320.000	
	WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	13,200	30.180	398,376.000	
	ZHEJIANG NHU CO LTD	12,200	24.510	299,022.000	
	AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	7,800	39.430	307,554.000	
	GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	13,900	37.000	514,300.000	
	MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	9,800	91.380	895,524.000	
	CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	10,700	58.470	625,629.000	
	CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	31,200	16.190	505,128.000	
	HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	13,800	34.300	473,340.000	

RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	24,600	12.060	296,676.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	14,200	41.530	589,726.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	12,900	35.540	458,466.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	19,500	30.390	592,605.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,700	93.030	716,331.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	20,700	31.660	655,362.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	16,300	32.500	529,750.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	3,100	113.420	351,602.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	29,450	41.480	1,221,586.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	120,200	6.870	825,774.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	20,900	20.610	430,749.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	29,200	21.660	632,472.000	
IFLYTEK CO LTD	17,500	36.990	647,325.000	
GOERTEK INC	27,700	21.690	600,813.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	29,400	29.000	852,600.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	38,100	17.020	648,462.000	
TCL CORP A	77,400	4.770	369,198.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	87,600	7.750	678,900.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	13,300	31.200	414,960.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	6,000	88.880	533,280.000	
AVIC AIRCRAFT CO LTD	34,700	16.910	586,777.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	40,200	16.190	650,838.000	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	5,300	119.350	632,555.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	16,000	139.660	2,234,560.000	
SUNING.COM CO LTD	56,100	10.610	595,221.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	168,300	4.940	831,402.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	33,200	19.670	653,044.000	

GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	13,500	69.760	941,760.000	
MIDEA GROUP CO LTD	14,500	60.110	871,595.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	38,800	35.230	1,366,924.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	27,000	13.240	357,480.000	
PING AN BANK CO LTD	63,800	16.990	1,083,962.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	20,200	36.620	739,724.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	125,700	5.080	638,556.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,800	31.680	1,324,224.000	
ZTE CORP	9,700	37.960	368,212.000	
WEICHAI POWER CO LTD	42,000	14.930	627,060.000	
GF SECURITIES CO LTD	48,300	15.630	754,929.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	26,200	12.620	330,644.000	
BYD CO LTD	13,300	51.610	686,413.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	47,900	12.100	579,590.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	13,300	46.800	622,440.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	3,200	149.860	479,552.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	13,800	31.970	441,186.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	28,400	14.970	425,148.000	
SF HOLDING CO LTD	12,300	37.920	466,416.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	71,690	9.250	663,132.500	
CSC FINANCIAL CO LTD	20,400	31.870	650,148.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	43,000	17.260	742,180.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	16,120	46.660	752,159.200	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	2,500	170.080	425,200.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	4,400	88.510	389,444.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	29,400	18.610	547,134.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	1,900	188.300	357,770.000	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	11,000	116.900	1,285,900.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,200	261.800	837,760.000	
WUXI APPTEC CO LTD	7,500	93.000	697,500.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	4,800	167.380	803,424.000	
PETROCHINA CO LTD	110,700	5.970	660,879.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	184,100	5.930	1,091,713.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	220,200	3.680	810,336.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.700	310,800.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	131,200	5.140	674,368.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	20,000	35.270	705,400.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	30,300	18.190	551,157.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	85,900	39.100	3,358,690.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	47,500	86.450	4,106,375.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	85,600	19.700	1,686,320.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	121,200	12.410	1,504,092.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	161,800	6.350	1,027,430.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	32,200	25.300	814,660.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,100	1,124.270	5,733,777.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	149,500	5.650	844,675.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	49,500	25.970	1,285,515.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	24,800	38.810	962,488.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	88,300	5.660	499,778.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	85,200	18.070	1,539,564.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	80,000	8.030	642,400.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	197,700	4.280	846,156.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	198,000	5.950	1,178,100.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	171,300	5.350	916,455.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	44,200	15.560	687,752.000	
HUAXIA BANK CO LTD	47,900	7.670	367,393.000	

INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	25,000	32.990	824,750.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	119,400	5.660	675,804.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	159,500	5.910	942,645.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	112,200	5.730	642,906.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	20,600	52.720	1,086,032.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	30,700	18.950	581,765.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	50,800	16.480	837,184.000	
CRRC CORP LTD	116,500	7.090	825,985.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	18,600	87.840	1,633,824.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	64,400	10.160	654,304.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	34,700	20.440	709,268.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	108,500	5.920	642,320.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	13,100	51.250	671,375.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	33,900	19.890	674,271.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,900	17.050	833,745.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	178,400	2.320	413,888.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	85,200	7.170	610,884.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	24,200	27.070	655,094.000	
GEMDALE CORP	40,600	14.350	582,610.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	35,500	20.000	710,000.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	18,100	54.400	984,640.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	21,900	27.760	607,944.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	100,000	4.630	463,000.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	84,300	8.550	720,765.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	38,000	9.120	346,560.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	29,500	21.460	633,070.000	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL SERVICE CORP LTD	8,400	91.000	764,400.000	

INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	353,900	1.340	474,226.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	155,800	3.520	548,416.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	103,600	2.810	291,116.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	83,700	4.330	362,421.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	6,100	75.950	463,295.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	16,000	35.420	566,720.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	21,700	28.530	619,101.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	32,000	14.560	465,920.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	9.400	222,780.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	17,300	22.580	390,634.000	
BANK OF NANJING CO LTD	60,000	8.730	523,800.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	16,000	14.300	228,800.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	131,800	4.390	578,602.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	53,200	7.120	378,784.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	11,200	34.810	389,872.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	19,200	28.080	539,136.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	60,800	8.200	498,560.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	106,500	5.680	604,920.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	6,800	82.470	560,796.000	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,000	32.150	514,400.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	82,700	7.240	598,748.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	16,500	25.240	416,460.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	34,000	12.340	419,560.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	5,000	116.170	580,850.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	3,700	95.200	352,240.000	

	SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	19,500	24.320	474,240.000	
	TONGWEI CO LTD	41,300	14.350	592,655.000	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,000	28.830	691,920.000	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	72,351	9.020	652,606.020	
	FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	10,700	108.300	1,158,810.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	39,500	19.080	753,660.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	121,400	5.060	614,284.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	64,100	7.230	463,443.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	48,600	9.690	470,934.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	2,400	260.270	624,648.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	47,500	14.810	703,475.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	60,300	10.820	652,446.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	30,000	13.420	402,600.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	89,200	7.010	625,292.000	
オフショア・人民元　小計		8,156,511		119,262,927.720 (1,910,592,102)	
カタール・リアル	QATAR INSURANCE CO SAQ	144,170	3.220	464,227.400	
	QATAR NATIONAL BANK	299,376	20.950	6,271,927.200	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	107,617	4.970	534,856.490	
	OOREDOO QSC	34,288	6.970	238,987.360	
	QATAR FUEL QSC	35,119	22.800	800,713.200	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	32,649	16.370	534,464.130	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	55,867	9.400	525,149.800	
	INDUSTRIES QATAR QSC	113,116	10.400	1,176,406.400	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	77,961	15.550	1,212,293.550	
	MASRAF AL RAYAN	276,069	4.140	1,142,925.660	
	BARWA REAL ESTATE CO	167,630	3.550	595,086.500	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	266,928	2.310	616,603.680	
カタール・リアル　小計		1,610,790		14,113,641.370 (425,102,878)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	26,028	19,960.000	519,518,880.000	
	ECOPETROL SA	301,511	3,420.000	1,031,167,620.000	

	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES SA-PREF	341,831	1,465.000	500,782,415.000	
	GRUPO ARGOS SA	22,093	18,160.000	401,208,880.000	
	BANCOLOMBIA SA	10,886	42,540.000	463,090,440.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	32,889	44,580.000	1,466,191,620.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	18,835	33,600.000	632,856,000.000	
コロンビア・ペソ　小計		754,073		5,014,815,855.000 (168,999,294)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,490	55.300	911,897.000	
	JARIR MARKETING CO	4,309	167.800	723,050.200	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,489	79.000	354,631.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	27,652	27.400	757,664.800	
	SAUDI BRITISH BANK	50,236	34.900	1,753,236.400	
	AL RAJHI BANK	79,447	65.900	5,235,557.300	
	ARAB NATIONAL BANK	43,147	27.900	1,203,801.300	
	BANK ALBILAD	26,934	26.900	724,524.600	
	BANK AL-JAZIRA	29,448	15.260	449,376.480	
	BANQUE SAUDI FRANSI	39,754	38.200	1,518,602.800	
	RIYAD BANK	75,334	25.500	1,921,017.000	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	59,336	31.700	1,880,951.200	
	SAUDI TELECOM CO	26,884	99.000	2,661,516.000	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	10,215	79.900	816,178.500	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	48,639	92.700	4,508,835.300	
	SAUDI CEMENT CO	5,494	69.600	382,382.400	
	SAUDI ELECTRICITY CO	61,075	20.380	1,244,708.500	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	16,160	24.700	399,152.000	
	SAVOLA GROUP	19,176	34.900	669,242.400	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	24,022	13.780	331,023.160	
	ALMARAI CO JSC	18,322	49.450	906,022.900	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,034	9.810	275,013.540	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,336	18.400	484,582.400	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	7,773	49.850	387,484.050	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	53,869	11.220	604,410.180	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	38,785	11.080	429,737.800	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	16,050	22.480	360,804.000	

