

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月15日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	D I A M外国株式インデックスファンド<DC年金>
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>
(以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。)

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権(以下「受益権」といいます。)

信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供されもしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

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

(3)【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されま

す。
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2020年5月16日から2020年11月17日

お申込みの取扱いは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。なお、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所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、お申込みの受付は行いません。

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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)

(9) 【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、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。

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社所定の方法により、販売会社に買付代金を支払うものとし、

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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)

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みの方法

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資(自動けいぞく投資)」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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。

また、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、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ます。

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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。

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

投資信託振替制度とは、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するものです。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われますので、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

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

<ファンドの特色>

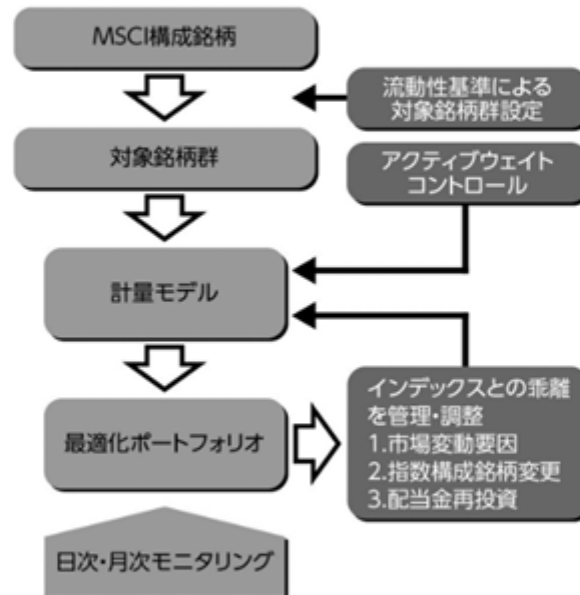
- 1** 主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドに投資を行い、「MSCIコクサイ・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
-

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。

- 2** 流動性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、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。



- 3** 株式への実質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。
- 4** 実質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。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日。))に、経費控除後の利子、配当収入および売買益(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。

商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
		不動産投信	
	内外	その他資産 ()	特殊型
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	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います。
海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を除く) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (株式))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ ブ・ファンズ	なし	その他 (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))
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

属性区分に記載している「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)当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

その他資産 (投資信託証券 (株式))	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、主として株式へ実質的に投資する旨の記載があるものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は株式に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(株式))に分類されます。
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います。
グローバル(日本を除く)	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
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います。

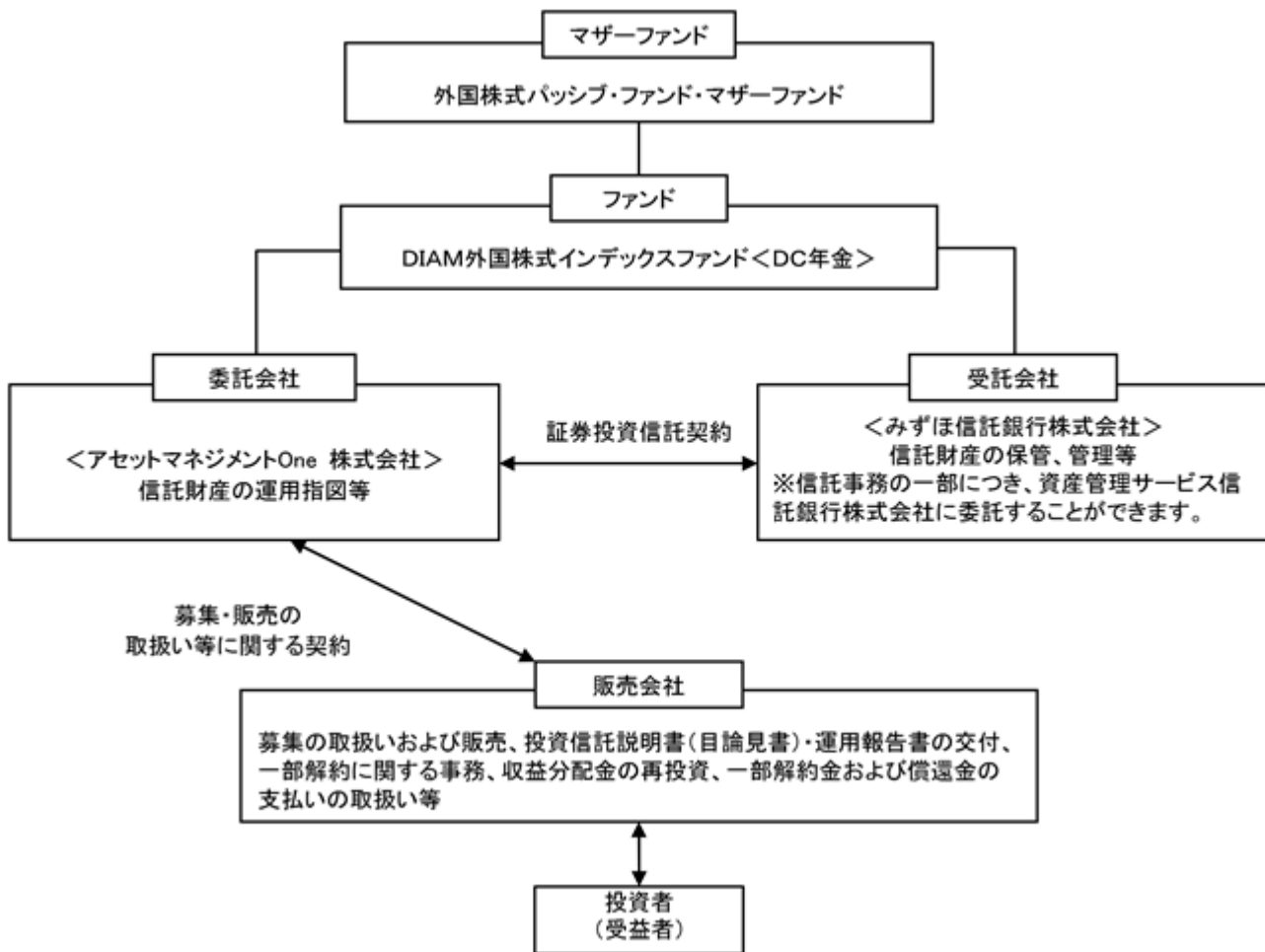
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
その他	日経225またはTOPIXにあてはまらない全てのものをいいます。

上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ
(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

(2) 【ファンドの沿革】

2002年9月5日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に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、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。

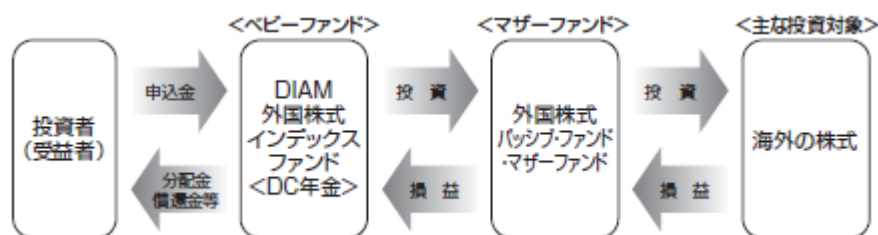
- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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・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。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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2月28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2月28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、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標に運用を行います。

<投資対象>

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

- 1)主に外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資を行い、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)株式への実質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)実質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。

当ファンドが対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、上記 1)ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>をご参照ください。

（2）【投資対象】

1. 投資の対象とする資産の種類（約款第15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。

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

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条および第23条に定めるものに限ります。)

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

2. 有価証券の指図範囲（約款第16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外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの受益証券のほか、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

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。)
 - 6) 特定目的会社に係る特定社債券(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) 協同組織金融機関に係る優先出資証券(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) 特定目的会社に係る優先出資証券(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) 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。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 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。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 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。)
 - 18) 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。)
 - 19) 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
 - 20) 外国の者に対する権利で19)の有価証券の性質を有するもの
- なお、上記1)、12)ならびに15)の証券または証書のうち1)の性質を有するものを以下「株式」といい、2)から6)までの証券および12)ならびに15)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」といいます。

3. 金融商品の指図範囲(約款第16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を指図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

4. 金融商品の指図範囲（約款第16条第3項）

上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.の1)から4)までに掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに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（以下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含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）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。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、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。</p> <p>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。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2020年2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月15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分配を行います。

1) 分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

2) 分配対象額についての分配方針

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。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

3) 留保益の運用方針

留保金の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

a．信託財産から生じる毎計算期末における利益は、次の方法により処理するものとします。

1) 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」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、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額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、監査報酬および当該監査報酬に

かかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金があるときは、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。

b. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資される性格を有します。

委託会社は受託会社から交付を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、別に定める契約に基づき、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、)に対し、遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

1) 株式への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

株式への実質投資割合には、制限を設けません。

2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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等への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

同一銘柄の転換社債、ならびに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(以下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含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への実質投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。

4) 外貨建資産への実質投資割合(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

5) 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)

6) 投資する株式等の範囲(約款第18条)

a. 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

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。

- b. 上記a.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。

7) 信用取引の指図範囲(約款第20条)

- a. 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。

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

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、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(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

8) 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産が運用対象とする有価証券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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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・オプションの売付けの指図は、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。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券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有価証券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・オプションの売付けの指図は、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およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券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組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差し引いた額)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および組入抵当証券の利払金および償還金とマザーファンドが限月

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および組入抵当証券の利払金および償還金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および組入抵当証券の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。）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．金融商品の指図範囲1）～4）に掲げる金融商品で運用している額とマザーファンドが限月までに受け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．金融商品の指図範囲1）～4）に掲げる金融商品で運用している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マザーファンド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．金融商品の指図範囲1）～4）に掲げる金融商品で運用している額の割合を乗じて得た額をいいます。）の合計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、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。

b. 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、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに別に定める外国の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内で行な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、為替の売予約と合わせてヘッジ対象とする外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）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・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、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・オプションの買付けの指図は、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。

c. 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取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲内で行な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・オプションの売付けの指図は、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．金融商品の指図範囲1）～4）に掲げる金融商品で運用しているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属す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（信託財産に属するマザーファンド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金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。) 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・オプションの売付けの指図は、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.金融商品の指図範囲1)~4)に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「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し引いた額。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け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金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・オプションの買付けの指図は、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、かつ本項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。

9) スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。) を行なうことの指図をすることができます。
- b. 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。
- c. 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(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。) 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、上記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。
- d. 上記c. 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の受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- e. 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基に算出した価額で評価するものとします。
- f. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

10) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
 - b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として当ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 - c. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託期間にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価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、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。
 - d. 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が、信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価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、上記ヘッジ対象外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額がヘッジ対象外貨建資産の時価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為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
 - e. 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。
 - f. 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あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 11) デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第23条の2)
- 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。
- 12) 有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第24条)
- a. 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)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 - 1) 株式の貸付けは、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。
 - b. 上記a.1)~2)で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。
 - c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- 13) 特別の場合の外貨建資産への投資制限(約款第25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。
- 14) 外貨為替予約の指図(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

- b. 上記a.の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、原則として信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- c. 上記b.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。

15) 資金の借入れ(約款第33条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに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。
- b. 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。
- c. 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。
- d. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

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。

当ファンドでは実質的に株式に投資します。株式の価格は一般に大きく変動します。株式市場全体の価格変動あるいは個別銘柄の価格変動により当ファンドの基準価額が下がる要因となる可能性があります。

為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替リスクとは、外国為替相場の変動により外貨建資産の価格が変動するリスクをいいます。一般に外国為替相場が対円で下落（円高）になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。したがって、外貨建資産が現地通貨建てでは値上がりしている場合でも、当該通貨の為替相場の対円での下落（円高）度合いによっては、当該資産の円ベースの評価額が減価し、ファンドの基準価額の変動および分配金に影響を与える要因となります。また外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。当ファンドでは、為替リスクに対して為替ヘッジを行わないことを原則としているため、円と外国通貨の為替レートの変化がファンドの資産価値に大きく影響します。

信用リスク

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

当ファンドが実質的に投資する株式の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

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。

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、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可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

当ファンドはマザーファンドへの投資を通じて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が、当該インデックス採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流入から組入株式の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と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）が乖離する場合があります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

当ファンドは、原則として確定拠出年金制度によるお申込みのみの取扱いとなります。

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、その他やむを得ない事情があるときは、お申込みの受付または解約の受付を中止することおよびすでに受付けたお申込みの受付または解約の受付を取り消すことができるものとします。

当ファンドは受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、対象インデックスが改廃された場合、受益者のため有利と認められる場合、その他やむを得ない事情がある場合は、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。

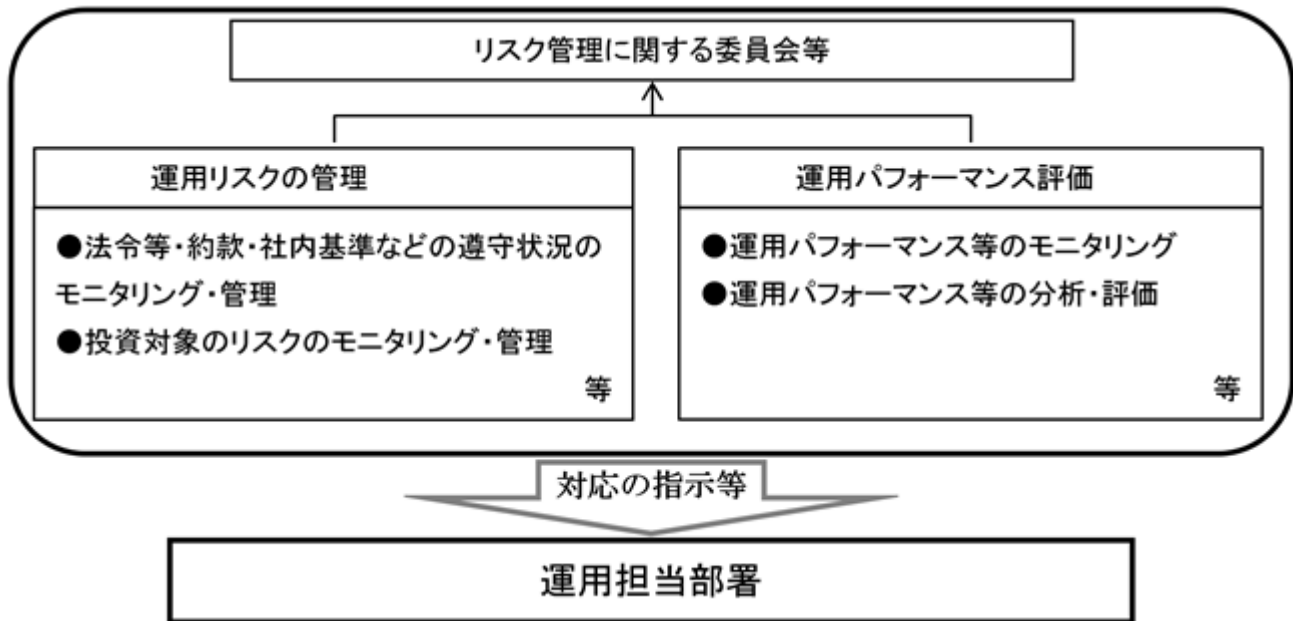
注意事項

- イ．当ファンドは、実質的に株式など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。
- ロ．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。
- ハ．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。
- ニ．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ますが、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2月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

