

【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8月11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】	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>
【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】	3,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>

（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（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】

3,000億円を上限とします。

（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。

「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、公表されません。

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）

- ・計算日翌日付の日本経済新聞朝刊の「オープン基準価格」の欄をご参照ください。

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2020年8月12日から2021年2月10日まで

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。

ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、フランクフルトの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれかの休業日に該当する日(以下「海外休業日」という場合があります。)には、お申込みの受付は行いません。

(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

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)

(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

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)

(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】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付は行いません。

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。

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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

当ファンドの信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 世界の6資産(国内外の株式・債券・リート)に分散投資を行うことにより、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。



- 各資産への投資は各資産の市場を代表する指数に連動する投資成果をめざすファンド(マザーファンド)を通じて行います。

投資対象のマザーファンド	ベンチマーク
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	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)
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジなし)
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)

※リート(REIT)はReal Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。

※パッシブ・ファンドとは市場(インデックス)そのものに連動する投資成果をめざすファンドです。インデックス・ファンドとも呼ばれます。

※当ファンドはファミリーファンド方式により運用します。また、上記マザーファンドには運用管理費用(信託報酬)はかかりません。

2 基本資産配分比率は、各資産のリターン、リスク等を推計し、証券投資理論に基づいて決定します。なお、基本資産配分比率は原則として年1回見直します。

●基本資産配分比率は、イボットソン・アソシエイツ・ジャパンの投資助言を受けます。

※基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。

※分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。また、為替リスクの観点から外貨建資産への基本配分比率は50%以下にしております。*

※時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。

※ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

* 2020年5月末時点

3 購入時手数料、換金手数料がかからないノーロードファンドです。運用管理費用(信託報酬)は信託財産の純資産総額に対して年率0.55%(税抜0.50%)と、低水準に設定しました。

●換金価額は、基準価額から信託財産留保額(換金申込日の翌営業日の基準価額の0.3%)を差し引いた価額となります。

4 「隔月分配型」(分配金受取専用)のファンドです。

●決算ごとに分配することを重視します。隔月(奇数月)に利子・配当等収益を中心とした分配と、さらに5月・11月に売買益(評価益を含みます。)等を加えた分配をめざします。

※決算は原則として年6回(毎年1月、3月、5月、7月、9月、11月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)です。

●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。

収益分配金に関する留意事項

◆投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。なお、分配金の有無や金額は確定したものではありません。

投資信託から分配金が支払われるイメージ



◆分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

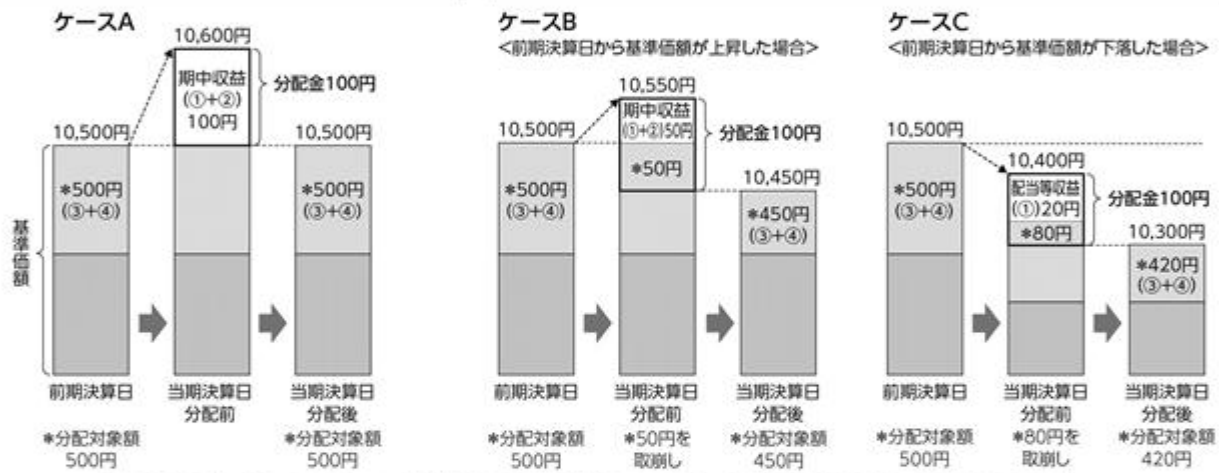
分配金額と基準価額の関係（イメージ）

分配金は、分配方針に基づき、以下の分配対象額から支払われます。

①配当等収益（経費控除後）、②有価証券売買益・評価益（経費控除後）、③分配準備積立金、④収益調整金

計算期間中に発生した収益の中から支払われる場合

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合



上記のそれぞれのケースにおいて、前期決算日から当期決算日まで保有した場合の損益を見ると、次の通りとなります。

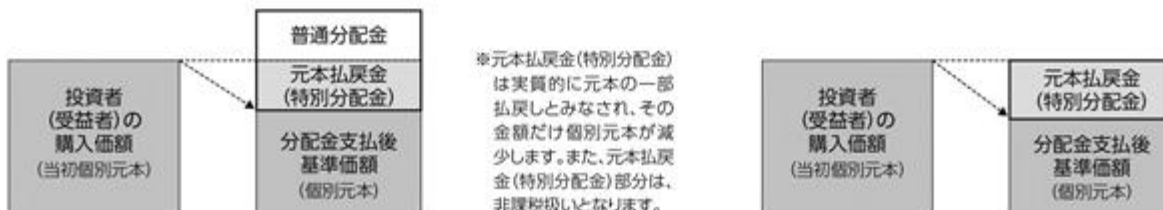
ケースA：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差0円=100円
 ケースB：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲50円=50円
 ケースC：分配金受取額100円+当期決算日と前期決算日との基準価額の差▲200円=▲100円

★A、B、Cのケースにおいては、分配金受取額はすべて同額ですが、基準価額の増減により、投資信託の損益状況はそれぞれ異なった結果となっています。このように、投資信託の収益については、分配金だけに注目するのではなく、「分配金の受取額」と「投資信託の基準価額の増減額」の合計額でご判断ください。
 ※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではないのでご留意ください。

◆投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部ないし全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普通分配金：個別元本(投資者(受益者)のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金(特別分配金)：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者(受益者)の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

5 実質組入外貨建資産の為替リスクに対しては、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	その他資産 () 資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

追加型投信	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。
内外	目論見書または投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を含む)		
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)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信) 資産配分変更 型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

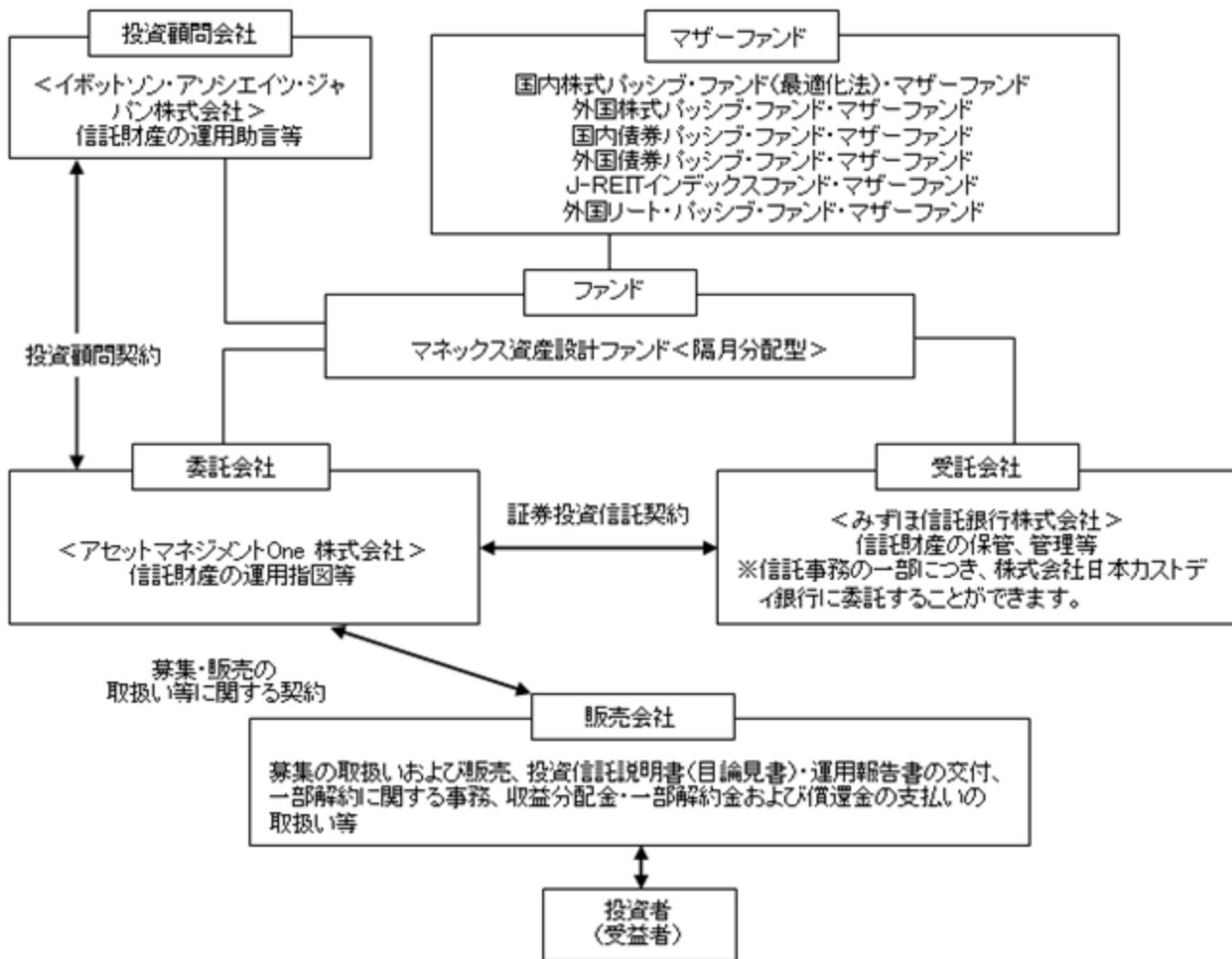
<p>その他資産 （投資信託証券 （資産複合（株式、 債券、不動産投信） 資産配分変更型））</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（株式、債券、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。</p> <p>（注）商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。</p>
<p>年6回（隔月）</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>グローバル （日本を含む）</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。</p>
<p>ファミリー ファンド</p>	<p>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。</p>
<p>為替ヘッジなし</p>	<p>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。</p>

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/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2007年1月26日	信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2016年4月13日	外国リートの投資対象マザーファンドを「グローバルリート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」から「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」へ変更
2018年10月12日	信託報酬率(税抜)を「年率0.95%」から「年率0.50%」に引き下げ

(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。

- ・「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・一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

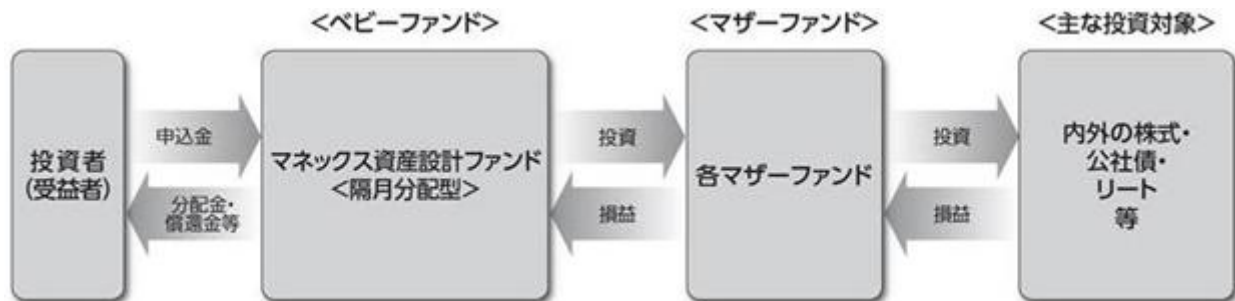
- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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5月29日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2020年5月29日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

<投資対象>

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド受益証券、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券、J-REITインデックスファンド・マザーファンド受益証券および外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。

<投資態度>

主として国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンドおよび外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンドの各受益証券への投資を通じ、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券(不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。)の計6資産への分散投資を行います。

基本資産配分比率は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

リート(REIT)とは

- ・リート(REIT)とは、不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券をいいます。(以下同じ。)
- ・REIT(リート)とは、Real Estate Investment Trustの略であり、不動産を中心に運用を行っている投資法人あるいは投資信託を一般的に総称するものです。なお、主に豪州市場に上場するリートについては、LPT(Listed Property Trust)と呼ばれる場合があります。
- ・リート(REIT)は、不特定多数の投資家から集めた資金などで不動産等を購入し、当該不動産をテナントに賃貸し、主にそのテナントから得る賃料から収入を得ます。多くのリート(REIT)は、一定の適格要件を満たすことにより、法人税の課税が免除されています。このため、リート(REIT)は、不動産の維持・管理費用や金利などを支払った後に残った収益について、そのほとんどをリート(REIT)に投資する投資家が、配当金(もしくは分配金)として享受する仕組みになっています。

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

<運用プロセス>

- ・基本資産配分比率決定のプロセスは、期待リターン(期待収益率)、リスク(標準偏差)、相関係数を推計し、代表的な証券投資理論の1つである平均分散アプローチにより効率的フロンティアを描き、一定のリスク水準から導きます。
- ・分散投資の観点から各資産の基本配分比率は一定の範囲内とします。
- ・決定した基本資産配分比率に基づき、6つのマザーファンドへ投資を行いポートフォリオを構築します。
- ・時価変動による基本資産配分比率からの乖離分については、原則としてリバランスを行いません。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分比率を見直すこととします。

(2)【投資対象】

1.投資の対象とする資産(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。

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

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23条、第24条および第25条に定めるものに限りません。)

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

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、主として次に掲げる1)から6)までのアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された親投資信託の受益証券ならびに7)から28)までの有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- 1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- 2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- 6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 7) 株券または新株引受権証券
- 8) 国債証券
- 9) 地方債証券
- 10) 特別の法律により法人の発行する債券
- 11) 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。)
- 12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- 13) 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。)
- 14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- 15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- 16) コマーシャル・ペーパー
- 17) 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
- 18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)から17)までの証券または証書の性質を有するもの
- 19) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- 20) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 21) 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。)
- 22) 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せん。)
- 23) 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。)
- 24) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 25) 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せん。)
- 26) 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。)
- 27) 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

28)外国の者に対する権利で上記27)の有価証券の性質を有するもの

なお、7)の証券または証書、18)ならびに23)の証券または証書のうち7)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、8)から12)までの証券および18)ならびに23)の証券または証書のうち8)から12)までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、19)の証券および20)の証券を以下「投資信託証券」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上記5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、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。(約款第16条第3項)

(参考) 当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
-------	-----------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）^{（注）}に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>（注） 東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（TOPIX）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（TOPIX）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数（TOPIX）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（TOPIX）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。

<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底的なリスク管理を行います。 3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。
<p>運用プロセス</p>	<p>流動性基準による対象銘柄群設定</p> <p>マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>最適化法によるポートフォリオの構築</p> <p>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。</p> <p>インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、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がたい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	---

ファンド名	外国株式パッシブ・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	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) ^(注) に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

(注)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。

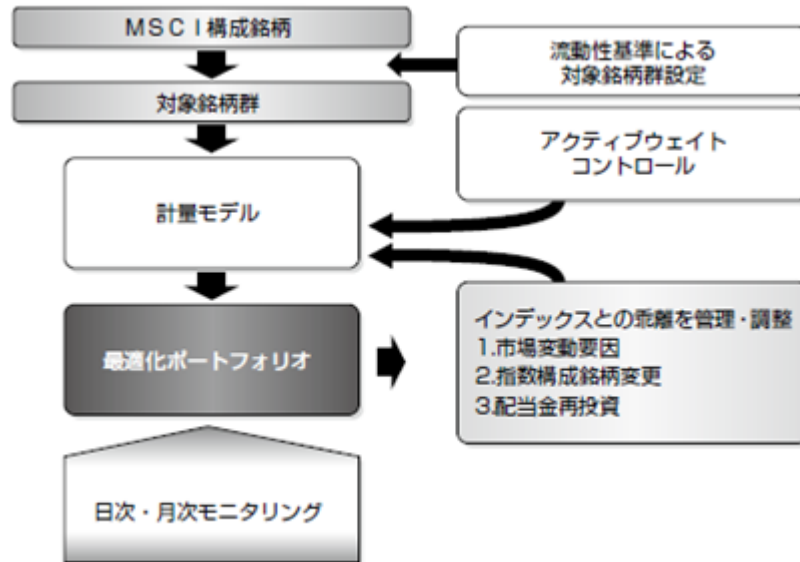
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝す

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。

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。

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。

運用プロセス



流動性基準による対象銘柄群設定

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

最適化法によるポートフォリオの構築

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

インデックスとの乖離を管理

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

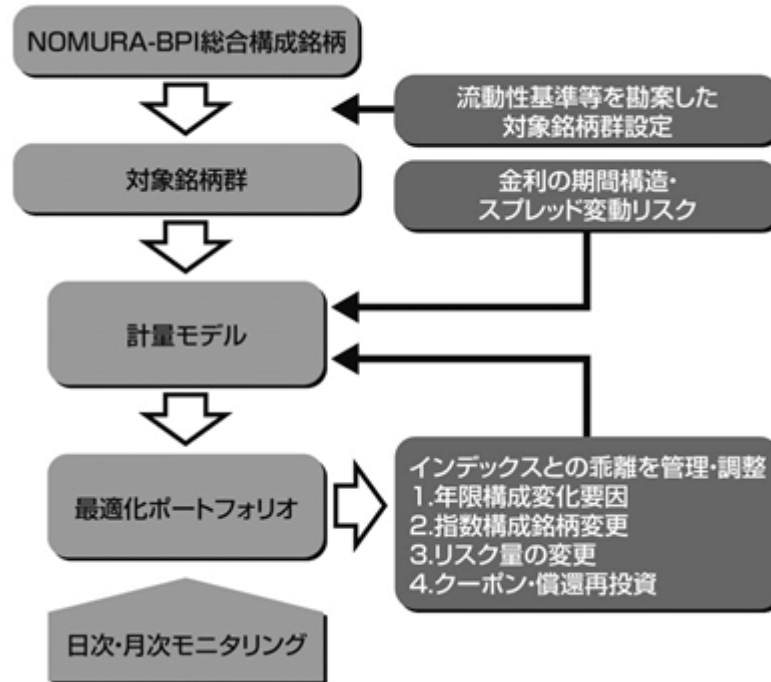
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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

<p>主な投資制限</p>	<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>
---------------	---

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、NOMURA - B P I 総合^(注)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 10px 0;"> <p>(注) NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p> </div>
<p>主な投資対象</p>	<p>わが国の公社債を主要投資対象とします。</p>
<p>投資態度</p>	<p>主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p>

運用プロセス



流動性基準等による対象銘柄群設定

NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

最適化法によるポートフォリオの構築

1. 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因
 2. 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因
- 1.、2.が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。

インデックスとの乖離を管理

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

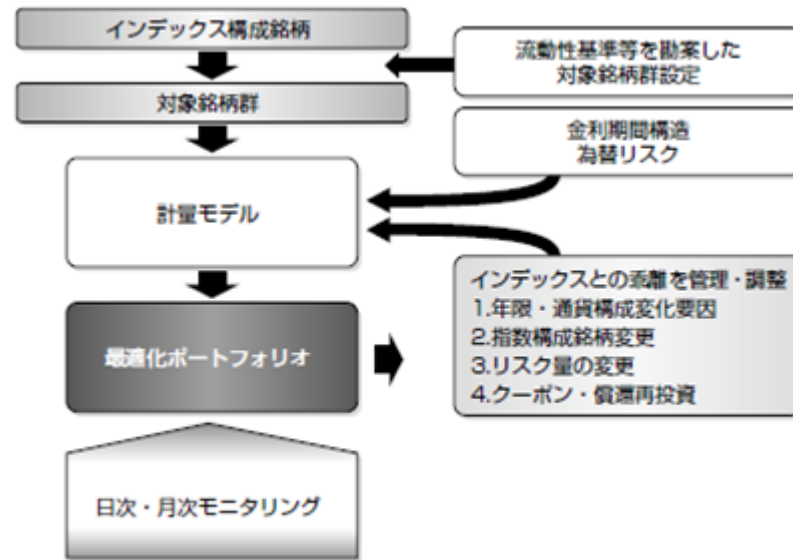
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーボン、償還再投資

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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がい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	---

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）^(注)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <div data-bbox="347 1413 1385 1805" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>(注) FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div> <p>外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>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>

運用プロセス



流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

最適化法によるポートフォリオの構築

金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

インデックスとの乖離を管理

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

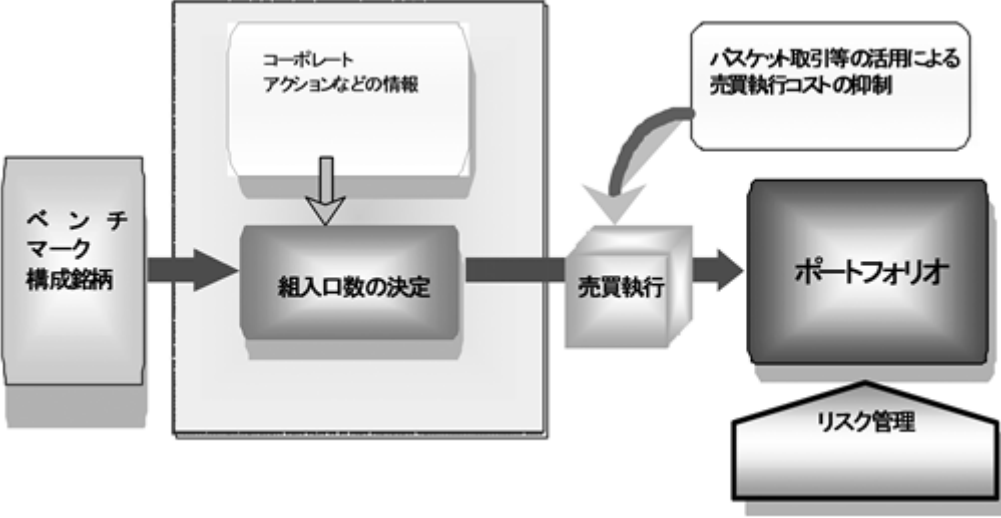
インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーボン・償還再投資