	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,022	103.000	208,266.000	
	ALINMA BANK	44,883	25.500	1,144,516.500	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	29,973	44.350	1,329,302.550	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	2,944	104.000	306,176.000	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	70,000	34.750	2,432,500.000	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	75,892	47.700	3,620,048.400	
サウジアラビア・リアル　小計		1,083,124		40,936,212.660 (1,203,934,014)	
タイ・バーツ	BANGKOK BANK PCL	26,400	153.000	4,039,200.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	88,100	43.000	3,788,300.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	286,500	16.300	4,669,950.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	56,300	74.500	4,194,350.000	
	ROBINSON PCL-NVDR	38,800	65.750	2,551,100.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	48,300	114.500	5,530,350.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	711,055	4.200	2,986,431.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	55,300	136.000	7,520,800.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,010,000	1.590	1,605,900.000	
	IRPC PCL NVDR	679,600	3.540	2,405,784.000	
	BANPU PCL PUBLIC CO LTD NVDR	384,200	11.500	4,418,300.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	17,900	343.000	6,139,700.000	
	SHIN CORP PCL	153,900	58.750	9,041,625.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	231,800	29.500	6,838,100.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	80,600	213.000	17,167,800.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	462,320	16.500	7,628,280.000	
	PTT PCL	751,700	46.500	34,954,050.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	315,400	14.600	4,604,840.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	728,600	10.300	7,504,580.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	49,350	368.000	18,160,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	292,900	74.750	21,894,275.000	
	KASIKORNBANK PCL -FOREIGN	79,100	138.000	10,915,800.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	151,000	62.500	9,437,500.000	

	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	622,800	25.500	15,881,400.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	34,200	140.000	4,788,000.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	177,210	34.000	6,025,140.000	
	THAI OIL PCL NVDR	72,200	64.250	4,638,850.000	
	CP ALL PCL NVDR	369,500	71.750	26,511,625.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	531,300	13.500	7,172,550.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	96,945	131.500	12,748,267.500	
	TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	28,400	51.250	1,455,500.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	85,422	31.500	2,690,793.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	148,408	56.750	8,422,154.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	89,800	39.750	3,569,550.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	423,100	11.300	4,781,030.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	51,100	60.000	3,066,000.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	34,900	193.500	6,753,150.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	60,200	44.000	2,648,800.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	59,700	70.500	4,208,850.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	59,400	62.750	3,727,350.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	51,500	95.750	4,931,125.000	
タイ・バーツ　小計		9,695,210		322,017,949.500 (1,172,145,336)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,669	828.500	4,696,766.500	
	CEZ	11,499	520.000	5,979,480.000	
	MONETA MONEY BANK AS	39,312	83.900	3,298,276.800	
チェコ・コルナ　小計		56,480		13,974,523.300 (68,055,928)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,537,939	46.150	163,275,884.850	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,485	37,450.000	93,063,250.000	
	BANCO DE CHILE	3,028,299	86.990	263,431,730.010	
	EMPRESAS CMPC SA	87,422	2,070.000	180,963,540.000	
	EMPRESAS COPEC SA	21,456	7,589.000	162,829,584.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	13,024	7,640.000	99,503,360.000	
	ENTEL CHILE SA	13,572	5,600.000	76,003,200.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,616,813	168.800	441,718,034.400	
	COLBUN SA	554,294	128.100	71,005,061.400	

	AGUAS ANDINAS SA	224,014	336.000	75,268,704.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	35,748	2,210.100	79,006,654.800	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	23,621	7,400.000	174,795,400.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	6,806	23,197.000	157,878,782.000	
	SACI FALABELLA	43,443	3,435.000	149,226,705.000	
	ITAU CORPBANCA	13,236,977	4.350	57,580,849.950	
	CENCOSUD SA	106,564	1,029.000	109,654,356.000	
	ENEL CHILE SA	2,205,539	78.100	172,252,595.900	
チリ・ペソ　小計		25,758,016		2,527,457,692.310 (359,151,738)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	186,045	8.720	1,622,312.400	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	16,573	23.800	394,437.400	
	ARCELIK	16,000	21.820	349,120.000	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	31,766	22.920	728,076.720	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	102,398	9.550	977,900.900	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	5,000	74.050	370,250.000	
	KOC HOLDING AS	49,560	20.800	1,030,848.000	
	TURK HAVA YOLLARI	32,791	14.840	486,618.440	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	93,118	14.460	1,346,486.280	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	142,362	12.200	1,736,816.400	
	TURKIYE IS BANKASI	90,875	6.740	612,497.500	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	7,949	125.500	997,599.500	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	50,427	10.350	521,919.450	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	23,201	48.300	1,120,608.300	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	13,735	29.520	405,457.200	
トルコ・リラ　小計		861,800		12,700,948.490 (238,523,813)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	10,134	6,640.000	67,289,760.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	28,765	2,884.000	82,958,260.000	
	OTP BANK NYRT	14,164	14,890.000	210,901,960.000	
ハンガリー・フォリント　小計		53,063		361,149,980.000 (132,794,848)	
パキスタン・ルピー	MCB BANK LTD	33,000	221.790	7,319,070.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	74,500	153.070	11,403,715.000	
	HABIB BANK LTD	45,000	170.980	7,694,100.000	
パキスタン・ルピー　小計		152,500		26,416,885.000	

				(19,020,157)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	461,400	44.350	20,463,090.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	139,530	52.000	7,255,560.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	52,170	86.500	4,512,705.000	
	AYALA CORP	16,883	795.000	13,421,985.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,785	1,980.000	5,514,300.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	62,790	132.500	8,319,675.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	162,710	77.050	12,536,805.500	
	JOLLIBEE FOODS CORP	36,330	206.600	7,505,778.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	112,605	67.000	7,544,535.000	
	BDO UNIBANK INC	122,503	153.000	18,742,959.000	
	MEGAWORLD CORP	962,000	4.250	4,088,500.000	
	PLDT INC	6,525	1,090.000	7,112,250.000	
	ROBINSONS LAND CORP	214,900	27.150	5,834,535.000	
	SECURITY BANK CORP	23,420	186.000	4,356,120.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	661,475	42.000	27,781,950.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	58,300	140.300	8,179,490.000	
	SM INVESTMENTS CORP	17,403	1,079.000	18,777,837.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	1,148,900	3.740	4,296,886.000	
	ABOITIZ POWER CORP	56,400	34.250	1,931,700.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	12,630	308.000	3,890,040.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	7,351	795.000	5,844,045.000	
フィリピン・ペソ　小計		4,339,010		197,910,745.500 (433,424,533)	
ブラジル・レアル	BRF SA	40,892	36.700	1,500,736.400	
	VALE SA	209,321	55.300	11,575,451.300	
	RAIA DROGASIL SA	16,500	112.370	1,854,105.000	
	TIM PARTICIPACOES SA	48,800	16.330	796,904.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,250	40.790	785,207.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,400	40.200	659,280.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,300	50.420	3,040,326.000	
	INVESTIMENTOS ITAU SA	287,460	13.530	3,889,333.800	
	LOJAS AMERICANAS SA	55,374	26.990	1,494,544.260	
	GERDAU SA	70,630	21.840	1,542,559.200	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRUPO PAO DE ACUCAR	12,406	89.590	1,111,453.540	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	197,210	32.090	6,328,468.900	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,200	28.790	1,243,728.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	280,912	30.330	8,520,060.960	

COGNA EDUCACAO	110,747	12.550	1,389,874.850	
CCR SA	85,020	18.300	1,555,866.000	
WEG SA	55,072	34.320	1,890,071.040	
BANCO BRADESCO SA PREF	273,850	34.800	9,529,980.000	
BANCO BRADESCO SA	73,441	33.050	2,427,225.050	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	47,606	15.070	717,422.420	
SUZANO SA	36,775	44.700	1,643,842.500	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	321,547	35.060	11,273,437.820	
PORTO SEGURO SA	8,800	63.850	561,880.000	
B2W CIA DIGITAL	13,400	69.170	926,878.000	
BRASKEM SA	15,730	34.000	534,820.000	
ENGIE BRASIL SA	15,487	53.360	826,386.320	
LOCALIZA RENT A CAR	37,989	48.000	1,823,472.000	
TELEFONICA BRASIL S.A.	31,928	58.690	1,873,854.320	
LOJAS RENNER SA	51,537	58.370	3,008,214.690	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	53,104	25.320	1,344,593.280	
COSAN SA	12,000	74.920	899,040.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	53,900	23.890	1,287,671.000	
EMBRAER SA	50,960	20.460	1,042,641.600	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	41,165	19.040	783,781.600	
JBS SA	72,200	28.730	2,074,306.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	78,249	15.350	1,201,122.150	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	20,698	59.910	1,240,017.180	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	23,340	33.500	781,890.000	
HYPERA SA	29,600	37.190	1,100,824.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	132,816	44.350	5,890,389.600	
MAGAZINE LUIZA SA	51,400	54.230	2,787,422.000	
CIELO SA	84,907	7.430	630,859.010	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,700	36.130	1,651,141.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	33,600	69.960	2,350,656.000	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	15,300	62.390	954,567.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	27,000	23.430	632,610.000	
AMBEV SA	309,495	19.210	5,945,398.950	
NATURA &CO HOLDING SA	43,600	43.730	1,906,628.000	

	RUMO SA	69,000	25.950	1,790,550.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	49,400	41.520	2,051,088.000	
ブラジル・レアル　小計		3,835,018		122,672,580.240 (3,260,637,183)	
ポーランド・ズロチ	BANK MILLENNIUM SA	49,782	6.005	298,940.910	
	MBANK	1,047	377.600	395,347.200	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,924	100.000	792,400.000	
	BANK PEKAO SA	11,985	106.500	1,276,402.500	
	ORANGE POLSKA SA	58,600	7.150	418,990.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	19,130	86.320	1,651,301.600	
	LPP SA	78	8,755.000	682,890.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,258	302.600	683,270.800	
	CD PROJEKT RED SA	4,504	290.600	1,308,862.400	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	60,904	35.410	2,156,610.640	
	CCC SA	2,025	96.450	195,311.250	
	GRUPA LOTOS SA	6,865	85.300	585,584.500	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	134,300	4.348	583,936.400	
	CYFROWY POLSAT SA	10,950	27.540	301,563.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	70,529	7.704	543,355.410	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	36,949	41.800	1,544,468.200	
	DINO POLSKA SA	3,444	159.700	550,006.800	
	AMREST HOLDINGS SE	4,400	45.400	199,760.000	
ポーランド・ズロチ　小計		485,674		14,169,001.610 (410,617,667)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	134,500	3.910	525,895.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	5,500	10.600	58,300.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	332,800	5.200	1,730,560.000	
	DIGI.COM BHD	180,100	4.560	821,256.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	48,320	7.000	338,240.000	
	RHB BANK BHD	107,680	5.850	629,928.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	41,300	9.860	407,218.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	92,200	4.640	427,808.000	
	GAMUDA BHD	124,000	3.990	494,760.000	
	GENTING BHD	125,600	6.170	774,952.000	
	YTL CORP BHD	283,710	1.000	283,710.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	17.160	347,592.960	