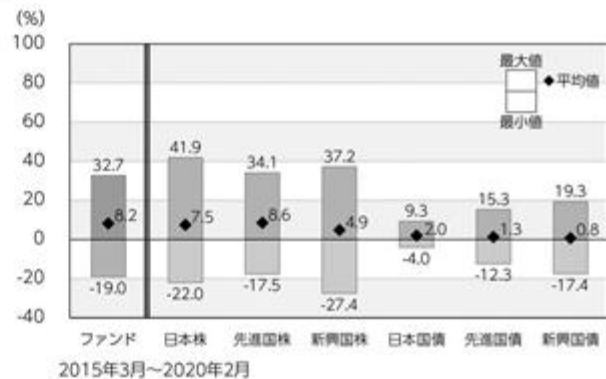
<参考情報>

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



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

各資産クラスの指数

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.275%（税抜0.25%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.11%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.11%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎年8月15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。

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】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上(ファンドの基準価額に反映)され、毎年8月15日（休業日の場合は翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

上記の「その他の費用」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を示すことができません。

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。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

上記は、2020年2月末現在のものであります。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 >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

令和2年2月28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	158,308,202,552	100.00
内 日本	158,308,202,552	100.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,133,549	0.00
純資産総額	158,314,336,101	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年2月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	312,160,700,522	95.68
内 アメリカ	205,120,966,573	62.87
内 イギリス	17,752,476,357	5.44
内 スイス	12,295,394,511	3.77
内 カナダ	12,184,447,318	3.73
内 フランス	11,813,720,670	3.62
内 ドイツ	9,814,052,493	3.01
内 オーストラリア	7,308,266,909	2.24
内 オランダ	6,108,975,971	1.87
内 アイルランド	5,925,199,336	1.82
内 スペイン	3,329,865,507	1.02
内 香港	2,991,180,848	0.92
内 スウェーデン	2,917,044,913	0.89
内 イタリア	2,337,693,461	0.72
内 デンマーク	2,282,930,678	0.70
内 フィンランド	1,380,515,657	0.42
内 シンガポール	1,359,417,834	0.42
内 パミュエダ	1,220,036,977	0.37
内 ジャージー	1,075,380,123	0.33
内 ベルギー	1,050,801,051	0.32
内 ケイマン諸島	756,574,281	0.23
内 イスラエル	703,526,718	0.22
内 ノルウェー	670,036,854	0.21
内 ニューゼーランド	337,386,603	0.10
内 オランダ領キュラソー	313,074,428	0.10
内 ルクセンブルグ	306,483,437	0.09
内 オーストリア	234,450,619	0.07
内 ポルトガル	208,069,888	0.06
内 リベリア	118,597,498	0.04
内 パナマ	111,398,612	0.03
内 マン島	56,908,971	0.02
内 パプアニューギニア	43,097,067	0.01
内 イギリス領バージン諸島	32,728,359	0.01
投資信託受益証券	765,934,404	0.23
内 オーストラリア	586,419,272	0.18

	内 シンガポール	179,515,132	0.06
投資証券		8,351,467,192	2.56
	内 アメリカ	7,486,179,527	2.29
	内 イギリス	223,373,148	0.07
	内 フランス	210,443,242	0.06
	内 香港	164,162,629	0.05
	内 オランダ	146,138,518	0.04
	内 カナダ	121,170,128	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,962,057,644	1.52
純資産総額		326,240,159,762	100.00

その他資産の投資状況

令和2年2月28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）	4,476,272,993	1.37
内 アメリカ	3,154,948,972	0.97
内 ドイツ	765,341,081	0.23
内 イギリス	258,430,265	0.08
内 カナダ	178,563,915	0.05
内 オーストラリア	118,988,760	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年2月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	42,496,564,628	4.1806 177,663,308,719	3.7252 158,308,202,552	- -	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年2月28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	35,559.27 12,444,929,611	29,931.29 10,475,264,340	- -	3.21
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	561,788	20,282.85 11,394,662,016	17,309.63 9,724,346,575	- -	2.98
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	233,618.82 7,604,059,105	206,198.94 6,711,569,591	- -	2.06
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	23,437.71 4,363,071,720	20,764.34 3,865,406,942	- -	1.18
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	166,414.57 4,035,886,350	144,238.58 3,498,074,253	- -	1.07
6	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	166,194.62 3,844,414,040	143,894.97 3,328,578,642	- -	1.02
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	247,652	15,042.24 3,725,242,752	13,281.51 3,289,194,768	- -	1.01
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	204,338	16,428.72 3,357,012,992	15,223.90 3,110,821,605	- -	0.95
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	230,364	12,158.58 2,800,899,675	11,502.95 2,649,865,665	- -	0.81
10	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	133,771	23,012.03 3,078,342,893	19,698.49 2,635,087,281	- -	0.81

11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	193,908	13,803.50 2,676,609,116	12,420.30 2,408,396,501	- -	0.74
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	102,032	24,818.72 2,532,304,047	22,725.32 2,318,710,676	- -	0.71
13	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	565,686	4,185.69 2,367,790,475	3,909.93 2,211,794,868	- -	0.68
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	69,914	37,310.15 2,608,502,421	31,277.28 2,186,719,935	- -	0.67
15	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	684,479	3,813.63 2,610,353,413	3,187.69 2,181,910,901	- -	0.67
16	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	342,807	7,361.35 2,523,524,400	6,109.47 2,094,371,447	- -	0.64
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	84,667	26,813.63 2,270,229,856	24,592.20 2,082,148,127	- -	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	32,695.49 2,396,808,681	27,786.46 2,036,942,433	- -	0.62
19	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,432	38,501.42 2,095,709,511	36,449.74 1,984,032,683	- -	0.61
20	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	320,311	6,402.74 2,050,871,031	6,025.21 1,929,942,898	- -	0.59
21	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	314,758	6,560.32 2,064,915,878	6,010.98 1,892,007,158	- -	0.58
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	139,440	15,269.86 2,129,229,585	12,917.11 1,801,162,822	- -	0.55
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	327,609	6,636.92 2,174,317,836	5,451.80 1,786,059,597	- -	0.55
24	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	198,319	9,044.38 1,793,674,281	8,544.29 1,694,495,921	- -	0.52
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	108,292	16,085.11 1,741,889,349	14,922.96 1,616,038,169	- -	0.50
26	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	166,222	10,808.88 1,796,674,449	9,614.05 1,598,066,951	- -	0.49

27	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	428,075	3,995.28 1,710,283,467	3,731.56 1,597,388,831	- -	0.49
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	351,108	5,043.62 1,770,858,385	4,492.10 1,577,212,773	- -	0.48
29	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	147,108	12,046.05 1,772,070,970	10,300.64 1,515,307,417	- -	0.46
30	WELLS FARGO & CO アメリカ	株式 銀行	323,987	5,276.71 1,709,586,933	4,647.49 1,505,727,023	- -	0.46

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年2月28日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.68
投資信託受益証券	0.23
投資証券	2.56
合計	98.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年2月28日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
銀行	外国	7.27
ソフトウェア		5.84
医薬品		5.65
情報技術サービス		4.34
石油・ガス・消耗燃料		4.19
保険		3.75
コンピュータ・周辺機器		3.48
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.48
半導体・半導体製造装置		3.31
資本市場		2.99
ヘルスケア機器・用品		2.85
インターネット販売・通信販売		2.61
電力		2.26
航空宇宙・防衛		2.21
化学		2.11
各種電気通信サービス		2.04
飲料		1.97
食品		1.97
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス		1.91
バイオテクノロジー		1.91
専門小売り		1.71
ホテル・レストラン・レジャー		1.68
機械		1.59
食品・生活必需品小売り		1.49
繊維・アパレル・贅沢品		1.39
家庭用品		1.36
娯楽		1.35

金属・鉱業	1.27
コングロマリット	1.24
メディア	1.22
総合公益事業	1.18
陸運・鉄道	0.99
各種金融サービス	0.98
タバコ	0.85
自動車	0.84
専門サービス	0.80
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.79
電気設備	0.76
通信機器	0.71
パーソナル用品	0.69
不動産管理・開発	0.52
電子装置・機器・部品	0.50
複合小売り	0.49
航空貨物・物流サービス	0.47
商業サービス・用品	0.46
消費者金融	0.44
建設関連製品	0.40
家庭用耐久財	0.40
建設・土木	0.33
無線通信サービス	0.30
商社・流通業	0.28
容器・包装	0.28
建設資材	0.27
自動車部品	0.25
エネルギー設備・サービス	0.22
運送インフラ	0.20
ガス	0.20
水道	0.13
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
紙製品・林産品	0.09
旅客航空輸送業	0.09
販売	0.06
海運業	0.05
レジャー用品	0.04
合計	95.68

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年2月28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	195	3,575,343,467	3,154,948,972	0.97
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar20	買建	184	842,895,744	765,341,081	0.23
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar20	買建	27	278,893,331	258,430,265	0.08
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar20	買建	11	190,348,705	178,563,915	0.05
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Mar20	買建	10	126,202,543	118,988,760	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(令和2年2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9計算期間末 (平成23年2月15日)	39,647	39,647	1.4110	1.4110
第10計算期間末 (平成24年2月15日)	41,707	41,707	1.3008	1.3008
第11計算期間末 (平成25年2月15日)	60,080	60,080	1.7592	1.7592
第12計算期間末 (平成26年2月17日)	75,426	75,426	2.3012	2.3012
第13計算期間末 (平成27年2月16日)	98,769	98,769	2.9168	2.9168
第14計算期間末 (平成28年2月15日)	82,214	82,214	2.4126	2.4126
第15計算期間末 (平成29年2月15日)	107,765	107,765	3.0461	3.0461
第16計算期間末 (平成30年2月15日)	123,694	123,694	3.3421	3.3421
第17計算期間末 (平成31年2月15日)	139,504	139,504	3.4447	3.4447
第18計算期間末 (令和2年2月17日)	177,764	177,764	4.1731	4.1731
平成31年2月末日	143,541	-	3.5352	-
3月末日	144,278	-	3.5592	-
4月末日	149,916	-	3.7180	-
令和1年5月末日	142,214	-	3.4826	-
6月末日	148,133	-	3.6071	-
7月末日	153,422	-	3.7044	-
8月末日	147,414	-	3.5187	-
9月末日	152,084	-	3.6311	-
10月末日	158,504	-	3.7744	-
11月末日	164,161	-	3.9140	-
12月末日	169,040	-	4.0315	-
令和2年1月末日	171,663	-	4.0356	-
2月末日	158,314	-	3.7177	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率（％）
第9計算期間	15.2
第10計算期間	7.8
第11計算期間	35.2
第12計算期間	30.8
第13計算期間	26.8
第14計算期間	17.3
第15計算期間	26.3
第16計算期間	9.7
第17計算期間	3.1
第18計算期間	21.1

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第9計算期間	8,936,687,787	4,025,800,144
第10計算期間	9,290,705,463	5,326,900,557
第11計算期間	8,170,299,501	6,081,641,525
第12計算期間	8,496,275,034	9,870,472,114
第13計算期間	8,954,460,215	7,869,839,615
第14計算期間	7,855,082,565	7,640,340,280
第15計算期間	7,253,514,984	5,952,570,108
第16計算期間	8,373,163,615	6,739,828,907
第17計算期間	9,162,101,369	5,674,741,976
第18計算期間	10,301,449,476	8,202,787,502

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2020年2月28日

基準価額・純資産の推移 (2010年2月26日～2020年2月28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、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。
 ※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:2002年9月5日)

分配の推移(税引前)

年月	分配金 (円)
2016年 2月	0円
2017年 2月	0円
2018年 2月	0円
2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	100.00

■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。資産の種類の内書は、国/地域を表します。

資産の状況

資産の種類	比率(%)
株式	95.68
内 アメリカ	62.87
内 イギリス	5.44
内 スイス	3.77
内 カナダ	3.73
内 フランス	3.62
内 その他	16.25
投資信託受益証券	0.23
内 オーストラリア	0.18
内 シンガポール	0.06
投資証券	2.56
内 アメリカ	2.29
内 イギリス	0.07
内 フランス	0.06
内 香港	0.05
内 オランダ	0.04
内 カナダ	0.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1.52
合計(純資産総額)	100.00

組入上位10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	3.21
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	2.98
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.06
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	1.18
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
6	ALPHABET INC-CL A	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	1.02
7	JPMORGAN CHASE & CO	株式	アメリカ	銀行	1.01
8	JOHNSON & JOHNSON	株式	アメリカ	医薬品	0.95
9	NESTLE SA-REGISTERED	株式	スイス	食品	0.81
10	VISA INC	株式	アメリカ	情報技術サービス	0.81