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</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>
--------	---

ファンド名	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
-------	--------------------------

基本方針	<p>この投資信託は、東証REIT指数（配当込み）^(注)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(注) 東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「株東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p>
主な投資対象	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。</p>

<p>投資態度</p>	<p>東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。</p> <p>不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。</p> <p>新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前を取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。</p> <p>配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。</p>  <pre> graph LR A[ベンチマーク構成銘柄] --> B[組入口数の決定] C[コーポレートアクションなどの情報] --> B B --> D[売買執行] E[バケット取引等の活用による 売買執行コストの抑制] --> D D --> F[ポートフォリオ] G[リスク管理] --- F </pre>

主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	--

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) ^(注) に連動する投資成果をめざして運用を行います。
------	--

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

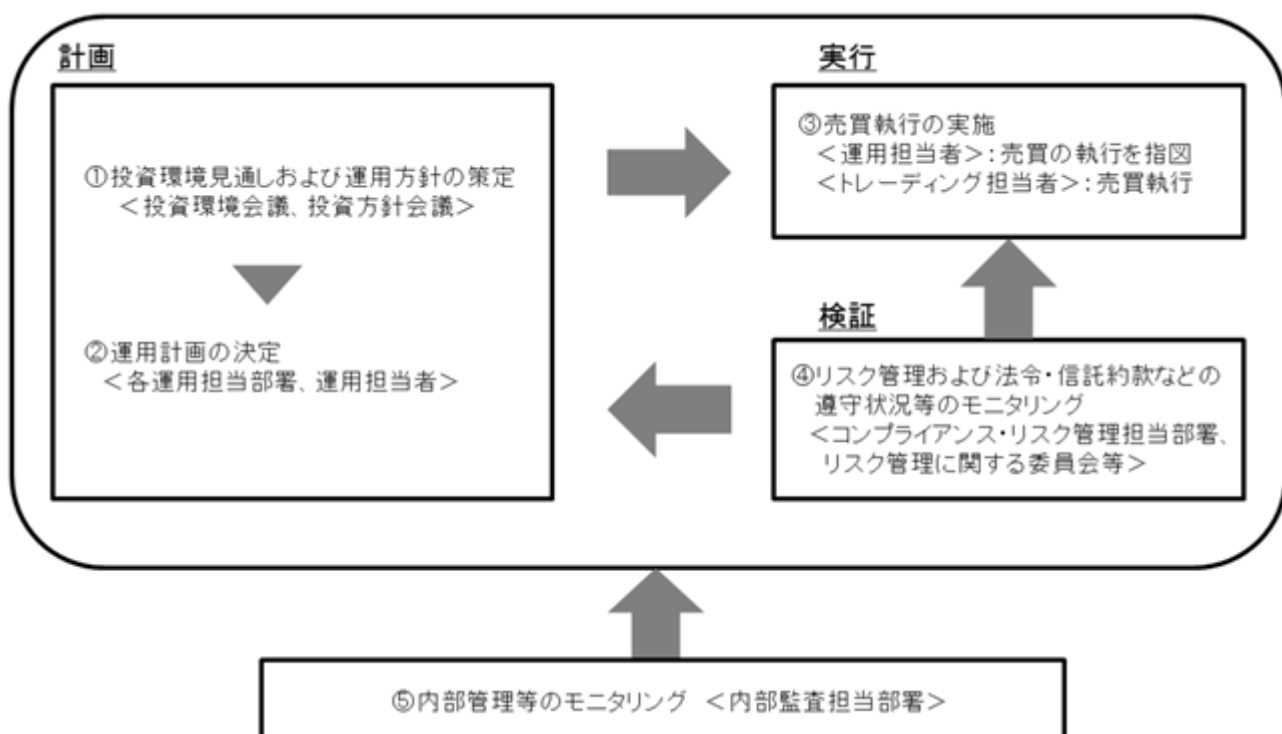
	<p>はS & P 先進国 REITインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。</p> <p>海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。)とします。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
<p>運用プロセス</p>	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] D --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>

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

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。

定期的に行わ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5月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として奇数月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1)分配対象額の範囲

経費控除後の利子、配当等収入および売買益（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

原則として、利子配当等収益を中心に安定した収益分配を継続的に行うことをめざします。また、毎年5月および11月の決算時には、利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。分配金額については、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。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

留保益の運用については、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) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、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た後、その残金を受益者に分配することができます。

なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、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、繰越欠損金のある時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. 上記1)および2)におけるみなし配当等収益とは、各マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、各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各マザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、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てします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

(5) 【投資制限】

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

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。(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、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

同一銘柄の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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第19条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 2) 上記1)の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図および範囲(約款第22条)

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

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- 1) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
- 2) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、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行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

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

3)スワップ取引の評価は、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行うものとします。

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

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25条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第25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。

有価証券の貸付の指図および範囲（約款第26条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1. 2.の範囲内で貸付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.公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

公社債の空売りの指図および範囲（約款第27条）

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

2)上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

公社債の借入れ（約款第28条）

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

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第29条)

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

外国為替予約の指図および範囲(約款第30条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産に係る売予約とマザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係る為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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。また、マザーファンドの信託財産に係る為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第37条)

- 1)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に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

委託会社は、同一の法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行う全ての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式にかかる議決権(株主総会において決

議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含む。)の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図してはなりません。

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

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

各資産(国内債券、外国債券、国内株式、外国株式、国内リートおよび外国リート)への資産配分は、基本資産配分比率に準じ、一定範囲内の変動に抑えます。

この資産配分が当ファンドの収益の源泉となる場合もありますが、収益率の悪い資産への配分が大きい場合、複数または全ての資産価値が下落する場合には、各資産の投資成果が各資産のベンチマークと同等あるいはそれ以上のものであったとしても、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。

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。

当ファンドは、実質的に株式に投資をしますので、株式市場の変動により基準価額が上下します。

金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

金利リスクとは、金利変動により債券およびリートの価格が変動するリスクをいいます。金利が上昇した場合には、債券およびリートの価格は下落し、当ファンドの基準価額が下がる場合があります。

リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

当ファンドは、実質的にリートに投資をしますので、これらの影響を受け、基準価額が上下します。

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。

当ファンドは、実質組入外貨建資産について原則として対円で為替ヘッジを行わないため為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には、当ファンドの基準価額が下がる要因となります。

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。

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

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およぼす場合があります。

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

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

当ファンドは、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合、受益者のため有利と認める場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中で信託を終了(繰上償還)する場合があります。

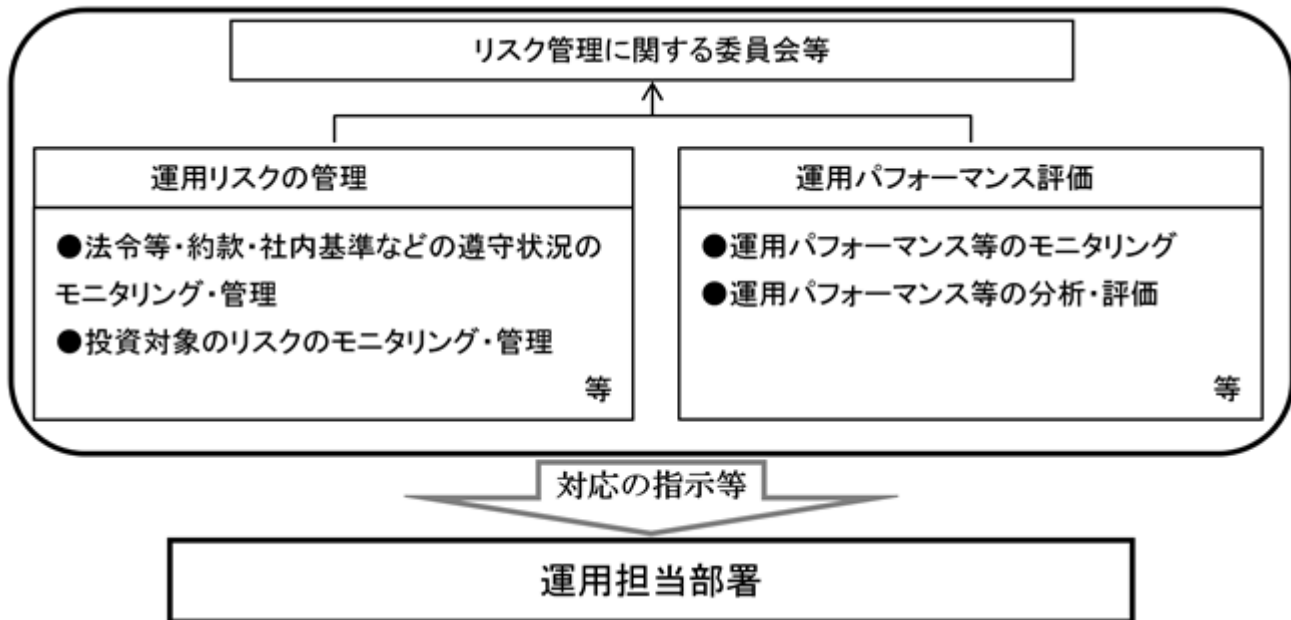
注意事項

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

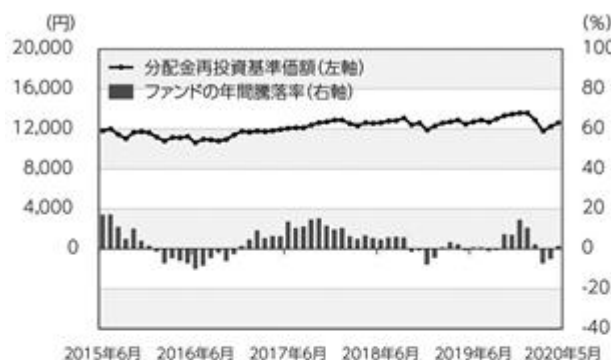
- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・リスク管理に関する委員会等：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、リスク管理に関する委員会等は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



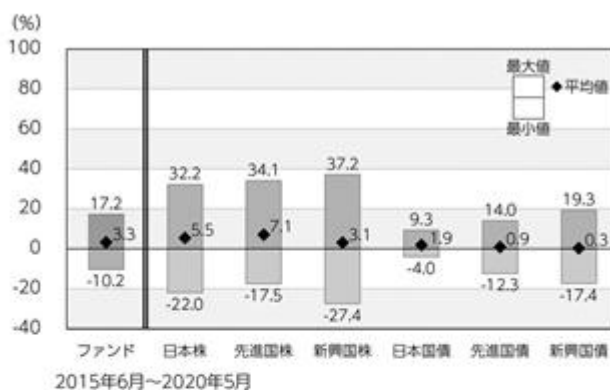
リスク管理体制は2020年5月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(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0.55%（税抜0.50%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.26%	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0.20%	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0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン）に対する投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

解約時に、解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額とします。

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て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期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。

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

税法が改正された場合等には、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。

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2020年5月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	376,490,831	98.28
内 日本	376,490,831	98.28
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,593,667	1.72
純資産総額	383,084,498	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	218,622,795,190	92.21
内 日本	218,622,795,190	92.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	18,471,224,167	7.79
純資産総額	237,094,019,357	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	5,331,780,000	2.25
内 日本	5,331,780,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	320,796,394,111	94.05
内 アメリカ	219,634,858,689	64.39
内 イギリス	15,715,426,148	4.61
内 スイス	12,441,404,119	3.65
内 カナダ	11,350,660,898	3.33
内 フランス	11,111,119,213	3.26
内 ドイツ	9,806,581,695	2.88
内 オーストラリア	6,806,643,700	2.00
内 オランダ	5,965,802,031	1.75
内 アイルランド	5,856,580,848	1.72
内 スウェーデン	2,988,762,803	0.88
内 スペイン	2,773,903,086	0.81
内 香港	2,711,551,159	0.79
内 デンマーク	2,562,117,795	0.75
内 イタリア	1,934,441,115	0.57
内 フィンランド	1,388,989,589	0.41
内 シンガポール	1,144,146,680	0.34

内	バミューダ	1,098,932,486	0.32
内	ジャージー	1,031,091,538	0.30
内	ベルギー	961,292,662	0.28
内	イスラエル	715,142,117	0.21
内	ケイマン諸島	636,505,863	0.19
内	ノルウェー	636,183,786	0.19
内	ニュージーランド	350,598,697	0.10
内	ルクセンブルグ	269,637,163	0.08
内	オランダ領キュラソー	234,594,901	0.07
内	オーストリア	202,182,832	0.06
内	ポルトガル	189,110,741	0.06
内	リベリア	78,247,161	0.02
内	パナマ	76,507,328	0.02
内	マン島	53,580,217	0.02
内	パプアニューギニア	48,430,942	0.01
内	イギリス領バージン諸島	21,366,109	0.01
投資信託受益証券		625,963,587	0.18
内	オーストラリア	458,001,395	0.13
内	シンガポール	167,962,192	0.05
投資証券		7,803,629,654	2.29
内	アメリカ	7,202,768,985	2.11
内	イギリス	179,285,529	0.05
内	香港	136,376,775	0.04
内	フランス	134,273,832	0.04
内	オランダ	78,497,139	0.02
内	カナダ	72,427,394	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,862,826,933	3.48
純資産総額		341,088,814,285	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	11,744,374,381	3.44
内 アメリカ	8,575,248,675	2.51
内 ドイツ	1,911,736,292	0.56
内 イギリス	593,904,038	0.17
内 カナダ	402,344,376	0.12
内 オーストラリア	261,141,000	0.08

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	184,652,392,600	80.91
内 日本	184,652,392,600	80.91
地方債証券	16,818,713,000	7.37
内 日本	16,818,713,000	7.37
特殊債券	15,699,575,052	6.88
内 日本	15,699,575,052	6.88
社債券	9,586,376,810	4.20
内 日本	9,183,508,810	4.02
内 フランス	402,868,000	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,471,763,691	0.64
純資産総額	228,228,821,153	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	119,509,344,826	97.25
内 アメリカ	55,317,169,368	45.01
内 フランス	11,983,337,327	9.75
内 イタリア	11,072,420,397	9.01
内 ドイツ	8,663,811,501	7.05
内 イギリス	7,914,367,031	6.44
内 スペイン	7,033,534,132	5.72
内 ベルギー	3,020,745,374	2.46
内 オーストラリア	2,324,020,907	1.89
内 オランダ	2,278,620,459	1.85
内 カナダ	2,168,936,856	1.76
内 オーストリア	2,014,002,302	1.64
内 アイルランド	1,038,849,277	0.85
内 メキシコ	791,265,473	0.64
内 フィンランド	682,758,744	0.56
内 ポーランド	672,528,566	0.55
内 デンマーク	575,425,108	0.47
内 マレーシア	566,136,087	0.46
内 シンガポール	494,440,195	0.40
内 イスラエル	380,150,820	0.31
内 スウェーデン	259,501,942	0.21
内 ノルウェー	257,322,960	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,378,499,190	2.75
純資産総額	122,887,844,016	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	37,594,873,120	95.08
内 日本	37,594,873,120	95.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,945,907,175	4.92
純資産総額	39,540,780,295	100.00

その他資産の投資状況

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	891,324,000	2.25
内 日本	891,324,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	3,719,487,849	10.63
内 オーストラリア	2,250,972,658	6.44
内 シンガポール	1,468,515,191	4.20
投資証券	30,887,124,968	88.31
内 アメリカ	26,038,187,735	74.45
内 イギリス	1,732,463,487	4.95
内 カナダ	633,529,813	1.81
内 香港	586,249,389	1.68
内 フランス	540,472,784	1.55
内 ベルギー	422,103,931	1.21
内 オランダ	319,165,158	0.91
内 スペイン	186,512,647	0.53
内 ニューージーランド	151,000,588	0.43
内 ドイツ	98,140,366	0.28
内 ガーンジー	86,547,239	0.25
内 アイルランド	47,467,557	0.14
内 イスラエル	24,386,165	0.07
内 マン島	8,711,705	0.02
内 韓国	6,636,287	0.02
内 イタリア	5,550,117	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	368,156,765	1.05
純資産総額	34,974,769,582	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	28,179,401	3.4597 97,495,091	3.6243 102,130,603	- -	26.66
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	75,324,315	1.3116 98,802,903	1.3112 98,765,241	- -	25.78
3	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	38,326,565	2.3739 90,987,265	2.5068 96,077,033	- -	25.08
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	17,884,013	1.9036 34,045,795	1.9338 34,584,104	- -	9.03
5	J・REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	11,809,922	1.8837 22,247,531	1.9122 22,582,932	- -	5.90
6	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	20,914,119	1.0278 21,497,622	1.0687 22,350,918	- -	5.83

（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5月29日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	98.28
合計	98.28

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機 器	1,110,400	7,649.68 8,494,210,130	6,755.00 7,500,752,000	- -	3.16
2	ソニー 日本	株式 電気機器	623,400	7,605.09 4,741,013,784	6,874.00 4,285,251,600	- -	1.81
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	90,200	37,843.85 3,413,515,536	44,350.00 4,000,370,000	- -	1.69

4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	774,900	4,907.02 3,802,456,874	4,832.00 3,744,316,800	- -	1.58
5	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	828,000	4,318.95 3,576,093,800	4,191.00 3,470,148,000	- -	1.46
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,305,400	2,799.22 3,654,102,167	2,444.00 3,190,397,600	- -	1.35
7	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	6,714,500	553.41 3,715,930,955	444.20 2,982,580,900	- -	1.26
8	第一三共 日本	株式 医薬品	284,800	8,033.06 2,287,815,616	10,085.00 2,872,208,000	- -	1.21
9	任天堂 日本	株式 その他製品	61,000	40,865.11 2,492,771,773	43,540.00 2,655,940,000	- -	1.12
10	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	681,300	4,228.99 2,881,214,604	3,710.00 2,527,623,000	- -	1.07
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	727,800	3,365.43 2,449,366,244	3,136.00 2,282,380,800	- -	0.96
12	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	783,400	2,781.84 2,179,300,365	2,784.00 2,180,985,600	- -	0.92
13	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	678,800	3,760.62 2,552,710,841	3,119.00 2,117,177,200	- -	0.89
14	信越化学工業 日本	株式 化学	167,400	13,196.29 2,209,059,117	12,620.00 2,112,588,000	- -	0.89
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	698,300	3,155.15 2,203,247,410	2,951.50 2,061,032,450	- -	0.87
16	花王 日本	株式 化学	238,300	8,670.53 2,066,187,984	8,647.00 2,060,580,100	- -	0.87
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	126,800	15,892.64 2,015,187,767	15,850.00 2,009,780,000	- -	0.85
18	HOYA 日本	株式 精密機器	198,700	10,028.12 1,992,588,072	10,110.00 2,008,857,000	- -	0.85
19	ファナック 日本	株式 電気機器	94,600	19,914.26 1,883,889,692	19,215.00 1,817,739,000	- -	0.77
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	13,336,100	158.35 2,111,876,238	134.50 1,793,705,450	- -	0.76
21	村田製作所 日本	株式 電気機器	292,400	6,443.75 1,884,154,960	6,015.00 1,758,786,000	- -	0.74
22	三菱商事 日本	株式 卸売業	687,800	2,816.14 1,936,947,656	2,515.00 1,729,817,000	- -	0.73
23	SMC 日本	株式 機械	31,200	50,129.01 1,564,025,246	54,370.00 1,696,344,000	- -	0.72

24	日立製作所 日本	株式 電気機器	478,200	4,074.41 1,948,385,955	3,455.00 1,652,181,000	- -	0.70
25	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	862,800	1,935.01 1,669,534,673	1,914.50 1,651,830,600	- -	0.70
26	中外製薬 日本	株式 医薬品	103,800	12,386.29 1,285,697,459	15,890.00 1,649,382,000	- -	0.70
27	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	347,100	6,014.09 2,087,492,170	4,668.00 1,620,262,800	- -	0.68
28	日本電産 日本	株式 電気機器	239,600	7,137.36 1,710,113,464	6,622.00 1,586,631,200	- -	0.67
29	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	685,600	2,606.54 1,787,046,264	2,310.00 1,583,736,000	- -	0.67
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	101,100	14,540.17 1,470,011,956	15,615.00 1,578,676,500	- -	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年5月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	92.21
合計	92.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年5月29日現在

業種	国内 / 外国	投資比率 (%)
電気機器	国内	13.40
情報・通信業		8.79
輸送用機器		6.72
化学		6.71
医薬品		6.59
サービス業		4.96
機械		4.71
銀行業		4.69
小売業		4.55
卸売業		4.28
陸運業		4.00
食料品		3.68
精密機器		2.42
建設業		2.41
その他製品		2.20
不動産業		1.94
保険業		1.90
電気・ガス業		1.47
その他金融業		1.05
ガラス・土石製品		0.73
証券、商品先物取引業		0.71
非鉄金属		0.64
ゴム製品		0.59
鉄鋼		0.53
金属製品		0.50
繊維製品		0.48
石油・石炭製品		0.41
空運業		0.34
パルプ・紙		0.22
鉱業		0.20
倉庫・運輸関連業		0.17
海運業	0.13	
水産・農林業	0.09	
合計		92.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	365,738	34,241.60 12,523,455,034	34,221.42 12,516,074,622	- -	3.67

2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	596,511	19,672.86 11,735,081,690	19,505.94 11,635,508,968	- -	3.41
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	34,687	228,630.12 7,930,493,214	258,190.28 8,955,846,346	- -	2.63
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	198,237	22,506.64 4,461,649,521	24,243.71 4,806,001,092	- -	1.41
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	25,221	159,756.86 4,029,227,959	152,340.97 3,842,191,778	- -	1.13
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	24,919	159,388.78 3,971,809,033	152,503.34 3,800,230,908	- -	1.11
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	216,556	15,971.49 3,458,724,004	15,803.68 3,422,382,613	- -	1.00
8	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	140,942	22,105.58 3,115,605,511	20,888.77 2,944,106,120	- -	0.86
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	244,715	11,918.92 2,916,739,858	11,468.71 2,806,567,031	- -	0.82
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	257,738	14,252.11 3,673,310,949	10,737.94 2,767,576,674	- -	0.81
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	204,950	13,435.22 2,753,549,749	12,479.93 2,557,762,022	- -	0.75
12	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	77,977	31,534.20 2,458,942,525	32,685.89 2,548,747,964	- -	0.75
13	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	73,917	35,694.91 2,638,461,294	32,506.31 2,402,769,581	- -	0.70