	HONG LEONG BANK BHD	50,408	17.200	867,017.600	
	IJM CORP BHD	153,360	2.230	341,992.800	
	IOI CORP BHD	106,413	4.660	495,884.580	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	23,300	24.740	576,442.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,400	33.500	381,900.000	
	MALAYAN BANKING BHD	268,675	8.650	2,324,038.750	
	MISC BHD	90,280	8.270	746,615.600	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,700	145.600	684,320.000	
	PPB GROUP BHD	47,560	18.680	888,420.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	19,600	22.460	440,216.000	
	PETRONAS GAS BHD	42,200	16.600	700,520.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	203,700	3.320	676,284.000	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,700	15.140	116,578.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	110,300	3.930	433,479.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	219,350	12.960	2,842,776.000	
	QL RESOURCES BHD	53,800	8.140	437,932.000	
	DIALOG GROUP BHD	231,044	3.440	794,791.360	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	220,030	19.220	4,228,976.600	
	AIRASIA GROUP BHD	55,500	1.720	95,460.000	
	SIME DARBY BERHAD	259,100	2.220	575,202.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	117,100	5.440	637,024.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	173,500	4.180	725,230.000	
	MAXIS BHD	141,400	5.470	773,458.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	156,600	7.100	1,111,860.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	127,500	5.540	706,350.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	64,500	4.100	264,450.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	106,300	4.940	525,122.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	114,000	5.420	617,880.000	
マレーシア・リンギット　小計		4,675,286		30,850,441.050 (837,897,979)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	161,700	16.100	2,603,370.000	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL SAB DE CV	13,600	99.840	1,357,824.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	92,500	35.790	3,310,575.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,900	203.050	2,213,245.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	20,260	202.280	4,098,192.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	37,600	75.640	2,844,064.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	167,400	109.990	18,412,326.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	60,525	48.980	2,964,514.500	

	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	9,655	205.150	1,980,723.250	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	99,000	39.350	3,895,650.000	
	ALSEA SAB DE CV	38,600	49.540	1,912,244.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,300	376.550	4,631,565.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	239,052	56.920	13,606,839.840	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,200,478	15.050	33,117,193.900	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	176,800	24.750	4,375,800.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	31,600	102.010	3,223,516.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	340,000	56.630	19,254,200.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	25,100	239.620	6,014,462.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	41,100	86.430	3,552,273.000	
メキシコ・ペソ　小計		3,778,170		133,368,578.290 (781,539,869)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	86,619	1.843	159,638.810	
	NATIONAL BANK OF GREECE	35,020	2.820	98,756.400	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	18,601	13.810	256,879.810	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS	178,915	0.853	152,614.490	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	3,854	20.760	80,009.040	
	OPAP SA	11,896	12.060	143,465.760	
	JUMBO SA	6,853	18.210	124,793.130	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL SA	2,700	19.400	52,380.000	
ユーロ　小計		347,588		1,068,537.440 (131,098,859)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	5,553	22,900.000	127,163,700.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,971	78,700.000	155,117,700.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,918	224,500.000	430,591,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	2,643	48,000.000	126,864,000.000	
	WOONGJIN COWAY CO LTD	3,865	89,600.000	346,304,000.000	
	KT&G CORP	7,583	94,100.000	713,560,300.000	
	S-1 CORPORATION	1,444	93,400.000	134,869,600.000	
	KOREA GAS CORP	1,737	35,450.000	61,576,650.000	
	CJ CORP	1,207	91,200.000	110,078,400.000	
	KAKAO CORP	3,350	167,000.000	559,450,000.000	
	CJ ENM CO LTD	563	160,000.000	90,080,000.000	

DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,634	27,200.000	71,644,800.000	
KMW CO LTD	2,564	56,900.000	145,891,600.000	
SK TELECOM CO LTD	1,341	234,500.000	314,464,500.000	
DAELIM INDUSTRIAL CO	2,091	84,100.000	175,853,100.000	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	20,407	7,450.000	152,032,150.000	
NCSOFT CORPORATION	1,142	614,000.000	701,188,000.000	
LG UPLUS CORP	9,656	13,200.000	127,459,200.000	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCT	13,540	4,515.000	61,133,100.000	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,600	17,600.000	63,360,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	638	1,404,000.000	895,752,000.000	
LG CHEM LTD	2,908	332,500.000	966,910,000.000	
LG CHEM LTD	726	177,000.000	128,502,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	79	832,000.000	65,728,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	29,516	41,750.000	1,232,293,000.000	
S-OIL CORP	3,484	85,700.000	298,578,800.000	
HANWHA CHEMICAL CORPORATION	8,289	19,800.000	164,122,200.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	11,739	3,505.000	41,145,195.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,354	37,650.000	163,928,100.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,126	53,800.000	114,378,800.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,085	209,500.000	227,307,500.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,355	106,500.000	250,807,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,508	131,500.000	329,802,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,618	242,000.000	1,117,556,000.000	
SK HYNIX INC	36,140	100,500.000	3,632,070,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,701	40,600.000	190,860,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	744	71,200.000	52,972,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,549	115,000.000	1,213,135,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,974	29,350.000	204,686,900.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	14,942	11,150.000	166,603,300.000	
KCC CORP	427	233,500.000	99,704,500.000	
KIA MOTORS CORP	17,752	40,450.000	718,068,400.000	
KOREA ZINC CO LTD	712	422,500.000	300,820,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,206	26,800.000	434,320,800.000	
HANWHA CORP	137	22,900.000	3,137,300.000	

KOREAN AIR CO LTD	2,656	27,300.000	72,508,800.000	
OCI COMPANY LTD	1,315	62,800.000	82,582,000.000	
CJ LOGISTICS	433	145,500.000	63,001,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,509	76,100.000	114,834,900.000	
HLB INC	2,106	112,000.000	235,872,000.000	
LG ELECTRONICS INC	7,254	66,600.000	483,116,400.000	
LOTTE CORP	2,810	36,650.000	102,986,500.000	
LG CORP	6,142	71,800.000	440,995,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,860	12,050.000	118,813,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,436	29,200.000	129,531,200.000	
NAVER CORP	9,139	188,000.000	1,718,132,000.000	
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	1,306	90,000.000	117,540,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,236	70,100.000	156,743,600.000	
OTTOGI CORP	100	534,000.000	53,400,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,018	90,000.000	181,620,000.000	
KANGWON LAND INC	8,336	29,400.000	245,078,400.000	
POSCO	5,251	238,500.000	1,252,363,500.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,773	19,100.000	224,864,300.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,821	259,000.000	989,639,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,670	134,500.000	493,615,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	320,091	60,000.000	19,205,460,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	27,888	7,470.000	208,323,360.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	55,211	49,500.000	2,732,944,500.000	
SHINSEGAE CO LTD	442	324,000.000	143,208,000.000	
YUHAN CORP	787	233,500.000	183,764,500.000	
HANON SYSTEMS	13,526	11,050.000	149,462,300.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	5,667	24,050.000	136,291,350.000	
GS HOLDINGS CORP	2,949	48,150.000	141,994,350.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,911	15,400.000	229,629,400.000	
CELLTRION INC	6,543	179,500.000	1,174,468,500.000	
HELIXMITH CO LTD	1,305	89,900.000	117,319,500.000	
HANA FINANCIAL GROUP	19,533	34,750.000	678,771,750.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,420	140,000.000	198,800,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	858	135,000.000	115,830,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,580	72,700.000	332,966,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,030	232,000.000	470,960,000.000	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	1,184	104,500.000	123,728,000.000	
SAMSUNG CARD CO	875	37,800.000	33,075,000.000	

	SK INNOVATION CO LTD	3,938	138,000.000	543,444,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	412	233,500.000	96,202,000.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	18,395	4,300.000	79,098,500.000	
	LG INNOTEK CO LTD	999	154,000.000	153,846,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,286	246,500.000	563,499,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	26,019	46,700.000	1,215,087,300.000	
	MEDY-TOX INC	329	373,000.000	122,717,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,958	33,400.000	132,197,200.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	19,615	7,100.000	139,266,500.000	
	HANMI PHARM CO LTD	531	298,500.000	158,503,500.000	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	11,369	2,205.000	25,068,645.000	
	FILA KOREA LTD	2,826	48,300.000	136,495,800.000	
	E-MART CO LTD	1,295	120,000.000	155,400,000.000	
	GS RETAIL CO LTD	2,482	39,550.000	98,163,100.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	4,090	30,250.000	123,722,500.000	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGINEERING & CONSTRUCTION	1,233	22,600.000	27,865,800.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	644	322,500.000	207,690,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	631	168,000.000	106,008,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,834	110,500.000	202,657,000.000	
	ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2,763	27,350.000	75,568,050.000	
	NETMARBLE CORP	1,524	96,500.000	147,066,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	34,219	10,600.000	362,721,400.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,403	197,500.000	474,592,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,272	109,000.000	574,648,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,066	440,500.000	469,573,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	534	198,500.000	105,999,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,636	33,100.000	120,351,600.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,978	52,400.000	208,447,200.000	
韓国・ウォン　小計		996,770		58,162,005,300.000 (5,571,920,108)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	124,000	10.840	1,344,160.000	
	JIANGSU EXPRESS	74,000	10.940	809,560.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	66,000	5.490	362,340.000	
	CHINA MOBILE LIMITED	407,500	65.400	26,650,500.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	75,000	57.000	4,275,000.000	