その他資産の投資状況

資産の種類	比率(%)
株価指数先物取引(買建)	1.37

株式組入上位5業種

順位	業種	比率(%)
1	銀行	7.27
2	ソフトウェア	5.84
3	医薬品	5.65
4	情報技術サービス	4.34
5	石油・ガス・消耗燃料	4.19

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。
 ※2020年については年年初から基準日までの収益率を表示しています。

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

○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】

お申込みの方法

- ・お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。
当ファンドは、原則として確定拠出年金制度による取得のみの取扱いとなります。ただし、委託会社または販売会社が取得する場合はこの限りではありません。
- ・当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「累積投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。
なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。
- ・当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。
なお、ニューヨーク証券取引所、またはロンドン証券取引所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。）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、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販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、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、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。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。委託会社は、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（発行価格）

- ・お申込日の翌営業日の基準価額 とします。
収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。
「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当たり換算した基準価額で表示することがあります。）

- ・基準価額は、当ファンドの委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

お申込単位

1円以上1円単位（当初元本1口 = 1円）

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

お申込手数料

ありません。

払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

解約のお申込方法

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に1口単位をもって解約の請求をすることができます。

受益者が解約の請求をするときは、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、解約の請求を受付けた場合には、この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。

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、その他やむを得ない事情があるときは、解約の請求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。解約の請求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実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
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、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

信託期間は2002年9月5日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年2月16日から翌年2月15日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、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。

(5) 【その他】

イ. 償還規定

- a. 委託会社は、受益権の口数が10億口を下回るようになった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了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、信託期間中においてこの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とき、対象インデックスが改廃の場合、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、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。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項についてあらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.～f.の規定は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d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 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。
- i. 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、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、

下記「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、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。

- j. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。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」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- k. 上記 d.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

ロ.信託約款の変更

- 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、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は上記a.のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- c. 委託会社は上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記c.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託約款の変更をしません。
- e. 委託会社は信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記a.～e.の規定にしたがいます。
- g. 上記c.に規定する一定の期間内に、委託会社に対し異議を述べた受益者は、受託会社に対し自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。当該買取請求権の内容および手続きは、公告または書面に付記します。

八. 関係法人との契約の更改

証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約について、委託会社と販売会社との間の当該契約は、原則として期間満了の3カ月前までに、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。

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年2月15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】

収益分配金請求権

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

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

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、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

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。

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期計算期間(平成31年2月16日から令和2年2月17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】

【DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 平成31年2月15日現在	第18期 令和2年2月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	459,401,647	700,041,690
親投資信託受益証券	139,499,173,012	177,760,364,200
未収入金	22,146,000	-
流動資産合計	139,980,720,659	178,460,405,890
負債の部		
流動負債		
未払解約金	287,806,047	470,882,482
未払受託者報酬	22,447,622	26,821,879
未払委託者報酬	164,616,149	196,694,117
その他未払費用	1,484,673	1,699,818
流動負債合計	476,354,491	696,098,296
負債合計		
	476,354,491	696,098,296
純資産の部		
元本等		
元本	40,498,716,145	42,597,378,119
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	99,005,650,023	135,166,929,475
(分配準備積立金)	34,259,848,280	56,410,883,183
元本等合計	139,504,366,168	177,764,307,594
純資産合計		
	139,504,366,168	177,764,307,594
負債純資産合計		
	139,980,720,659	178,460,405,890

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第17期 自 平成30年2月16日 至 平成31年2月15日	第18期 自 平成31年2月16日 至 令和2年2月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	4,195,043,982	30,847,030,188
営業収益合計	4,195,043,982	30,847,030,188
営業費用		
支払利息	269,055	286,251
受託者報酬	43,546,216	50,401,248
委託者報酬	319,339,411	369,609,752
その他費用	2,943,569	3,226,917
営業費用合計	366,098,251	423,524,168
営業利益又は営業損失()	3,828,945,731	30,423,506,020
経常利益又は経常損失()	3,828,945,731	30,423,506,020
当期純利益又は当期純損失()	3,828,945,731	30,423,506,020
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()	505,835,727	2,110,554,930
期首剰余金又は期首欠損金()	86,682,882,930	99,005,650,023
剰余金増加額又は欠損金減少額	22,363,370,540	28,066,702,854
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	22,363,370,540	28,066,702,854
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,363,713,451	20,218,374,492
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,363,713,451	20,218,374,492
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()	99,005,650,023	135,166,929,475

(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18期	
	自 平成31年2月16日 至 令和2年2月17日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年2月15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2月17日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第17期	第18期
	平成31年2月15日現在	令和2年2月17日現在
1. 期首元本額	37,011,356,752円	40,498,716,145円
期中追加設定元本額	9,162,101,369円	10,301,449,476円
期中一部解約元本額	5,674,741,976円	8,202,787,502円
2. 受益権の総数	40,498,716,145口	42,597,378,119口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第17期	第18期
	自 平成30年2月16日 至 平成31年2月15日	自 平成31年2月16日 至 令和2年2月17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(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(3,323,177,090円)、信託約款に規定される収益調整金(73,377,370,728円)及び分配準備積立金(30,936,671,190円)より分配対象収益は107,637,219,008円(1万口当たり26,577.93円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(28,313,003,446円)、信託約款に規定される収益調整金(85,117,077,965円)及び分配準備積立金(28,097,879,737円)より分配対象収益は141,527,961,148円(1万口当たり33,224.57円)ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第17期 自 平成30年2月16日 至 平成31年2月15日	第18期 自 平成31年2月16日 至 令和2年2月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	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。	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17期 平成31年2月15日現在	第18期 令和2年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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。	(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。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第17期 平成31年2月15日現在	第18期 令和2年2月17日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	4,119,623,276	30,266,304,662
合計	4,119,623,276	30,266,304,662

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第17期 平成31年2月15日現在	第18期 令和2年2月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3,4447円 (34,447円)	4,1731円 (41,731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2月17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	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	42,514,197,886	177,760,364,200	
親投資信託受益証券	合計	42,514,197,886	177,760,364,200	
合計			177,760,364,200	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

令和2年2月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,284,831,811
コール・ローン	264,485,286
株式	350,796,430,193
投資信託受益証券	821,917,447
投資証券	9,281,030,671
派生商品評価勘定	284,853,450
未収入金	106,292
未収配当金	425,800,789
差入委託証拠金	2,480,411,891
流動資産合計	370,639,867,830
資産合計	370,639,867,830
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,721,632
未払解約金	211,699,000
流動負債合計	219,420,632
負債合計	219,420,632
純資産の部	
元本等	
元本	88,590,932,378
剰余金	
剰余金又は欠損金()	281,829,514,820
元本等合計	370,420,447,198
純資産合計	370,420,447,198
負債純資産合計	370,639,867,830

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2月16日 至 令和2年2月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年2月17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	101,602,311,525円
同期中追加設定元本額	23,968,777,744円
同期中一部解約元本額	36,980,156,891円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,405,331,645円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,265,172円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	6,568,890円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	9,804,082円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,959,861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)	13,341,477円
たわらノーロード 先進国株式	12,358,698,257円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	181,844,047円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,666,506,602円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	215,144,281円
たわらノーロード バランス(堅実型)	21,417,034円
たわらノーロード バランス(標準型)	170,820,437円
たわらノーロード バランス(積極型)	210,567,034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)	679,207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)	87,148,596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)	220,238,898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)	147,447,694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)	270,535,285円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	64,582円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,015,608円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,220,065円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,516,202円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,637,207円
たわらノーロード 全世界株式	43,988,328円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	42,514,197,886円
One DC 先進国株式インデックスファンド	189,412,832円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	176,623,075円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	878,800,098円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,066,933,587円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	117,048,457円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	341,782,574円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	300,493,482円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,606,178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	186,919,230円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	206,435,395円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	158,994,799円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	277,906,766円
投資のソムリエ	1,161,944,551円
クルーズコントロール	194,095,583円
投資のソムリエ<DC年金>	110,373,729円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	175,641,805円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	100,302,518円
クルーズコントロール<DC年金>	196,533円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	553,382円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,320,962円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	63,170,120円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	668,936,157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)	1,662,660,975円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	1,709,520円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	1,370,366円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	565,992円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	1,592,751円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	11,750,393円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	563,321,995円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	144,219,671円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	261,455円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	222,668円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	257,387円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	65,132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)	25,533,156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)	259,123,350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)	85,286,421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)	2,001,550,769円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,249,815,085円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	205,960,997円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	14,470,386円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	17,813,512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)	59,958,854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)	135,238,394円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,631,553円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	48,605,100円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,643,533円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,877,279円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,536,268円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,685,027円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	375,124,662円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	492,768,252円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,604,220,114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)	579,217,915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)	95,885,349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)	618,117,607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)	27,550,457円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,905,718円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	9,443,862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)	214,153,029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)	24,495,642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)	88,530,403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)	152,767,521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)	444,738,720円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	22,591,432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	88,590,932,378円
2. 受益権の総数	88,590,932,378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2月16日 至 令和2年2月17日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有していません。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年2月17日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年2月17日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	58,345,071,328
投資信託受益証券	85,814,875
投資証券	1,424,956,008
合計	59,855,842,211

(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2月17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	3,137,380	-	3,136,120	1,260
アメリカ・ドル	1,977,480	-	1,976,220	1,260
カナダ・ドル	1,159,900	-	1,159,900	-
買建	701,543,548	-	701,557,280	13,732
アメリカ・ドル	520,386,114	-	520,404,600	18,486
オーストラリア・ドル	19,982,729	-	19,978,120	4,609
カナダ・ドル	21,873,984	-	21,872,400	1,584
ユーロ	139,300,721	-	139,302,160	1,439
合計	704,680,928	-	704,693,400	14,992

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	令和2年2月17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	9,839,451,880	-	10,116,568,706	277,116,826
合計	9,839,451,880	-	10,116,568,706	277,116,826

（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2月17日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.1812円 (41,812円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年2月17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	2,134.870	69,487,883.630	
	ABBOTT LABORATORIES	136,553	89.660	12,243,341.980	
	AES CORP	47,598	20.930	996,226.140	
	ABIOMED INC	3,574	167.220	597,644.280	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,481	150.700	10,320,086.700	
	ADVANCED MICRO DEVICES	79,023	55.310	4,370,762.130	
	ADOBE INC	37,540	379.670	14,252,811.800	
	CHUBB LTD	35,214	164.560	5,794,815.840	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,359	256.010	4,444,077.590	
	ALLEGHANY CORP	1,094	825.220	902,790.680	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	125.420	759,041.840	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	121.840	416,936.480	
	ALLSTATE CORP	25,832	125.570	3,243,724.240	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,687	180.810	10,068,766.470	
	AMGEN INC	46,484	223.480	10,388,244.320	
	HESS CORP	21,367	60.340	1,289,284.780	

AMERICAN EXPRESS CO	54,474	135.870	7,401,382.380	
AMERICAN ELECTRIC POWER	39,277	103.760	4,075,381.520	
AFLAC INC	57,028	52.810	3,011,648.680	
AMERICAN INTL GROUP	68,037	48.480	3,298,433.760	
AMERCO	585	346.250	202,556.250	
ANALOG DEVICES	29,105	117.650	3,424,203.250	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	102.560	1,865,771.520	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	60,452	41.960	2,536,565.920	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	171.340	700,266.580	
VALERO ENERGY CORP	31,433	82.640	2,597,623.120	
APACHE CORP	31,470	27.360	861,019.200	
ANSYS INC	6,770	291.980	1,976,704.600	
APPLE INC	349,977	324.950	113,725,026.150	
APPLIED MATERIALS INC	71,121	66.850	4,754,438.850	
ALBEMARLE CORP	7,634	89.640	684,311.760	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,146	44.770	1,886,876.420	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,813	100.430	784,659.590	
AMEREN CORP	19,487	86.790	1,691,276.730	
ARROW ELECTRONICS INC	5,795	79.190	458,906.050	
AUTOLIV INC	5,913	77.260	456,838.380	
AUTODESK INC	17,235	208.950	3,601,253.250	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,493	181.250	6,070,606.250	
AUTOZONE INC	1,917	1,053.210	2,019,003.570	
AVERY DENNISON CORP	6,549	138.130	904,613.370	
BALL CORP	25,262	77.220	1,950,731.640	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	102,032	226.800	23,140,857.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,637	45.900	3,058,638.300	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,097	93.140	3,455,214.580	
BECTON DICKINSON & CO	20,772	260.220	5,405,289.840	
AMETEK INC	17,821	101.340	1,805,980.140	
VERIZON COMM INC	320,311	58.510	18,741,396.610	
WR BERKLEY CORP	12,201	79.400	968,759.400	
BEST BUY CO INC	18,720	90.210	1,688,731.200	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,524	403.630	615,132.120	
YUM! BRANDS INC	23,110	105.280	2,433,020.800	
FIRSTENERGY CORP	43,584	52.230	2,276,392.320	
BOEING CO	41,369	340.490	14,085,730.810	
ROBERT HALF INTL INC	8,324	60.200	501,104.800	
BORGWARNER INC	17,210	34.150	587,721.500	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,658	42.310	4,512,699.980	