14	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	358,015	7,113.81 2,546,851,221	6,634.60 2,375,286,677	- -	0.70
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	89,758	25,792.01 2,315,039,897	26,359.90 2,366,012,281	- -	0.69
16	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	57,829	37,642.31 2,176,817,633	38,056.19 2,200,751,989	- -	0.65
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	107,928	23,924.25 2,582,097,511	19,903.80 2,148,177,650	- -	0.63
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	339,364	6,253.49 2,122,209,392	5,991.57 2,033,323,704	- -	0.60
19	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	600,323	4,015.86 2,410,813,370	3,339.88 2,005,007,861	- -	0.59
20	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	702,316	3,598.59 2,527,348,324	2,673.19 1,877,428,181	- -	0.55
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	455,333	3,893.48 1,772,830,731	4,105.49 1,869,367,536	- -	0.55
22	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	148,438	14,558.59 2,161,049,197	12,554.12 1,863,509,577	- -	0.55
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	209,451	8,835.06 1,850,513,514	8,499.17 1,780,159,907	- -	0.52
24	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	47,864	30,912.93 1,479,616,944	36,504.28 1,747,241,068	- -	0.51
25	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	348,773	4,978.02 1,736,201,401	4,902.83 1,709,974,849	- -	0.50
26	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	334,645	6,277.45 2,100,719,062	5,063.58 1,694,504,305	- -	0.50
27	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	347,986	6,269.75 2,181,786,142	4,843.15 1,685,348,813	- -	0.49
28	NOVARTIS AG-REG SHS スイス	株式 医薬品	176,770	10,475.80 1,851,808,514	9,298.53 1,643,702,491	- -	0.48
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	114,623	15,576.63 1,785,440,964	14,225.14 1,630,528,646	- -	0.48
30	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	39,896	40,169.44 1,602,600,037	40,843.11 1,629,477,111	- -	0.48

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年5月29日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.05
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.29
合計	96.52

（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5月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	6.53
医薬品		5.75
銀行		5.56
情報技術サービス		4.61
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.89
コンピュータ・周辺機器		3.88
半導体・半導体製造装置		3.59
石油・ガス・消耗燃料		3.44
インターネット販売・通信販売		3.28
保険		3.08
ヘルスケア機器・用品		3.00
資本市場		2.94
バイオテクノロジー		2.15
化学		2.14
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.13
電力		2.07
食品		1.97
各種電気通信サービス		1.85
飲料		1.81
専門小売り		1.76
航空宇宙・防衛		1.61
機械		1.55
食品・生活必需品小売り		1.52
ホテル・レストラン・レジャー		1.49
娯楽		1.43
家庭用品		1.42
繊維・アパレル・贅沢品		1.39
金属・鉱業		1.35
メディア		1.13
コングロマリット		1.12
総合公益事業		1.04
陸運・鉄道		1.02
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.93
各種金融サービス		0.86
自動車		0.82
タバコ		0.80
専門サービス		0.78
通信機器		0.77

電気設備	0.70
パーソナル用品	0.68
電子装置・機器・部品	0.52
複合小売り	0.50
航空貨物・物流サービス	0.49
建設関連製品	0.46
不動産管理・開発	0.45
商業サービス・用品	0.43
消費者金融	0.35
家庭用耐久財	0.34
無線通信サービス	0.29
建設・土木	0.29
商社・流通業	0.28
容器・包装	0.26
建設資材	0.24
自動車部品	0.24
ガス	0.18
運送インフラ	0.17
エネルギー設備・サービス	0.16
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
水道	0.12
紙製品・林産品	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
旅客航空輸送業	0.06
販売	0.05
海運業	0.05
レジャー用品	0.04
合計	94.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,550,000,000	101.70 2,593,360,500	101.53 2,589,066,000	0.1 2028/3/20	1.13
2	325回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,300,000,000	102.42 2,355,775,000	102.23 2,351,313,000	0.8 2022/9/20	1.03
3	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,200,000,000	103.03 2,266,820,000	102.83 2,262,260,000	0.4 2025/9/20	0.99
4	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,210,000,000	101.92 2,252,601,300	101.49 2,242,973,200	0.1 2027/6/20	0.98
5	129回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,120,000,000	100.39 2,128,437,600	100.33 2,127,186,800	0.1 2021/9/20	0.93

6	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,080,000,000	101.55 2,112,366,200	101.37 2,108,537,600	0.1 2026/6/20	0.92
7	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,030,000,000	101.70 2,064,640,900	101.50 2,060,612,400	0.1 2027/9/20	0.90
8	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	101.47 2,009,145,600	101.31 2,006,017,200	0.1 2026/3/20	0.88
9	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,940,000,000	102.90 1,996,282,900	102.79 1,994,184,200	0.5 2024/9/20	0.87
10	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,940,000,000	103.08 1,999,933,500	102.72 1,992,787,400	0.4 2025/6/20	0.87
11	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,960,000,000	101.61 1,991,643,000	101.49 1,989,380,400	0.1 2028/6/20	0.87
12	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,930,000,000	103.26 1,992,962,600	103.03 1,988,594,800	0.6 2024/6/20	0.87
13	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,930,000,000	101.59 1,960,802,800	101.42 1,957,579,700	0.1 2026/9/20	0.86
14	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,910,000,000	102.62 1,960,042,000	102.40 1,955,935,500	0.3 2025/12/20	0.86
15	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,890,000,000	103.08 1,948,244,400	102.86 1,944,167,400	0.6 2024/3/20	0.85
16	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,860,000,000	103.01 1,916,019,000	102.69 1,910,164,200	0.6 2023/12/20	0.84
17	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,830,000,000	102.76 1,880,520,000	102.58 1,877,287,200	0.4 2025/3/20	0.82
18	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,820,000,000	101.68 1,850,591,000	101.47 1,846,808,600	0.1 2027/3/20	0.81
19	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	103.18 1,826,392,200	102.96 1,822,392,000	0.8 2023/6/20	0.80
20	130回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,780,000,000	100.46 1,788,188,000	100.40 1,787,191,200	0.1 2021/12/20	0.78
21	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	101.74 1,790,624,000	101.52 1,786,787,200	0.1 2027/12/20	0.78
22	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,760,000,000	101.83 1,792,358,000	101.45 1,785,572,800	0.1 2026/12/20	0.78

23	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,720,000,000	101.60 1,747,520,000	101.46 1,745,146,400	0.1 2028/9/20	0.76
24	328回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,590,000,000	102.28 1,626,261,600	102.15 1,624,200,900	0.6 2023/3/20	0.71
25	142回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,600,000,000	101.22 1,619,610,500	101.07 1,617,216,000	0.1 2024/12/20	0.71
26	356回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,580,000,000	101.30 1,600,550,500	101.11 1,597,664,400	0.1 2029/9/20	0.70
27	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,540,000,000	101.41 1,561,749,200	101.37 1,561,175,000	0.1 2028/12/20	0.68
28	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,470,000,000	101.50 1,492,152,900	101.28 1,488,830,700	0.1 2029/3/20	0.65
29	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,460,000,000	101.50 1,481,903,000	101.05 1,475,344,600	0.1 2029/12/20	0.65
30	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,450,000,000	101.45 1,471,083,000	101.22 1,467,762,500	0.1 2029/6/20	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年5月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	80.91
地方債証券	7.37
特殊債券	6.88
社債券	4.20
合計	99.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,118,312,000	101.00 1,129,538,800	102.66 1,148,148,206	2 2021/11/15	0.93
2	US T N/B 2.0 05/31/21 アメリカ	国債証券	1,089,278,900	100.66 1,096,554,933	101.81 1,109,064,626	2 2021/5/31	0.90
3	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	984,974,800	101.30 997,825,637	103.07 1,015,293,555	2.125 2021/12/31	0.83
4	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	950,565,200	101.08 960,887,739	102.59 975,220,484	2.125 2021/9/30	0.79
5	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	910,779,100	101.19 921,630,175	103.12 939,276,521	2 2022/2/15	0.76
6	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	751,634,700	100.75 757,330,677	102.87 773,244,197	1.75 2022/3/31	0.63
7	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	690,342,600	108.30 747,687,012	108.67 750,208,246	2.375 2024/8/15	0.61
8	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	708,622,700	101.70 720,691,429	104.49 740,455,356	2 2022/11/30	0.60
9	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	702,170,900	101.72 714,294,315	104.05 730,641,732	2.125 2022/6/30	0.59
10	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	670,987,200	104.63 702,072,774	108.72 729,541,313	2.5 2024/5/15	0.59
11	US T N/B 8.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	645,180,000	111.23 717,636,732	111.51 719,451,301	8 2021/11/15	0.59
12	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	647,330,600	105.04 680,000,565	108.62 703,162,864	2.75 2023/11/15	0.57
13	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	520,445,200	113.25 589,444,842	120.60 627,705,701	3.125 2028/11/15	0.51
14	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	604,318,600	100.67 608,402,470	103.49 625,446,139	1.625 2022/11/15	0.51
15	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	572,059,600	105.35 602,718,419	109.18 624,617,575	2.75 2024/2/15	0.51
16	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	593,565,600	102.11 606,132,493	104.95 622,965,646	2.125 2022/12/31	0.51
17	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	569,909,000	102.98 586,917,221	107.74 614,032,420	2 2025/2/15	0.50
18	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	558,080,700	104.62 583,891,932	109.88 613,234,766	2.25 2025/11/15	0.50
19	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	557,005,400	103.17 574,716,427	108.33 603,437,018	2 2025/8/15	0.49
20	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	553,779,500	103.71 574,329,907	108.66 601,759,298	2.125 2025/5/15	0.49
21	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	580,662,000	100.82 585,425,239	103.06 598,467,452	1.75 2022/5/15	0.49

22	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証 券	503,240,400	110.99 558,557,522	118.14 594,531,353	2.875 2028/8/15	0.48
23	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証 券	564,532,500	100.96 570,001,408	103.62 584,996,803	1.75 2022/9/30	0.48
24	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	476,357,900	110.75 527,603,586	117.80 561,171,932	2.875 2028/5/15	0.46
25	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証 券	550,553,600	100.10 551,134,257	101.75 560,209,791	1.5 2021/9/30	0.46
26	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証 券	535,499,400	101.10 541,398,257	104.10 557,463,239	1.75 2023/1/31	0.45
27	US T N/B 1.625 12/31/21 アメリカ	国債証 券	537,650,000	102.42 550,671,130	102.27 549,894,118	1.625 2021/12/31	0.45
28	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	512,918,100	102.59 526,221,912	106.82 547,900,714	2 2024/5/31	0.45
29	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	504,315,700	104.01 524,567,125	108.52 547,300,730	2.25 2024/11/15	0.45
30	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	469,906,100	109.60 515,024,423	116.39 546,963,353	2.75 2028/2/15	0.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年5月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.25
合計	97.25

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	4,141	735,122.22 3,044,141,118	676,000.00 2,799,316,000	- -	7.08
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	4,276	659,629.18 2,820,574,400	588,000.00 2,514,288,000	- -	6.36
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	6,435	279,039.36 1,795,618,334	304,000.00 1,956,240,000	- -	4.95
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	13,806	156,810.10 2,164,920,365	132,500.00 1,829,295,000	- -	4.63
5	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	6,102	269,865.34 1,646,718,339	266,400.00 1,625,572,800	- -	4.11
6	GLP投資法人 日本	投資証券	10,651	133,039.75 1,417,006,454	143,700.00 1,530,548,700	- -	3.87
7	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	4,056	331,101.27 1,342,946,756	335,500.00 1,360,788,000	- -	3.44
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	8,521	178,672.13 1,522,465,222	155,800.00 1,327,571,800	- -	3.36
9	日本リテールファンド投資 法人 日本	投資証券	8,082	179,980.99 1,454,606,364	142,200.00 1,149,260,400	- -	2.91
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	9,602	156,525.32 1,502,956,132	114,200.00 1,096,548,400	- -	2.77
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	5,507	151,582.04 834,762,295	176,700.00 973,086,900	- -	2.46
12	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証券	1,421	638,721.95 907,623,898	653,000.00 927,913,000	- -	2.35
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	2,810	406,492.31 1,142,243,409	329,000.00 924,490,000	- -	2.34
14	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	12,504	77,803.52 972,855,266	67,100.00 839,018,400	- -	2.12
15	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証券	2,794	263,732.78 736,869,395	286,500.00 800,481,000	- -	2.02
16	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証券	1,323	687,239.94 909,218,446	598,000.00 791,154,000	- -	2.00
17	アクティピア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証券	2,143	431,472.17 924,644,875	366,500.00 785,409,500	- -	1.99

18	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	4,920	153,418.51 754,819,092	145,500.00 715,860,000	- -	1.81
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	3,976	149,744.97 595,386,039	160,700.00 638,943,200	- -	1.62
20	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	987	709,690.73 700,464,753	629,000.00 620,823,000	- -	1.57
21	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	13,776	61,136.96 842,222,800	44,850.00 617,853,600	- -	1.56
22	コンフォリア・レジデンスシャル投資法人 日本	投資証券	1,862	322,405.47 600,319,000	326,000.00 607,012,000	- -	1.54
23	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	1,217	439,355.39 534,695,510	469,000.00 570,773,000	- -	1.44
24	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	1,519	391,779.45 595,112,990	350,000.00 531,650,000	- -	1.34
25	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	3,956	148,668.90 588,134,202	133,300.00 527,334,800	- -	1.33
26	イオンリート投資法人 日本	投資証券	4,615	126,376.32 583,226,718	114,000.00 526,110,000	- -	1.33
27	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,389	390,206.24 541,996,478	378,500.00 525,736,500	- -	1.33
28	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	5,234.7	94,012.61 492,127,833	98,900.00 517,711,830	- -	1.31
29	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	18,758	44,901.76 842,267,250	27,280.00 511,718,240	- -	1.29
30	ケネディクス・レジデンスシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	2,790	184,625.92 515,106,320	181,300.00 505,827,000	- -	1.28

（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5月29日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	95.08
合計	95.08

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	224,820	9,374.10 2,107,485,735	10,005.66 2,249,473,942	- -	6.43
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	26,851	68,162.34 1,830,227,011	74,555.92 2,001,901,155	- -	5.72
3	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	80,023	14,899.85 1,192,331,260	15,704.75 1,256,741,729	- -	3.59
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	45,726	22,567.36 1,031,915,235	21,633.96 989,234,486	- -	2.83
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	42,498	19,614.33 833,570,199	17,100.49 726,736,874	- -	2.08
6	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	106,212	7,725.79 820,571,787	6,545.35 695,194,831	- -	1.99
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	123,460	6,743.04 832,496,053	5,520.59 681,572,066	- -	1.95
8	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	104,260	6,716.74 700,287,369	5,989.42 624,457,033	- -	1.79
9	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	37,297	16,381.98 610,998,806	16,682.20 622,196,170	- -	1.78
10	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	93,359	10,424.70 973,240,453	6,424.91 599,823,872	- -	1.72
11	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	20,100	29,323.95 589,411,493	26,759.91 537,874,307	- -	1.54
12	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	489,196	1,014.73 496,402,244	1,099.50 537,872,714	- -	1.54
13	LINK REIT 香港	投資証券	643,920	1,052.31 677,604,248	790.58 509,076,712	- -	1.46
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	163,706	2,796.84 457,860,146	2,817.28 461,206,621	- -	1.32
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	113,340	4,778.34 541,577,175	3,952.80 448,010,669	- -	1.28
16	MID AMERICA アメリカ	投資証券	34,682	12,855.43 445,852,028	12,651.97 438,795,963	- -	1.25
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	28,178	14,845.02 418,303,166	14,896.13 419,743,176	- -	1.20
18	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	111,746	3,649.26 407,790,633	3,745.26 418,518,930	- -	1.20
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	150,477	3,114.37 468,641,483	2,751.69 414,066,462	- -	1.18
20	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	39,555	10,760.33 425,625,119	10,454.06 413,510,604	- -	1.18
21	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	43,718	11,866.28 518,770,371	9,436.83 412,559,456	- -	1.18
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	334,954	1,085.37 363,551,465	1,123.85 376,439,526	- -	1.08

23	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	55,610	6,850.02 380,929,926	6,720.62 373,733,956	- -	1.07
24	UDR INC アメリカ	投資証 券	89,518	4,513.75 404,061,950	4,134.52 370,114,722	- -	1.06
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	52,358	7,753.27 405,946,087	6,696.96 350,639,871	- -	1.00
26	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証 券	157,205	1,969.63 309,637,235	1,951.66 306,812,203	- -	0.88
27	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	29,412	10,323.04 303,621,452	9,951.90 292,705,326	- -	0.84
28	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	140,047	2,111.18 295,665,303	2,083.93 291,848,340	- -	0.83
29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証 券	217,849	1,472.89 320,868,932	1,293.58 281,806,394	- -	0.81
30	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信 託受益 証券	1,637,682	201.24 329,578,761	169.81 278,099,693	- -	0.80

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年5月29日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.63
投資証券	88.31
合計	98.95

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年5月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0206月	買建	342	5,002,497,860	5,331,780,000	2.25

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun20	買建	525	8,131,687,425	8,575,248,675	2.51
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun20	買建	519	1,776,708,393	1,911,736,292	0.56
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun20	買建	72	559,933,948	593,904,038	0.17
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun20	買建	28	385,236,783	402,344,376	0.12
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Jun20	買建	25	244,102,620	261,141,000	0.08

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0206月	買建	524	955,601,640	891,324,000	2.25

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日（令和2年5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8特定期間末 (平成22年11月11日)	861	863	0.6399	0.6414
第9特定期間末 (平成23年5月11日)	823	825	0.6487	0.6502
第10特定期間末 (平成23年11月11日)	712	714	0.5956	0.5971
第11特定期間末 (平成24年5月11日)	692	694	0.6202	0.6217
第12特定期間末 (平成24年11月12日)	652	653	0.6218	0.6233
第13特定期間末 (平成25年5月13日)	824	825	0.8225	0.8240
第14特定期間末 (平成25年11月11日)	736	738	0.8118	0.8133
第15特定期間末 (平成26年5月12日)	712	713	0.8414	0.8429
第16特定期間末 (平成26年11月11日)	684	685	0.9368	0.9383
第17特定期間末 (平成27年5月11日)	622	623	1.0095	1.0110
第18特定期間末 (平成27年11月11日)	534	535	0.9947	0.9962
第19特定期間末 (平成28年5月11日)	498	499	0.9354	0.9369
第20特定期間末 (平成28年11月11日)	482	483	0.9205	0.9220
第21特定期間末 (平成29年5月11日)	492	493	1.0090	1.0105
第22特定期間末 (平成29年11月13日)	477	478	1.0570	1.0585

第23特定期間末 (平成30年5月11日)	448	449	1.0565	1.0580
第24特定期間末 (平成30年11月12日)	428	428	1.0434	1.0449
第25特定期間末 (令和1年5月13日)	411	411	1.0361	1.0376
第26特定期間末 (令和1年11月11日)	430	431	1.0940	1.0955
第27特定期間末 (令和2年5月11日)	370	371	0.9993	1.0008
令和1年5月末日	407	-	1.0254	-
6月末日	415	-	1.0449	-
7月末日	428	-	1.0572	-
8月末日	421	-	1.0412	-
9月末日	424	-	1.0655	-
10月末日	432	-	1.0929	-
11月末日	433	-	1.1046	-
12月末日	437	-	1.1134	-
令和2年1月末日	424	-	1.1117	-
2月末日	400	-	1.0539	-
3月末日	356	-	0.9630	-
4月末日	370	-	0.9986	-
5月末日	383	-	1.0297	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第8特定期間	0.0065
第9特定期間	0.0045
第10特定期間	0.0045
第11特定期間	0.0045
第12特定期間	0.0045
第13特定期間	0.0045
第14特定期間	0.0045
第15特定期間	0.0045
第16特定期間	0.0045
第17特定期間	0.0045
第18特定期間	0.0045
第19特定期間	0.0045
第20特定期間	0.0045
第21特定期間	0.0045
第22特定期間	0.0045
第23特定期間	0.0045
第24特定期間	0.0045
第25特定期間	0.0045
第26特定期間	0.0045
第27特定期間	0.0045

【収益率の推移】

	収益率（％）
第8特定期間	2.6
第9特定期間	2.1
第10特定期間	7.5
第11特定期間	4.9
第12特定期間	1.0
第13特定期間	33.0
第14特定期間	0.8
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.9
第17特定期間	8.2
第18特定期間	1.0
第19特定期間	5.5
第20特定期間	1.1
第21特定期間	10.1
第22特定期間	5.2
第23特定期間	0.4
第24特定期間	0.8
第25特定期間	0.3
第26特定期間	6.0
第27特定期間	8.2

（注1）収益率は期間騰落率です。

（注2）各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

(4) 【設定及び解約の実績】

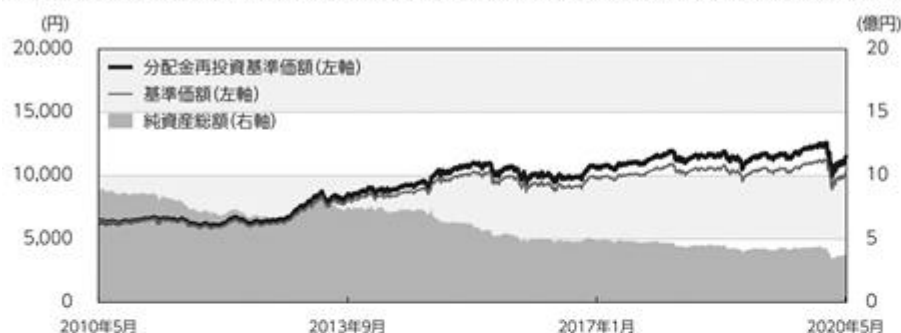
	設定口数	解約口数
第8特定期間	12,120,000	62,800,000
第9特定期間	21,210,000	98,740,000
第10特定期間	7,120,000	79,920,000
第11特定期間	10,800,000	90,460,000
第12特定期間	3,810,000	71,430,000
第13特定期間	22,800,000	69,530,000
第14特定期間	13,700,000	108,500,000
第15特定期間	52,399,738	112,932,769
第16特定期間	31,449,359	147,724,782
第17特定期間	44,688,338	158,989,550
第18特定期間	22,117,058	100,883,651
第19特定期間	21,980,050	26,586,206
第20特定期間	10,137,344	18,761,221
第21特定期間	9,179,637	45,104,386
第22特定期間	6,636,994	43,222,568
第23特定期間	4,576,025	31,482,595
第24特定期間	6,951,749	21,627,662
第25特定期間	6,012,015	19,263,147
第26特定期間	13,077,272	16,654,903
第27特定期間	11,204,748	33,518,095