DATANG INTERNATIONAL POWER GEN	100,000	1.480	148,000.000	
BEIJING ENTERPRISES	43,000	36.350	1,563,050.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	328,000	3.910	1,282,480.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	272,000	9.900	2,692,800.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	112,000	6.850	767,200.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	49,500	61.850	3,061,575.000	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	144,000	2.830	407,520.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	124,000	4.360	540,640.000	
CNOOC LTD	1,179,000	13.740	16,199,460.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	212,000	7.970	1,689,640.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	328,000	18.000	5,904,000.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	249,120	29.650	7,386,408.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	182,888	36.950	6,757,711.600	
CITIC LTD	416,000	10.120	4,209,920.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	130,000	6.970	906,100.000	
LENOVO GROUP LTD	464,000	5.810	2,695,840.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,416,000	3.990	5,649,840.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	428,742	7.120	3,052,643.040	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	111,190	20.050	2,229,359.500	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,685,200	4.740	7,987,848.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	72,000	18.720	1,347,840.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	167,000	9.000	1,503,000.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	51,100	89.450	4,570,895.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	232,000	7.110	1,649,520.000	
TOWNGAS CHINA CO LTD	80,000	5.490	439,200.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	78,000	6.340	494,520.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	308,000	1.770	545,160.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	76,000	13.700	1,041,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	2.600	379,600.000	

CHINA DING YI FENG HOLDINGS LTD	80,000	11.550	924,000.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	73,000	21.500	1,569,500.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	56,000	17.500	980,000.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	38,000	14.100	535,800.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	121,200	30.900	3,745,080.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	33,500	24.700	827,450.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	352,000	16.340	5,751,680.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	138,000	3.050	420,900.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	43.700	2,447,200.000	
BYD CO LTD	37,500	44.900	1,683,750.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	994,000	3.110	3,091,340.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	134,000	12.600	1,688,400.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	860,000	1.420	1,221,200.000	
SINOTRANS LTD	160,000	2.800	448,000.000	
MAANSHAN IRON & STEEL	140,000	3.160	442,400.000	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL	241,592	5.970	1,442,304.240	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	84,000	6.020	505,680.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	483,788	9.470	4,581,472.360	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	189,000	3.700	699,300.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	159,200	10.920	1,738,464.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	246,000	5.800	1,426,800.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	479,000	22.750	10,897,250.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	401,000	4.000	1,604,000.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	120,000	9.400	1,128,000.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	193,700	13.680	2,649,816.000	
WEICHAI POWER CO LTD	125,440	15.640	1,961,881.600	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	100,000	3.780	378,000.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	287,000	2.320	665,840.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	17,000	14.980	254,660.000	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	42,000	11.040	463,680.000	

TINGYI HOLDING CORP	122,000	13.780	1,681,160.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	34,000	49.500	1,683,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	214,000	16.220	3,471,080.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	208,000	3.870	804,960.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	103,333	41.800	4,319,319.400	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	7.170	831,720.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	448,500	11.080	4,969,380.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	191,000	32.600	6,226,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	384,400	406.400	156,220,160.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	370,000	95.600	35,372,000.000	
LI NING CO LTD	140,000	26.650	3,731,000.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	338,000	3.950	1,335,100.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	336,240	0.730	245,455.200	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.680	352,800.000	
AIR CHINA / HONG KONG	162,000	8.010	1,297,620.000	
ZTE CORP	47,288	27.600	1,305,148.800	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	320,000	2.620	838,400.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	239,000	15.980	3,819,220.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	250,500	3.270	819,135.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	580,205	5.520	3,202,731.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	150,250	7.190	1,080,297.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	53,000	67.600	3,582,800.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,424,530	6.800	43,686,804.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	49,200	113.000	5,559,600.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	208,000	7.280	1,514,240.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	80,000	11.920	953,600.000	
SSY GROUP LTD	104,000	6.500	676,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	80,000	8.020	641,600.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	286,000	8.800	2,516,800.000	
BANK OF CHINA LTD	5,442,200	3.330	18,122,526.000	

SHUI ON LAND LTD	300,000	1.750	525,000.000	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	77,000	30.300	2,333,100.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	60,000	14.040	842,400.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	268,970	41.100	11,054,667.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	4,412,235	5.970	26,341,042.950	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	93,000	8.800	818,400.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	56,500	9.630	544,095.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	179,600	5.610	1,007,556.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	290,000	6.260	1,815,400.000	
CHINA COAL ENERGY CO	160,000	3.050	488,000.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	54,000	20.000	1,080,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	28.550	893,615.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	83,000	24.700	2,050,100.000	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HOLDINGS LTD	191,000	4.150	792,650.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	491,142	12.260	6,021,400.920	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	216,000	3.490	753,840.000	
CHINA CITIC BANK-H	672,800	4.600	3,094,880.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	61,000	11.380	694,180.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	46,900	145.700	6,833,330.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	69,000	75.200	5,188,800.000	
FOSUN INTERNATIONAL	173,028	12.020	2,079,796.560	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	396,000	6.080	2,407,680.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	90,000	12.520	1,126,800.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	133,500	3.190	425,865.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	2.910	436,500.000	
SOHO CHINA LTD	170,000	3.040	516,800.000	
KINGSOFT CORP LTD	58,000	21.450	1,244,100.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	38,500	16.120	620,620.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	288,000	4.850	1,396,800.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	104,000	8.200	852,800.000	

BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	52,500	17.700	929,250.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	100,500	8.910	895,455.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	321,000	7.010	2,250,210.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	175,200	31.450	5,510,040.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	133,000	22.150	2,945,950.000	
CRRC CORP LTD - H	265,450	5.840	1,550,228.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	99,000	10.600	1,049,400.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	142,500	9.930	1,415,025.000	
BBMG CORP	222,000	2.450	543,900.000	
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	130,000	3.160	410,800.000	
SINOPHARM GROUP CO	78,000	28.900	2,254,200.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	190,000	10.080	1,915,200.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	189,000	1.730	326,970.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	190,527	9.970	1,899,554.190	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	4.650	392,925.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	181,000	4.030	729,430.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	272,000	5.090	1,384,480.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	48,200	15.200	732,640.000	
HUANENG RENEWABLES CORP LTD	330,000	3.050	1,006,500.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	162,000	44.650	7,233,300.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	130,000	4.230	549,900.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	121,800	6.780	825,804.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	113,500	36.850	4,182,475.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	50,800	34.900	1,772,920.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	474,656	5.990	2,843,189.440	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	203,000	4.060	824,180.000	

XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	55,200	9.260	511,152.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	78,000	10.740	837,720.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	173,000	3.700	640,100.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,047,000	3.380	6,918,860.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,500	32.200	1,271,900.000	
FAR EAST HORIZON LTD	146,000	7.510	1,096,460.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	133,000	18.420	2,449,860.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	132,000	9.050	1,194,600.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	177,200	9.300	1,647,960.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	509,000	3.290	1,674,610.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	31,000	23.950	742,450.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	210,000	6.190	1,299,900.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	121,500	4.780	580,770.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	306,000	4.700	1,438,200.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	68,000	6.710	456,280.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	96,000	8.640	829,440.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	59,800	14.300	855,140.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	552,000	5.370	2,964,240.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	35,000	50.550	1,769,250.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	54,000	17.500	945,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	74,000	28.600	2,116,400.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	103,000	5.280	543,840.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	24,200	61.350	1,484,670.000	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	188,000	0.270	50,760.000	

CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	19,000	10.740	204,060.000	
A-LIVING SERVICES CO LTD	29,750	32.300	960,925.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,748,000	1.770	4,863,960.000	
XIAOMI CORP	519,800	11.900	6,185,620.000	
WUXI APPTEC CO LTD	7,000	98.150	687,050.000	
MEITUAN DIANPING	67,200	113.100	7,600,320.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	18,000	35.500	639,000.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	244,000	5.830	1,422,520.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	54,500	29.100	1,585,950.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	516,000	1.860	959,760.000	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO LTD	102,000	12.700	1,295,400.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	116,000	37.000	4,292,000.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	32,000	15.860	507,520.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	30,000	25.650	769,500.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	108,461	32.800	3,557,520.800	
LUYE PHARMA GROUP LTD	53,000	5.910	313,230.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	39,000	21.500	838,500.000	
CGN POWER CO LTD	749,000	2.080	1,557,920.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	82,000	4.390	359,980.000	
GF SECURITIES CO LTD	62,000	10.120	627,440.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,400	25.500	622,200.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	124,800	13.940	1,739,712.000	
3SBIO INC	64,500	11.400	735,300.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	13,500	16.860	227,610.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	7.400	688,200.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	604,000	1.310	791,240.000	
CHINA LITERATURE LTD	15,600	41.300	644,280.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	188,000	5.790	1,088,520.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	141,000	4.470	630,270.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	525,000	1.320	693,000.000	
BOC AVIATION LTD	8,800	74.200	652,960.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	23,000	30.150	693,450.000	

	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	96,000	16.200	1,555,200.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,500	99.000	3,613,500.000	
香港・ドル　小計		62,215,625		706,155,959.700 (10,006,229,950)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	40,000	168.000	6,720,000.000	
	ACER INC	220,532	17.800	3,925,469.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	51,554	235.500	12,140,967.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	32,616	257.500	8,398,620.000	
	ASIA CEMENT CORP	164,928	48.950	8,073,225.600	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	20,000	227.500	4,550,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	300,779	12.600	3,789,815.400	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	79.800	5,266,800.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	51,000	90.800	4,630,800.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	28,975	89.100	2,581,672.500	
	QUANTA COMPUTER INC	187,858	64.100	12,041,697.800	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	58,070	46.300	2,688,641.000	
	EVA AIRWAYS CORP	202,125	13.700	2,769,112.500	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	46,760	244.000	11,409,440.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	331,771	22.500	7,464,847.500	
	CHINA AIRLINES	156	9.030	1,408.680	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	115,169	42.400	4,883,165.600	
	CHINA STEEL CORP	793,058	24.000	19,033,392.000	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	190,994	26.050	4,975,393.700	
	ADVANTECH CO LTD	21,889	308.500	6,752,756.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	290,304	18.900	5,486,745.600	
	DELTA ELECTRONICS INC	128,663	149.500	19,235,118.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	68,000	85.500	5,814,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	255,327	110.000	28,085,970.000	
	AU OPTRONICS CORP	520,194	10.350	5,384,007.900	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	108,800	109.000	11,859,200.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	208,820	13.150	2,745,983.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	243,824	29.500	7,192,808.000	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	27,307	190.500	5,201,983.500	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	402.000	6,159,444.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,285	232.500	9,366,262.500	
	FORMOSA PLASTICS CORP	293,633	99.700	29,275,210.100	