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,988	72.010	719,235.880	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	8,766	113.430	994,327.380	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	763.200	1,472,212.800	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	181,488	66.380	12,047,173.440	
INGREDION INC	5,305	97.340	516,388.700	
ONEOK INC	32,427	76.980	2,496,230.460	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	112.810	665,579.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	156.860	969,551.660	
SEMPRA ENERGY	21,599	160.960	3,476,575.040	
FEDEX CORP	19,368	158.620	3,072,152.160	
VERISIGN INC	8,048	209.570	1,686,619.360	
AMPHENOL CORP	22,763	104.070	2,368,945.410	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	71.400	1,740,803.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	7.210	903,081.340	
CSX CORP	59,540	79.590	4,738,788.600	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	14.800	464,956.800	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	48.640	683,392.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,052	53.990	1,082,607.480	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,820	203.830	2,613,100.600	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	59.620	1,368,279.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	42.600	1,361,581.200	
CATERPILLAR INC	43,258	137.990	5,969,171.420	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	117.100	1,155,191.500	
CITRIX SYSTEMS INC	9,464	122.030	1,154,891.920	
CENTURYLINK INC	80,424	13.900	1,117,893.600	
CERNER CORP	25,143	77.070	1,937,771.010	
JPMORGAN CHASE & CO	247,652	137.460	34,042,243.920	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	76.430	1,520,651.280	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,222	115.210	1,292,886.620	
CINTAS CORP	6,604	300.880	1,987,011.520	
CISCO SYSTEMS INC	330,940	46.970	15,544,251.800	
CLOROX COMPANY	9,876	164.830	1,627,861.080	
COCA-COLA CO/THE	314,758	59.950	18,869,742.100	
COPART INC	16,749	103.250	1,729,334.250	
COGNEX CORP	12,284	53.760	660,387.840	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,779	76.690	4,814,521.510	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,145	144.900	3,208,810.500	
COMERICA INC	11,985	62.760	752,178.600	
NRG ENERGY, INC.	21,039	40.060	842,822.340	
COMCAST CORP-CL A	351,108	46.090	16,182,567.720	
CONAGRA BRANDS INC	35,802	32.690	1,170,367.380	

CONSOLIDATED EDISON INC	25,220	94.300	2,378,246.000	
CMS ENERGY CORP	22,937	68.510	1,571,413.870	
COOPER COS INC	3,936	353.310	1,390,628.160	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	13,220	55.250	730,405.000	
CORNING INC	58,376	28.590	1,668,969.840	
SEALED AIR CORP	13,870	34.770	482,259.900	
HEICO CORP-CL A	5,292	103.160	545,922.720	
CUMMINS INC	11,963	166.780	1,995,189.140	
DR HORTON INC	28,355	61.810	1,752,622.550	
DANAHER CORP	48,299	165.950	8,015,219.050	
MOODY'S CORP	12,922	277.830	3,590,119.260	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	42,370	68.420	2,898,955.400	
TARGET CORP	39,421	116.630	4,597,671.230	
DEERE & CO	23,824	168.070	4,004,099.680	
MORGAN STANLEY	95,198	55.840	5,315,856.320	
REPUBLIC SERVICES INC	18,081	100.430	1,815,874.830	
COSTAR GROUP INC	2,785	731.370	2,036,865.450	
THE WALT DISNEY CO	139,440	139.540	19,457,457.600	
DOLLAR TREE INC	18,697	88.680	1,658,049.960	
DOVER CORP	11,113	119.860	1,332,004.180	
OMNICOM GROUP	17,365	78.140	1,356,901.100	
DTE ENERGY CO	14,817	134.020	1,985,774.340	
DUKE ENERGY CORP	56,801	101.280	5,752,805.280	
FLOWSERVE CORP	9,882	46.410	458,623.620	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	121.710	1,180,587.000	
EBAY INC	63,771	38.140	2,432,225.940	
BANK OF AMERICA CORP	684,479	34.850	23,854,093.150	
CITIGROUP INC	174,672	78.790	13,762,406.880	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,423	74.730	704,180.790	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,104	44.190	755,825.760	
EATON CORP PLC	31,818	103.550	3,294,753.900	
EATON VANCE CORP	9,184	49.150	451,393.600	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	78.760	1,782,181.280	
DISH NETWORK CORP	17,749	39.970	709,427.530	
ECOLAB INC	20,479	207.310	4,245,501.490	
PERKINELMER INC	8,338	95.560	796,779.280	
ELECTRONIC ARTS INC	22,491	109.690	2,467,037.790	
SALESFORCE.COM INC	64,404	189.950	12,233,539.800	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	163.560	366,865.080	
EMERSON ELECTRIC CO	46,705	73.510	3,433,284.550	
ATMOS ENERGY CORP	8,650	120.450	1,041,892.500	
ENTERGY CORP	15,031	134.130	2,016,108.030	
EOG RESOURCES INC	44,603	74.920	3,341,656.760	
EQUIFAX INC	9,161	162.960	1,492,876.560	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,346	215.010	3,729,563.460	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,515	73.390	918,475.850	
EXXON MOBIL CORP	327,609	60.650	19,869,485.850	
FMC CORP	10,209	105.470	1,076,743.230	

NEXTERA ENERGY INC	37,404	278.520	10,417,762.080	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,875	299.540	861,177.500	
ASSURANT INC	4,594	142.520	654,736.880	
FASTENAL CO	45,891	38.320	1,758,543.120	
FIFTH THIRD BANCORP	58,144	29.600	1,721,062.400	
M&T BANK CORP	9,999	169.780	1,697,630.220	
FISERV INC	44,349	122.320	5,424,769.680	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	57.510	668,438.730	
FORD MOTOR CO	310,836	8.100	2,517,771.600	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	24.360	577,648.680	
FREEPORT-MCMORAN INC	114,993	12.240	1,407,514.320	
FLEX LTD	35,127	13.580	477,024.660	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	109.160	1,557,713.200	
GAP INC/THE	18,295	18.140	331,871.300	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	57.850	1,063,630.100	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,821	188.060	3,539,477.260	
GENERAL MILLS INC	46,141	53.310	2,459,776.710	
GENUINE PARTS CO	11,605	96.470	1,119,534.350	
GILEAD SCIENCES INC	97,831	67.560	6,609,462.360	
GARTNER INC	7,384	152.410	1,125,395.440	
MCKESSON CORP	14,558	168.030	2,446,180.740	
NVIDIA CORP	44,712	289.790	12,957,090.480	
GENERAL ELECTRIC CO	674,757	12.830	8,657,132.310	
WW GRAINGER INC	3,762	307.650	1,157,379.300	
HALLIBURTON CO	66,843	22.120	1,478,567.160	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,728	69.860	2,286,378.080	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,900	237.080	5,903,292.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	34.360	443,278.360	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,586	228.550	4,019,280.300	
HASBRO INC	9,473	97.710	925,606.830	
HENRY SCHEIN INC	11,516	72.130	830,649.080	
HEICO CORP	2,278	129.760	295,593.280	
HERSHEY FOODS CORP	11,292	160.340	1,810,559.280	
HP INC	117,482	22.370	2,628,072.340	
F5 NETWORKS INC	4,874	127.510	621,483.740	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	80.000	837,760.000	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	24.240	677,241.360	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	43.320	513,558.600	
HOLOGIC INC	19,688	53.020	1,043,857.760	
UNUM GROUP	15,185	30.010	455,701.850	
HOME DEPOT INC	84,667	245.030	20,745,955.010	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,185	89.010	1,173,596.850	
HORMEL FOODS CORP	24,161	48.580	1,173,741.380	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	27.180	1,024,088.040	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	244.780	713,044.140	
HUMANA INC	10,384	375.850	3,902,826.400	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,000	110.070	660,420.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	14.080	1,119,599.360	
BIOGEN INC	14,119	333.000	4,701,627.000	
IDEX CORP	6,154	174.790	1,075,657.660	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,755	187.860	4,650,474.300	
INTUIT INC	20,054	304.290	6,102,231.660	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	288.780	1,961,104.980	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	60.130	659,024.800	
INGERSOLL-RAND PLC	18,244	146.550	2,673,658.200	
INTEL CORP	342,807	67.270	23,060,626.890	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	135.870	1,082,204.550	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	43.190	1,270,261.090	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	24.470	706,253.140	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,108	100.660	1,017,471.280	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	172.080	1,035,749.520	
INCYTE CORP	13,798	78.450	1,082,453.100	
JOHNSON & JOHNSON	204,338	150.130	30,677,263.940	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,753	59.100	1,699,302.300	
KLA CORPORATION	12,724	176.280	2,242,986.720	
DEVON ENERGY CORP	33,312	22.820	760,179.840	
KELLOGG CO	19,181	67.710	1,298,745.510	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	47.800	552,568.000	
KEYCORP	79,497	19.730	1,568,475.810	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,125	145.560	3,802,755.000	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,929	565.940	5,053,278.260	
KOHL'S CORP	11,910	44.470	529,637.700	
KROGER CO	63,944	28.230	1,805,139.120	
LAM RESEARCH CORP	11,139	339.300	3,779,462.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,716	389.480	1,057,827.680	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	98.940	706,728.420	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	99.670	1,321,026.180	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	45.600	498,316.800	
LENNAR CORP	22,753	70.350	1,600,673.550	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	23.470	488,058.650	
ELI LILLY & CO	67,242	141.120	9,489,191.040	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	61.110	937,671.840	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	53,913	105.950	5,712,082.350	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,662	85.820	2,030,672.840	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,676	437.850	8,615,136.600	
LOEWS CORP	21,759	54.190	1,179,120.210	
LOWE'S COS INC	59,941	125.420	7,517,800.220	
DOMINION ENERGY INC	63,796	87.460	5,579,598.160	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	31.520	1,215,820.960	
MCCORMICK & CO INC	9,935	166.840	1,657,555.400	
MCDONALD'S CORPORATION	58,712	217.090	12,745,788.080	
S&P GLOBAL INC	19,018	307.650	5,850,887.700	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	291.370	907,326.180	
MANPOWERGROUP INC	4,555	92.700	422,248.500	
MARKEL CORPORATION	1,065	1,323.640	1,409,676.600	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,561	230.550	3,818,138.550	
MARSH & MCLENNAN COS	38,872	118.780	4,617,216.160	
MASCO CORP	21,216	45.610	967,661.760	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	263.480	1,261,015.280	
METLIFE INC	61,260	52.280	3,202,672.800	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	63.560	1,359,294.160	
MEDTRONIC PLC	103,771	117.330	12,175,451.430	
ACTIVISION BLIZZARD INC	60,243	63.520	3,826,635.360	
CVS HEALTH CORP	100,451	71.370	7,169,187.870	
MERCK & CO. INC.	198,319	82.650	16,391,065.350	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	21.440	700,787.840	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	195.280	1,571,808.720	
MICROSOFT CORP	561,788	185.350	104,127,405.800	
MICRON TECH INC	84,794	58.500	4,960,449.000	
MIDDLEBY CORP	4,188	113.730	476,301.240	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,473	109.360	2,020,207.280	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	25.120	1,223,720.800	
3M CO	44,296	161.010	7,132,098.960	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	137.980	686,588.480	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,593	184.410	2,322,275.130	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	173.640	1,322,094.960	
MYLAN NV	43,574	21.900	954,270.600	
ILLUMINA INC	11,619	298.920	3,473,151.480	
XCEL ENERGY INC	38,963	70.260	2,737,540.380	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,545	104.300	682,643.500	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	27,194	22.890	622,470.660	
NETAPP INC	17,963	54.240	974,313.120	
NEWELL BRANDS INC	33,317	20.100	669,671.700	

NEWMONT CORP	63,869	44.070	2,814,706.830	
NVR INC	263	3,993.630	1,050,324.690	
NIKE INC-CL B	96,700	103.540	10,012,318.000	
NOBLE ENERGY INC	39,436	19.160	755,593.760	
NORDSTROM INC	9,487	40.280	382,136.360	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,260	209.350	4,241,431.000	
EVERSOURCE ENERGY	24,768	93.660	2,319,770.880	
NISOURCE INC	31,548	30.210	953,065.080	
TAPESTRY INC	21,790	29.210	636,485.900	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	101.200	1,615,050.800	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,194	370.940	4,523,242.360	
WELLS FARGO & CO	323,987	48.220	15,622,653.140	
NUCOR CORP	24,042	47.150	1,133,580.300	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	54.980	1,054,241.500	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,969	102.640	3,691,858.160	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,550	41.600	2,893,280.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	221.910	1,155,929.190	
OGE ENERGY CORP	16,028	46.120	739,211.360	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,822	390.890	2,275,761.580	
ORACLE CORP	180,697	55.470	10,023,262.590	
PACCAR INC	27,394	74.740	2,047,427.560	
PTC INC	7,766	87.350	678,360.100	
EXELON CORP	73,721	49.760	3,668,356.960	
PARKER HANNIFIN CORP	10,092	211.840	2,137,889.280	
PAYCHEX INC	25,329	89.210	2,259,600.090	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,163	274.950	1,694,516.850	
PPL CORPORATION	53,724	35.370	1,900,217.880	
PEPSICO INC	108,292	146.990	15,917,841.080	
PENTAIR PLC	12,511	44.240	553,486.640	
PFIZER INC	428,075	36.510	15,629,018.250	
ESSENTIAL UTILITIES INC	15,516	53.720	833,519.520	
CONOCOPHILLIPS	85,896	58.620	5,035,223.520	
PVH CORP	5,205	89.370	465,170.850	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,908	139.230	1,797,180.840	
ALTRIA GROUP INC	144,297	45.170	6,517,895.490	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,494	154.130	5,316,560.220	
BROWN & BROWN INC	17,294	47.850	827,517.900	
POLARIS INC	4,095	93.900	384,520.500	
GARMIN LTD	10,774	98.180	1,057,791.320	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	120.150	2,286,574.650	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	139.490	363,789.920	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,984	318.310	10,817,447.040	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,483	137.390	2,539,379.370	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	112.850	1,228,146.550	