(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5月29日

基準価額・純資産の推移 (2010年5月31日~2020年5月29日)



※基準価額は1万円当たり・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:2007年1月26日)

分配の推移(税引前)

2019年 9月	15円
2019年11月	15円
2020年 1月	15円
2020年 3月	15円
2020年 5月	15円
直近1年間累計	90円
設定来累計	1,695円

※分配金は1万円当たりです。

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	26.66
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.78
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	25.08
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.03
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.90
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.83

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.16
2	ソニー	株式	日本	電気機器	1.81
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.69
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.58
5	武田薬品工業	株式	日本	医薬品	1.46

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	3.67
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.41
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.63
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	1.41
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	1.13

○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。

データの基準日:2020年5月29日

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.13
2	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.03
3	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	0.99
4	347回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/6/20	0.98
5	129回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2021/9/20	0.93

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	2	2021/11/15	0.93
2	US T N/B 2.0 05/31/21	国債証券	アメリカ	2	2021/5/31	0.90
3	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/12/31	0.83
4	US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/9/30	0.79
5	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2	2022/2/15	0.76

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	7.08
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.36
3	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.95
4	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.63
5	大和ハウスリート投資法人	投資証券	日本	4.11

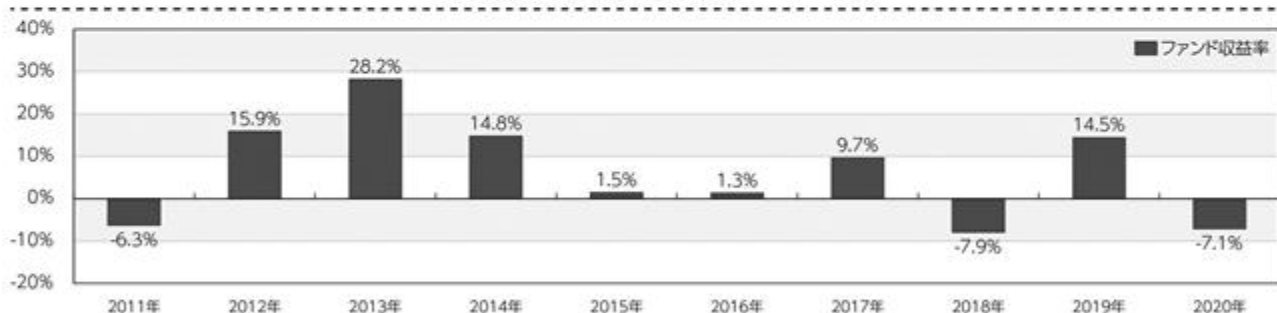
■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.43
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.72
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.59
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.83
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	アメリカ	2.08

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年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。なお、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行、Frankfurtの銀行、オランダの銀行、フランスの銀行、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、オーストラリア証券取引所のいずれかの休業日に該当する日(以下「海外休業日」という場合があります。)には、お申込みの受付は行いません。

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係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。

・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。

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に各販売会社の定める単位をもって解約の請求をすることができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。解約の受付は、原則として販売会社の営業日の午後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解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。なお、解約の請求を受益者がするとき、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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

・ 解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額として当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を控除した価額とします。

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および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・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2007年1月26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奇数月の12日から翌奇数月の11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、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、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、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.から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、その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」の規定に従い、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出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の変更事項のうち、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.の規定に従います。
- 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。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

当ファンドの投資顧問契約について、委託会社とイボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社(投資顧問会社)との間の当該契約は、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。

ニ. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

- ・委託会社は、毎年5月11日、11月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
 - ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。
- (URL <http://www.am-one.co.jp/>)

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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。

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

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) 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- (3) 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、当特定期間(令和1年11月12日から令和2年5月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 令和1年11月11日現在	当期 令和2年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,865,349	7,491,876
親投資信託受益証券	426,828,140	365,076,207
未収入金	2,175,000	-
流動資産合計	433,868,489	372,568,083
資産合計	433,868,489	372,568,083
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	590,163	556,693
未払解約金	2,440,005	800,361
未払受託者報酬	31,256	26,260
未払委託者報酬	359,624	302,262
その他未払費用	2,949	2,343
流動負債合計	3,423,997	1,687,919
負債合計	3,423,997	1,687,919
純資産の部		
元本等		
元本	393,442,139	371,128,792
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	37,002,353	248,628
(分配準備積立金)	54,372,975	60,266,045
元本等合計	430,444,492	370,880,164
純資産合計	430,444,492	370,880,164
負債純資産合計	433,868,489	372,568,083

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期		当期	
	自 至	令和1年5月14日 令和1年11月11日	自 至	令和1年11月12日 令和2年5月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		26,000,600		33,415,933
その他収益		1,162		1,457
営業収益合計		26,001,762		33,414,476
営業費用				
支払利息		1,612		1,190
受託者報酬		91,141		88,551
委託者報酬		1,048,607		1,018,836
その他費用		8,588		8,043
営業費用合計		1,149,948		1,116,620
営業利益又は営業損失()		24,851,814		34,531,096
経常利益又は経常損失()		24,851,814		34,531,096
当期純利益又は当期純損失()		24,851,814		34,531,096
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()		128,026		993,869
期首剰余金又は期首欠損金()		14,342,952		37,002,353
剰余金増加額又は欠損金減少額		714,659		758,252
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		714,659		758,252
剰余金減少額又は欠損金増加額		971,972		2,760,446
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		971,972		2,760,446
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		1,807,074		1,711,560
期末剰余金又は期末欠損金()		37,002,353		248,628

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	当期
	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	前期	当期
	令和1年11月11日現在	令和2年5月11日現在
1. 期首元本額	397,019,770円	393,442,139円
期中追加設定元本額	13,077,272円	11,204,748円
期中一部解約元本額	16,654,903円	33,518,095円
2. 受益権の総数	393,442,139口	371,128,792口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は248,628円であり ます。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期	当期
	自 令和1年5月14日 至 令和1年11月11日	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 分配金の計算過程	(自令和1年5月14日 至令和1年7月11日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,243,843円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(9,656,094円)及び分配準備積立金(54,631,088円)より分配対象収益は65,531,025円(1万口当たり1,609.26円)であり、うち610,815円(1万口当たり15円)を分配金額としております。	(自令和1年11月12日 至令和2年1月14日) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,172,707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(9,405,787円)、信託約款に規定される収益調整金(10,062,222円)及び分配準備積立金(53,860,754円)より分配対象収益は74,501,470円(1万口当たり1,897.44円)であり、うち588,962円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

<p>(自令和1年7月12日 至令和1年9月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(747,747円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(9,680,702円)及び分配準備積立金(54,738,297円)より分配対象収益は65,166,746円(1万口当たり1,612.78円)であり、うち606,096円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和1年9月12日 至令和1年11月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,775,564円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(9,678,403円)及び分配準備積立金(53,187,574円)より分配対象収益は64,641,541円(1万口当たり1,642.97円)であり、うち590,163円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自令和2年1月15日 至令和2年3月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(670,323円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(10,504,693円)及び分配準備積立金(60,517,298円)より分配対象収益は71,692,314円(1万口当たり1,900.29円)であり、うち565,905円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自令和2年3月12日 至令和2年5月11日)</p> <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,677,378円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(10,829,119円)及び分配準備積立金(59,145,360円)より分配対象収益は71,651,857円(1万口当たり1,930.64円)であり、うち556,693円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
--	---

(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	前期 自 令和1年5月14日 至 令和1年11月11日	当期 自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左

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。	同左
-------------------	---	----

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	前期 令和1年11月11日現在	当期 令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
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。	同左
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。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 令和1年11月11日現在	当期 令和2年5月11日現在
	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)	最終計算期間の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	14,764,052	2,547,288
合計	14,764,052	2,547,288

(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)

	前期 令和1年11月11日現在	当期 令和2年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.0940円	0.9993円
(1万口当たり純資産額)	(10,940円)	(9,993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5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	38,326,565	90,987,265	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	75,324,315	98,802,903	
	J-REITインデックスファン ド・マザーファンド	11,809,922	22,247,531	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	28,179,401	97,495,091	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	17,884,013	34,045,795	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	20,914,119	21,497,622	
親投資信託受益証券 合計		192,438,335	365,076,207	
合計			365,076,207	

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,699,241,869
株式	216,613,529,510
派生商品評価勘定	258,778,660
未収入金	3,068,781,698
未収配当金	2,342,559,530
流動資産合計	226,982,891,267
資産合計	226,982,891,267
負債の部	
流動負債	
前受金	153,140,100
未払解約金	4,787,084,000
流動負債合計	4,940,224,100
負債合計	4,940,224,100
純資産の部	
元本等	
元本	93,530,083,865
剰余金	
剰余金又は欠損金()	128,512,583,302
元本等合計	222,042,667,167
純資産合計	222,042,667,167
負債純資産合計	226,982,891,267

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,335,804,545円
同期中追加設定元本額	32,622,697,027円
同期中一部解約元本額	35,428,417,707円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	14,628,661,741円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	2,741,564,396円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,711,158円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	6,193,941円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	10,689,013円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	38,222,154円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	24,830,116円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,082,106円
たわらノーロード TOPIX	700,353,129円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	413,618,446円
たわらノーロード バランス(堅実型)	15,490,361円
たわらノーロード バランス(標準型)	91,466,760円
たわらノーロード バランス(積極型)	134,296,721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)	629,194円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	39,326,735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)	120,162,734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)	75,709,757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)	148,081,227円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	263,498円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,013,147円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,330,332円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,657,123円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,443,471円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,317,776,683円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,130,181,902円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,634,911,825円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,591,475,594円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	371,686,992円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,269,637,940円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,137,316,385円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	38,326,565円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,121,011,998円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,648,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	354,497,885円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	265,125,387円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	431,507,281円
投資のソムリエ	8,184,811,850円
クルーズコントロール	443,891,157円
投資のソムリエ<DC年金>	788,388,958円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	305,718,385円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	358,198,386円
クルーズコントロール<DC年金>	505,379円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,680,922円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	12,953,113円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	182,413,987円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,740,254,601円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,576,751円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,725,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,672,347円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	17,153,998円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	71,248,712円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	566,623,291円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	258,528,260円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,769,559円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	784,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,120,158円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	220,995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)	50,135,055円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	55,973,518円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	194,838,944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)	61,447,948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)	92,766,527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)	202,430,840円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,874,297円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	47,084,104円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,337,087円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	11,000,517円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,727,155円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	58,604,095円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	902,473,069円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	901,671,414円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,518,686,746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)	177,415,499円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	49,238,326円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	486,772,172円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	124,201,776円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	2,297,457円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	35,244,824円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	499,495,548円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	39,371,664円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	145,557,454円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	372,596,569円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	406,376,498円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	56,025,545円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	25,210,472円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	5,411,810円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	113,210円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	127,887円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	475,341,313円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,523,201,601円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	2,016,755,536円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	81,133,359円
計	93,530,083,865円
2. 受益権の総数	93,530,083,865口
3. 差入代用有価証券 株式	1,664,500,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	28,934,158,478
合計	28,934,158,478

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和2年2月8日から令和2年5月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,204,059,900	-	5,462,960,000	258,900,100
合計	5,204,059,900	-	5,462,960,000	258,900,100

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年5月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3740円 (23,740円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

令和2年5月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,000	2,582.00	12,910,000	
日本水産	141,200	479.00	67,634,800	
マルハニチロ	20,400	2,317.00	47,266,800	
ハウスイ	700	913.00	639,100	
カネコ種苗	4,300	1,429.00	6,144,700	
サカタのタネ	16,900	3,600.00	60,840,000	
ホクト	10,800	1,964.00	21,211,200	
ホクリヨウ	2,400	594.00	1,425,600	
ヒノキヤグループ	3,500	1,791.00	6,268,500	
ショーボンドホールディングス	22,000	4,490.00	98,780,000	
ミライト・ホールディングス	41,900	1,449.00	60,713,100	
タマホーム	7,700	1,380.00	10,626,000	
サンヨーホームズ	1,100	615.00	676,500	
日本アクア	5,600	635.00	3,556,000	
ファーストコーポレーション	4,500	497.00	2,236,500	
ベステラ	2,600	1,008.00	2,620,800	
TATERU	29,800	117.00	3,486,600	
スペースバリューホールディングス	17,600	365.00	6,424,000	
住石ホールディングス	29,800	114.00	3,397,200	

日鉄鉱業	3,200	4,535.00	14,512,000
三井松島ホールディングス	5,600	871.00	4,877,600
国際石油開発帝石	567,000	697.00	395,199,000
石油資源開発	18,500	1,898.00	35,113,000
K&Oエナジーグループ	6,900	1,562.00	10,777,800
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,079.00	3,021,200
第一カッター興業	1,800	1,712.00	3,081,600
安藤・間	84,100	715.00	60,131,500
東急建設	41,300	588.00	24,284,400
コムシスホールディングス	50,100	2,992.00	149,899,200
ビーアールホールディングス	15,800	494.00	7,805,200
高松コンストラクショングループ	8,800	2,347.00	20,653,600
東建コーポレーション	4,400	7,370.00	32,428,000
ソネック	1,600	761.00	1,217,600
ヤマウラ	6,200	770.00	4,774,000
大成建設	108,800	3,535.00	384,608,000
大林組	326,100	952.00	310,447,200
清水建設	331,100	875.00	289,712,500
飛島建設	9,400	1,108.00	10,415,200
長谷工コーポレーション	126,300	1,208.00	152,570,400
松井建設	12,800	667.00	8,537,600
銭高組	1,400	3,405.00	4,767,000
鹿島建設	256,000	1,167.00	298,752,000
不動テトラ	8,700	1,406.00	12,232,200
大末建設	3,900	757.00	2,952,300
鉄建建設	7,100	2,227.00	15,811,700
西松建設	25,100	2,238.00	56,173,800
三井住友建設	78,700	464.00	36,516,800
大豊建設	7,400	2,365.00	17,501,000
前田建設工業	81,700	892.00	72,876,400
佐田建設	7,300	401.00	2,927,300
ナカノフドー建設	8,900	369.00	3,284,100
奥村組	17,700	2,437.00	43,134,900
東鉄工業	14,000	2,780.00	38,920,000
イチケン	2,400	1,271.00	3,050,400
富士ピー・エス	4,900	522.00	2,557,800
浅沼組	3,700	3,580.00	13,246,000
戸田建設	135,100	652.00	88,085,200
熊谷組	15,100	2,538.00	38,323,800
北野建設	2,000	2,566.00	5,132,000
植木組	1,500	2,488.00	3,732,000
矢作建設工業	14,400	805.00	11,592,000
ピーエス三菱	10,700	557.00	5,959,900
日本ハウスホールディングス	23,100	290.00	6,699,000
大東建託	35,600	11,495.00	409,222,000
新日本建設	13,800	771.00	10,639,800
N I P P O	27,000	2,478.00	66,906,000
東亜道路工業	2,000	2,941.00	5,882,000
前田道路	28,900	2,077.00	60,025,300
日本道路	3,100	6,680.00	20,708,000

東亜建設工業	10,200	1,470.00	14,994,000
日本国土開発	31,800	569.00	18,094,200
若築建設	5,900	1,205.00	7,109,500
東洋建設	36,700	449.00	16,478,300
五洋建設	129,400	562.00	72,722,800
世紀東急工業	15,800	808.00	12,766,400
福田組	3,800	4,240.00	16,112,000
日本ドライケミカル	2,600	1,425.00	3,705,000
住友林業	82,600	1,337.00	110,436,200
日本基礎技術	11,100	405.00	4,495,500
巴コーポレーション	14,700	393.00	5,777,100
大和ハウス工業	322,800	2,778.50	896,899,800
ライト工業	18,700	1,440.00	26,928,000
積水ハウス	356,900	1,880.50	671,150,450
日特建設	8,600	727.00	6,252,200
北陸電気工事	5,600	914.00	5,118,400
ユアテック	18,600	620.00	11,532,000
日本リーテック	6,900	2,000.00	13,800,000
四電工	1,800	2,309.00	4,156,200
中電工	13,000	2,220.00	28,860,000
関電工	46,400	924.00	42,873,600
きんでん	77,500	1,761.00	136,477,500
東京エネシス	10,900	757.00	8,251,300
トーエネック	3,200	3,425.00	10,960,000
住友電設	9,200	2,366.00	21,767,200
日本電設工業	17,900	2,123.00	38,001,700
協和エクシオ	49,500	2,665.00	131,917,500
新日本空調	8,700	2,246.00	19,540,200
日本工営	6,700	3,060.00	20,502,000
九電工	22,900	3,035.00	69,501,500
三機工業	23,500	1,323.00	31,090,500
日揮ホールディングス	100,500	1,065.00	107,032,500
中外炉工業	3,500	1,584.00	5,544,000
ヤマト	10,600	635.00	6,731,000
太平電業	7,900	2,409.00	19,031,100
高砂熱学工業	28,300	1,714.00	48,506,200
三晃金属工業	1,500	2,136.00	3,204,000
NEC ネットエスアイ	9,700	4,785.00	46,414,500
朝日工業社	2,200	2,900.00	6,380,000
明星工業	21,100	790.00	16,669,000
大気社	15,900	3,185.00	50,641,500
ダイダン	7,800	2,790.00	21,762,000
日比谷総合設備	10,500	1,841.00	19,330,500
日本製粉	30,500	1,719.00	52,429,500
日清製粉グループ本社	118,000	1,709.00	201,662,000
日東富士製粉	700	5,890.00	4,123,000
昭和産業	9,600	3,270.00	31,392,000
鳥越製粉	9,300	902.00	8,388,600
中部飼料	12,800	1,623.00	20,774,400
フィード・ワン	70,700	185.00	13,079,500

東洋精糖	1,900	1,203.00	2,285,700	
日本甜菜製糖	5,400	1,729.00	9,336,600	
三井製糖	9,100	2,205.00	20,065,500	
塩水港精糖	11,900	209.00	2,487,100	
日新製糖	4,800	1,910.00	9,168,000	
L I F U L L	35,000	384.00	13,440,000	
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,226.00	8,459,400	
日本M&Aセンター	75,200	3,660.00	275,232,000	
メンバーズ	3,000	1,833.00	5,499,000	
中広	1,400	524.00	733,600	
UTグループ	15,800	1,830.00	28,914,000	
アイティメディア	3,000	959.00	2,877,000	
タケエイ	9,600	880.00	8,448,000	
E・Jホールディングス	1,500	1,577.00	2,365,500	
ビーネックスグループ	12,600	756.00	9,525,600	
コシダカホールディングス	24,300	505.00	12,271,500	
アルトナー	2,500	696.00	1,740,000	
パソナグループ	10,900	1,185.00	12,916,500	
C D S	2,600	1,381.00	3,590,600	
リンクアンドモチベーション	22,300	379.00	8,451,700	
G C A	12,300	690.00	8,487,000	
エス・エム・エス	31,000	2,432.00	75,392,000	
サニーサイドアップグループ	2,700	780.00	2,106,000	
パーソルホールディングス	99,500	1,319.00	131,240,500	
リニカル	4,800	973.00	4,670,400	
クックパッド	35,000	306.00	10,710,000	
エスクリ	3,100	457.00	1,416,700	
アイ・ケイ・ケイ	4,900	625.00	3,062,500	
森永製菓	24,500	4,460.00	109,270,000	
中村屋	2,700	3,970.00	10,719,000	
江崎グリコ	31,000	4,840.00	150,040,000	
名糖産業	5,000	1,265.00	6,325,000	
井村屋グループ	6,000	1,929.00	11,574,000	
不二家	5,800	2,024.00	11,739,200	
山崎製パン	78,400	1,874.00	146,921,600	
第一屋製パン	1,900	914.00	1,736,600	
モロゾフ	1,800	5,600.00	10,080,000	
亀田製菓	5,900	5,100.00	30,090,000	
寿スピリッツ	10,100	4,920.00	49,692,000	
カルビー	47,600	3,270.00	155,652,000	
森永乳業	19,300	4,100.00	79,130,000	
六甲バター	6,900	1,406.00	9,701,400	
ヤクルト本社	71,900	6,420.00	461,598,000	
明治ホールディングス	69,100	7,550.00	521,705,000	
雪印メグミルク	25,200	2,488.00	62,697,600	
プリマハム	16,300	2,417.00	39,397,100	
日本ハム	39,900	3,770.00	150,423,000	
林兼産業	3,700	588.00	2,175,600	
丸大食品	11,100	1,986.00	22,044,600	
S F o o d s	8,300	2,400.00	19,920,000	

柿安本店	3,700	2,400.00	8,880,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	67,000	637.00	42,679,000	
学情	3,700	1,301.00	4,813,700	
スタジオアリス	5,000	1,577.00	7,885,000	
クロスキャット	2,800	1,050.00	2,940,000	
シミックホールディングス	5,000	1,559.00	7,795,000	
エプコ	1,700	955.00	1,623,500	
システナ	36,500	1,604.00	58,546,000	
N J S	2,200	1,750.00	3,850,000	
デジタルアーツ	5,000	7,430.00	37,150,000	
日鉄ソリューションズ	15,400	2,725.00	41,965,000	
総合警備保障	39,600	5,160.00	204,336,000	
キューブシステム	5,500	740.00	4,070,000	
いちご	130,900	288.00	37,699,200	
エイジア	1,900	1,374.00	2,610,600	
日本駐車場開発	102,200	130.00	13,286,000	
コア	4,500	1,176.00	5,292,000	
カカクコム	73,500	2,493.00	183,235,500	
アイロムグループ	3,600	1,917.00	6,901,200	
セントケア・ホールディング	6,600	420.00	2,772,000	
サイネックス	1,700	621.00	1,055,700	
ルネサンス	5,600	1,189.00	6,658,400	
ディップ	14,100	2,554.00	36,011,400	
S B Sホールディングス	9,000	1,913.00	17,217,000	
オプトホールディング	5,400	1,527.00	8,245,800	
新日本科学	11,000	703.00	7,733,000	
ツクイ	23,600	482.00	11,375,200	
キャリアデザインセンター	2,600	906.00	2,355,600	
ベネフィット・ワン	36,300	2,000.00	72,600,000	
エムスリー	219,300	3,695.00	810,313,500	
ツカダ・グローバルホールディング	6,500	361.00	2,346,500	
プラス	900	462.00	415,800	
アウトソーシング	57,400	624.00	35,817,600	
ウェルネット	10,500	655.00	6,877,500	
ワールドホールディングス	3,200	1,546.00	4,947,200	
ディー・エヌ・エー	48,800	1,334.00	65,099,200	
博報堂D Yホールディングス	138,300	1,209.00	167,204,700	
ぐるなび	17,500	686.00	12,005,000	
タカミヤ	10,800	455.00	4,914,000	
ジャパンベストレスキューシステム	7,000	727.00	5,089,000	
ファンコミュニケーションズ	27,700	464.00	12,852,800	
ライク	3,200	1,750.00	5,600,000	
ビジネス・ブレークスルー	4,400	421.00	1,852,400	
エスプール	25,900	743.00	19,243,700	
W D Bホールディングス	4,600	2,564.00	11,794,400	
手間いらず	600	4,775.00	2,865,000	
ティア	6,000	523.00	3,138,000	
C D G	1,000	1,454.00	1,454,000	
バリューコマース	5,600	2,473.00	13,848,800	
インフォマート	109,100	808.00	88,152,800	