FORMOSA TAFFETA CO LTD	79,000	34.350	2,713,650.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	253,594	87.500	22,189,475.000	
GIANT MANUFACTURING	24,151	195.500	4,721,520.500	
MEDIATEK INC	98,507	422.000	41,569,954.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	439,936	46.800	20,589,004.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	500,459	22.200	11,110,189.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	687.000	13,053,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,000	71.200	8,686,400.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	702,141	20.200	14,183,248.200	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	508,941	42.850	21,808,121.850	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	834,403	9.830	8,202,181.490	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	739,545	28.550	21,114,009.750	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	829,225	89.600	74,298,560.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	756,495	31.700	23,980,891.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	5,050.000	31,411,000.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	713,593	14.550	10,382,778.150	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	795,061	10.300	8,189,128.300	
INVENTEC CO LTD	206,005	23.150	4,769,015.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	156,845	49.250	7,724,616.250	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	805,443	13.050	10,511,031.150	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,295,048	22.500	29,138,580.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	697,852	23.900	16,678,662.800	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	41,560	101.500	4,218,340.000	
NAN YA PLASTICS CORP	347,828	73.000	25,391,444.000	
WISTRON CORP	213,916	28.750	6,150,085.000	
POU CHEN CORP	153,990	39.050	6,013,309.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	310,297	74.600	23,148,156.200	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	36,392	310.000	11,281,520.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	75,480	97.500	7,359,300.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	12,658	341.000	4,316,378.000	

	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	12,393	45.350	562,022.550	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	25,829	71.800	1,854,522.200	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	37,588	65.000	2,443,220.000	
	STANDARD FOODS CORP	34,639	70.000	2,424,730.000	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	46,899	37.550	1,761,057.450	
	TAIWAN CEMENT CORP	308,684	44.250	13,659,267.000	
	TATUNG CO LTD	120,000	21.500	2,580,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,650,083	341.500	563,503,344.500	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	713,525	16.050	11,452,076.250	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	219,000	19.550	4,281,450.000	
	YAGEO CORP	14,160	390.000	5,522,400.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	113,000	38.800	4,384,400.000	
	INNOLUX CORPORATION	666,345	9.350	6,230,325.750	
	WPG HOLDINGS CO LTD	109,203	38.550	4,209,775.650	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,645	302.000	4,120,790.000	
	PEGATRON CORP	135,554	69.200	9,380,336.800	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,000	511.000	4,599,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	285.000	6,270,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	82,029	140.000	11,484,060.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	37,385	138.000	5,159,130.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	677,674	21.000	14,231,154.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	209,993	52.000	10,919,636.000	
	WIWYNN CORP	5,000	690.000	3,450,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	240,903	80.700	19,440,872.100	
	GLOBALWAFERS CO LTD	14,000	396.000	5,544,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	289.500	2,895,000.000	
台湾・ドル　小計		22,428,829		1,485,170,080.720 (5,465,425,897)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	18,432	214.760	3,958,456.320	
	CLICKS GROUP LTD	15,748	256.000	4,031,488.000	
	DISCOVERY LTD	26,029	120.250	3,129,987.250	
	GOLD FIELDS LTD	54,414	88.330	4,806,388.620	
	REMGRO LTD	36,309	190.860	6,929,935.740	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	12,960	149.910	1,942,833.600	
	NORTHAM PLATINUM LTD	26,073	134.450	3,505,514.850	

	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	80,234	21.640	1,736,263.760	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,729	131.990	2,604,030.710	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,226	1,431.350	4,617,535.100	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	11,718	109.810	1,286,753.580	
	MTN GROUP LTD	116,247	82.600	9,602,002.200	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,905	307.870	8,898,982.350	
	TELKOM SA SOC LTD	22,080	35.000	772,800.000	
	FIRSTRAND LTD	217,279	59.320	12,888,990.280	
	PSG GROUP LTD	11,126	233.590	2,598,922.340	
	NASPERS LTD	29,569	2,389.030	70,641,228.070	
	NEDBANK GROUP LTD	25,563	210.220	5,373,853.860	
	PICK'N PAY STORES LTD	27,032	62.060	1,677,605.920	
	RMB HOLDINGS LTD	43,597	76.520	3,336,042.440	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,162	1,363.720	4,312,082.640	
	SASOL LTD	36,214	308.500	11,172,019.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	33,217	119.040	3,954,151.680	
	MR PRICE GROUP LTD	18,990	184.500	3,503,655.000	
	STANDARD BANK GROUP LTD	84,044	163.820	13,768,088.080	
	SPAR GROUP LTD/THE	12,986	191.850	2,491,364.100	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,051	48.200	3,472,858.200	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,788	118.420	3,409,074.960	
	ABSA GROUP LTD	48,353	140.920	6,813,904.760	
	TIGER BRANDS LTD	13,003	213.000	2,769,639.000	
	SANLAM LTD	118,973	77.540	9,225,166.420	
	INVESTEC LTD	21,242	82.770	1,758,200.340	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	51,218	147.520	7,555,679.360	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,074	418.630	1,286,868.620	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	101,875	24.930	2,539,743.750	
	RMI HOLDINGS	55,570	29.580	1,643,760.600	
	VODACOM GROUP PTY LTD	41,031	117.500	4,821,142.500	
	SIBANYE STILLWATER	163,740	35.550	5,820,957.000	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	28,593	126.180	3,607,864.740	
	OLD MUTUAL LTD	339,931	19.070	6,482,484.170	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,251	292.430	2,412,839.930	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	66,633	17.770	1,184,068.410	
	MULTICHOICE GROUP LTD	28,769	113.850	3,275,350.650	
	BID CORP LTD	21,757	333.990	7,266,620.430	
南アフリカ・ランド　小計		2,227,735		268,887,199.330 (2,059,675,947)	
合計		183,006,755		46,798,421,986 (46,798,421,986)	

（２）株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・バーツ	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	28,584.300	
	タイ・バーツ　小計		9,465.000	28,584.300 (104,047)	
新株予約権証券　合計			9,465	104,047 (104,047)	
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	16,400.000	1,251,812.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	27,800.000	1,293,812.000	
		ENERGISA SA	10,600.000	585,756.000	
		KLABIN SA	40,200.000	822,090.000	
		SUL AMERICA SA	17,869.000	1,123,245.340	
	ブラジル・レアル　小計		112,869.000	5,076,715.340 (134,939,094)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,067,375.000	7,631,731.250	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	39,700.000	4,528,579.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	132,100.000	23,924,631.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	171,900.000	7,541,253.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	27,400.000	2,070,070.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,438,475.000	45,696,264.250 (267,780,108)	
投資信託受益証券　合計			1,551,344	402,719,202 (402,719,202)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	207,200.000	6,427,344.000	
	メキシコ・ペソ　小計		207,200.000	6,427,344.000 (37,664,236)	
	南アフリカ・ランド	FORTRESS REIT LTD	67,467.000	1,268,379.600	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	184,218.000	4,043,585.100	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	425,362.000	3,147,678.800	
	南アフリカ・ランド　小計		677,047.000	8,459,643.500 (64,800,868)	
投資証券　合計			884,247	102,465,104 (102,465,104)	
合計				505,288,353 (505,288,353)	

（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 58銘柄	11.20	－	－	－	14.48
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 7銘柄	0.42	－	－	－	0.54
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.05	－	－	－	0.06
インド・ルピー	株式 85銘柄	6.69	－	－	－	8.66
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	1.49	－	－	－	1.93
オフショア・人民元	株式 162銘柄	3.12	－	－	－	4.04
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.69	－	－	－	0.90
コロンビア・ペソ	株式 7銘柄	0.28	－	－	－	0.36
サウジアラビア・リアル	株式 33銘柄	1.97	－	－	－	2.55
タイ・バーツ	株式 41銘柄 新株予約権証券 1銘柄	1.92 －	－ 0.00	－ －	－ －	2.48
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.11	－	－	－	0.14
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.59	－	－	－	0.76
トルコ・リラ	株式 15銘柄	0.39	－	－	－	0.50
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22	－	－	－	0.28
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03	－	－	－	0.04
フィリピン・ペソ	株式 21銘柄	0.71	－	－	－	0.92
ブラジル・レアル	株式 50銘柄 投資信託受益証券 5銘柄	5.33 －	－ －	－ 0.22	－ －	7.18
ポーランド・ズロチ	株式 18銘柄	0.67	－	－	－	0.87
マレーシア・リンギット	株式 40銘柄	1.37	－	－	－	1.77
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	1.28 － －	－ － －	－ 0.44 －	－ － 0.06	2.30
ユーロ	株式 9銘柄	0.21	－	－	－	0.28
韓国・ウォン	株式 111銘柄	9.11	－	－	－	11.78
香港・ドル	株式 210銘柄	16.36	－	－	－	21.15
台湾・ドル	株式 88銘柄	8.93	－	－	－	11.55
南アフリカ・ランド	株式 44銘柄 投資証券 3銘柄	3.37 －	－ －	－ －	－ 0.11	4.49

（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2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,051,950,047
投資証券	39,964,352,980
未収配当金	332,083,290
前払金	12,977,400
差入委託証拠金	21,685,500
流動資産合計	45,383,049,217
資産合計	45,383,049,217
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,841,790
未払金	4,018,478,450
未払解約金	61,153,000
流動負債合計	4,090,473,240
負債合計	4,090,473,240
純資産の部	
元本等	
元本	17,388,243,328
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	23,904,332,649
元本等合計	41,292,575,977
純資産合計	41,292,575,977
負債純資産合計	45,383,049,217

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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	17,082,103,863円
同期中追加設定元本額	20,892,408,243円
同期中一部解約元本額	20,586,268,778円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	257,195円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	738,770円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	1,096,761円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	3,558,545円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	2,776,726円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,391,460円
たわらノーロード　国内リート	3,789,552,247円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	640,927,567円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	338,632,945円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	5,492,026円
たわらノーロード　バランス（標準型）	98,312,824円
たわらノーロード　バランス（積極型）	107,008,681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）	153,183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）	65,184,831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）	139,969,003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）	82,477,874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）	136,322,411円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,629,349円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	3,101,831円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,037,083円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	3,428,625円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,828,475円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	328,184,484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）	105,960,037円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	207,630,366円
投資のソムリエ	2,599,573,576円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	251,388,659円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	82,866,098円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	102,228,276円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,095,626,393円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	2,160,188円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	1,776,229円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	843,544円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	4,495,474円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	807,672,633円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	69,681,272円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	321,602円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	270,974円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	270,996円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	25,591,945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）	87,369,628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）	785,828,086円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	6,903,006円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,513,492,931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）	353,769,449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）	1,411,203,987円
計	17,388,243,328円
２．　受益権の総数	17,388,243,328口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
投資証券	1,501,902,383
合計	1,501,902,383