PROCTER & GAMBLE CO	193,908	126.140	24,459,555.120	
PROGRESSIVE CORP	46,127	83.770	3,864,058.790	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,039	58.480	2,283,000.720	
PULTE GROUP INC	21,209	46.690	990,248.210	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,692	206.370	4,889,318.040	
QUALCOMM INC	93,982	89.600	8,420,787.200	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	98.950	1,027,892.600	
EXACT SCIENCES CORP	11,306	98.180	1,110,023.080	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,161	198.180	626,446.980	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,116	399.550	2,443,647.800	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	154.220	777,577.240	
RESMED INC	11,116	176.600	1,963,085.600	
US BANCORP	115,614	55.110	6,371,487.540	
SEATTLE GENETICS INC /WA	9,150	118.070	1,080,340.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	47.680	1,501,920.000	
ROSS STORES INC	28,814	121.780	3,508,968.920	
ROLLINS INC	12,378	39.820	492,891.960	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,949	392.730	3,121,810.770	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,251	200.680	1,856,490.680	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	113.160	1,592,727.000	
RPM INTERNATIONAL INC	11,141	75.440	840,477.040	
RAYTHEON COMPANY	21,972	227.180	4,991,598.960	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	102.830	395,689.840	
ACCENTURE PLC-CL A	49,357	212.370	10,481,946.090	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,385	59.680	6,647,456.800	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,190	213.670	2,177,297.300	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,563	137.760	2,694,998.880	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	47,412	157.440	7,464,545.280	
BOOKING HOLDINGS INC	3,283	1,990.960	6,536,321.680	
SCHLUMBERGER LTD	106,593	34.420	3,668,931.060	
SCHWAB (CHARLES) CORP	89,867	47.230	4,244,418.410	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,590	160.400	2,500,636.000	
BUNGE LTD	10,622	54.220	575,924.840	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	68.540	730,156.620	
ANTHEM INC	19,728	297.820	5,875,392.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	94.360	1,202,995.640	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	56.360	1,249,783.000	

SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,367	585.450	3,727,560.150	
CENTENE CORP	46,124	64.940	2,995,292.560	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	265.420	1,073,358.480	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	237.950	1,487,663.400	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	43.930	498,649.430	
ACUITY BRANDS INC	3,087	116.900	360,870.300	
SNAP-ON INC	3,981	156.260	622,071.060	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,388	94.480	2,965,538.240	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	133.590	707,626.230	
EDISON INTERNATIONAL	26,652	77.140	2,055,935.280	
SOUTHERN CO	80,067	69.020	5,526,224.340	
TRUIST FINANCIAL CORP	103,681	54.940	5,696,234.140	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	57.970	658,075.440	
AT&T INC	565,686	38.250	21,637,489.500	
CHEVRON CORP	147,108	110.080	16,193,648.640	
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,776	166.970	1,966,238.720	
STATE STREET CORP	29,590	77.850	2,303,581.500	
STARBUCKS CORP	92,312	89.280	8,241,615.360	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	28.440	499,036.680	
STRYKER CORP	25,850	221.540	5,726,809.000	
NETFLIX INC	33,860	380.400	12,880,344.000	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	20.660	1,011,410.300	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	39.060	382,514.580	
SYNOPSIS INC	11,855	163.350	1,936,514.250	
SYSCO CORP	38,229	78.210	2,989,890.090	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,850	603.360	5,339,736.000	
TELEFLEX INC	3,455	386.650	1,335,875.750	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	12.220	1,079,294.840	
TERADYNE INC	12,162	70.160	853,285.920	
TEXAS INSTRUMENTS INC	72,056	132.210	9,526,523.760	
TEXTRON INC	16,304	48.080	783,896.320	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,995	339.190	10,513,194.050	
TIFFANY & CO	8,733	134.270	1,172,579.910	
GLOBE LIFE INC	7,282	110.950	807,937.900	
DAVITA INC	8,159	85.980	701,510.820	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	98.170	939,781.410	
TRIMBLE INC	20,073	45.360	910,511.280	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,851	338.250	964,350.750	
TYSON FOODS INC	22,736	80.510	1,830,475.360	
UGI CORP	14,797	41.700	617,034.900	
MARATHON OIL CORP	58,418	10.640	621,567.520	
UNION PACIFIC CORP	54,482	184.000	10,024,688.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	63,451	153.460	9,737,190.460	
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,307	298.780	21,902,665.460	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	139.930	860,989.290	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	146.920	1,061,643.920	
VF CORP	26,750	83.660	2,237,905.000	
VIACOMCBS INC	45,361	34.980	1,586,727.780	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,829	243.820	4,834,706.780	
VULCAN MATERIALS CO	9,794	146.970	1,439,424.180	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,250	52.850	3,184,212.500	
WALMART INC	110,464	117.890	13,022,600.960	
WASTE MANAGEMENT INC	32,300	125.750	4,061,725.000	
WATERS CORP	5,468	216.060	1,181,416.080	
ALLERGAN PLC	25,262	198.320	5,009,959.840	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,240	174.570	914,746.800	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	110.000	1,009,360.000	
VAIL RESORTS INC	3,109	249.410	775,415.690	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	69.250	1,562,764.750	
WABTEC CORP	14,964	77.050	1,152,976.200	
WHIRLPOOL CORP	4,614	152.160	702,066.240	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	118.990	1,654,198.980	
WYNN RESORTS LTD	7,970	132.140	1,053,155.800	
NASDAQ INC	9,020	116.200	1,048,124.000	
CME GROUP INC	27,673	213.130	5,897,946.490	
WILLIAMS COS INC	90,718	21.540	1,954,065.720	
LKQ CORP	22,196	33.200	736,907.200	
ALLIANT ENERGY CORP	17,221	59.740	1,028,782.540	
WEC ENERGY GROUP INC	23,839	101.870	2,428,478.930	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	49.540	1,080,962.800	
CARMAX INC	12,081	98.810	1,193,723.610	
XILINX INC	18,997	90.170	1,712,959.490	
TJX COMPANIES INC	93,010	63.380	5,894,973.800	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,128	238.770	985,642.560	
ZIONS BANCORP NA	13,142	46.260	607,948.920	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	5.400	147,960.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	5.510	420,964.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	58.070	911,699.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	31.890	545,319.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,178	128.700	1,052,508.600	
SIGNATURE BANK	4,171	144.360	602,125.560	
CBRE GROUP INC	23,613	63.960	1,510,287.480	

LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	20.330	258,841.560	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	16.540	1,264,979.200	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	291.600	949,449.600	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	64.840	194,520.000	
T-MOBILE US INC	25,675	96.480	2,477,124.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	68.070	1,889,555.130	
MOSAIC CO/THE	28,249	18.750	529,668.750	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,892	345.690	999,735.480	
CELANESE CORP	10,326	110.020	1,136,066.520	
DEXCOM INC	7,216	283.910	2,048,694.560	
DISCOVERY INC-A	10,423	30.210	314,878.830	
EXPEDIA GROUP INC	11,527	122.800	1,415,515.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	38.300	707,592.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,312	178.820	1,843,991.840	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	19.450	661,747.350	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,248	96.860	4,285,861.280	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	17.190	252,624.240	
LIVE NATION	11,339	74.020	839,312.780	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,040	921.940	1,880,757.600	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	79.550	358,611.400	
TRANSDIGM GROUP INC	3,681	646.750	2,380,686.750	
MASTERCARD INC	69,914	340.950	23,837,178.300	
HANESBRANDS INC	27,619	14.300	394,951.700	
WESTERN UNION CO	35,222	26.240	924,225.280	
OWENS CORNING	7,756	63.820	494,987.920	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	112.810	1,253,657.530	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	62.520	550,613.640	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,067	67.910	479,919.970	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	21.400	371,290.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	122.280	1,122,041.280	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,545	16.250	480,106.250	
DELTA AIR LINES INC	11,158	58.900	657,206.200	
INSULET CORP	4,781	212.320	1,015,101.920	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	26.200	158,195.600	
DISCOVER FINANCIAL	23,978	76.420	1,832,398.760	
TE CONNECTIVITY LTD	25,641	93.300	2,392,305.300	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	77.930	1,244,542.100	
WABCO HOLDING INC	4,076	136.010	554,376.760	

LULULEMON ATHLETICA INC	8,255	254.410	2,100,154.550	
VMWARE INC	6,532	161.820	1,057,008.240	
MERCADOLIBRE INC	3,500	735.010	2,572,535.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	294.570	1,348,246.890	
INVESCO LTD	33,443	17.780	594,616.540	
MSCI INC	6,714	322.560	2,165,667.840	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	120,348	88.500	10,650,798.000	
VISA INC	133,771	210.290	28,130,703.590	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	139.320	2,025,155.520	
DISCOVERY INC-C	30,421	28.730	873,995.330	
MARATHON PETROLEUM CORP	51,474	58.330	3,002,478.420	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	72.990	848,435.760	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	160,064	22.000	3,521,408.000	
XYLEM INC	13,237	88.140	1,166,709.180	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	82.600	1,724,357.600	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	246.210	856,564.590	
SPLUNK INC	11,194	172.520	1,931,188.880	
EPAM SYSTEMS INC	4,023	236.750	952,445.250	
HCA HEALTHCARE INC	20,649	149.570	3,088,470.930	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	171.380	2,111,401.600	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	140.850	601,852.050	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	318.430	2,192,390.550	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	12,453	117.730	1,466,091.690	
NXP SEMICONDUCTOR NV	21,318	137.080	2,922,271.440	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	9,833	76.650	753,699.450	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	36.890	702,311.820	
LEAR CORP	4,681	122.760	574,639.560	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	125.630	1,083,181.860	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	66.260	1,144,177.680	
DOLLAR GENERAL CORP	20,252	158.030	3,200,423.560	
FORTINET INC	11,150	119.190	1,328,968.500	
AON PLC	18,189	235.730	4,287,692.970	
TESLA INC	10,548	800.030	8,438,716.440	
GENERAL MOTORS CO	100,695	34.760	3,500,158.200	
XPO LOGISTICS INC	7,614	95.200	724,852.800	
TRIPADVISOR INC	9,263	29.650	274,647.950	
ALLY FINANCIAL INC	31,871	32.850	1,046,962.350	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	28.620	347,389.560	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	62.580	642,884.340	

APTIV PLC	18,920	88.320	1,671,014.400	
PHILLIPS 66	34,235	89.470	3,063,005.450	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,885	122.420	720,441.700	
FACEBOOK INC	186,156	214.180	39,870,892.080	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	164.320	2,210,596.960	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,424	74.970	856,457.280	
SERVICENOW INC	14,406	356.160	5,130,840.960	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,272	247.250	1,798,002.000	
WORKDAY INC	12,224	196.990	2,408,005.760	
ABBVIE INC	114,434	94.050	10,762,517.700	
ZOETIS INC	36,825	144.170	5,309,060.250	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	52.460	886,521.540	
COTY INC	23,813	11.410	271,706.330	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	14.600	441,839.800	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	41.920	590,024.000	
CDW CORP	11,406	138.290	1,577,335.740	
SPRINT CORP	63,882	8.690	555,134.580	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	29.200	297,810.800	
ARCONIC INC	30,749	33.360	1,025,786.640	
TWILIO INC	9,190	127.740	1,173,930.600	
SNAP INC	57,130	17.560	1,003,202.800	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	14,304	46.850	670,142.400	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	49.350	247,046.100	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	49.720	706,272.600	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	15.450	238,084.500	
OKTA INC	8,816	137.030	1,208,056.480	
BLACK KNIGHT INC	12,700	74.390	944,753.000	
BAKER HUGHES CO	51,005	21.980	1,121,089.900	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,669	95.170	1,015,368.730	
ALTICE USA INC-A	13,887	28.710	398,695.770	
TECHNIPFMC LTD	31,257	17.260	539,495.820	
BROADCOM INC	30,762	317.770	9,775,240.740	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,725	242.390	1,387,682.750	
MONGODB INC	3,423	171.330	586,462.590	
BURLINGTON STORES INC	5,095	245.680	1,251,739.600	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29,578	30.980	916,326.440	
VEEVA SYSTEMS INC	9,733	158.870	1,546,281.710	
TWITTER INC	57,562	36.910	2,124,613.420	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	48.880	645,900.320	
EVERGY INC	18,388	72.340	1,330,187.920	
ALLEGION PLC	7,469	138.900	1,037,444.100	
STERIS PLC	6,658	168.510	1,121,939.580	
DOCUSIGN INC	7,220	89.410	645,540.200	
WIX.COM LTD	4,000	148.260	593,040.000	
DROPBOX INC	17,573	18.530	325,627.690	

KKR & CO INC	37,307	33.540	1,251,276.780	
PERRIGO CO PLC	10,553	57.710	609,013.630	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,655	113.230	2,338,765.650	
ARAMARK	18,144	42.480	770,757.120	
CIGNA CORP	29,083	220.340	6,408,148.220	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	52.880	685,324.800	
DOW INC	56,434	48.630	2,744,385.420	
AMCOR PLC	130,000	10.210	1,327,300.000	
PINTEREST INC	13,183	23.220	306,109.260	
XEROX HOLDINGS CORP	17,455	37.820	660,148.100	
FOX CORP-A	26,257	37.800	992,514.600	
FOX CORP-B	13,009	37.310	485,365.790	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,312	39.660	527,953.920	
CORTEVA INC	59,322	30.710	1,821,778.620	
BLACKSTONE GROUP INC	50,889	62.950	3,203,462.550	
GRUBHUB INC	8,158	50.390	411,081.620	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,923	314.430	1,233,508.890	
SABRE CORP	19,809	22.040	436,590.360	
ARISTA NETWORKS INC	4,441	223.470	992,430.270	
IHS MARKIT LTD	29,796	80.760	2,406,324.960	
FNF GROUP	21,372	45.080	963,449.760	
SYNCHRONY FINANCIAL	43,986	33.750	1,484,527.500	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	38.670	1,385,159.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	118.940	411,175.580	
CDK GLOBAL INC	9,969	52.100	519,384.900	
WAYFAIR INC	5,091	82.460	419,803.860	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,954	98.160	1,369,724.640	
QORVO INC	8,871	106.020	940,503.420	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,888	34.910	589,560.080	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	137.070	1,138,640.490	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	29.890	508,668.020	
GODADDY INC	12,328	78.390	966,391.920	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	21.390	560,503.560	
TRANSUNION	15,000	98.130	1,471,950.000	
SQUARE INC	26,487	81.860	2,168,225.820	
DUPONT DE NEMOURS INC	58,757	53.100	3,119,996.700	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	55.150	1,065,553.150	
WESTROCK CO	18,284	40.530	741,050.520	
KRAFT HEINZ CO	51,163	26.880	1,375,261.440	
FORTIVE CORP	22,500	77.810	1,750,725.000	
MATCH GROUP INC	4,599	76.500	351,823.500	
WASTE CONNECTIONS INC	20,417	103.810	2,119,488.770	
ALPHABET INC-CL A	23,132	1,518.730	35,131,262.360	