サッポロホールディングス	35,600	2,071.00	73,727,600
アサヒグループホールディングス	218,700	3,813.00	833,903,100
キリンホールディングス	442,900	2,077.50	920,124,750
宝ホールディングス	77,400	823.00	63,700,200
オエノンホールディングス	27,900	395.00	11,020,500
養命酒製造	3,100	1,918.00	5,945,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	73,300	2,061.00	151,071,300
サントリー食品インターナショナル	69,900	4,285.00	299,521,500
ダイドーグループホールディングス	5,400	4,485.00	24,219,000
伊藤園	31,700	6,090.00	193,053,000
キーコーヒー	10,300	2,274.00	23,422,200
ユニカフェ	2,800	917.00	2,567,600
ジャパンフーズ	1,600	1,153.00	1,844,800
日清オイリオグループ	13,400	3,590.00	48,106,000
不二製油グループ本社	25,500	2,555.00	65,152,500
かどや製油	1,100	3,755.00	4,130,500
J・オイルミルズ	5,400	4,200.00	22,680,000
ローソン	25,900	5,570.00	144,263,000
サンエー	8,500	4,160.00	35,360,000
カワチ薬品	8,000	2,404.00	19,232,000
エービーシー・マート	16,000	5,930.00	94,880,000
ハードオフコーポレーション	4,200	679.00	2,851,800
高千穂交易	4,000	940.00	3,760,000
アスクル	10,700	3,420.00	36,594,000
ゲオホールディングス	18,500	1,367.00	25,289,500
アダストリア	14,200	1,709.00	24,267,800
ジーフット	6,300	473.00	2,979,900
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,800	403.00	725,400
伊藤忠食品	2,500	4,625.00	11,562,500
くら寿司	5,400	4,760.00	25,704,000
キャンドウ	5,000	1,896.00	9,480,000
エレマテック	9,600	828.00	7,948,800
パルグループホールディングス	10,400	1,360.00	14,144,000
JALUX	2,900	1,650.00	4,785,000
エディオン	46,900	976.00	45,774,400
あらた	8,100	4,675.00	37,867,500
サーラコーポレーション	20,700	564.00	11,674,800
ワッツ	4,700	683.00	3,210,100
トーメンデバイス	1,500	3,810.00	5,715,000
ハローズ	3,800	2,890.00	10,982,000
J Pホールディングス	31,500	280.00	8,820,000
フジオフードシステム	8,600	1,460.00	12,556,000
あみやき亭	2,200	3,085.00	6,787,000
東京エレクトロン デバイス	3,700	2,840.00	10,508,000
ひらまつ	19,700	164.00	3,230,800
フィールズ	8,000	348.00	2,784,000
双日	565,300	250.00	141,325,000
アルフレッサ ホールディングス	113,900	2,092.00	238,278,800
大黒天物産	2,500	4,090.00	10,225,000

ハニーズホールディングス	9,100	1,218.00	11,083,800	
ファーマライズホールディングス	2,600	669.00	1,739,400	
キッコーマン	75,200	4,795.00	360,584,000	
味の素	230,600	1,899.50	438,024,700	
キュービー	58,100	2,136.00	124,101,600	
ハウス食品グループ本社	39,100	3,515.00	137,436,500	
カゴメ	39,600	2,770.00	109,692,000	
焼津水産化学工業	5,100	934.00	4,763,400	
アリアケジャパン	9,500	6,240.00	59,280,000	
ピエトロ	1,400	1,610.00	2,254,000	
エバラ食品工業	2,500	2,227.00	5,567,500	
やまみ	500	2,040.00	1,020,000	
ニチレイ	49,800	2,698.00	134,360,400	
横浜冷凍	26,700	893.00	23,843,100	
東洋水産	53,800	5,080.00	273,304,000	
イトアイト	3,700	1,773.00	6,560,100	
大冷	1,500	1,845.00	2,767,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,800	1,144.00	6,635,200	
日清食品ホールディングス	44,400	8,810.00	391,164,000	
永谷園ホールディングス	5,100	2,205.00	11,245,500	
一正蒲鉾	4,100	946.00	3,878,600	
フジッコ	11,300	1,940.00	21,922,000	
ロック・フィールド	11,400	1,314.00	14,979,600	
日本たばこ産業	602,900	2,033.00	1,225,695,700	
ケンコーマヨネーズ	5,800	2,000.00	11,600,000	
わらべや日洋ホールディングス	6,900	1,675.00	11,557,500	
なとり	5,800	1,790.00	10,382,000	
イフジ産業	1,800	788.00	1,418,400	
ピクルスコーポレーション	2,300	2,188.00	5,032,400	
北の達人コーポレーション	36,600	533.00	19,507,800	
ユーグレナ	45,300	666.00	30,169,800	
スター・マイカ・ホールディングス	5,400	1,526.00	8,240,400	
A Dワークスグループ	18,800	178.00	3,346,400	
片倉工業	14,900	1,047.00	15,600,300	
グンゼ	7,500	3,775.00	28,312,500	
ヒューリック	219,200	1,039.00	227,748,800	
神栄	1,700	539.00	916,300	
ラサ商事	5,600	842.00	4,715,200	
アルペン	7,900	1,657.00	13,090,300	
ハブ	3,000	693.00	2,079,000	
ラクーンホールディングス	4,600	685.00	3,151,000	
クオールホールディングス	15,100	1,205.00	18,195,500	
アルコニックス	10,900	1,184.00	12,905,600	
神戸物産	35,400	5,160.00	182,664,000	
ソリトンシステムズ	4,600	1,312.00	6,035,200	
ジーンズホールディングス	5,400	6,340.00	34,236,000	
ビックカメラ	60,700	1,045.00	63,431,500	
D C Mホールディングス	56,300	1,096.00	61,704,800	
ペッパーフードサービス	8,800	511.00	4,496,800	
Monotaro	72,900	3,670.00	267,543,000	

東京一番フーズ	2,800	476.00	1,332,800
DDホールディングス	4,200	985.00	4,137,000
あいホールディングス	14,700	1,418.00	20,844,600
ディーブイエックス	3,700	915.00	3,385,500
きちりホールディングス	2,800	609.00	1,705,200
アークランドサービスホールディングス	7,600	1,847.00	14,037,200
J.フロントリテイリング	122,300	943.00	115,328,900
ドトール・日レスホールディングス	16,300	1,777.00	28,965,100
マツモトキヨシホールディングス	42,400	3,610.00	153,064,000
ブロンコピリー	5,400	2,209.00	11,928,600
ZOZO	70,500	1,950.00	137,475,000
トレジャー・ファクトリー	3,100	715.00	2,216,500
物語コーポレーション	2,700	7,720.00	20,844,000
ココカラファイン	10,700	4,950.00	52,965,000
三越伊勢丹ホールディングス	179,100	690.00	123,579,000
東洋紡	40,300	1,384.00	55,775,200
ユニチカ	30,400	338.00	10,275,200
富士紡ホールディングス	5,000	3,090.00	15,450,000
日清紡ホールディングス	69,300	770.00	53,361,000
倉敷紡績	10,200	2,476.00	25,255,200
ダイワボウホールディングス	8,700	7,080.00	61,596,000
シキボウ	5,500	1,058.00	5,819,000
日東紡績	15,500	5,120.00	79,360,000
トヨタ紡織	30,100	1,380.00	41,538,000
マクニカ・富士エレホールディングス	24,500	1,589.00	38,930,500
Hamee	3,700	1,404.00	5,194,800
ラクト・ジャパン	3,800	3,760.00	14,288,000
ウエルシアホールディングス	30,500	7,500.00	228,750,000
クリエイトSDホールディングス	17,300	3,075.00	53,197,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,100	1,088.00	20,780,800
八洲電機	7,900	857.00	6,770,300
メディアスホールディングス	5,800	920.00	5,336,000
レスターホールディングス	10,600	1,806.00	19,143,600
ジュテックホールディングス	2,400	1,000.00	2,400,000
丸善CHIホールディングス	11,200	381.00	4,267,200
大光	4,500	701.00	3,154,500
OCHIホールディングス	2,900	1,387.00	4,022,300
TOKAIホールディングス	54,200	958.00	51,923,600
黒谷	2,200	439.00	965,800
ミサワ	2,100	558.00	1,171,800
ティーライフ	1,500	942.00	1,413,000
Cominix	1,900	744.00	1,413,600
エー・ピーカンパニー	2,000	435.00	870,000
三洋貿易	10,500	918.00	9,639,000
チムニー	3,100	1,837.00	5,694,700
シュッピン	7,200	829.00	5,968,800
ビューティガレージ	1,800	1,712.00	3,081,600
ウイン・パートナーズ	7,400	917.00	6,785,800

ネクステージ	14,900	831.00	12,381,900
ジョイフル本田	30,000	1,282.00	38,460,000
鳥貴族	3,100	1,859.00	5,762,900
キリン堂ホールディングス	4,100	2,024.00	8,298,400
ホットランド	7,000	1,182.00	8,274,000
すかいらくホールディングス	114,900	1,778.00	204,292,200
SFPホールディングス	4,500	1,584.00	7,128,000
綿半ホールディングス	3,900	1,823.00	7,109,700
日本毛織	33,400	951.00	31,763,400
ダイトウボウ	17,100	130.00	2,223,000
トーア紡コーポレーション	4,200	490.00	2,058,000
ダイドーリミテッド	13,900	205.00	2,849,500
ヨシックス	1,700	2,113.00	3,592,100
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	29,700	1,011.00	30,026,700
三栄建築設計	4,200	1,151.00	4,834,200
野村不動産ホールディングス	62,300	1,901.00	118,432,300
三重交通グループホールディングス	20,600	497.00	10,238,200
サムティ	14,600	1,466.00	21,403,600
ディア・ライフ	13,600	439.00	5,970,400
コーセーアールイー	3,100	472.00	1,463,200
日本商業開発	6,600	1,455.00	9,603,000
プレサンスコーポレーション	17,000	1,168.00	19,856,000
フィル・カンパニー	1,500	2,864.00	4,296,000
THEグローバル社	4,900	348.00	1,705,200
ハウスコム	1,400	1,323.00	1,852,200
日本管理センター	6,900	1,074.00	7,410,600
サンセイランディック	3,100	765.00	2,371,500
エストラスト	1,500	607.00	910,500
フージャースホールディングス	20,500	622.00	12,751,000
オープンハウス	29,800	2,440.00	72,712,000
東急不動産ホールディングス	279,000	555.00	154,845,000
飯田グループホールディングス	85,500	1,475.00	126,112,500
イーグランド	1,800	659.00	1,186,200
ムゲンエステート	7,400	487.00	3,603,800
帝国繊維	11,500	2,281.00	26,231,500
日本コークス工業	89,300	60.00	5,358,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,700	512.00	2,406,400
ミタチ産業	3,000	618.00	1,854,000
B E E N O S	4,100	1,030.00	4,223,000
あさひ	7,700	1,369.00	10,541,300
日本調剤	6,200	1,680.00	10,416,000
コスモス薬品	4,500	28,020.00	126,090,000
シップヘルスケアホールディングス	16,500	4,770.00	78,705,000
トーエル	5,000	707.00	3,535,000
ソフトクリエイイトホールディングス	4,500	1,850.00	8,325,000
オンリー	1,800	584.00	1,051,200
セブン&アイ・ホールディングス	401,000	3,457.00	1,386,257,000
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	55,200	755.00	41,676,000

明治電機工業	3,200	1,291.00	4,131,200
ツルハホールディングス	22,300	13,890.00	309,747,000
デリカフーズホールディングス	3,700	623.00	2,305,100
スターティアホールディングス	2,500	591.00	1,477,500
サンマルクホールディングス	8,100	1,905.00	15,430,500
フェリシモ	2,200	980.00	2,156,000
トリドールホールディングス	25,400	1,369.00	34,772,600
帝人	83,100	1,688.00	140,272,800
東レ	737,700	509.50	375,858,150
クラレ	160,500	1,113.00	178,636,500
旭化成	675,400	766.60	517,761,640
サカイオーベックス	2,700	1,931.00	5,213,700
TOKYO BASE	9,500	378.00	3,591,000
稲葉製作所	5,800	1,369.00	7,940,200
宮地エンジニアリンググループ	3,100	1,650.00	5,115,000
トーカロ	28,700	1,126.00	32,316,200
アルファ	3,700	945.00	3,496,500
SUMCO	123,200	1,639.00	201,924,800
川田テクノロジーズ	2,100	5,100.00	10,710,000
RS Technologies	2,900	2,917.00	8,459,300
信和	4,600	724.00	3,330,400
ピーロット	5,000	684.00	3,420,000
ファーストブラザーズ	2,400	657.00	1,576,800
ハウズドゥ	5,100	895.00	4,564,500
シーアールイー	2,600	1,195.00	3,107,000
プロパティエージェント	1,700	960.00	1,632,000
ケイアイスター不動産	3,200	1,178.00	3,769,600
アグレ都市デザイン	1,800	438.00	788,400
グッドコムアセット	2,500	1,542.00	3,855,000
ジェイ・エス・ビー	2,000	2,401.00	4,802,000
テンポイノベーション	2,500	705.00	1,762,500
グローバル・リンク・マネジメント	1,800	606.00	1,090,800
住江織物	2,200	1,860.00	4,092,000
日本フェルト	6,000	467.00	2,802,000
イチカワ	1,500	1,381.00	2,071,500
エコナックホールディングス	18,700	94.00	1,757,800
日東製網	1,100	1,420.00	1,562,000
芦森工業	2,200	856.00	1,883,200
アツギ	8,600	628.00	5,400,800
ウイルプラスホールディングス	1,400	695.00	973,000
JMホールディングス	7,800	2,443.00	19,055,400
コメダホールディングス	22,400	1,811.00	40,566,400
サツドラホールディングス	1,600	2,035.00	3,256,000
アレンザホールディングス	5,100	886.00	4,518,600
串カツ田中ホールディングス	1,700	1,749.00	2,973,300
パロックジャパンリミテッド	7,300	625.00	4,562,500
クスリのアオキホールディングス	9,200	8,140.00	74,888,000
ダイニック	3,700	742.00	2,745,400
共和レザー	5,500	671.00	3,690,500
力の源ホールディングス	4,700	705.00	3,313,500

スシローグローバルホールディングス	56,300	2,030.00	114,289,000	
LIXILビバ	10,200	2,047.00	20,879,400	
アセンテック	700	3,000.00	2,100,000	
セーレン	25,100	1,306.00	32,780,600	
ソトー	4,100	917.00	3,759,700	
東海染工	1,500	1,114.00	1,671,000	
小松マテール	16,900	714.00	12,066,600	
ワコールホールディングス	26,500	2,205.00	58,432,500	
ホギメディカル	11,700	3,400.00	39,780,000	
レナウン	27,300	77.00	2,102,100	
クラウドシアホールディングス	2,600	418.00	1,086,800	
T S Iホールディングス	34,000	438.00	14,892,000	
マツオカコーポレーション	2,900	2,024.00	5,869,600	
ワールド	14,400	1,358.00	19,555,200	
T I S	102,200	2,123.00	216,970,600	
ネオス	4,300	668.00	2,872,400	
電算システム	4,000	3,215.00	12,860,000	
グリー	62,600	439.00	27,481,400	
コーエーテックモホールディングス	20,900	2,975.00	62,177,500	
三菱総合研究所	4,400	4,115.00	18,106,000	
ボルテージ	2,200	420.00	924,000	
電算	1,100	2,052.00	2,257,200	
A G S	5,800	752.00	4,361,600	
ファインデックス	8,800	901.00	7,928,800	
ブレインパッド	2,500	5,650.00	14,125,000	
K L a b	20,000	743.00	14,860,000	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,500	943.00	11,787,500	
イーブクイニシアティブジャパン	1,500	2,151.00	3,226,500	
ネクソン	284,800	1,694.00	482,451,200	
アイスタイル	29,000	310.00	8,990,000	
エムアップホールディングス	3,000	2,585.00	7,755,000	
エイチーム	7,200	780.00	5,616,000	
エニグモ	7,400	911.00	6,741,400	
テクノスジャパン	8,400	500.00	4,200,000	
e n i s h	4,800	408.00	1,958,400	
コロプラ	33,600	935.00	31,416,000	
オルトプラス	6,400	430.00	2,752,000	
ブロードリーフ	51,000	539.00	27,489,000	
クロス・マーケティンググループ	4,500	310.00	1,395,000	
デジタルハーツホールディングス	5,500	765.00	4,207,500	
システム情報	5,400	903.00	4,876,200	
メディアドゥホールディングス	3,200	3,910.00	12,512,000	
じげん	25,900	357.00	9,246,300	
ブイキューブ	6,300	1,128.00	7,106,400	
エンカレッジ・テクノロジー	1,800	889.00	1,600,200	
サイバーリンクス	1,700	1,298.00	2,206,600	
ディー・エル・イー	8,700	131.00	1,139,700	
フィックスターズ	11,000	1,300.00	14,300,000	
C A R T A H O L D I N G S	4,900	875.00	4,287,500	

オブティム	5,400	2,152.00	11,620,800
セレス	3,400	875.00	2,975,000
S H I F T	4,100	8,360.00	34,276,000
特種東海製紙	6,500	4,115.00	26,747,500
ティーガイア	9,000	2,208.00	19,872,000
セック	1,600	3,715.00	5,944,000
日本アジアグループ	11,000	250.00	2,750,000
テクマトリックス	7,300	2,732.00	19,943,600
プロシップ	2,900	1,243.00	3,604,700
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	24,600	1,699.00	41,795,400
GMOペイメントゲートウェイ	21,600	10,150.00	219,240,000
ザッパラス	4,600	346.00	1,591,600
システムリサーチ	2,700	1,770.00	4,779,000
インターネットイニシアティブ	15,100	3,805.00	57,455,500
さくらインターネット	11,200	588.00	6,585,600
ヴィンクス	2,900	1,107.00	3,210,300
GMOクラウド	1,900	3,305.00	6,279,500
SRAホールディングス	5,500	2,231.00	12,270,500
システムインテグレータ	3,400	746.00	2,536,400
朝日ネット	7,300	969.00	7,073,700
eBASE	12,300	1,056.00	12,988,800
アバント	7,400	996.00	7,370,400
アドソル日進	3,700	2,570.00	9,509,000
フリービット	5,400	834.00	4,503,600
コムチュア	11,500	2,223.00	25,564,500
サイバーコム	1,900	1,915.00	3,638,500
アステリア	6,500	458.00	2,977,000
アイル	5,700	1,711.00	9,752,700
王子ホールディングス	425,900	586.00	249,577,400
日本製紙	44,800	1,575.00	70,560,000
三菱製紙	11,700	385.00	4,504,500
北越コーポレーション	60,400	431.00	26,032,400
中越パルプ工業	4,300	1,365.00	5,869,500
巴川製紙所	3,000	876.00	2,628,000
大王製紙	44,900	1,472.00	66,092,800
阿波製紙	2,700	512.00	1,382,400
マークラインズ	5,100	1,787.00	9,113,700
メディカル・データ・ビジョン	7,900	832.00	6,572,800
gumi	13,300	765.00	10,174,500
ショーケース	2,500	542.00	1,355,000
モバイルファクトリー	2,400	1,116.00	2,678,400
テラスカイ	3,700	2,617.00	9,682,900
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4,200	1,395.00	5,859,000
PCIホールディングス	4,200	913.00	3,834,600
パイブドHD	1,400	1,567.00	2,193,800
アイビーシー	1,900	986.00	1,873,400
ネオジャパン	2,000	1,256.00	2,512,000
P R T I M E S	900	2,360.00	2,124,000

ランドコンピュータ	1,600	1,100.00	1,760,000
ダブルスタンダード	1,400	4,250.00	5,950,000
オープンドア	5,100	1,166.00	5,946,600
マイネット	3,400	910.00	3,094,000
アカツキ	3,600	4,300.00	15,480,000
ベネフィットジャパン	700	1,641.00	1,148,700
Ubicomホールディングス	2,400	1,342.00	3,220,800
L I N E	23,400	5,310.00	124,254,000
カナミックネットワーク	6,300	744.00	4,687,200
ノムラシステムコーポレーション	2,400	394.00	945,600
レンゴー	96,300	877.00	84,455,100
トモク	6,200	1,772.00	10,986,400
ザ・バック	7,700	3,335.00	25,679,500
チェンジ	3,600	4,260.00	15,336,000
シンクロ・フード	4,500	314.00	1,413,000
オークネット	6,300	1,090.00	6,867,000
セグエグループ	1,800	892.00	1,605,600
エイトレッド	1,400	1,929.00	2,700,600
A O I T Y O H O L D I N G S	10,500	466.00	4,893,000
マクロミル	21,100	723.00	15,255,300
ビーグリー	2,000	1,473.00	2,946,000
オロ	2,700	3,255.00	8,788,500
ユーザーローカル	1,000	3,030.00	3,030,000
テモナ	1,500	729.00	1,093,500
ニーズウェル	1,500	668.00	1,002,000
サインポスト	1,700	1,490.00	2,533,000
昭和電工	72,600	2,357.00	171,118,200
住友化学	748,300	340.00	254,422,000
住友精化	4,600	2,984.00	13,726,400
日産化学	56,600	4,045.00	228,947,000
ラサ工業	3,700	1,371.00	5,072,700
クレハ	8,700	4,430.00	38,541,000
多木化学	4,000	5,660.00	22,640,000
テイカ	7,500	1,589.00	11,917,500
石原産業	18,300	681.00	12,462,300
片倉コープアグリ	2,600	1,175.00	3,055,000
日本曹達	15,100	2,822.00	42,612,200
東ソー	157,500	1,345.00	211,837,500
トクヤマ	29,400	2,351.00	69,119,400
セントラル硝子	20,700	1,896.00	39,247,200
東亜合成	64,000	1,003.00	64,192,000
大阪ソーダ	10,400	2,500.00	26,000,000
関東電化工業	24,300	899.00	21,845,700
デンカ	37,300	2,677.00	99,852,100
イビデン	63,800	2,854.00	182,085,200
信越化学工業	175,000	12,120.00	2,121,000,000
日本カーバイド工業	3,500	1,125.00	3,937,500
堺化学工業	6,600	1,863.00	12,295,800
第一稀元素化学工業	11,200	760.00	8,512,000
エア・ウォーター	94,800	1,514.00	143,527,200