（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2年1月14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2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 不動産投信指数先物取引 買建	1,174,112,400	－	1,163,331,000	△10,781,400
合計	1,174,112,400	－	1,163,331,000	△10,781,400

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3747円 (23,747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2年1月14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	514	75,044,000	
	ＧＬＰ投資法人	9,127	1,227,581,500	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	4,701	558,008,700	
	Ｏｎｅリート投資法人	571	198,708,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,838	310,761,000	
	いちごホテルリート投資法人	607	83,948,100	
	さくら総合リート投資法人	793	75,969,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,836	962,064,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,476	1,183,578,000	
	イオンリート投資法人	3,955	593,645,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	23,543	514,649,980	

インヴィンシブル投資法人	16,074	986,943,600	
エスコンジャパンリート投資法人	376	48,917,600	
オリックス不動産投資法人	7,302	1,716,700,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,545	349,683,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,134	936,684,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,281	470,114,100	
ケネディクス商業リート投資法人	1,415	382,333,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,526	526,470,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	734	84,189,800	
サンケイリアルエステート投資法人	531	67,543,200	
ザイマックス・リート投資法人	532	74,320,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,805	950,302,500	
ジャパンエクセレント投資法人	3,282	587,806,200	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,665	2,664,455,000	
スターアジア不動産投資法人	1,216	140,812,800	
スターツプロシード投資法人	571	114,257,100	
タカラレーベン不動産投資法人	1,040	130,832,000	
トーセイ・リート投資法人	798	105,575,400	
ヒューリックリート投資法人	3,117	606,879,900	
フロンティア不動産投資法人	1,302	584,598,000	
プレミア投資法人	3,310	503,451,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	782	107,134,000	
マリモ地方創生リート投資法人	315	40,572,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,228	1,675,220,800	
ラサールロジポート投資法人	3,407	545,460,700	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	567	68,096,700	
阪急阪神リート投資法人	1,655	277,047,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	902	427,548,000	
三菱地所物流リート投資法人	721	251,989,500	
産業ファンド投資法人	4,720	777,856,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	860	129,602,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,619	504,943,200	
森ヒルズリート投資法人	4,216	749,604,800	
星野リゾート・リート投資法人	558	318,618,000	
積水ハウス・リート投資法人	10,715	958,992,500	
大江戸温泉リート投資法人	623	58,375,100	

	大和ハウスリート投資法人	4,940	1,387,646,000	
	大和証券オフィス投資法人	846	698,796,000	
	投資法人みらい	4,167	250,436,700	
	東急リアル・エステート投資法人	2,457	501,228,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,218	825,804,000	
	日本ビルファンド投資法人	3,549	2,881,788,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	2,320	1,104,320,000	
	日本プロロジスリート投資法人	5,265	1,477,359,000	
	日本ヘルスケア投資法人	178	37,789,400	
	日本リート投資法人	1,190	553,945,000	
	日本リテールファンド投資法人	6,926	1,609,602,400	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,394	665,532,000	
	日本賃貸住宅投資法人	4,122	432,397,800	
	福岡リート投資法人	1,895	350,196,000	
	平和不動産リート投資法人	2,282	300,539,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	11,830	2,179,086,000	
投資証券　合計		212,984	39,964,352,980	
合計			39,964,352,980	

（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2年1月14日現在
資産の部	
流動資産	
預金	132,898,568
コール・ローン	52,412,120
投資信託受益証券	4,423,507,485
投資証券	36,828,028,312
派生商品評価勘定	1,472
未収入金	9,937,039
未収配当金	198,384,986
流動資産合計	41,645,169,982
資産合計	41,645,169,982
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	408
未払金	112,583,636
未払解約金	838,000
流動負債合計	113,422,044
負債合計	113,422,044
純資産の部	
元本等	
元本	29,640,253,704
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	11,891,494,234
元本等合計	41,531,747,938
純資産合計	41,531,747,938
負債純資産合計	41,645,169,982

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年1月14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	40,387,573,752円
同期中追加設定元本額	41,534,742,608円
同期中一部解約元本額	52,282,062,656円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	149,781,513円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	90,546,901円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,123,577円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	12,000,264円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	17,835,829円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	57,101,122円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	44,818,485円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	22,588,234円
たわらノーロード　先進国リート	4,849,254,458円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	440,597,624円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	225,123,794円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	587,830,256円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	4,775,176円

	たわらノーロード　バランス（標準型）	85,485,169円
	たわらノーロード　バランス（積極型）	171,118,815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）	42,183,342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）	175,669,559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）	131,384,126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）	250,936,816円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,249,786円
	たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	3,892,582円
	たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,515,537円
	たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,607,105円
	Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,813,361円
	マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	18,760,242円
	マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	520,836,657円
	マネックス資産設計ファンド　エボリューション	51,197,652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）	184,756,360円
	ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	361,025,820円
	投資のソムリエ	5,144,639,393円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	497,171,326円
	ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	143,623,510円
	投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	221,005,042円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,374,491,688円
	ワールドアセットバランス（基本コース）	812,123,062円
	ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	3,152,334,046円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	7,867,234円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	6,495,377円
	リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,827,884円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	12,066,338円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,766,404,334円
	９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	121,836,794円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	1,172,464円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	995,914円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	995,529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＞	69,243,183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）	162,964,865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）	314,933,341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）	1,338,675,061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）	557,083,637円
	計	29,640,253,704円
２．	受益権の総数	29,640,253,704口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年3月18日 至　令和2年1月14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2年1月14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2年1月14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	14,916,964
投資証券	458,433,866
合計	473,350,830

（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2年1月14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2年1月14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	36,700,886	－	36,701,950	1,064
アメリカ・ドル	30,840,768	－	30,842,000	1,232
イギリス・ポンド	3,578,510	－	3,578,750	240
オーストラリア・ドル	2,281,608	－	2,281,200	△408
合計	36,700,886	－	36,701,950	1,064

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②計算日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4012円 (14,012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2年1月14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	137,800.000	119,197.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	150,000.000	80,250.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	418,500.000	410,130.000	
		PRIME US REIT	100,000.000	98,000.000	

アメリカ・ドル　小計		806,300.000	707,577.000 (77,946,682)	
オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	93,467.000	343,958.560	
	APN INDUSTRIA REIT	45,032.000	131,493.440	
	ARENA REIT	96,709.000	283,357.370	
	BWP TRUST	127,864.000	507,620.080	
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	96,513.000	283,748.220	
	CHARTER HALL GROUP	129,554.000	1,561,125.700	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	117,483.000	655,555.140	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	93,664.000	417,741.440	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	64,674.000	212,130.720	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	529,034.000	624,260.120	
	DEXUS	300,234.000	3,626,826.720	
	GDI PROPERTY GROUP	162,681.000	245,648.310	
	GOODMAN GROUP	443,395.000	6,243,001.600	
	GPT GROUP	534,137.000	3,124,701.450	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	82,134.000	350,712.180	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	51,054.000	164,904.420	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	63,461.000	295,093.650	
	MIRVAC GROUP	1,096,619.000	3,585,944.130	
	NATIONAL STORAGE REIT	206,892.000	407,577.240	
	RURAL FUNDS GROUP	116,459.000	223,601.280	
	SCENTRE GROUP	1,473,177.000	5,848,512.690	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	263,343.000	721,559.820	
	STOCKLAND	674,863.000	3,266,336.920	
	VICINITY CENTRES	896,690.000	2,241,725.000	
	VIVA ENERGY REIT	120,103.000	325,479.130	
オーストラリア・ドル　小計		7,879,236.000	35,692,615.330 (2,714,423,394)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	112,395.000	165,220.650	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	831,460.000	2,560,896.800	
	ASCOTT TRUST	518,516.000	694,811.440	
	CACHE LOGISTICS TRUST	247,780.000	179,640.500	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	794,279.000	1,660,043.110	
	CAPITALAND MALL TRUST	789,260.000	2,012,613.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	198,880.000	322,185.600	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	226,400.000	371,296.000	
	ESR REIT	535,630.000	294,596.500	

		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	213,400.000	161,117.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	141,400.000	141,400.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	201,900.000	565,320.000	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	176,180.000	290,697.000	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	228,100.000	163,091.500	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	442,450.000	544,213.500	
		KEPPEL DC REIT	343,400.000	755,480.000	
		KEPPEL REIT	543,900.000	679,875.000	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	455,900.000	102,577.500	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	598,500.000	1,448,370.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	423,920.000	1,140,344.800	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	835,220.000	1,469,987.200	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	604,400.000	707,148.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	724,655.000	405,806.800	
		PARKWAY LIFE REIT	109,200.000	368,004.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	295,000.000	135,700.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	181,500.000	161,535.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	199,300.000	105,629.000	
		SPH REIT	220,200.000	240,018.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	350,400.000	252,288.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	648,590.000	1,206,377.400	
	シンガポール・ドル　小計		12,192,115.000	19,306,283.300 (1,580,412,351)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	387,000.000	3,579,750.000	
	香港・ドル　小計		387,000.000	3,579,750.000 (50,725,058)	
投資信託受益証券　合計			21,264,651	4,423,507,485 (4,423,507,485)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	23,229.000	590,016.600	
		AGREE REALTY CORP	11,901.000	846,399.120	
		ALEXANDER'S INC.	665.000	225,601.250	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	31,844.000	5,119,878.320	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,813.000	590,551.170	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	38,131.000	1,752,119.450	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	28,249.000	364,694.590	
AMERICAN HOMES 4 RENT	70,704.000	1,881,433.440	
AMERICOLD REALTY TRUST	53,200.000	1,861,468.000	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	41,481.000	2,152,863.900	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	58,960.000	928,620.000	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	25,699.000	68,616.330	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	38,787.000	8,184,832.740	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,367.000	100,822.350	
BOSTON PROPERTIES INC	39,762.000	5,438,248.740	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	11,492.000	99,750.560	
BRANDYWINE REALTY TRUST	49,539.000	775,285.350	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	82,663.000	1,696,244.760	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	17,255.000	319,217.500	
BRT APARTMENTS CORP	2,813.000	49,030.590	
CAMDEN PROPERTY TRUST	26,817.000	2,869,419.000	
CARETRUST REIT INC	25,479.000	529,708.410	
CBL & ASSOCIATES	70,695.000	72,108.900	
CEDAR REALTY TRUST INC	27,397.000	77,533.510	
CHATHAM LODGING TRUST	15,435.000	273,045.150	
CITY OFFICE REIT INC	14,118.000	190,593.000	
CLIPPER REALTY INC	5,169.000	54,222.810	
COLONY CAPITAL INC	137,188.000	666,733.680	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	31,277.000	659,944.700	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	4,932.000	218,684.880	
CORECIVIC INC	31,742.000	504,062.960	
COREPOINT LODGING INC	14,852.000	147,183.320	
CORESITE REALTY CORP	10,537.000	1,189,838.040	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	31,401.000	930,725.640	
COUSINS PROPERTIES INC	40,740.000	1,682,969.400	
CUBESMART	53,725.000	1,668,698.500	
CYRUSONE INC	31,388.000	1,966,772.080	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	53,470.000	557,157.400	
DIGITAL REALTY TRUST INC	57,996.000	7,073,772.120	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	66,334.000	555,215.580	