	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	104,040	14.440	1,502,337.600	
	PAYPAL HOLDINGS INC	86,404	122.990	10,626,827.960	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,471	26.890	953,815.190	
	DXC TECHNOLOGY CO	20,848	30.820	642,535.360	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,166	51.850	423,407.100	
	ALPHABET INC-CL C	24,252	1,520.740	36,880,986.480	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	171.090	540,473.310	
	LINDE PLC	41,798	222.640	9,305,906.720	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	48.280	571,973.160	
	ROKU INC	6,674	130.250	869,288.500	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	11,986	534.890	6,411,191.540	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	23.290	698,700.000	
アメリカ・ドル	小計	23,287,756		2,232,683,476.010 (245,148,645,666)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	8.680	276,006.640	
	ASHTED GROUP	36,689	26.790	982,898.310	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	26.090	475,281.530	
	BHP GROUP PLC	161,284	16.752	2,701,829.560	
	BARCLAYS PLC	1,342,831	1.759	2,362,039.720	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	8.706	716,355.790	
	BT GROUP PLC	630,777	1.535	968,242.690	
	BUNZL PLC	27,838	19.350	538,665.300	
	EASYJET PLC	13,628	14.985	204,215.580	
	AVIVA PLC	314,691	4.109	1,293,065.310	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	50.600	525,784.600	
	DIAGEO PLC	182,812	30.795	5,629,695.540	
	SCHRODERS PLC	10,932	33.810	369,610.920	
	DCC PLC	7,898	62.520	493,782.960	
	NATIONAL GRID PLC	264,642	10.400	2,752,276.800	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.167	359,028.560	
	BAE SYSTEMS PLC	248,672	6.432	1,599,458.300	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	177,272	33.470	5,933,293.840	
	HALMA PLC	27,901	21.980	613,263.980	
	NEXT PLC	10,018	71.280	714,083.040	
	IMPERIAL BRANDS PLC	71,656	18.250	1,307,722.000	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	26.460	397,349.820	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,981	20.935	1,653,467.230	
	COMPASS GROUP PLC	119,560	19.410	2,320,659.600	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,561,212	5.845	9,125,284.140	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	452,758	3.184	1,441,581.470	
	CENTRICA PLC	471,340	0.712	335,594.080	
	UNILEVER PLC	85,586	46.055	3,941,663.230	
	MEGGITT PLC	62,181	6.460	401,689.260	
	MORRISON SUPERMARKETS	168,676	1.817	306,484.290	

UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	10.120	551,408.440	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.746	464,644.540	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,547	26.690	681,849.430	
PEARSON PLC	65,009	5.702	370,681.310	
PERSIMMON PLC	26,085	32.300	842,545.500	
PRUDENTIAL PLC	204,940	14.765	3,025,939.100	
RIO TINTO PLC	87,436	41.970	3,669,688.920	
VODAFONE GROUP PLC	2,043,718	1.500	3,065,577.000	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,464	63.380	3,451,928.320	
RELX PLC	147,523	20.730	3,058,151.790	
RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	4.917	691,413.780	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	6.772	943,122.890	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	2.131	846,931.850	
ST JAMES'S PLACE PLC	37,685	11.880	447,697.800	
SSE PLC	74,684	16.590	1,239,007.560	
BP PLC	1,574,009	4.568	7,190,073.110	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	7.838	682,776.010	
SMITHS GROUP PLC	31,720	17.380	551,293.600	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	92.750	511,794.500	
STANDARD CHARTERED PLC	218,329	6.352	1,386,825.800	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,393,991	0.566	3,052,998.900	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	2.318	584,801.260	
TESCO PLC	757,316	2.558	1,937,214.320	
3I GROUP PLC	76,643	11.660	893,657.380	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	18.190	1,237,411.130	
GLAXOSMITHKLINE PLC	386,219	16.686	6,444,450.230	
WEIR GROUP	19,161	13.805	264,517.600	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,660	82.200	2,027,052.000	
WPP PLC	95,148	9.772	929,786.250	
ASTRAZENECA PLC	101,556	73.000	7,413,588.000	
WHITBREAD PLC	9,814	47.660	467,735.240	
CARNIVAL PLC	13,350	30.960	413,316.000	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.838	324,829.740	
INTERTEK GROUP PLC	12,083	58.960	712,413.680	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	19.985	633,244.710	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,460	47.790	595,463.400	
ITV PLC	254,308	1.360	345,858.880	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.060	282,662.900	
G4S PLC	122,250	2.010	245,722.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	23.260	369,671.180	

	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	8,233	53.240	438,324.920	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	333,687	19.240	6,420,137.880	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	286,367	19.270	5,518,292.090	
	TUI AG-DI	29,824	8.974	267,640.570	
	AVEVA GROUP PLC	5,704	52.850	301,456.400	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	201,144	3.256	654,924.860	
	EXPERIAN PLC	69,842	28.230	1,971,639.660	
	MONDI PLC	39,767	16.625	661,126.370	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	16.895	353,561.660	
	OCADO GROUP PLC	31,011	11.665	361,743.310	
	INFORMA PLC	102,475	7.782	797,460.450	
	GLENCORE PLC	866,421	2.339	2,026,558.710	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.366	415,104.180	
	EVRAZ PLC	48,765	3.855	187,989.070	
	NMC HEALTH PLC	8,149	7.750	63,154.750	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.480	392,175.120	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	28.400	431,907.200	
	FERGUSON PLC	17,128	75.560	1,294,191.680	
	M&G PLC	204,940	2.490	510,300.600	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,086	8.674	278,313.960	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	8.020	209,322.000	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.890	449,689.720	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	2.375	866,245.620	
イギリス・ポンド	小計	23,261,639		138,461,381.420 (19,827,669,819)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOLIM BM	79,754	28.590	2,280,166.860	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	106,399	24.410	2,597,199.590	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	541.300	952,688.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.480	1,581,034.320	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	13.850	684,342.350	
	NICE LTD	4,902	615.100	3,015,220.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	95.200	994,268.800	
	AZRIELI GROUP	2,291	280.000	641,480.000	
イスラエル・シュケル	小計	357,095		12,746,400.120 (407,884,804)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,432	79.750	991,452.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,180	26.610	5,805,769.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	265,407	25.700	6,820,959.900	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	10.990	1,271,125.380	

TELSTRA CORP LTD	296,965	3.770	1,119,558.050	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	10.570	412,377.980	
AMP LTD	302,414	1.825	551,905.550	
ASX LTD	15,573	82.250	1,280,879.250	
BHP GROUP LTD	228,136	38.650	8,817,456.400	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	33.550	702,738.300	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,867	4.800	71,361.600	
COMPUTERSHARE LT	38,040	17.430	663,037.200	
CSL LIMITED	35,166	331.190	11,646,627.540	
REA GROUP LTD	4,119	113.730	468,453.870	
TRANSURBAN GROUP	206,475	16.370	3,379,995.750	
COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	11.910	578,837.910	
COCHLEAR LTD	4,381	233.000	1,020,773.000	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	7.760	1,030,993.600	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,026	90.990	12,467,995.740	
BORAL LIMITED	86,101	4.720	406,396.720	
RIO TINTO LIMITED	28,081	97.650	2,742,109.650	
APA GROUP	94,106	11.470	1,079,395.820	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	37.150	1,683,749.450	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	6.790	1,226,090.670	
TPG TELECOM LTD	28,719	8.060	231,475.140	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	38.970	127,626.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	30.500	1,034,743.000	
ORICA LTD	27,865	22.430	625,011.950	
CIMIC GROUP LTD	8,709	27.390	238,539.510	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	17.830	766,226.420	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	14.150	522,715.150	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.580	730,415.400	
MACQUARIE GROUP LTD	24,765	148.580	3,679,583.700	
WORLEY LTD	27,772	14.140	392,696.080	
SUNCORP GROUP LTD	104,783	12.570	1,317,122.310	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	27.350	6,192,614.350	
NEWCREST MINING LTD	62,080	27.990	1,737,619.200	
OIL SEARCH LTD	105,470	6.470	682,390.900	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	3.090	421,556.340	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	6.430	400,473.260	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	14.150	1,525,653.000	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	10.100	461,640.700	
SANTOS LTD	132,862	8.190	1,088,139.780	
SONIC HEALTHCARE	34,684	31.630	1,097,054.920	

	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	4,466	22.340	99,770.440	
	TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	4.650	690,687.750	
	WESFARMERS LTD	86,051	45.650	3,928,228.150	
	ALUMINA LIMITED	184,613	2.210	407,994.730	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	75,944	32.830	2,493,241.520	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	95,647	43.140	4,126,211.580	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	73.670	736,331.650	
	SEEK LTD	25,899	23.640	612,252.360	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.745	288,040.170	
	AGL ENERGY LTD	49,644	20.680	1,026,637.920	
	BRAMBLES LTD	126,693	12.650	1,602,666.450	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.900	391,045.900	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.480	822,822.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	11.290	651,060.430	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	3.050	631,075.500	
	SOUTH32 LTD(AUD)	357,525	2.630	940,290.750	
	COLES GROUP LTD	81,608	16.980	1,385,703.840	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	29.050	232,400.000	
	オーストラリア・ドル 小計	5,776,333		110,579,800.130 (8,153,048,664)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,302	66.060	1,076,910.120	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	68,496	44.060	3,017,933.760	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	26.120	3,681,692.360	
	ATCO LTD	7,193	54.140	389,429.020	
	BANK OF MONTREAL	50,286	101.810	5,119,617.660	
	BANK OF NOVA SCOTIA	94,561	74.730	7,066,543.530	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,548	73.760	1,884,420.480	
	BCE INC	11,673	64.330	750,924.090	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	68,751	90.070	6,192,402.570	
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,415	36.770	750,659.550	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.650	250,164.750	
	SAPUTO INC	18,601	41.400	770,081.400	
	BLACKBERRY LTD	39,652	7.730	306,509.960	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	36,321	21.830	792,887.430	
	CGI INC	18,686	102.940	1,923,536.840	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	58.690	665,544.600	
	CAE INC	23,000	40.460	930,580.000	
	CAMECO CORP	32,627	12.250	399,680.750	
	ROGERS COMM-CL B	27,696	65.710	1,819,904.160	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,111	110.050	3,753,915.550	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,493	38.810	3,550,843.330	

CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	148.910	724,000.420	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	41.910	382,177.290	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,493	124.500	6,908,878.500	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	36.890	586,956.790	
OPEN TEXT CORP	21,795	63.280	1,379,187.600	
EMPIRE CO LTD	15,093	31.570	476,486.010	
KINROSS GOLD CORP	99,741	6.690	667,267.290	
FORTIS INC	32,312	58.360	1,885,728.320	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	12.180	673,505.280	
TELUS CORP	15,945	53.730	856,724.850	
GREAT WEST LIFECO INC	20,722	34.750	720,089.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	31.800	685,035.600	
ENBRIDGE INC	156,599	56.030	8,774,241.970	
IGM FINANCIAL INC	2,953	39.410	116,377.730	
MANULIFE FINANCIAL CORP	147,054	26.110	3,839,579.940	
LOBLAW CO LTD	15,354	71.090	1,091,515.860	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,909	67.920	1,623,899.280	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,241	66.440	2,939,372.040	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	628.930	1,303,142.960	
METRO INC	19,949	55.840	1,113,952.160	
HUSKY ENERGY INC	28,749	8.280	238,041.720	
EMERA INC	19,138	59.330	1,135,457.540	
METHANEX CORP	5,281	44.550	235,268.550	
ONEX CORP	6,646	86.180	572,752.280	
POWER CORP OF CANADA	23,792	34.380	817,968.960	
POWER FINANCIAL CORP	21,676	36.000	780,336.000	
QUEBECOR INC-B	11,331	32.880	372,563.280	
ROYAL BANK OF CANADA	111,311	108.300	12,054,981.300	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,747	358.880	3,856,883.360	
SHAW COMM INC-B	35,431	25.890	917,308.590	
SUNCOR ENERGY INC	119,141	39.450	4,700,112.450	
LUNDIN MINING CORP	43,480	7.330	318,708.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	17.830	731,315.280	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	108.550	1,779,568.700	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	140,924	75.290	10,610,167.960	
TC ENERGY CORP	71,704	74.620	5,350,552.480	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	63.170	359,816.320	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	110.530	683,517.520	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	152.740	1,678,459.860	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	39.750	1,389,779.250	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,565	1,473.130	2,305,448.450	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	153.180	2,285,751.960	

	CI FINANCIAL CORP	20,695	25.090	519,237.550	
	KEYERA CORP	16,668	35.980	599,714.640	
	PARKLAND FUEL CORP	10,583	47.690	504,703.270	
	ALTAGAS LTD	23,944	22.330	534,669.520	
	PEMBINA PIPELINE CORP	42,684	52.740	2,251,154.160	
	DOLLARAMA INC	23,536	43.610	1,026,404.960	
	STARS GROUP INC	18,529	30.950	573,472.550	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	11.820	954,122.220	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,250	49.020	747,555.000	
	INTER PIPELINE LTD	27,946	21.820	609,781.720	
	NUTRIEN LTD	44,453	54.660	2,429,800.980	
	CRONOS GROUP INC	16,000	9.690	155,040.000	
	WSP GLOBAL INC	8,400	96.670	812,028.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	69.190	560,715.760	
	OVINTIV INC	19,278	21.020	405,223.560	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	14.450	216,186.450	
	AIR CANADA	10,722	46.220	495,570.840	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	19,685	89.110	1,754,130.350	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	2.060	137,117.720	
	SHOPIFY INC	7,605	704.180	5,355,288.900	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	29.980	558,647.320	
	HYDRO ONE LTD	27,340	29.300	801,062.000	
カナダ・ドル	小計	3,092,662		157,018,688.980 (13,010,568,569)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.300	537,500.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	2.040	166,056.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	2.050	253,585.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	141,900	25.550	3,625,545.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	11.170	406,588.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	29.160	173,327.040	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	4.430	211,754.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.220	635,258.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.720	760,795.800	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.885	368,514.000	
	KEPPEL CORP LTD	101,100	6.720	679,392.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	2.180	387,822.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	251,553	11.060	2,782,176.180	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	607,122	3.220	1,954,932.840	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	8.620	409,450.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	95,200	26.250	2,499,000.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	8.230	333,315.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	17.080	358,680.000	