大陽日酸	98,000	1,661.00	162,778,000
日本化学工業	3,100	2,379.00	7,374,900
東邦アセチレン	1,600	1,285.00	2,056,000
日本パーカラライジング	51,400	1,146.00	58,904,400
高压ガス工業	16,300	789.00	12,860,700
チタン工業	1,400	1,757.00	2,459,800
四国化成工業	15,700	1,075.00	16,877,500
戸田工業	2,500	1,399.00	3,497,500
ステラ ケミファ	5,600	2,382.00	13,339,200
保土谷化学工業	3,800	3,685.00	14,003,000
日本触媒	15,800	5,130.00	81,054,000
大日精化工業	9,100	2,357.00	21,448,700
カネカ	26,300	2,847.00	74,876,100
協和キリン	104,700	2,582.00	270,335,400
三菱瓦斯化学	94,800	1,350.00	127,980,000
三井化学	92,500	2,133.00	197,302,500
J S R	95,000	1,986.00	188,670,000
東京応化工業	17,500	4,580.00	80,150,000
大阪有機化学工業	9,500	1,757.00	16,691,500
三菱ケミカルホールディングス	681,100	621.70	423,439,870
K Hネオケム	18,000	1,997.00	35,946,000
ダイセル	132,600	887.00	117,616,200
住友ベークライト	16,100	2,887.00	46,480,700
積水化学工業	219,000	1,438.00	314,922,000
日本ゼオン	91,900	968.00	88,959,200
アイカ工業	30,600	3,020.00	92,412,000
宇部興産	51,300	1,832.00	93,981,600
積水樹脂	18,300	2,273.00	41,595,900
タキロンシーアイ	22,100	643.00	14,210,300
旭有機材	5,800	1,350.00	7,830,000
日立化成	44,700	4,610.00	206,067,000
ニチバン	5,400	1,451.00	7,835,400
リケンテクノス	26,000	429.00	11,154,000
大倉工業	4,800	1,588.00	7,622,400
積水化成成品工業	13,700	644.00	8,822,800
群栄化学工業	2,300	2,646.00	6,085,800
タイガースポリマー	5,500	426.00	2,343,000
ミライアル	3,600	1,149.00	4,136,400
ダイキアクシス	3,700	748.00	2,767,600
ダイキョーニシカワ	21,300	570.00	12,141,000
竹本容器	3,700	769.00	2,845,300
森六ホールディングス	5,400	1,529.00	8,256,600
日本化薬	63,100	1,038.00	65,497,800
カーリットホールディングス	11,200	508.00	5,689,600
E P S ホールディングス	13,500	1,130.00	15,255,000
ソルクシーズ	4,500	678.00	3,051,000
レグス	2,600	945.00	2,457,000
プレステージ・インターナショナル	37,500	870.00	32,625,000
フェイス	3,700	635.00	2,349,500
プロトコーポレーション	9,300	971.00	9,030,300

ハイマックス	1,100	1,953.00	2,148,300
アミューズ	5,400	2,279.00	12,306,600
野村総合研究所	144,800	2,557.00	370,253,600
ドリームインキュベータ	3,000	1,301.00	3,903,000
サイバネットシステム	7,500	679.00	5,092,500
クイック	6,200	1,091.00	6,764,200
T A C	6,300	203.00	1,278,900
C Eホールディングス	6,100	418.00	2,549,800
ケネディクス	93,100	503.00	46,829,300
日本システム技術	1,700	1,270.00	2,159,000
電通グループ	102,600	2,358.00	241,930,800
インテージホールディングス	12,800	810.00	10,368,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	698.00	2,722,200
東邦システムサイエンス	2,700	924.00	2,494,800
ぴあ	2,900	3,330.00	9,657,000
イオンファンタジー	3,900	1,978.00	7,714,200
ソースネクスト	48,900	339.00	16,577,100
シーティーエス	11,300	696.00	7,864,800
ネクシィーズグループ	3,200	1,062.00	3,398,400
インフォコム	11,200	2,583.00	28,929,600
メディカルシステムネットワーク	10,100	470.00	4,747,000
日本精化	8,300	1,350.00	11,205,000
扶桑化学工業	10,400	3,430.00	35,672,000
トリケミカル研究所	2,300	9,600.00	22,080,000
HEROZ	1,500	3,735.00	5,602,500
ラクスル	8,200	2,725.00	22,345,000
F I G	11,500	263.00	3,024,500
システムサポート	700	2,990.00	2,093,000
A D E K A	46,800	1,427.00	66,783,600
日油	38,400	3,560.00	136,704,000
ミヨシ油脂	4,200	1,140.00	4,788,000
新日本理化	17,500	184.00	3,220,000
ハリマ化成グループ	8,500	954.00	8,109,000
イーソル	3,700	1,303.00	4,821,100
アルテリア・ネットワークス	11,400	2,138.00	24,373,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,000	1,014.00	2,028,000
花王	249,200	8,450.00	2,105,740,000
第一工業製薬	3,800	4,755.00	18,069,000
石原ケミカル	2,800	1,911.00	5,350,800
日華化学	3,400	898.00	3,053,200
ニイタカ	1,700	2,759.00	4,690,300
三洋化成工業	6,100	4,380.00	26,718,000
武田薬品工業	865,700	3,764.00	3,258,494,800
アステラス製薬	902,100	1,805.00	1,628,290,500
大日本住友製薬	77,100	1,519.00	117,114,900
塩野義製薬	133,100	5,636.00	750,151,600
わかもと製薬	12,500	240.00	3,000,000
あすか製薬	11,900	1,126.00	13,399,400
日本新薬	27,200	7,090.00	192,848,000

ビオフェルミン製薬	1,800	2,353.00	4,235,400	
中外製薬	108,500	12,725.00	1,380,662,500	
科研製薬	17,800	5,760.00	102,528,000	
エーザイ	124,600	7,440.00	927,024,000	
理研ビタミン	9,700	2,138.00	20,738,600	
ロート製薬	53,400	3,050.00	162,870,000	
小野薬品工業	239,000	2,631.50	628,928,500	
久光製薬	27,500	5,060.00	139,150,000	
有機合成薬品工業	8,000	355.00	2,840,000	
持田製薬	14,400	4,165.00	59,976,000	
参天製薬	193,900	1,916.00	371,512,400	
扶桑薬品工業	3,700	2,370.00	8,769,000	
日本ケミファ	1,400	2,573.00	3,602,200	
ツムラ	32,200	2,950.00	94,990,000	
日医工	29,600	1,454.00	43,038,400	
テルモ	294,500	3,511.00	1,033,989,500	
みらかホールディングス	27,800	3,050.00	84,790,000	
キッセイ薬品工業	18,400	2,612.00	48,060,800	
生化学工業	20,100	1,114.00	22,391,400	
栄研化学	18,400	1,840.00	33,856,000	
日水製薬	4,500	1,238.00	5,571,000	
鳥居薬品	6,500	2,969.00	19,298,500	
JCRファーマ	7,300	10,720.00	78,256,000	
東和薬品	13,300	2,290.00	30,457,000	
富士製薬工業	7,200	1,153.00	8,301,600	
沢井製薬	21,400	6,060.00	129,684,000	
ゼリア新薬工業	18,800	2,063.00	38,784,400	
第一三共	297,800	7,635.00	2,273,703,000	
キョーリン製薬ホールディングス	23,000	2,240.00	51,520,000	
大幸薬品	12,600	1,706.00	21,495,600	
ダイト	6,300	3,995.00	25,168,500	
大塚ホールディングス	198,200	4,242.00	840,764,400	
大正製薬ホールディングス	22,000	6,820.00	150,040,000	
ペプチドリーム	52,900	4,260.00	225,354,000	
大日本塗料	11,600	967.00	11,217,200	
日本ペイントホールディングス	84,100	6,500.00	546,650,000	
関西ペイント	114,500	2,105.00	241,022,500	
神東塗料	8,600	183.00	1,573,800	
中国塗料	29,100	808.00	23,512,800	
日本特殊塗料	7,700	927.00	7,137,900	
藤倉化成	13,800	506.00	6,982,800	
太陽ホールディングス	7,500	4,445.00	33,337,500	
DIC	43,000	2,509.00	107,887,000	
サカティンクス	22,300	993.00	22,143,900	
東洋インキSCホールディングス	21,400	1,993.00	42,650,200	
T&K TOKA	7,900	726.00	5,735,400	
アルプス技研	8,900	1,812.00	16,126,800	
サニックス	17,900	317.00	5,674,300	
ダイオーズ	1,900	1,092.00	2,074,800	
日本空調サービス	10,600	719.00	7,621,400	

オリエンタルランド	105,700	14,280.00	1,509,396,000	
フォーカスシステムズ	6,600	801.00	5,286,600	
ダスキン	24,800	2,779.00	68,919,200	
パーク24	55,100	1,877.00	103,422,700	
明光ネットワークジャパン	12,100	827.00	10,006,700	
ファルコホールディングス	5,500	1,600.00	8,800,000	
クレスコ	6,300	1,480.00	9,324,000	
フジ・メディア・ホールディングス	98,200	1,112.00	109,198,400	
秀英予備校	2,100	425.00	892,500	
田谷	1,900	510.00	969,000	
ラウンドワン	27,900	952.00	26,560,800	
リゾートトラスト	45,500	1,210.00	55,055,000	
オービック	35,400	16,870.00	597,198,000	
ジャストシステム	16,600	6,870.00	114,042,000	
TDCソフト	9,100	860.00	7,826,000	
Zホールディングス	1,402,500	437.00	612,892,500	
ビー・エム・エル	12,800	3,040.00	38,912,000	
ワタベウェディング	1,900	389.00	739,100	
トレンドマイクロ	45,500	5,370.00	244,335,000	
りらいあコミュニケーションズ	18,200	1,198.00	21,803,600	
IDホールディングス	4,000	1,520.00	6,080,000	
リソー教育	45,700	283.00	12,933,100	
日本オラクル	20,700	12,030.00	249,021,000	
早稲田アカデミー	3,400	1,000.00	3,400,000	
アルファシステムズ	3,100	3,505.00	10,865,500	
フューチャー	12,400	1,632.00	20,236,800	
CAC Holdings	6,800	1,187.00	8,071,600	
SBテクノロジー	3,700	2,620.00	9,694,000	
トーセ	2,800	781.00	2,186,800	
ユー・エス・エス	111,400	1,759.00	195,952,600	
オービックビジネスコンサルタント	10,500	5,050.00	53,025,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	46,600	3,350.00	156,110,000	
アイティフォー	12,500	708.00	8,850,000	
東京個別指導学院	3,700	586.00	2,168,200	
東計電算	1,600	3,895.00	6,232,000	
サイバーエージェント	61,300	4,435.00	271,865,500	
楽天	463,600	993.00	460,354,800	
エクスネット	1,700	981.00	1,667,700	
クリーク・アンド・リバー社	5,100	1,008.00	5,140,800	
テー・オー・ダブリュー	16,200	308.00	4,989,600	
大塚商会	55,300	4,780.00	264,334,000	
サイボウズ	12,000	2,164.00	25,968,000	
ソフトブレーン	6,200	464.00	2,876,800	
山田コンサルティンググループ	4,900	1,196.00	5,860,400	
セントラルスポーツ	3,700	2,490.00	9,213,000	
パラカ	2,700	1,675.00	4,522,500	
電通国際情報サービス	6,400	4,515.00	28,896,000	
ACCESS	9,600	885.00	8,496,000	
デジタルガレージ	18,400	3,995.00	73,508,000	
イーエムシステムズ	14,500	798.00	11,571,000	

ウェザーニューズ	3,500	3,875.00	13,562,500	
C I J	7,200	808.00	5,817,600	
ビジネスエンジニアリング	1,100	2,566.00	2,822,600	
日本エンタープライズ	10,900	235.00	2,561,500	
WOWOW	4,800	2,533.00	12,158,400	
スカラ	7,100	562.00	3,990,200	
インテリジェント ウェイブ	4,600	619.00	2,847,400	
フルキャストホールディングス	10,100	1,539.00	15,543,900	
エン・ジャパン	17,700	2,646.00	46,834,200	
富士フイルムホールディングス	199,500	5,213.00	1,039,993,500	
コニカミノルタ	227,400	406.00	92,324,400	
資生堂	206,800	6,503.00	1,344,820,400	
ライオン	135,400	2,335.00	316,159,000	
高砂香料工業	6,500	2,211.00	14,371,500	
マンダム	23,400	2,129.00	49,818,600	
ミルボン	13,900	4,930.00	68,527,000	
ファンケル	42,100	2,867.00	120,700,700	
コーセー	19,600	13,440.00	263,424,000	
コタ	6,000	1,199.00	7,194,000	
シーボン	1,500	2,175.00	3,262,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	44,400	1,975.00	87,690,000	
ノエビアホールディングス	8,800	5,030.00	44,264,000	
アジュバンコスメジャパン	2,400	947.00	2,272,800	
エステー	6,700	1,559.00	10,445,300	
アグロ カネショウ	3,200	1,444.00	4,620,800	
コニシ	17,100	1,492.00	25,513,200	
長谷川香料	18,000	2,118.00	38,124,000	
星光PMC	6,100	668.00	4,074,800	
小林製薬	29,200	9,720.00	283,824,000	
荒川化学工業	9,400	1,360.00	12,784,000	
メック	7,200	1,713.00	12,333,600	
日本高純度化学	2,900	2,657.00	7,705,300	
タカラパイオ	27,300	2,494.00	68,086,200	
J C U	12,600	2,926.00	36,867,600	
新田ゼラチン	6,700	703.00	4,710,100	
O A T アグリオ	1,900	1,075.00	2,042,500	
デクセリアルズ	27,000	745.00	20,115,000	
アース製薬	7,900	6,120.00	48,348,000	
北興化学工業	10,800	574.00	6,199,200	
大成ラミック	3,400	2,670.00	9,078,000	
クミアイ化学工業	43,100	850.00	36,635,000	
日本農薬	18,700	435.00	8,134,500	
富士興産	3,100	413.00	1,280,300	
ニチレキ	12,400	1,484.00	18,401,600	
ユシロ化学工業	5,800	1,151.00	6,675,800	
ピーピー・カストロール	3,700	1,177.00	4,354,900	
富士石油	28,600	177.00	5,062,200	
MORESCO	3,900	939.00	3,662,100	
出光興産	115,400	2,464.00	284,345,600	
J X T Gホールディングス	1,564,800	381.10	596,345,280	

コスモエネルギーホールディングス	30,100	1,607.00	48,370,700
横浜ゴム	60,200	1,405.00	84,581,000
TOYO TIRE	59,800	1,299.00	77,680,200
ブリヂストン	299,700	3,422.00	1,025,573,400
住友ゴム工業	93,200	1,054.00	98,232,800
藤倉コンポジット	8,900	373.00	3,319,700
オカモト	6,300	4,275.00	26,932,500
アキレス	7,300	1,639.00	11,964,700
フコク	4,600	619.00	2,847,400
ニッタ	11,700	2,099.00	24,558,300
クリエートメディック	3,400	990.00	3,366,000
住友理工	20,000	578.00	11,560,000
三ツ星ベルト	13,700	1,502.00	20,577,400
バンドー化学	18,300	658.00	12,041,400
A G C	102,900	2,750.00	282,975,000
日本板硝子	50,000	380.00	19,000,000
石塚硝子	2,000	2,139.00	4,278,000
有沢製作所	16,700	796.00	13,293,200
日本山村硝子	4,300	866.00	3,723,800
日本電気硝子	41,800	1,622.00	67,799,600
オハラ	4,200	929.00	3,901,800
住友大阪セメント	19,700	3,675.00	72,397,500
太平洋セメント	65,800	2,263.00	148,905,400
リソルホールディングス	1,000	3,435.00	3,435,000
日本ヒューム	10,600	659.00	6,985,400
日本コンクリート工業	22,700	262.00	5,947,400
三谷セキサン	4,800	4,800.00	23,040,000
アジアパイルホールディングス	14,900	434.00	6,466,600
東海カーボン	109,100	867.00	94,589,700
日本カーボン	5,400	3,410.00	18,414,000
東洋炭素	6,100	1,569.00	9,570,900
ノリタケカンパニーリミテド	5,700	3,585.00	20,434,500
T O T O	74,300	4,000.00	297,200,000
日本碍子	124,900	1,430.00	178,607,000
日本特殊陶業	79,100	1,644.00	130,040,400
ダントーホールディングス	8,400	86.00	722,400
M A R U W A	4,000	7,840.00	31,360,000
品川リフラクトリーズ	2,700	2,317.00	6,255,900
黒崎播磨	2,100	4,025.00	8,452,500
ヨータイ	8,500	605.00	5,142,500
イソライト工業	5,500	464.00	2,552,000
東京窯業	12,800	300.00	3,840,000
ニッカトー	4,800	601.00	2,884,800
フジインコーポレーテッド	9,300	3,065.00	28,504,500
クニミネ工業	4,300	1,059.00	4,553,700
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,191.00	2,143,800
ニチアス	28,500	2,220.00	63,270,000
日本製鉄	460,200	983.50	452,606,700
神戸製鋼所	187,900	376.00	70,650,400
中山製鋼所	13,900	384.00	5,337,600

合同製鐵	5,600	2,080.00	11,648,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	277,600	748.00	207,644,800	
東京製鐵	50,200	776.00	38,955,200	
共英製鋼	11,600	1,417.00	16,437,200	
大和工業	21,900	2,172.00	47,566,800	
東京鐵鋼	4,300	1,263.00	5,430,900	
大阪製鐵	5,400	1,237.00	6,679,800	
淀川製鋼所	13,800	1,770.00	24,426,000	
丸一鋼管	33,400	2,525.00	84,335,000	
モリ工業	3,100	2,378.00	7,371,800	
大同特殊鋼	16,800	3,635.00	61,068,000	
日本高周波鋼業	4,100	384.00	1,574,400	
日本冶金工業	8,600	1,775.00	15,265,000	
山陽特殊製鋼	7,000	1,050.00	7,350,000	
愛知製鋼	5,700	2,846.00	16,222,200	
日立金属	110,900	1,072.00	118,884,800	
日本金属	2,400	649.00	1,557,600	
大平洋金属	7,000	1,654.00	11,578,000	
新日本電工	67,000	157.00	10,519,000	
栗本鐵工所	5,100	1,850.00	9,435,000	
虹 技	1,500	1,157.00	1,735,500	
日本鑄鉄管	1,000	1,337.00	1,337,000	
日本製鋼所	31,300	1,367.00	42,787,100	
三菱製鋼	7,700	751.00	5,782,700	
日亜鋼業	15,100	273.00	4,122,300	
日本精線	1,700	2,968.00	5,045,600	
エンビプロ・ホールディングス	4,500	594.00	2,673,000	
大紀アルミニウム工業所	16,800	590.00	9,912,000	
日本軽金属ホールディングス	260,600	174.00	45,344,400	
三井金属鉱業	27,800	2,139.00	59,464,200	
東邦亜鉛	5,400	1,444.00	7,797,600	
三菱マテリアル	67,900	2,275.00	154,472,500	
住友金属鉱山	131,600	2,868.00	377,428,800	
DOWAホールディングス	26,100	3,120.00	81,432,000	
古河機械金属	18,200	1,090.00	19,838,000	
エス・サイエンス	47,500	39.00	1,852,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,800	998.00	10,778,400	
東邦チタニウム	18,500	637.00	11,784,500	
UACJ	15,600	1,785.00	27,846,000	
CKサンエツ	2,200	2,995.00	6,589,000	
古河電気工業	31,900	2,081.00	66,383,900	
住友電気工業	384,400	1,134.00	435,909,600	
フジクラ	124,500	329.00	40,960,500	
昭和電線ホールディングス	12,000	1,216.00	14,592,000	
東京特殊電線	1,600	2,461.00	3,937,600	
タツタ電線	20,700	549.00	11,364,300	
カナレ電気	1,800	1,650.00	2,970,000	
平河ヒューテック	4,100	1,069.00	4,382,900	
リョービ	12,600	1,331.00	16,770,600	