DOUGLAS EMMETT INC	45,710.000	1,927,133.600	
DUKE REALTY TRUST	101,733.000	3,598,296.210	
EAST GROUP	10,673.000	1,420,256.110	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	19,729.000	458,304.670	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	39,851.000	560,305.060	
EPR PROPERTIES	21,790.000	1,554,934.400	
EQUINIX INC	23,672.000	14,083,893.120	
EQUITY COMMONWEALTH	34,107.000	1,113,934.620	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	50,391.000	3,578,768.820	
EQUITY RESIDENTIAL	96,948.000	7,976,881.440	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	21,620.000	561,687.600	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	18,387.000	5,617,228.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	35,838.000	3,874,804.560	
FARMLAND PARTNERS INC	9,630.000	66,158.100	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,461.000	2,468,238.630	
FIRST INDUSTRIAL RT	35,269.000	1,489,057.180	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	18,364.000	513,090.160	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	35,353.000	281,056.350	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	17,285.000	212,605.500	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	56,512.000	2,496,135.040	
GEO GROUP INC	32,330.000	508,227.600	
GETTY REALTY CORP	8,997.000	291,322.860	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,046.000	179,345.340	
GLADSTONE LAND CORP	7,339.000	96,507.850	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,391.000	168,641.510	
GLOBAL NET LEASE INC	23,824.000	479,100.640	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	37,377.000	1,259,604.900	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	57,501.000	1,757,805.570	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	136,897.000	4,836,571.010	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,669.000	186,581.850	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	28,829.000	1,427,900.370	
HOST HOTELS & RESORTS INC	198,500.000	3,507,495.000	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	43,026.000	1,536,028.200	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	24,008.000	345,955.280	

		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	17,276.000	382,577.020	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	3,094.000	258,813.100	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,829.000	272,241.900	
		INVITATION HOMES INC	148,917.000	4,495,804.230	
		IRON MOUNTAIN INC	79,561.000	2,453,661.240	
		JBG SMITH PROPERTIES	32,976.000	1,309,476.960	
		KILROY REALTY CORP	27,034.000	2,199,486.240	
		KIMCO REALTY	117,016.000	2,311,066.000	
		KITE REALTY GROUP TRUST	22,303.000	412,605.500	
		LEXINGTON REALTY TRUST	69,730.000	749,597.500	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	43,706.000	2,703,653.160	
		LIFE STORAGE INC	12,962.000	1,431,652.900	
		LTC PROPERTIES INC	10,581.000	487,784.100	
		MACK CALI	24,165.000	564,252.750	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	143,277.000	3,107,678.130	
		MID AMERICA	31,558.000	4,213,939.740	
		MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	25,675.000	373,571.250	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	12,309.000	1,033,463.640	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	47,553.000	2,567,386.470	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	15,828.000	549,073.320	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	29,051.000	225,145.250	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,911.000	272,851.760	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	12,788.000	430,508.020	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	60,536.000	2,613,339.120	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,334.000	147,325.080	
		PARAMOUNT GROUP INC	56,539.000	790,980.610	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	66,456.000	1,608,235.200	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	36,603.000	937,036.800	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	21,989.000	111,044.450	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	51,903.000	991,866.330	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	35,229.000	796,175.400	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,788.000	87,955.560	
		PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,841.000	196,791.660	
		PROLOGIS INC	175,350.000	16,097,130.000	

PS BUSINESS PARKS	5,612.000	945,734.240	
PUBLIC STORAGE	41,715.000	9,042,977.700	
QTS REALTY TRUST INC	16,030.000	849,109.100	
REALTY INCOME CORP	90,659.000	6,795,798.640	
REGENCY CENTERS CORP	46,403.000	2,882,554.360	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	30,938.000	523,161.580	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	60,072.000	771,925.200	
RETAIL VALUE INC	5,794.000	201,573.260	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	30,821.000	1,440,573.540	
RLJ LODGING TRUST	47,862.000	797,380.920	
RPT REALTY	23,077.000	332,539.570	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,214.000	1,289,386.500	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	54,166.000	1,181,360.460	
SAFEHOLD INC	3,834.000	158,267.520	
SAUL CENTERS INC	3,811.000	202,973.860	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	8,860.000	350,856.000	
SERVICE PROPERTIES TRUST	46,045.000	1,071,467.150	
SIMON PROPERTY GROUP INC	85,187.000	12,376,819.230	
SITE CENTERS CORP	39,812.000	514,769.160	
SL GREEN	22,604.000	2,077,759.680	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	27,854.000	1,381,279.860	
STAG INDUSTRIAL INC	37,176.000	1,190,375.520	
STORE CAPITAL CORP	59,234.000	2,227,790.740	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	27,784.000	336,464.240	
SUN COMMUNITIES INC	25,646.000	3,927,428.440	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	63,087.000	841,580.580	
TANGER FACTORY OUTLET	24,561.000	392,484.780	
TAUBMAN CENTERS INC	16,310.000	511,970.900	
TERRENO REALTY CORP	18,760.000	1,044,181.600	
THE MACERICH COMPANY	30,931.000	781,007.750	
UDR INC	81,095.000	3,778,216.050	
UMH PROPERTIES INC	10,282.000	162,147.140	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,355.000	390,387.800	
URBAN EDGE PROPERTIES	30,753.000	583,384.410	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9,539.000	229,794.510	
VENTAS INC	103,701.000	5,951,400.390	
VEREIT INC	295,739.000	2,768,117.040	
VICI PROPERTIES INC	127,629.000	3,235,395.150	

	VORNADO REALTY TRUST	43,865.000	2,939,393.650	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	60,728.000	218,013.520	
	WASHINGTON REIT	22,154.000	668,164.640	
	WEINGARTEN REALTY INVST	33,858.000	1,027,928.880	
	WELLTOWER INC	112,669.000	9,472,082.830	
	WHITESTONE REIT	14,179.000	190,707.550	
	WP CAREY INC	47,671.000	3,968,610.750	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	30,130.000	611,036.400	
アメリカ・ドル　小計		6,247,177.000	275,188,444.670 (30,314,759,061)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	61,323.000	59,973.890	
	ASSURA PLC	642,591.000	491,582.110	
	BIG YELLOW GROUP PLC	41,453.000	489,145.400	
	BRITISH LAND CO PLC	261,061.000	1,533,472.310	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	223,391.000	54,060.620	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	161,306.000	154,692.450	
	DERWENT LONDON PLC	29,238.000	1,146,129.600	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	156,197.000	153,385.450	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	71,241.000	625,495.980	
	HAMMERSON PLC	215,044.000	586,424.980	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	138,707.000	161,454.940	
	INTU PROPERTIES PLC	306,665.000	76,666.250	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	208,102.000	1,983,628.260	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	235,103.000	531,332.780	
	LXI REIT PLC	136,496.000	185,634.560	
	NEWRIVER REIT PLC	101,531.000	199,000.760	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	141,447.000	137,203.590	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	340,883.000	537,231.600	
	RDI REIT PLC	66,401.000	87,383.710	
	REGIONAL REIT LTD	125,404.000	141,957.320	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	55,918.000	436,999.170	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	178,467.000	99,584.580	
	SEGRO PLC	303,513.000	2,651,489.560	
	SHAFTESBURY PLC	62,122.000	567,484.470	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	87,749.000	84,414.530	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	476,031.000	675,964.020	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	221,253.000	190,720.080	

	UNITE GROUP PLC	100,918.000	1,261,475.000	
	WORKSPACE GROUP PLC	34,107.000	395,982.270	
イギリス・ポンド　小計		5,183,662.000	15,699,970.240 (2,247,607,740)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	48,280.000	1,027,881.200	
イスラエル・シュケル　小計		48,280.000	1,027,881.200 (32,676,343)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	16,931.000	898,697.480	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,331.000	201,559.530	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,891.000	275,875.530	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	23,102.000	1,224,174.980	
	CHOICE PROPERTIES REIT	40,390.000	577,173.100	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	23,360.000	331,011.200	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	11,173.000	176,980.320	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,038.000	210,042.180	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	16,903.000	228,190.500	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	7,097.000	225,187.810	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	30,048.000	612,077.760	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,004.000	474,871.200	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	39,467.000	828,412.330	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,203.000	303,983.490	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,866.000	280,967.400	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,001.000	142,583.760	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4,537.000	82,709.510	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	7,599.000	228,045.990	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,057.000	228,684.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	43,578.000	1,169,633.520	
	SLATE OFFICE REIT	12,079.000	71,024.520	
	SLATE RETAIL REIT	8,902.000	117,684.440	
	SMARTCENTRES REIT	19,332.000	609,151.320	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,905.000	250,232.850	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	15,322.000	112,310.260	