	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	4.100	583,430.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.995	187,856.000	
シンガポール・ドル 小計		2,924,934		17,314,976.860 (1,366,497,974)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	191,483	13.455	2,576,403.760	
	NESTLE SA-REGISTERED	230,364	107.560	24,777,951.840	
	CIE FINANC RICHEMONT	40,915	74.480	3,047,349.200	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	54,432	340.600	18,539,539.200	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,896	242.100	701,121.600	
	SIKA INHABER	10,209	186.500	1,903,978.500	
	SGS SA-REG	424	2,654.000	1,125,296.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	166,222	95.620	15,894,147.640	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,252	181.600	590,563.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,196.000	581,940.000	
	CLARIANT AG-REG	12,282	23.690	290,960.580	
	SWISSCOM AG-REG	1,960	571.000	1,119,160.000	
	ABB LTD	140,852	23.790	3,350,869.080	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	58.340	755,152.960	
	GEBERIT AG	2,901	524.200	1,520,704.200	
	LONZA GROUP AG-REG	5,793	416.900	2,415,101.700	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	8,375.000	661,625.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	91,400.000	822,600.000	
	GIVAUDAN-REG	742	3,330.000	2,470,860.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,558	433.100	5,005,769.800	
	LAFARGEHOLCIM LTD	37,997	49.700	1,888,450.900	
	TEMENOS GROUP	4,730	167.550	792,511.500	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	255.700	1,172,128.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	158.850	638,259.300	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	965.600	766,686.400	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	253.000	539,902.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	48.340	221,977.280	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	234.600	390,139.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,458	517.000	1,270,786.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	188.450	652,979.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	644.500	407,968.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	123.400	739,166.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	80.750	242,250.000		
DUFREY GROUP	3,138	85.600	268,612.800		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	943.200	1,419,516.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	50.260	897,090.740		
SWISS RE LTD	22,597	115.400	2,607,693.800		
ALCON INC	32,032	61.470	1,969,007.040		
UBS GROUP AG	301,686	12.965	3,911,358.990		
スイス・フラン 小計		1,344,447		108,947,579.360	

				(12,181,428,848)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	376.400	19,679,697.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	28,768	331.100	9,525,084.800	
	ERICSSON LM-B SHS	236,160	88.200	20,829,312.000	
	LUNDBERGS B	7,382	445.000	3,284,990.000	
	SKF AB-B SHS	28,812	190.650	5,493,007.800	
	SANDVIK AB	87,784	184.400	16,187,369.600	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	100.300	13,121,948.100	
	SKANSKA AB-B SHS	24,400	238.700	5,824,280.000	
	SWEDBANK AB	71,958	156.950	11,293,808.100	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	112,106	109.550	12,281,212.300	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	173.350	20,668,000.450	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	594.000	7,686,954.000	
	TELE2 AB-B SHS	34,618	146.900	5,085,384.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	253.000	2,884,959.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	222.900	4,277,673.900	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	148.450	3,577,348.100	
	INVESTOR AB-B SHS	35,180	563.200	19,813,376.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	60,283	204.500	12,327,873.500	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	241.100	19,550,316.800	
	TELIA CO AB	231,855	41.420	9,603,434.100	
	LUNDIN PETROLEUM AB	12,146	301.000	3,655,946.000	
	BOLIDEN AB	21,855	233.400	5,100,957.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	253.900	5,926,787.700	
	KINNEVIK AB-B	18,310	232.400	4,255,244.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,844	453.400	3,556,469.600	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	399.000	2,362,080.000	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	73.200	2,466,254.400		
HEXAGON AB	21,145	565.600	11,959,612.000		
EPIROC AB-A	48,955	119.250	5,837,883.750		
EPIROC AB-B	30,899	117.400	3,627,542.600		
ESSITY AB-B	46,640	315.500	14,714,920.000		
NORDEA BANK ABP	259,268	85.740	22,229,638.320		
スウェーデン・クローナ 小計	1,940,382		308,689,365.720 (3,491,276,726)		
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	1,025.500	8,656,245.500	
	A P MOLLER A/S	491	8,580.000	4,212,780.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	8,060.000	2,200,380.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	121.550	6,203,182.700	
	GENMAB A/S	5,014	1,633.000	8,187,862.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,533	378.200	5,874,580.600	
	NOVO NORDISK A/S-B	136,925	436.050	59,706,146.250	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13,963	696.400	9,723,833.200	
	COLOPLAST-B	9,729	948.800	9,230,875.200	

	DSV PANALPINA A S	17,626	778.000	13,713,028.000	
	DEMANT A/S	7,244	232.200	1,682,056.800	
	H LUNDBECK A/S	4,840	260.500	1,260,820.000	
	TRYG A/S	11,107	207.400	2,303,591.800	
	PANDORA A/S	8,251	341.000	2,813,591.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,539	545.000	4,108,755.000	
	ISS A/S	11,107	169.500	1,882,636.500	
	ORSTED A/S	15,090	743.000	11,211,870.000	
デンマーク・クローネ 小計		324,207		152,972,234.550 (2,435,317,974)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	8.350	711,795.750	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	17.060	509,991.640	
	A2 MILK CO LTD	55,091	15.910	876,497.810	
	FISHER & PAYKEL	43,184	24.280	1,048,507.520	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	5.230	335,263.920	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.765	760,603.590	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.330	329,042.220	
	MERIDIAN ENERGY LTD	75,656	5.580	422,160.480	
ニュージーランド・ドル 小計		574,531		4,993,862.930 (352,616,661)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	224.400	7,895,065.200	
	DNB ASA	71,352	175.250	12,504,438.000	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	29.510	2,748,531.890	
	TELENOR ASA	54,766	162.200	8,883,045.200	
	ORKLA ASA	64,938	88.500	5,747,013.000	
	EQUINOR ASA	81,022	160.800	13,028,337.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,171	378.600	4,607,940.600	
	AKER BP ASA	8,552	256.900	2,197,008.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	207.500	3,461,722.500	
	SCHIBSTED ASA	7,445	260.000	1,935,700.000	
ノルウェー・クローネ 小計		445,251		63,008,802.790 (747,914,489)	
ユーロ	CRH PLC	61,990	35.770	2,217,382.300	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	101.900	636,467.400	
	KERRY GROUP PLC-A	12,258	116.700	1,430,508.600	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	60.000	706,080.000	
	UMICORE	14,115	44.990	635,033.850	
	AIR LIQUIDE	36,317	138.800	5,040,799.600	
	AIRBUS SE	45,122	129.860	5,859,542.920	
	AXA	148,160	25.460	3,772,153.600	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	28.050	1,246,794.450	
	ADIDAS AG	13,900	288.400	4,008,760.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	18.720	1,629,201.600	
	DASSAULT AVIATION SA	163	1,092.000	177,996.000	

DANONE	48,833	72.520	3,541,369.160	
SAFRAN SA	25,898	145.000	3,755,210.000	
INTESA SANPAOLO	1,157,631	2.507	2,902,180.910	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,251	65.860	1,663,030.860	
ACCOR SA	12,277	38.510	472,787.270	
BOUYGUES	17,572	38.620	678,630.640	
BNP PARIBAS	86,434	53.680	4,639,777.120	
THALES SA	8,549	96.000	820,704.000	
CAPGEMINI SA	12,515	114.950	1,438,599.250	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	36.820	157,000.480	
INGENICO GROUP	4,334	137.000	593,758.000	
UNICREDIT SPA	155,718	13.886	2,162,300.140	
NATIXIS	70,166	4.351	305,292.260	
KONINKLIJKE DSM NV	13,716	115.650	1,586,255.400	
COMMERZBANK AG	83,118	6.610	549,409.980	
EIFFAGE	6,461	110.500	713,940.500	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,463	48.600	1,529,101.800	
UNITED INTERNET	9,882	30.870	305,057.340	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	42.040	233,153.840	
PUBLICIS GROUPE	15,198	40.920	621,902.160	
FAURECIA	6,117	43.020	263,153.340	
IBERDROLA SA	477,267	10.855	5,180,733.280	
ENI SPA	197,838	12.892	2,550,527.490	
JERONIMO MARTINS	19,517	16.865	329,154.200	
KBC GROUPE	18,577	72.460	1,346,089.420	
HANNOVER RUECK SE	4,868	192.000	934,656.000	
WARTSILA OYJ	34,935	11.175	390,398.620	
L'OREAL	19,554	268.200	5,244,382.800	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,486	414.950	8,915,615.700	
GEA GROUP AG	11,838	27.780	328,859.640	
BOLLORE	71,347	3.762	268,407.410	
MEDIOBANCA SPA	41,639	9.606	399,984.230	
MICHELIN(CGDE) -B	12,422	108.800	1,351,513.600	
CONTINENTAL AG	8,312	110.800	920,969.600	
DEUTSCHE POST AG-REG	76,032	33.255	2,528,444.160	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	15.555	247,091.170	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	27.170	255,370.830	
OMV AG	12,817	43.970	563,563.490	
VERBUND AG	4,908	48.620	238,626.960	
PERNOD-RICARD	16,719	166.000	2,775,354.000	
PEUGEOT SA	43,905	19.370	850,439.850	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,649	65.000	822,185.000	
RENAULT SA	14,917	34.500	514,636.500	
REPSOL SA	114,998	12.650	1,454,724.700	

REMY COINTREAU	1,860	100.200	186,372.000	
MERCK KGAA	9,850	122.350	1,205,147.500	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,436	35.890	1,415,358.040	
RWE AG	46,489	33.350	1,550,408.150	
SEB SA	1,551	119.900	185,964.900	
SOCIETE GENERALE-A	61,181	31.730	1,941,273.130	
VINCI S.A.	39,237	105.800	4,151,274.600	
SODEXO	7,075	99.820	706,226.500	
SOLVAY SA	5,563	97.520	542,503.760	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,656	97.000	4,234,632.000	
VIVENDI SA	67,989	25.300	1,720,121.700	
SAP SE	76,071	127.140	9,671,666.940	
TELEFONICA S.A	367,755	6.247	2,297,365.480	
TOTAL SA	186,020	45.250	8,417,405.000	
VALEO	19,653	27.210	534,758.130	
E.ON SE	181,317	11.104	2,013,343.960	
VOEST-ALPINE AG	9,875	22.880	225,940.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,585	83.050	629,934.250	
SIEMENS AG-REG	59,113	106.660	6,304,992.580	
UPM-KYMMENE OYJ	39,909	30.060	1,199,664.540	
ING GROEP NV-CVA	304,508	10.710	3,261,280.680	
PUMA AG	7,351	71.950	528,904.450	
BAYER AG	72,011	77.370	5,571,491.070	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41,915	12.235	512,830.020	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	93.300	1,283,714.700	
DAIMLER AG	69,481	43.065	2,992,199.260	
BASF SE	70,554	62.510	4,410,330.540	
BEIERSDORF AG	8,371	105.800	885,651.800	
HOCHTIEF AG	1,707	112.800	192,549.600	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	63.560	764,690.360	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,214	74.480	1,207,618.720	
ORANGE	151,246	13.360	2,020,646.560	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	41.300	1,492,623.300	
RANDSTAD NV	9,074	55.180	500,703.320	
ALLIANZ SE	32,944	231.250	7,618,300.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	4.713	950,169.070	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,026	23.180	2,063,622.680	
HERMES INTL	2,483	705.000	1,750,515.000	
ENDESA S.A.	23,417	25.100	587,766.700	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	15.210	244,820.160	
ERSTE GROUP BANK AG	20,943	35.440	742,219.920	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,091	282.300	3,130,989.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	46,714	16.024	748,545.130	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,953	155.300	1,545,700.900	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	31.260	629,482.620	
HEINEKEN NV	19,582	103.850	2,033,590.700	
AKZO NOBEL	17,491	87.160	1,524,515.560	
ASML HOLDING NV	33,053	292.950	9,682,876.350	
AEGON NV	150,349	3.806	572,228.290	
BANKINTER S.A.	57,960	6.264	363,061.440	
VOLKSWAGEN AG	2,645	171.300	453,088.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	170.460	2,454,794.460	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523,594	5.243	2,745,203.340	
KERING	5,830	579.400	3,377,902.000	
CNP ASSURANCES	13,987	16.830	235,401.210	
FORTUM OYJ	37,452	22.170	830,310.840	
AGEAS	14,365	52.640	756,173.600	
UCB SA	9,095	89.740	816,185.300	
THYSSENKRUPP AG	27,110	11.190	303,360.900	
CARREFOUR SA	51,094	15.855	810,095.370	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	23.920	564,799.040	
ATOS SE	7,304	80.840	590,455.360	
NOKIA OYJ	430,800	3.942	1,698,213.600	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,925	44.550	3,204,258.750	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,687	69.900	1,446,021.300	
SANOFI	87,169	92.240	8,040,468.560	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	28.950	1,609,938.450	
ELISA OYJ	10,787	56.560	610,112.720	
BANCO SANTANDER SA	1,264,063	3.923	4,958,919.140	
METSO OYJ	8,585	33.240	285,365.400	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	19.020	658,015.920	
QIAGEN N.V.	17,974	34.280	616,148.720	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	10.186	1,521,625.420	
BMW VORZUG	4,116	52.250	215,061.000	
ENEL SPA	632,333	8.277	5,233,820.240	
COLRUYT NV	4,673	46.400	216,827.200	
VOPAK (KON.)	5,364	50.820	272,598.480	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,592	15.630	4,119,942.960	
SARTORIUS AG	2,712	231.200	627,014.400	
LEONARDO SPA	28,316	11.475	324,926.100	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,935	74.660	443,107.100	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	22.570	2,235,964.760	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	108.900	410,661.900	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.501	727,863.520	
EUROFINS SCIENTIFIC	899	471.000	423,429.000	
TELEPERFORMANCE	4,383	241.600	1,058,932.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,525	153.900	2,235,397.500	
EURAZEO	2,748	65.600	180,268.800	
BANCO SABADELL	413,631	0.852	352,413.610	