アーレスティ	13,500	394.00	5,319,000
アサヒホールディングス	18,100	2,638.00	47,747,800
東洋製罐グループホールディングス	65,500	1,111.00	72,770,500
ホッカンホールディングス	5,600	1,572.00	8,803,200
コロナ	5,600	980.00	5,488,000
横河ブリッジホールディングス	19,200	1,880.00	36,096,000
OSJBホールディングス	51,900	251.00	13,026,900
駒井ハルテック	2,000	1,535.00	3,070,000
高田機工	900	2,260.00	2,034,000
三和ホールディングス	97,000	860.00	83,420,000
文化シャッター	30,400	808.00	24,563,200
三協立山	13,300	927.00	12,329,100
アルインコ	7,500	948.00	7,110,000
東洋シャッター	2,600	700.00	1,820,000
LIXILグループ	151,800	1,401.00	212,671,800
日本フィルコン	7,800	524.00	4,087,200
ノーリツ	21,300	1,268.00	27,008,400
長府製作所	10,500	2,346.00	24,633,000
リンナイ	20,000	8,800.00	176,000,000
ユニプレス	20,100	992.00	19,939,200
ダイニチ工業	5,600	696.00	3,897,600
日東精工	14,500	474.00	6,873,000
三洋工業	1,500	1,882.00	2,823,000
岡部	20,800	788.00	16,390,400
ジーテクト	12,700	1,136.00	14,427,200
東プレ	19,200	1,334.00	25,612,800
高周波熱錬	19,800	599.00	11,860,200
東京製綱	7,500	570.00	4,275,000
サンコール	5,700	412.00	2,348,400
モリテックスチール	8,400	291.00	2,444,400
パイオラックス	15,200	1,633.00	24,821,600
エイチワン	10,300	566.00	5,829,800
日本発条	110,300	730.00	80,519,000
中央発條	1,200	2,752.00	3,302,400
アドパネクス	1,500	1,371.00	2,056,500
三浦工業	44,600	4,440.00	198,024,000
タクマ	34,900	1,230.00	42,927,000
テクノプロ・ホールディングス	19,900	6,320.00	125,768,000
アトラ	2,700	269.00	726,300
インターワークス	2,000	397.00	794,000
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	6,630.00	27,183,000
KeepPer 技研	3,700	1,586.00	5,868,200
ファーストロジック	2,100	567.00	1,190,700
三機サービス	2,000	1,153.00	2,306,000
Gunosy	6,300	955.00	6,016,500
デザインワン・ジャパン	2,400	219.00	525,600
イー・ガーディアン	4,500	1,988.00	8,946,000
リブセンス	6,700	282.00	1,889,400
ジャパンマテリアル	30,600	1,547.00	47,338,200

ベクトル	12,600	777.00	9,790,200
ウチヤマホールディングス	5,000	353.00	1,765,000
チャーム・ケア・コーポレーション	8,600	917.00	7,886,200
ライクキッズ	1,800	653.00	1,175,400
キャリアリンク	3,200	501.00	1,603,200
I B J	7,100	880.00	6,248,000
アサンテ	4,200	1,562.00	6,560,400
N・フィールド	7,100	516.00	3,663,600
パリュール	4,000	1,460.00	5,840,000
M&Aキャピタルパートナーズ	8,100	3,315.00	26,851,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,443.00	5,627,700
E R Iホールディングス	2,900	676.00	1,960,400
アピスト	1,700	2,148.00	3,651,600
シグマクシス	6,900	1,657.00	11,433,300
ウィルグループ	6,700	691.00	4,629,700
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	198.00	2,811,600
リクルートホールディングス	712,400	3,312.00	2,359,468,800
エラン	5,900	1,760.00	10,384,000
ツガミ	21,500	1,023.00	21,994,500
オークマ	12,000	4,410.00	52,920,000
芝浦機械	11,700	2,209.00	25,845,300
アマダ	127,500	981.00	125,077,500
アイダエンジニアリング	26,900	731.00	19,663,900
滝澤鉄工所	3,200	1,084.00	3,468,800
F U J I	44,300	1,792.00	79,385,600
牧野フライス製作所	12,100	3,450.00	41,745,000
オーエスジー	47,700	1,462.00	69,737,400
ダイジェット工業	1,100	1,241.00	1,365,100
旭ダイヤモンド工業	27,200	503.00	13,681,600
D M G 森精機	65,200	1,205.00	78,566,000
ソディック	24,300	787.00	19,124,100
ディスコ	13,900	25,060.00	348,334,000
日東工器	5,600	1,987.00	11,127,200
日進工具	4,100	2,785.00	11,418,500
パンチ工業	9,600	365.00	3,504,000
富士ダイス	4,600	598.00	2,750,800
土木管理総合試験所	4,600	334.00	1,536,400
ネットマーケティング	2,900	725.00	2,102,500
日本郵政	814,200	866.40	705,422,880
ベルシステム24ホールディングス	16,800	1,272.00	21,369,600
鎌倉新書	7,600	1,137.00	8,641,200
S M N	1,700	891.00	1,514,700
一蔵	1,400	389.00	544,600
L I T A L I C O	3,400	2,410.00	8,194,000
グローバルキッズCOMPANY	1,600	665.00	1,064,000
エアトリ	4,600	1,080.00	4,968,000
アトラエ	2,600	2,758.00	7,170,800
ストライク	3,700	4,360.00	16,132,000
ソラスト	27,500	1,162.00	31,955,000

セラク	3,100	924.00	2,864,400
インソース	4,200	2,680.00	11,256,000
豊田自動織機	84,100	5,510.00	463,391,000
豊和工業	5,800	723.00	4,193,400
OKK	4,400	494.00	2,173,600
石川製作所	2,600	1,463.00	3,803,800
東洋機械金属	7,500	414.00	3,105,000
津田駒工業	2,000	806.00	1,612,000
エンシュウ	2,600	1,027.00	2,670,200
島精機製作所	16,200	1,668.00	27,021,600
オプトラン	11,500	3,090.00	35,535,000
NCホールディングス	3,200	539.00	1,724,800
イワキ	4,900	987.00	4,836,300
フリー	10,300	890.00	9,167,000
ヤマシンフィルタ	22,500	861.00	19,372,500
日阪製作所	12,600	735.00	9,261,000
やまびこ	19,900	871.00	17,332,900
平田機工	4,900	5,380.00	26,362,000
ペガサスミシン製造	10,600	336.00	3,561,600
マルマエ	3,900	894.00	3,486,600
タツモ	4,800	1,248.00	5,990,400
ナブテスコ	60,700	3,300.00	200,310,000
三井海洋開発	11,000	1,669.00	18,359,000
レオン自動機	10,100	1,322.00	13,352,200
SMC	32,600	51,120.00	1,666,512,000
ホソカワミクロン	3,600	5,110.00	18,396,000
ユニオンツール	3,800	2,866.00	10,890,800
オイレス工業	13,300	1,374.00	18,274,200
日精エー・エス・ビー機械	3,000	3,080.00	9,240,000
サトーホールディングス	14,700	2,300.00	33,810,000
技研製作所	9,100	4,070.00	37,037,000
日本エアテック	3,200	1,150.00	3,680,000
カワタ	3,000	751.00	2,253,000
日精樹脂工業	8,700	970.00	8,439,000
オカダアイヨン	3,400	885.00	3,009,000
ワイエイシイホールディングス	4,600	461.00	2,120,600
小松製作所	471,300	2,099.00	989,258,700
住友重機械工業	59,500	2,322.00	138,159,000
日立建機	41,700	2,599.00	108,378,300
日工	14,300	586.00	8,379,800
巴工業	4,400	1,894.00	8,333,600
井関農機	10,400	1,202.00	12,500,800
TOWA	10,600	959.00	10,165,400
丸山製作所	2,300	1,347.00	3,098,100
北川鉄工所	4,700	1,640.00	7,708,000
シンニッタン	16,600	269.00	4,465,400
ローツェ	4,600	4,795.00	22,057,000
タカキタ	3,700	532.00	1,968,400
クボタ	552,000	1,365.00	753,480,000
荏原実業	2,700	2,259.00	6,099,300

東洋エンジニアリング	13,800	387.00	5,340,600
三菱化工機	3,700	1,600.00	5,920,000
月島機械	19,100	1,255.00	23,970,500
帝国電機製作所	8,700	1,305.00	11,353,500
東京機械製作所	4,500	245.00	1,102,500
新東工業	24,700	779.00	19,241,300
澁谷工業	9,100	2,685.00	24,433,500
アイチコーポレーション	17,900	703.00	12,583,700
小森コーポレーション	26,200	774.00	20,278,800
鶴見製作所	8,000	1,873.00	14,984,000
住友精密工業	1,500	2,204.00	3,306,000
日本ギア工業	3,700	268.00	991,600
酒井重工業	2,000	2,105.00	4,210,000
荏原製作所	43,100	2,431.00	104,776,100
石井鐵工所	1,400	2,423.00	3,392,200
西島製作所	10,500	739.00	7,759,500
北越工業	10,800	1,026.00	11,080,800
ダイキン工業	132,600	14,050.00	1,863,030,000
オルガノ	3,700	5,860.00	21,682,000
トーヨーカネツ	4,600	1,941.00	8,928,600
栗田工業	56,300	3,080.00	173,404,000
椿本チエイン	14,800	2,624.00	38,835,200
大同工業	4,900	635.00	3,111,500
日機装	31,300	857.00	26,824,100
木村化工機	8,900	442.00	3,933,800
レイズネクスト	17,500	1,205.00	21,087,500
アネスト岩田	16,300	851.00	13,871,300
ダイフク	53,200	7,420.00	394,744,000
サムコ	2,600	1,871.00	4,864,600
加藤製作所	5,800	1,228.00	7,122,400
油研工業	1,800	1,413.00	2,543,400
タダノ	50,300	826.00	41,547,800
フジテック	37,800	1,587.00	59,988,600
C K D	28,600	1,876.00	53,653,600
キトー	7,900	1,124.00	8,879,600
平和	28,900	1,930.00	55,777,000
理想科学工業	9,200	1,510.00	13,892,000
SANKYO	23,100	3,030.00	69,993,000
日本金銭機械	11,700	595.00	6,961,500
マースグループホールディングス	6,500	1,704.00	11,076,000
フクシマガリレイ	6,400	3,250.00	20,800,000
オーイズミ	4,600	416.00	1,913,600
ダイコク電機	4,800	1,295.00	6,216,000
竹内製作所	17,500	1,709.00	29,907,500
アマノ	27,300	2,269.00	61,943,700
JUKI	14,700	648.00	9,525,600
サンデンホールディングス	13,800	368.00	5,078,400
蛇の目ミシン工業	9,500	447.00	4,246,500
ブラザー工業	127,000	1,924.00	244,348,000
マックス	15,900	1,657.00	26,346,300

モリタホールディングス	18,100	1,657.00	29,991,700
グローリー	26,600	2,514.00	66,872,400
新晃工業	9,700	1,401.00	13,589,700
大和冷機工業	15,100	970.00	14,647,000
セガサミーホールディングス	103,100	1,381.00	142,381,100
日本ピストンリング	3,700	1,181.00	4,369,700
リケン	4,800	2,793.00	13,406,400
T P R	13,900	1,307.00	18,167,300
ツバキ・ナカシマ	21,600	816.00	17,625,600
ホシザキ	30,400	8,380.00	254,752,000
大豊工業	8,600	558.00	4,798,800
日本精工	195,700	793.00	155,190,100
NTN	240,800	220.00	52,976,000
ジェイテクト	99,500	816.00	81,192,000
不二越	9,700	3,355.00	32,543,500
ミネベアミツミ	193,300	1,875.00	362,437,500
日本トムソン	31,000	394.00	12,214,000
THK	60,500	2,688.00	162,624,000
ユーシン精機	8,000	701.00	5,608,000
前澤給装工業	3,900	2,108.00	8,221,200
イーグル工業	12,800	726.00	9,292,800
前澤工業	7,200	353.00	2,541,600
日本ピラー工業	10,600	1,295.00	13,727,000
キッツ	42,200	710.00	29,962,000
日立製作所	500,000	3,268.00	1,634,000,000
三菱電機	1,040,300	1,362.00	1,416,888,600
富士電機	62,700	2,758.00	172,926,600
東洋電機製造	3,800	1,274.00	4,841,200
安川電機	112,000	3,520.00	394,240,000
シンフォニアテクノロジー	13,500	1,075.00	14,512,500
明電舎	19,100	1,739.00	33,214,900
オリジン	2,800	1,489.00	4,169,200
山洋電気	5,000	4,805.00	24,025,000
デンヨー	8,900	2,008.00	17,871,200
ベイカレント・コンサルティング	6,100	6,410.00	39,101,000
Orchestra Holdings	2,100	910.00	1,911,000
アイモバイル	3,100	671.00	2,080,100
キャリアインデックス	4,300	334.00	1,436,200
MS - Japan	3,200	829.00	2,652,800
船場	1,700	936.00	1,591,200
グレイステクノロジー	4,600	3,235.00	14,881,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,500	2,713.00	28,486,500
フルテック	1,500	1,280.00	1,920,000
グリーンズ	2,600	482.00	1,253,200
ツナググループ・ホールディングス	1,500	473.00	709,500
GAMEWITH	2,400	671.00	1,610,400
ソウルドアウト	1,600	2,175.00	3,480,000
MS&Consulting	1,700	607.00	1,031,900

日総工産	6,900	571.00	3,939,900
キュービーネットホールディングス	4,200	1,998.00	8,391,600
RPAホールディングス	5,700	847.00	4,827,900
三櫻工業	13,400	734.00	9,835,600
マキタ	135,700	3,450.00	468,165,000
東芝テック	13,000	3,555.00	46,215,000
芝浦メカトロニクス	1,800	2,981.00	5,365,800
マブチモーター	28,900	3,275.00	94,647,500
日本電産	250,500	6,242.00	1,563,621,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	334.00	2,171,000
トレックス・セミコンダクター	6,000	1,083.00	6,498,000
東光高岳	5,700	963.00	5,489,100
ダブル・スコープ	16,800	426.00	7,156,800
宮越ホールディングス	3,900	579.00	2,258,100
ダイヘン	11,400	3,275.00	37,335,000
ヤーマン	17,100	715.00	12,226,500
JVCケンウッド	85,200	175.00	14,910,000
ミマキエンジニアリング	9,300	420.00	3,906,000
第一精工	4,300	2,219.00	9,541,700
日新電機	24,400	1,095.00	26,718,000
大崎電気工業	20,900	524.00	10,951,600
オムロン	93,300	6,720.00	626,976,000
日東工業	15,200	1,830.00	27,816,000
I D E C	15,100	1,706.00	25,760,600
正興電機製作所	2,500	926.00	2,315,000
不二電機工業	1,500	1,251.00	1,876,500
ジーエス・ユアサ コーポレーション	34,800	1,599.00	55,645,200
サクサホールディングス	2,500	1,762.00	4,405,000
メルコホールディングス	3,600	2,617.00	9,421,200
テクノメディカ	2,400	1,881.00	4,514,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,800	501.00	901,800
日本電気	126,200	4,290.00	541,398,000
富士通	100,300	10,610.00	1,064,183,000
沖電気工業	42,100	1,087.00	45,762,700
岩崎通信機	4,600	843.00	3,877,800
電気興業	5,000	2,642.00	13,210,000
サンケン電気	11,300	2,315.00	26,159,500
ナカヨ	2,000	1,356.00	2,712,000
アイホン	5,800	1,593.00	9,239,400
ルネサスエレクトロニクス	497,500	590.00	293,525,000
セイコーエプソン	129,100	1,206.00	155,694,600
ワコム	70,100	457.00	32,035,700
アルバック	19,200	3,005.00	57,696,000
アクセル	4,500	733.00	3,298,500
E I Z O	8,100	3,565.00	28,876,500
ジャパンディスプレイ	302,700	46.00	13,924,200
日本信号	26,400	1,070.00	28,248,000
京三製作所	24,400	515.00	12,566,000
能美防災	13,700	2,075.00	28,427,500

ホーチキ	7,600	1,343.00	10,206,800
星和電機	5,200	600.00	3,120,000
エレコム	11,500	4,470.00	51,405,000
パナソニック	1,188,600	820.40	975,127,440
シャープ	120,400	1,134.00	136,533,600
アンリツ	67,000	2,205.00	147,735,000
富士通ゼネラル	28,300	1,861.00	52,666,300
ソニー	651,800	7,059.00	4,601,056,200
T D K	50,300	9,550.00	480,365,000
帝国通信工業	4,700	1,197.00	5,625,900
タムラ製作所	35,500	462.00	16,401,000
アルプスアルパイン	92,400	1,263.00	116,701,200
池上通信機	3,300	890.00	2,937,000
日本電波工業	9,500	412.00	3,914,000
鈴木	5,100	729.00	3,717,900
日本トリム	1,500	3,395.00	5,092,500
ローランド ディー . ジー .	5,800	1,419.00	8,230,200
フォスター電機	11,000	1,225.00	13,475,000
S M K	2,700	2,628.00	7,095,600
ヨコオ	6,800	2,613.00	17,768,400
ティアック	7,800	152.00	1,185,600
ホシデン	28,700	890.00	25,543,000
ヒロセ電機	16,100	12,120.00	195,132,000
日本航空電子工業	24,000	1,494.00	35,856,000
T O A	11,300	724.00	8,181,200
マクセルホールディングス	22,400	1,019.00	22,825,600
古野電気	13,400	842.00	11,282,800
ユニデンホールディングス	2,900	1,935.00	5,611,500
スミダコーポレーション	8,000	714.00	5,712,000
アイコム	5,800	2,600.00	15,080,000
リオン	4,400	2,307.00	10,150,800
本多通信工業	9,300	419.00	3,896,700
船井電機	10,600	422.00	4,473,200
横河電機	95,500	1,507.00	143,918,500
新電元工業	3,700	2,507.00	9,275,900
アズビル	65,700	2,836.00	186,325,200
東亜ディーケーケー	5,100	881.00	4,493,100
日本光電工業	43,000	3,860.00	165,980,000
チノー	3,700	1,400.00	5,180,000
共和電業	11,000	387.00	4,257,000
日本電子材料	4,200	972.00	4,082,400
堀場製作所	20,600	5,850.00	120,510,000
アドバンテスト	77,400	5,300.00	410,220,000
小野測器	4,500	500.00	2,250,000
エスベック	9,200	1,777.00	16,348,400
キーエンス	94,300	39,990.00	3,771,057,000
日置電機	5,400	3,215.00	17,361,000
シスメックス	74,400	7,450.00	554,280,000
日本マイクロニクス	18,100	924.00	16,724,400
メガチップス	9,700	1,593.00	15,452,100

OBARA GROUP	5,400	2,940.00	15,876,000
IMAGICA GROUP	8,900	386.00	3,435,400
澤藤電機	1,300	2,510.00	3,263,000
デンソー	229,100	3,865.00	885,471,500
原田工業	5,000	847.00	4,235,000
コーセル	13,900	883.00	12,273,700
イリソ電子工業	8,700	3,355.00	29,188,500
オブテックスグループ	17,100	1,304.00	22,298,400
千代田インテグレ	4,800	1,773.00	8,510,400
アイ・オー・データ機器	3,500	1,013.00	3,545,500
レーザーテック	45,700	7,610.00	347,777,000
スタンレー電気	73,200	2,488.00	182,121,600
岩崎電気	4,100	1,543.00	6,326,300
ウシオ電機	57,600	1,159.00	66,758,400
岡谷電機産業	8,500	319.00	2,711,500
ヘリオス テクノ ホールディング	10,100	337.00	3,403,700
エノモト	3,100	1,083.00	3,357,300
日本セラミック	10,700	2,032.00	21,742,400
遠藤照明	5,100	575.00	2,932,500
古河電池	7,500	567.00	4,252,500
双信電機	5,200	346.00	1,799,200
山一電機	7,600	1,563.00	11,878,800
図研	6,800	2,621.00	17,822,800
日本電子	20,500	3,430.00	70,315,000
カシオ計算機	92,100	1,695.00	156,109,500
ファナック	98,900	17,835.00	1,763,881,500
日本シイエムケイ	24,700	441.00	10,892,700
エンプラス	5,300	2,344.00	12,423,200
大真空	3,900	1,800.00	7,020,000
ローム	46,200	7,130.00	329,406,000
浜松ホトニクス	74,700	4,705.00	351,463,500
三井ハイテック	11,600	1,320.00	15,312,000
新光電気工業	34,900	1,375.00	47,987,500
京セラ	146,400	5,776.00	845,606,400
協栄産業	1,100	1,146.00	1,260,600
太陽誘電	46,300	3,140.00	145,382,000
村田製作所	305,700	6,051.00	1,849,790,700
双葉電子工業	16,600	1,016.00	16,865,600
日東電工	71,800	5,420.00	389,156,000
北陸電気工業	4,300	942.00	4,050,600
東海理化電機製作所	27,200	1,449.00	39,412,800
ニチコン	35,600	718.00	25,560,800
日本ケミコン	7,900	1,273.00	10,056,700
KOA	16,000	948.00	15,168,000
三井E&Sホールディングス	37,800	635.00	24,003,000
日立造船	82,500	362.00	29,865,000
三菱重工業	174,300	2,742.50	478,017,750
川崎重工業	80,800	1,680.00	135,744,000
IHI	75,000	1,381.00	103,575,000
名村造船所	33,700	175.00	5,897,500

サノヤスホールディングス	13,000	157.00	2,041,000	
スプリックス	2,900	968.00	2,807,200	
マネジメントソリューションズ	3,000	1,049.00	3,147,000	
カーブスホールディングス	25,100	613.00	15,386,300	
日本車輛製造	3,800	2,641.00	10,035,800	
三菱ロジスネクスト	13,800	1,072.00	14,793,600	
近畿車輛	1,700	1,114.00	1,893,800	
F P G	31,900	546.00	17,417,400	
島根銀行	2,100	488.00	1,024,800	
じもとホールディングス	70,700	93.00	6,575,100	
全国保証	28,900	3,440.00	99,416,000	
めぶきフィナンシャルグループ	533,000	232.00	123,656,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	13,900	1,044.00	14,511,600	
九州フィナンシャルグループ	224,500	439.00	98,555,500	
かんぼ生命保険	36,200	1,378.00	49,883,600	
ゆうちょ銀行	290,400	1,030.00	299,112,000	
富山第一銀行	24,400	272.00	6,636,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	585,900	326.00	191,003,400	
ジェイリース	3,000	233.00	699,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	68,200	616.00	42,011,200	
マーキュリアインベストメント	4,700	587.00	2,758,900	
イントラスト	3,700	658.00	2,434,600	
日本モーゲージサービス	2,100	1,708.00	3,586,800	
C A S A	3,700	1,200.00	4,440,000	
アルヒ	16,400	1,371.00	22,484,400	
プレミアグループ	5,600	1,770.00	9,912,000	
日産自動車	1,226,700	380.00	466,146,000	
いすゞ自動車	301,500	894.30	269,631,450	
トヨタ自動車	1,161,000	6,658.00	7,729,938,000	代用有価証券 250,000株
日野自動車	130,100	683.00	88,858,300	
三菱自動車工業	384,500	309.00	118,810,500	
エフテック	7,500	480.00	3,600,000	
レシップホールディングス	4,400	487.00	2,142,800	
G M B	1,900	663.00	1,259,700	
ファルテック	1,900	685.00	1,301,500	
武蔵精密工業	23,300	908.00	21,156,400	
日産車体	20,300	906.00	18,391,800	
新明和工業	28,000	1,114.00	31,192,000	
極東開発工業	19,300	1,234.00	23,816,200	
日信工業	21,200	2,217.00	47,000,400	
トビー工業	8,600	1,319.00	11,343,400	
ティラド	3,900	1,435.00	5,596,500	
曙ブレーキ工業	57,500	199.00	11,442,500	
タチエス	17,100	980.00	16,758,000	
N O K	55,900	1,266.00	70,769,400	
フタバ産業	29,000	506.00	14,674,000	
K Y B	11,600	2,229.00	25,856,400	