カナダ・ドル　小計		443,116.000	9,861,264.980 (832,192,152)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	256,219.000	358,706.600	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	312,253.000	693,201.660	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	433,536.000	667,645.440	
	PRECINCT PROPERTIES	284,777.000	526,837.450	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	88,368.000	250,965.120	
ニュージーランド・ドル　小計		1,375,153.000	2,497,356.270 (182,257,061)	
ユーロ	AEDIFICA	6,897.000	780,740.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43,258.000	740,576.960	
	ALTAREA	1,041.000	207,991.800	
	BEFIMMO	6,364.000	338,564.800	
	COFINIMMO SA	6,877.000	918,767.200	
	COVIVIO	12,408.000	1,271,820.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,428.000	275,414.800	
	GECINA SA	15,189.000	2,489,477.100	
	HAMBORNER REIT AG	19,860.000	194,667.720	
	HIBERNIA REIT PLC	187,117.000	264,957.670	
	ICADE	7,683.000	748,708.350	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	13,170.000	81,785.700	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	66,381.000	750,769.110	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	5,442.000	141,764.100	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	121,080.000	187,674.000	
	KLEPIERRE	57,680.000	1,897,095.200	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	19,504.000	135,162.720	
	MERCIALYS	8,526.000	100,862.580	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	101,739.000	1,262,580.990	
	MONTEA SCA	3,145.000	262,293.000	
	NSI NV	4,350.000	193,575.000	
	RETAIL ESTATES	2,812.000	233,677.200	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	38,175.000	5,039,100.000	
	VASTNED RETAIL	4,861.000	124,684.650	
	WAREHOUSES DE PAUW	36,237.000	866,064.300	
	WERELDHAVE NV	12,110.000	230,695.500	
ユーロ　小計		813,334.000	19,739,470.850 (2,421,835,679)	
韓国・ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	9,173.000	67,421,550.000	
韓国・ウォン　小計		9,173.000	67,421,550.000	

				(6,458,984)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	545,070.000	2,758,054.200	
		LINK REIT	582,520.000	48,261,782.000	
		PROSPERITY REIT	426,000.000	1,307,820.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	274,000.000	1,402,880.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	386,000.000	2,038,080.000	
	香港・ドル　小計		2,213,590.000	55,768,616.200 (790,241,292)	
投資証券　合計			16,333,485	36,828,028,312 (36,828,028,312)	
合計				41,251,535,797 (41,251,535,797)	

（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	4銘柄	0.19	－	73.68
	投資証券	154銘柄	－	72.99	
イギリス・ポンド	投資証券	29銘柄	－	5.41	5.45
イスラエル・シュケル	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	6.54	－	6.58
カナダ・ドル	投資証券	25銘柄	－	2.00	2.02
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	30銘柄	3.81	－	3.83
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	－	0.44	0.44
ユーロ	投資証券	26銘柄	－	5.83	5.87
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	0.12	－	2.04
	投資証券	5銘柄	－	1.90	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（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】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	18,813,994円
Ⅱ　負債総額	76,091円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,737,903円
Ⅳ　発行済数量	17,452,049口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0737円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	16,302,384円
Ⅱ　負債総額	65,597円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,236,787円
Ⅳ　発行済数量	15,126,115口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0734円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	18,894,707円
Ⅱ　負債総額	69,370円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,825,337円
Ⅳ　発行済数量	17,538,672口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0734円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	224,231,105,628円
Ⅱ　負債総額	486,309,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	223,744,796,628円
Ⅳ　発行済数量	169,075,264,935口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3233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2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	500,228,269,549円
Ⅱ　負債総額	8,408,833,099円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	491,819,436,450円
Ⅳ　発行済数量	344,084,282,218口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4294円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	142,025,313,622円
Ⅱ　負債総額	1,590,154,546円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	140,435,159,076円
Ⅳ　発行済数量	66,611,108,243口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1083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2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	258,401,441,348円
Ⅱ　負債総額	290,881,370円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	258,110,559,978円
Ⅳ　発行済数量	96,797,339,440口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6665円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	358,489,950,519円
Ⅱ　負債総額	150,915,774円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	358,339,034,745円
Ⅳ　発行済数量	88,634,852,865口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.0429円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	56,040,831,650円
Ⅱ　負債総額	267,004,721円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	55,773,826,929円
Ⅳ　発行済数量	46,909,501,231口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1890円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	43,936,034,544円
Ⅱ　負債総額	520,352,667円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	43,415,681,877円
Ⅳ　発行済数量	17,581,204,671口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4694円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	42,428,844,128円
Ⅱ　負債総額	248,633,754円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	42,180,210,374円
Ⅳ　発行済数量	29,974,953,193口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4072円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2020年1月31日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2020年1月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

１．投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

２．運用計画、売買計画の決定

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

２【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年1月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,303,744,158,370
追加型株式投資信託	862	13,926,263,748,709
単位型公社債投資信託	38	107,016,149,241
単位型株式投資信託	179	1,339,283,470,708
合計	1,105	16,676,307,527,028

３【委託会社等の経理状況】

１．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。

２．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

３．委託会社は、第34期事業年度（自2018年4月1日至2019年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受け、第35期中間会計期間（自2019年4月1日至2019年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第33期 （2018年3月31日現在）		第34期 （2019年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金・預金		49,071,217		41,087,475
金銭の信託		12,083,824		18,773,228
有価証券		―		153,518
未収委託者報酬		11,769,015		12,438,085
未収運用受託報酬		4,574,225		3,295,109
未収投資助言報酬		341,689		327,064
未収収益		59,526		56,925
前払費用		569,431		573,874
その他		427,238		491,914
流動資産計		78,896,169		77,197,195
固定資産				
有形固定資産		1,643,826		1,461,316
建物	※1	1,156,953	※1	1,096,916
器具備品	※1	476,504	※1	364,399
建設仮勘定		10,368		―
無形固定資産		1,934,700		2,411,540
ソフトウエア		1,026,319		885,545
ソフトウエア仮勘定		904,389		1,522,040
電話加入権		3,931		3,931
電信電話専用施設利用権		60		23
投資その他の資産		8,270,313		9,269,808
投資有価証券		1,721,433		1,611,931
関係会社株式		3,229,196		4,499,196
長期差入保証金		1,518,725		1,312,328
繰延税金資産		1,699,533		1,748,459
その他		101,425		97,892
固定資産計		11,848,840		13,142,665
資産合計		90,745,010		90,339,861

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第33期（自　2017年4月1日　至　2018年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第34期（自　2018年4月1日　至　2019年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

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

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

※1. 関係会社に対する事項

（千円）

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

※2. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第33期（2018年3月31日現在）

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

第34期（2019年3月31日現在）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（千円）

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

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

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期（2018年3月31日現在）

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

第34期（2019年3月31日現在）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第33期（2018年3月31日現在）

（千円）

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

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

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

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

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

3．当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）年金資産の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（3）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

（4）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（千円）

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

（注）特別損失に計上しております。

（5）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3.簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

（2）損益計算書項目

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当はありません。

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

(東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(1) 中間貸借対照表

（単位：千円）

		第35期中間会計期間末 （2019年9月30日現在）
（資産の部）		
流動資産		
現金・預金		37,156,171
金銭の信託		18,742,684
有価証券		997
未収委託者報酬		11,945,046
未収運用受託報酬		3,120,602
未収投資助言報酬		332,118
未収収益		58,808
前払費用		781,218
その他		2,233,840
流動資産計		74,371,488
固定資産		
有形固定資産		1,362,999
建物	※1	1,051,855
器具備品	※1	311,144
無形固定資産		3,541,152
ソフトウエア		3,323,996
ソフトウエア仮勘定		213,219
電話加入権		3,931
電信電話専用施設利用権		6
投資その他の資産		8,896,987
投資有価証券		958,309
関係会社株式		4,499,196
長期差入保証金		1,307,197
繰延税金資産		2,036,732
その他		95,551
固定資産計		13,801,139
資産合計		88,172,628

（単位：千円）

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

(2) 中間損益計算書

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

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

重要な会計方針

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

（2）基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの

該当事項はありません。

（金融商品関係）

第35期中間会計期間末（2019年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資　産

（1）現金・預金

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

（2）金銭の信託

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

（3）未収委託者報酬及び（4）未収運用受託報酬

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

負　債

（1）未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

（有価証券関係）

第35期中間会計期間末
（2019年9月30日現在）

1.子会社株式

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

2.その他有価証券

区　分	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
①株式	691,010	58,146	632,863
②投資信託	5,937	3,000	2,937
小計	696,947	61,146	635,800
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	-	-	-
②投資信託	2,990	3,000	△9
小計	2,990	3,000	△9
合計	699,937	64,146	635,791

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

（企業結合等関係）

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

1.結合当事企業

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

2.企業結合日

2016年10月1日

3.企業結合の方法

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

4.結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5.企業結合の主な目的

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

6.合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7.交付した株式数

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

8.経済的持分比率（議決権比率）

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

9.取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10.会計処理

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

11.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

（2）損益計算書項目

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

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

（資産除去債務関係）

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

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

（セグメント情報等）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

（１）サービスごとの情報

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

（２）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

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

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 （自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）
中間純利益金額	7,197,308千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	―
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	7,197,308千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
（うち普通株式）	(24,490株)
（うちA種種類株式）	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

(1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

(2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

ａ．名称

みずほ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2019年3月末日現在　　247,369百万円

ｃ．事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2019年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(3)投資顧問会社

ａ．名称

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。

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。

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。

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
半期報告書	2019年12月17日
有価証券届出書の訂正届出書	2019年12月17日

独立監査人の監査報告書

２０１９年5月３０日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

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

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

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

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

以　上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和２年２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　丘本　正彦　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）の平成３１年３月１８日から令和２年１月１４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、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）の令和２年１月１４日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和２年２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　丘本　正彦　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）の平成３１年３月１８日から令和２年１月１４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、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）の令和２年１月１４日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和２年２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　丘本　正彦　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）の平成３１年３月１８日から令和２年１月１４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、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）の令和２年１月１４日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

２０１９年１１月２８日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以　　上

（注１）上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。