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	93.800	627,428.200	
FRAPORT AG	3,149	69.220	217,973.780	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	92.700	907,625.700	
INDITEX	83,883	31.430	2,636,442.690	
JC DECAUX SA	6,058	22.960	139,091.680	
ANDRITZ AG	6,265	35.560	222,783.400	
MAPFRE SA	84,474	2.419	204,342.600	
ESSILORLUXOTTICA	21,761	139.350	3,032,395.350	
SNAM SPA	169,163	4.995	844,969.180	
CREDIT AGRICOLE SA	86,205	13.490	1,162,905.450	
ENAGAS	18,095	25.630	463,774.850	
WENDEL	2,220	125.600	278,832.000	
WIRECARD AG	8,963	138.900	1,244,960.700	
TENARIS SA	36,959	9.630	355,915.170	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.517	394,302.970	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.511	254,271.550	
ATLANTIA SPA	37,365	22.830	853,042.950	
ILIAD SA	2,102	134.700	283,139.400	
PROXIMUS	14,283	26.370	376,642.710	
SES FDR	28,847	11.050	318,759.350	
TERNA SPA	113,654	6.494	738,069.070	
BIOMERIEUX	3,248	93.000	302,064.000	
GRIFOLS SA	23,518	33.010	776,329.180	
FERROVIAL SA	38,666	29.870	1,154,953.420	
LANXESS AG	6,856	57.260	392,574.560	
NESTE OYJ	32,931	39.110	1,287,931.410	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	22.530	217,211.730	
RECORDATI SPA	6,859	40.350	276,760.650	
GALAPAGOS NV	3,426	239.600	820,869.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	39,752	8.960	356,177.920	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	281.400	1,172,875.200	
KONE OYJ	26,502	57.880	1,533,935.760	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	181.400	341,757.600	
ENGIE	139,272	16.135	2,247,153.720	
ALSTOM	15,712	48.600	763,603.200	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	41.280	150,011.520	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	12.290	154,141.180	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	12.865	692,137.000	
IPSEN SA	3,646	68.450	249,568.700	
DEUTSCHE WOHNEN	26,947	38.900	1,048,238.300	
ARKEMA SA	5,033	86.020	432,938.660	
LEGRAND SA	20,673	76.100	1,573,215.300	
UNILEVER NV	113,134	54.850	6,205,399.900	
ADP	2,313	168.700	390,203.100	
ORION OYJ	8,051	39.180	315,438.180	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	13.970	560,029.360	
SYMRISE AG	9,988	98.860	987,413.680	
SCOR SE	10,116	37.230	376,618.680	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	34.840	606,111.480	
PRYSMIAN SPA	21,452	23.770	509,914.040	
CAIXABANK	297,224	2.807	834,307.760	
BUREAU VERITAS SA	23,179	25.540	591,991.660	
GETLINK	37,646	16.660	627,182.360	
SUEZ SA	26,620	15.000	399,300.000	
AMADEUS IT GROUP SA	33,891	72.840	2,468,620.440	
BRENTAG AG	12,353	49.750	614,561.750	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	27.080	463,501.280	
EDENRED	19,188	49.450	948,846.600	
BANKIA SA	100,675	1.685	169,637.370	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.583	158,960.400	
KION GROUP AG	4,567	59.540	271,919.180	
VONOVIA SE	38,617	53.180	2,053,652.060	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	4.122	339,059.230	
KNORR-BREMSE AG	4,492	98.840	443,989.280	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	40.055	459,350.740	
FERRARI NV	8,934	159.750	1,427,206.500	
METRO AG	10,774	12.575	135,483.050	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	8.768	683,474.360	
AROUNDTOWN SA	71,783	8.780	630,254.740	
AIB GROUP PLC	41,352	2.398	99,162.090	
MONCLER SPA	14,353	38.100	546,849.300	
PROSUS NV	36,871	71.900	2,651,024.900	
WORLDLINE SA	7,758	73.950	573,704.100	
NN GROUP NV	21,720	36.110	784,309.200	
FINECOBANK SPA	45,048	10.920	491,924.160	
ZALANDO SE	9,964	47.470	472,991.080	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	79,084	12.262	969,728.000	
AENA SME SA	5,338	168.350	898,652.300	
CELLNEX TELECOM SAU	19,780	47.410	937,769.800	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	9,000	94.050	846,450.000	
ABN AMRO BANK NV	34,251	15.185	520,101.430	
EXOR NV	7,971	74.740	595,752.540	
ALTICE EUROPE NV	56,763	6.532	370,775.910	
COVESTRO AG	12,708	39.100	496,882.800	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	58,731	67.750	3,979,025.250	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	10.950	438,164.250	
AMUNDI SA	4,119	76.850	316,545.150	
ADYEN NV	818	883.600	722,784.800	
PIRELLI & C SPA	34,086	4.520	154,068.720	

	UNIPER SE	14,252	29.520	420,719.040	
	DELIVERY HERO SE	8,081	79.260	640,500.060	
ユーロ 小計		15,245,632		334,420,571.470 (39,782,671,182)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	19,100	114.300	2,183,130.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.200	2,984,800.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	17.520	1,819,627.200	
	CLP HOLDINGS LTD	121,000	82.500	9,982,500.000	
	PCCW LTD	331,000	4.790	1,585,490.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	55.250	2,734,875.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	94,440	269.600	25,461,024.000	
	MTR CORP	126,000	45.250	5,701,500.000	
	HANG SENG BANK LTD	57,700	163.900	9,457,030.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	37.200	4,294,740.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	57.000	5,785,500.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	776,755	15.220	11,822,211.100	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	157,000	57.200	8,980,400.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	24.550	1,804,425.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	275,000	27.900	7,672,500.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	10.380	1,401,300.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	21.000	1,060,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	10.440	5,055,737.040	
	SINO LAND CO	255,400	11.080	2,829,832.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	125,000	115.500	14,437,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,500	74.400	2,269,200.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	70.900	8,047,150.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	30.850	2,159,500.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	48.950	3,132,800.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.620	1,500,720.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	17.440	2,169,536.000	
	AIA GROUP LTD	935,627	80.650	75,458,317.550	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	11.940	3,450,660.000	
	SANDS CHINA LTD	199,200	40.450	8,057,640.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	25.300	2,636,260.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	42.400	4,059,800.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.850	1,805,500.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	101,900	23.350	2,379,365.000	

	WH GROUP LTD	742,500	8.220	6,103,350.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,832	70.850	14,795,747.200	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	198,332	51.850	10,283,514.200	
香港・ドル	小計	7,279,712		275,363,681.290 (3,890,888,817)	
合計		85,854,581		350,796,430,193 (350,796,430,193)	

(2) 株式以外の有価証券

令和2年2月17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	1,114,698.500	
		GOODMAN GROUP	132,051.000	2,170,918.440	
		GPT GROUP	158,232.000	987,367.680	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	1,083,785.220	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,584,410.360	
		STOCKLAND	194,018.000	975,910.540	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	673,403.070	
	オーストラリア・ドル	小計	1,589,005.000	8,590,493.810 (633,377,109)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	662,659.800	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	429,104.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	501,480.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	449,982.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	345,780.000	
	シンガポール・ドル	小計	990,506.000	2,389,005.800 (188,540,338)	
投資信託受益証券	合計		2,579,511	821,917,447 (821,917,447)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	865,290.940	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,646.000	1,512,444.780	
		AMERICAN TOWER CORP	34,213.000	8,767,081.250	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	1,127,933.740	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,491.000	2,387,017.230	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,770,735.210	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	958,491.180	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	31,583.000	5,241,830.510	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,605.000	2,052,057.500	
		DUKE REALTY TRUST	27,278.000	1,049,657.440	
		EQUINIX INC	6,522.000	4,230,495.300	

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	1,025,220.240	
	EQUITY RESIDENTIAL	27,869.000	2,409,553.740	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,075.000	1,645,162.750	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	9,261.000	1,068,997.230	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	763,380.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,162.000	1,498,444.220	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	932,011.560	
	INVITATION HOMES INC	42,384.000	1,379,599.200	
	IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	794,597.780	
	KIMCO REALTY	32,980.000	635,194.800	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	39,953.000	962,068.240	
	MID AMERICA	8,834.000	1,285,435.340	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	778,538.960	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	787,610.720	
	PROLOGIS INC	56,079.000	5,470,506.450	
	PUBLIC STORAGE	12,188.000	2,837,610.160	
	REALTY INCOME CORP	23,491.000	1,885,152.750	
	REGENCY CENTERS CORP	11,403.000	730,020.060	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,778.000	2,586,086.580	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,306.000	3,237,669.520	
	SL GREEN	7,097.000	674,498.880	
	SUN COMMUNITIES INC	7,418.000	1,246,149.820	
	UDR INC	22,345.000	1,124,400.400	
	VENTAS INC	29,505.000	1,762,923.750	
	VEREIT INC	82,604.000	828,518.120	
	VICI PROPERTIES INC	34,200.000	961,362.000	
	VORNADO REALTY TRUST	12,472.000	846,724.080	
	WELLTOWER INC	32,099.000	2,867,082.680	
	WEYERHAEUSER CO	57,621.000	1,766,659.860	
	WP CAREY INC	13,039.000	1,119,137.370	
アメリカ・ドル	小計	1,077,717.000	75,873,352.340 (8,330,894,087)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	410,396.080	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	556,084.590	
	SEGRO PLC	87,247.000	815,759.450	
イギリス・ポンド	小計	212,909.000	1,782,240.120 (255,216,785)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,819.000	459,600.820	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,676.000	385,867.080	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	230,867.040	

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	372,631.890	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	96,426.480	
カナダ・ドル 小計		52,777.000	1,545,393.310 (128,051,290)	
ユーロ	COVIVIO	4,265.000	472,988.500	
	GECINA SA	3,670.000	666,105.000	
	ICADE	2,234.000	234,346.600	
	KLEPIERRE	17,042.000	532,221.660	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,383,501.100	
ユーロ 小計		38,109.000	3,289,162.860 (391,278,814)	
香港・ドル	LINK REIT	157,900.000	12,426,730.000	
香港・ドル 小計		157,900.000	12,426,730.000 (175,589,695)	
投資証券 合計		1,539,412	9,281,030,671 (9,281,030,671)	
合計			10,102,948,118 (10,102,948,118)	

(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	608銘柄	66.18	-	-	70.24
	投資証券	41銘柄	-	-	2.25	
イギリス・ポンド	株式	93銘柄	5.35	-	-	5.56
	投資証券	3銘柄	-	-	0.07	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.11	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式	62銘柄	2.20	-	-	2.43
	投資信託受益証券	7銘柄	-	0.17	-	
カナダ・ドル	株式	85銘柄	3.51	-	-	3.64
	投資証券	5銘柄	-	-	0.03	
シンガポール・ドル	株式	20銘柄	0.37	-	-	0.43
	投資信託受益証券	5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.29	-	-	3.38
スウェーデン・クローナ	株式	32銘柄	0.94	-	-	0.97
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.66	-	-	0.67
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	0.20	-	-	0.21
ユーロ	株式	236銘柄	10.74	-	-	11.13
	投資証券	5銘柄	-	-	0.11	
香港・ドル	株式	36銘柄	1.05	-	-	1.13
	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和2年2月28日現在

資産総額	159,673,980,729円
負債総額	1,359,644,628円
純資産総額(-)	158,314,336,101円
発行済数量	42,583,836,484口
1口当たり純資産額(/)	3.7177円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年2月28日現在

資産総額	331,082,247,910円
負債総額	4,842,088,148円
純資産総額(-)	326,240,159,762円
発行済数量	87,577,580,483口
1口当たり純資産額(/)	3.7252円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2020年2月28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2月28日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年2月28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	1,278,461,917,901
追加型株式投資信託	859	13,545,054,116,096
単位型公社債投資信託	38	103,552,799,629
単位型株式投資信託	180	1,323,787,336,372
合計	1,103	16,250,856,169,998

3【委託会社等の経理状況】

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

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

表示方法の変更

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

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

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 関係会社に対する事項

(千円)

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

2. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(2018年3月31日現在)

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第33期（2018年3月31日現在）

（千円）

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

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

第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第33期（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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

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

第34期(自2018年4月1日至2019年3月31日)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(注) 特別損失に計上しております。

(5) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

(2) 退職給付費用

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

4. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

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

(2) 損益計算書項目

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

(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

該当はありません。

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第33期(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

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

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

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

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

重要な会計方針

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

注記事項

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

(金融商品関係)

第35期中間会計期間末(2019年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

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

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

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

(有価証券関係)

第35期中間会計期間末

(2019年9月30日現在)

1. 子会社株式

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

2. その他有価証券

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2019年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212,500千円

取得原価 144,212,500千円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224,837千円

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

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451,657千円

うち現金・預金 11,605,537千円

うち金銭の信託 11,792,364千円

b. 負債の額 負債合計 9,256,209千円

うち未払手数料及び未払費用 4,539,592千円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030,000千円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030,000千円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

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

(2) 損益計算書項目

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

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

第35期中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

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

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

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) 通常の見積り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。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社中国銀行	15,149	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。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
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

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）・運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2019年5月30日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和2年3月27日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>の平成31年2月16日から令和2年2月17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、DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>の令和2年2月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

アセットマネジメントOne株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

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

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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

（注2）XBRLデータは中間監査の対象には含まれておりません。