市光工業	15,800	512.00	8,089,600
大同メタル工業	20,000	556.00	11,120,000
プレス工業	51,700	259.00	13,390,300
ミクニ	13,500	262.00	3,537,000
太平洋工業	21,700	1,009.00	21,895,300
ケーヒン	24,000	2,550.00	61,200,000
河西工業	14,000	541.00	7,574,000
アイシン精機	85,700	3,225.00	276,382,500
マツダ	305,900	632.00	193,328,800
今仙電機製作所	10,000	785.00	7,850,000
本田技研工業	819,100	2,614.00	2,141,127,400
スズキ	206,300	3,603.00	743,298,900
S U B A R U	323,000	2,220.50	717,221,500
安永	5,000	1,017.00	5,085,000
ヤマハ発動機	135,600	1,442.00	195,535,200
ショーワ	24,600	2,258.00	55,546,800
小糸製作所	62,400	4,170.00	260,208,000
T B K	12,500	457.00	5,712,500
エクセディ	14,200	1,693.00	24,040,600
ミツバ	19,200	482.00	9,254,400
豊田合成	33,600	2,116.00	71,097,600
愛三工業	16,300	565.00	9,209,500
盟和産業	1,700	944.00	1,604,800
日本プラスト	8,100	467.00	3,782,700
ヨロズ	9,700	1,167.00	11,319,900
エフ・シー・シー	17,000	1,636.00	27,812,000
新家工業	2,300	1,113.00	2,559,900
シマノ	38,900	18,030.00	701,367,000
テイ・エス テック	24,100	2,934.00	70,709,400
関西みらいフィナンシャルグループ	60,000	362.00	21,720,000
三十三フィナンシャルグループ	9,500	1,517.00	14,411,500
第四北越フィナンシャルグループ	17,700	2,281.00	40,373,700
ジャムコ	5,200	691.00	3,593,200
小野建	9,100	1,187.00	10,801,700
はるやまホールディングス	4,700	777.00	3,651,900
南陽	2,200	1,451.00	3,192,200
ノジマ	18,200	1,938.00	35,271,600
佐島電機	7,100	841.00	5,971,100
カッパ・クリエイト	14,400	1,412.00	20,332,800
エコートレーディング	2,500	508.00	1,270,000
伯東	6,300	984.00	6,199,200
コンドーテック	7,900	977.00	7,718,300
中山福	5,800	473.00	2,743,400
ライトオン	7,700	532.00	4,096,400
ナガイレーベン	13,600	2,556.00	34,761,600
ジーンズメイト	3,200	242.00	774,400
三菱食品	11,100	2,575.00	28,582,500
良品計画	136,200	1,429.00	194,629,800
三城ホールディングス	11,000	270.00	2,970,000
松田産業	7,500	1,393.00	10,447,500

第一興商	15,300	3,585.00	54,850,500
メディバルホールディングス	110,500	2,094.00	231,387,000
アドヴァン	15,600	1,102.00	17,191,200
S P K	4,500	1,329.00	5,980,500
萩原電気ホールディングス	3,900	2,197.00	8,568,300
アルビス	3,900	2,065.00	8,053,500
アズワン	6,700	9,980.00	66,866,000
スズデン	3,600	1,199.00	4,316,400
尾家産業	3,000	1,440.00	4,320,000
シモジマ	6,300	1,216.00	7,660,800
ドウシシャ	9,800	1,518.00	14,876,400
小津産業	2,400	1,944.00	4,665,600
コナカ	12,000	336.00	4,032,000
高速	6,100	1,444.00	8,808,400
ハウス オブ ローゼ	1,400	1,572.00	2,200,800
G - 7ホールディングス	6,100	2,416.00	14,737,600
たけびし	3,600	1,399.00	5,036,400
イオン北海道	12,500	789.00	9,862,500
コジマ	17,700	422.00	7,469,400
ヒマラヤ	3,700	782.00	2,893,400
コーナン商事	14,600	2,694.00	39,332,400
ネットワンシステムズ	38,900	3,130.00	121,757,000
エコス	3,700	1,896.00	7,015,200
ワタミ	12,200	1,147.00	13,993,400
マルシェ	2,800	622.00	1,741,600
リックス	2,300	1,488.00	3,422,400
システムソフト	26,100	75.00	1,957,500
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	225,300	2,034.00	458,260,200
丸文	8,800	519.00	4,567,200
西松屋チェーン	22,500	867.00	19,507,500
ゼンショーホールディングス	49,100	2,307.00	113,273,700
ハピネット	8,500	1,098.00	9,333,000
幸楽苑ホールディングス	6,600	1,626.00	10,731,600
ハークスレイ	2,100	1,028.00	2,158,800
橋本総業ホールディングス	2,100	1,848.00	3,880,800
日本ライフライン	30,400	1,304.00	39,641,600
サイゼリヤ	15,300	2,375.00	36,337,500
タカショー	5,100	474.00	2,417,400
V Tホールディングス	42,900	306.00	13,127,400
マルカ	3,700	1,858.00	6,874,600
アルゴグラフィックス	8,700	3,480.00	30,276,000
魚力	2,800	1,509.00	4,225,200
I D O M	27,900	471.00	13,140,900
日本エム・ディ・エム	6,000	1,617.00	9,702,000
ポブラ	2,800	466.00	1,304,800
フジ・コーポレーション	2,700	1,873.00	5,057,100
ユナイテッドアローズ	10,800	1,789.00	19,321,200
進和	6,100	1,757.00	10,717,700
エスケイジャパン	2,200	311.00	684,200

ダイトロン	4,400	1,608.00	7,075,200
ハイデイ日高	14,800	1,812.00	26,817,600
シークス	13,200	975.00	12,870,000
京都きもの友禅	6,900	233.00	1,607,700
コロワイド	34,100	1,650.00	56,265,000
ピーシーデボコーポレーション	13,800	572.00	7,893,600
田中商事	3,200	703.00	2,249,600
オーハシテクニカ	5,800	1,480.00	8,584,000
壺番屋	7,200	4,800.00	34,560,000
白銅	3,700	1,333.00	4,932,100
トップカルチャー	3,900	304.00	1,185,600
P L A N T	2,800	605.00	1,694,000
スギホールディングス	20,500	6,270.00	128,535,000
薬王堂ホールディングス	4,500	2,648.00	11,916,000
島津製作所	124,400	2,703.00	336,253,200
J M S	8,900	836.00	7,440,400
クボテック	2,800	343.00	960,400
長野計器	7,600	814.00	6,186,400
ブイ・テクノロジー	4,900	4,215.00	20,653,500
スター精密	16,100	1,227.00	19,754,700
東京計器	6,900	767.00	5,292,300
愛知時計電機	1,400	4,415.00	6,181,000
インターアクション	5,600	2,439.00	13,658,400
オーバル	9,200	231.00	2,125,200
東京精密	18,900	3,560.00	67,284,000
マニー	41,500	2,462.00	102,173,000
ニコン	158,700	994.00	157,747,800
トプコン	52,500	878.00	46,095,000
オリンパス	575,800	1,668.00	960,434,400
理研計器	9,200	1,977.00	18,188,400
S C R E E Nホールディングス	18,100	5,350.00	96,835,000
キヤノン電子	11,000	1,571.00	17,281,000
タムロン	8,400	1,851.00	15,548,400
H O Y A	207,800	9,732.00	2,022,309,600
シード	4,500	810.00	3,645,000
ノーリツ鋼機	7,100	1,248.00	8,860,800
エー・アンド・デイ	9,600	785.00	7,536,000
朝日インテック	117,900	2,797.00	329,766,300
キヤノン	560,000	2,253.00	1,261,680,000
リコー	264,600	773.00	204,535,800
シチズン時計	122,200	386.00	47,169,200
リズム時計工業	3,200	630.00	2,016,000
大研医器	7,400	656.00	4,854,400
メニコン	14,800	4,495.00	66,526,000
シンシア	1,400	361.00	505,400
中本パックス	2,700	1,485.00	4,009,500
スノーピーク	5,400	916.00	4,946,400
パラマウントベッドホールディングス	11,000	4,510.00	49,610,000
トランザクション	5,800	981.00	5,689,800
粧美堂	3,100	366.00	1,134,600

ニホンフラッシュ	9,700	1,243.00	12,057,100
前田工織	11,500	2,071.00	23,816,500
永大産業	13,700	283.00	3,877,100
アートネイチャー	11,200	693.00	7,761,600
バンダイナムコホールディングス	107,600	5,483.00	589,970,800
アイフィスジャパン	2,800	715.00	2,002,000
共立印刷	17,300	145.00	2,508,500
SHOEI	9,200	2,364.00	21,748,800
フランスベッドホールディングス	14,800	890.00	13,172,000
マーベラス	15,700	582.00	9,137,400
パイロットコーポレーション	16,900	3,700.00	62,530,000
萩原工業	5,800	1,334.00	7,737,200
エイベックス	17,500	901.00	15,767,500
トッパン・フォームズ	22,400	963.00	21,571,200
フジシールインターナショナル	23,300	1,870.00	43,571,000
タカラトミー	46,700	919.00	42,917,300
廣済堂	7,500	800.00	6,000,000
エステールホールディングス	2,700	611.00	1,649,700
アーク	38,400	90.00	3,456,000
レック	11,200	1,363.00	15,265,600
タカノ	4,200	713.00	2,994,600
三光合成	12,100	313.00	3,787,300
プロネクサス	8,900	1,114.00	9,914,600
ホクシン	6,900	117.00	807,300
ウッドワン	3,400	1,069.00	3,634,600
大建工業	7,000	1,630.00	11,410,000
きもと	18,500	145.00	2,682,500
凸版印刷	146,900	1,554.00	228,282,600
大日本印刷	136,200	2,207.00	300,593,400
共同印刷	3,100	2,835.00	8,788,500
NISSHA	21,500	821.00	17,651,500
光村印刷	900	1,601.00	1,440,900
藤森工業	9,300	3,310.00	30,783,000
ヴィア・ホールディングス	12,500	488.00	6,100,000
TAKARA & COMPANY	5,000	1,871.00	9,355,000
前澤化成工業	6,600	1,064.00	7,022,400
未来工業	5,600	1,914.00	10,718,400
アシックス	86,000	1,063.00	91,418,000
ツツミ	3,200	1,622.00	5,190,400
ウェーブロックホールディングス	3,700	741.00	2,741,700
JSP	6,100	1,416.00	8,637,600
ニチハ	14,500	2,293.00	33,248,500
エフピコ	11,500	7,950.00	91,425,000
小松ウオール工業	3,200	1,884.00	6,028,800
ヤマハ	61,900	4,470.00	276,693,000
河合楽器製作所	3,200	3,065.00	9,808,000
クリナップ	9,700	529.00	5,131,300
ピジョン	62,900	4,095.00	257,575,500
天馬	6,900	1,520.00	10,488,000
オリバー	2,200	2,750.00	6,050,000

兼松サステック	600	1,514.00	908,400	
キングジム	8,800	900.00	7,920,000	
象印マホービン	30,500	1,645.00	50,172,500	
リンテック	24,700	2,409.00	59,502,300	
信越ポリマー	18,800	844.00	15,867,200	
東リ	25,700	260.00	6,682,000	
イトーキ	22,200	345.00	7,659,000	
任天堂	63,800	43,640.00	2,784,232,000	
三菱鉛筆	17,000	1,413.00	24,021,000	
松風	4,700	1,619.00	7,609,300	
タカラスタンダード	21,400	1,591.00	34,047,400	
コクヨ	49,800	1,349.00	67,180,200	
ナカバヤシ	10,300	547.00	5,634,100	
ニフコ	38,200	2,112.00	80,678,400	
立川ブラインド工業	4,500	1,098.00	4,941,000	
グローブライド	4,700	2,189.00	10,288,300	
オカムラ	36,200	810.00	29,322,000	
バルカー	8,500	1,867.00	15,869,500	
MUTOHホールディングス	1,400	1,353.00	1,894,200	
伊藤忠商事	716,800	2,235.00	1,602,048,000	
丸紅	1,066,400	497.50	530,534,000	
スクロール	15,800	350.00	5,530,000	
高島	1,700	1,566.00	2,662,200	
ヨンドシーホールディングス	10,400	1,716.00	17,846,400	
三陽商会	5,200	981.00	5,101,200	
長瀬産業	57,500	1,317.00	75,727,500	
ナイガイ	3,900	416.00	1,622,400	
蝶理	6,500	1,729.00	11,238,500	
豊田通商	114,300	2,600.00	297,180,000	
オンワードホールディングス	61,300	349.00	21,393,700	
三共生興	15,200	473.00	7,189,600	
兼松	38,200	1,190.00	45,458,000	
美津濃	9,400	1,926.00	18,104,400	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,113.00	2,114,700	
ファミリーマート	81,900	1,861.00	152,415,900	
ルックホールディングス	3,500	832.00	2,912,000	
三井物産	900,700	1,639.00	1,476,247,300	
日本紙パルプ商事	5,800	3,680.00	21,344,000	
東京エレクトロン	66,000	22,720.00	1,499,520,000	
カメイ	13,200	1,065.00	14,058,000	
東都水産	1,300	2,937.00	3,818,100	
OUGホールディングス	1,700	2,700.00	4,590,000	
スターゼン	3,700	4,390.00	16,243,000	
セイコーホールディングス	14,700	1,874.00	27,547,800	
山善	40,000	938.00	37,520,000	
椿本興業	1,900	3,320.00	6,308,000	
住友商事	646,300	1,326.50	857,316,950	
日本ユニシス	31,900	3,165.00	100,963,500	
内田洋行	4,100	5,780.00	23,698,000	
三菱商事	719,100	2,417.00	1,738,064,700	

第一実業	5,000	3,650.00	18,250,000
キヤノンマーケティングジャパン	25,400	2,147.00	54,533,800
西華産業	5,800	1,153.00	6,687,400
佐藤商事	8,400	885.00	7,434,000
菱洋エレクトロ	10,400	2,467.00	25,656,800
東京産業	9,500	510.00	4,845,000
ユアサ商事	9,700	3,020.00	29,294,000
神鋼商事	2,600	1,828.00	4,752,800
トルク	6,300	287.00	1,808,100
阪和興業	19,200	1,793.00	34,425,600
正栄食品工業	6,600	3,875.00	25,575,000
カナデン	8,400	1,260.00	10,584,000
菱電商事	7,500	1,400.00	10,500,000
ニプロ	72,000	1,229.00	88,488,000
フルサト工業	5,700	1,400.00	7,980,000
岩谷産業	22,800	3,735.00	85,158,000
ナイス	4,500	817.00	3,676,500
昭光通商	3,400	590.00	2,006,000
ニチモウ	1,700	1,774.00	3,015,800
極東貿易	3,000	1,415.00	4,245,000
イワキ	13,800	450.00	6,210,000
兼松エレクトロニクス	5,600	3,770.00	21,112,000
三愛石油	25,300	1,139.00	28,816,700
稲畑産業	22,500	1,205.00	27,112,500
G S Iクレオス	2,600	1,070.00	2,782,000
明和産業	9,700	512.00	4,966,400
クワザワ	3,700	520.00	1,924,000
キムラタン	56,400	24.00	1,353,600
ヤマエ久野	7,500	1,310.00	9,825,000
ゴールドウイン	18,500	5,910.00	109,335,000
ユニ・チャーム	200,600	3,914.00	785,148,400
デサント	19,900	1,425.00	28,357,500
キング	4,900	494.00	2,420,600
ワキタ	21,800	990.00	21,582,000
ヤマトインターナショナル	6,300	348.00	2,192,400
東邦ホールディングス	32,800	2,198.00	72,094,400
サンゲツ	27,800	1,588.00	44,146,400
ミツウロコグループホールディングス	15,100	1,173.00	17,712,300
シナネンホールディングス	4,200	2,750.00	11,550,000
伊藤忠エネクス	22,500	814.00	18,315,000
サンリオ	28,700	1,770.00	50,799,000
サンワ テクノス	7,400	811.00	6,001,400
リョーサン	11,300	2,444.00	27,617,200
新光商事	16,300	888.00	14,474,400
トーヨー	4,700	1,805.00	8,483,500
三信電気	5,600	1,566.00	8,769,600
東陽テクニカ	11,200	1,055.00	11,816,000
モスフードサービス	13,500	2,844.00	38,394,000
加賀電子	10,300	2,054.00	21,156,200
三益半導体工業	8,000	2,192.00	17,536,000

ソーダニッカ	10,600	616.00	6,529,600
立花エレテック	7,600	1,568.00	11,916,800
木曾路	13,400	2,394.00	32,079,600
S R S ホールディングス	12,200	927.00	11,309,400
千趣会	18,800	355.00	6,674,000
タカキュー	8,500	133.00	1,130,500
ケーヨー	21,000	588.00	12,348,000
上新電機	12,000	2,196.00	26,352,000
日本瓦斯	16,200	3,815.00	61,803,000
ロイヤルホールディングス	18,000	1,947.00	35,046,000
東天紅	700	916.00	641,200
いなげや	12,700	1,649.00	20,942,300
島忠	19,300	2,819.00	54,406,700
チヨダ	10,600	1,081.00	11,458,600
ライフコーポレーション	7,800	3,040.00	23,712,000
リンガーハット	12,700	2,322.00	29,489,400
MrMaxHD	13,900	431.00	5,990,900
テンアライド	9,500	385.00	3,657,500
AOKIホールディングス	20,400	692.00	14,116,800
オークワ	16,100	1,368.00	22,024,800
コメリ	15,800	2,304.00	36,403,200
青山商事	21,200	946.00	20,055,200
しまむら	11,900	7,100.00	84,490,000
はせがわ	5,600	406.00	2,273,600
高島屋	74,500	1,014.00	75,543,000
松屋	20,700	644.00	13,330,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	48,200	865.00	41,693,000
近鉄百貨店	3,900	2,753.00	10,736,700
丸井グループ	93,900	1,822.00	171,085,800
クレディセゾン	71,900	1,238.00	89,012,200
アクシアル リテイリング	8,500	3,940.00	33,490,000
井筒屋	6,000	167.00	1,002,000
イオン	394,300	2,213.00	872,585,900
イズミ	20,800	3,320.00	69,056,000
フォーパル	4,500	1,170.00	5,265,000
平和堂	20,700	1,824.00	37,756,800
フジ	12,300	1,746.00	21,475,800
ヤオコー	11,700	6,460.00	75,582,000
ゼビオホールディングス	12,400	934.00	11,581,600
ケーズホールディングス	98,900	1,215.00	120,163,500
PALTAC	16,400	5,300.00	86,920,000
三谷産業	13,600	409.00	5,562,400
Olympicグループ	5,400	661.00	3,569,400
日産東京販売ホールディングス	15,500	215.00	3,332,500
新生銀行	75,400	1,340.00	101,036,000
あおぞら銀行	61,200	1,952.00	119,462,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,020,500	423.80	2,975,287,900
りそなホールディングス	1,126,100	328.30	369,698,630
三井住友トラスト・ホールディングス	193,900	3,058.00	592,946,200
三井住友フィナンシャルグループ	709,700	2,816.00	1,998,515,200

千葉銀行	342,300	493.00	168,753,900	
群馬銀行	197,000	335.00	65,995,000	
武蔵野銀行	15,200	1,360.00	20,672,000	
千葉興業銀行	28,600	238.00	6,806,800	
筑波銀行	43,600	167.00	7,281,200	
七十七銀行	34,600	1,382.00	47,817,200	
青森銀行	7,900	2,313.00	18,272,700	
秋田銀行	6,600	1,508.00	9,952,800	
山形銀行	11,600	1,280.00	14,848,000	
岩手銀行	6,700	2,512.00	16,830,400	
東邦銀行	91,800	237.00	21,756,600	
東北銀行	5,000	908.00	4,540,000	
みちのく銀行	6,800	1,091.00	7,418,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	86,400	1,629.00	140,745,600	
静岡銀行	254,000	650.00	165,100,000	
十六銀行	12,800	1,902.00	24,345,600	
スルガ銀行	105,200	376.00	39,555,200	
八十二銀行	247,500	359.00	88,852,500	
山梨中央銀行	12,000	822.00	9,864,000	
大垣共立銀行	20,300	2,170.00	44,051,000	
福井銀行	8,800	1,586.00	13,956,800	
北國銀行	10,600	3,020.00	32,012,000	
清水銀行	4,300	1,783.00	7,666,900	
富山銀行	2,000	2,239.00	4,478,000	
滋賀銀行	20,600	2,545.00	52,427,000	
南都銀行	17,100	2,225.00	38,047,500	
百五銀行	92,200	305.00	28,121,000	
京都銀行	36,700	3,680.00	135,056,000	
紀陽銀行	36,300	1,565.00	56,809,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	67,900	873.00	59,276,700	
広島銀行	151,200	446.00	67,435,200	
山陰合同銀行	60,700	541.00	32,838,700	
中国銀行	88,300	988.00	87,240,400	
鳥取銀行	3,700	1,138.00	4,210,600	
伊予銀行	146,500	582.00	85,263,000	
百十四銀行	10,900	1,938.00	21,124,200	
四国銀行	15,600	850.00	13,260,000	
阿波銀行	16,700	2,258.00	37,708,600	
大分銀行	5,900	2,162.00	12,755,800	
宮崎銀行	6,900	2,311.00	15,945,900	
佐賀銀行	6,200	1,165.00	7,223,000	
沖縄銀行	9,400	3,065.00	28,811,000	
琉球銀行	23,700	1,013.00	24,008,100	
セブン銀行	343,200	282.00	96,782,400	
みずほフィナンシャルグループ	13,943,900	123.30	1,719,282,870	
高知銀行	3,700	721.00	2,667,700	
山口フィナンシャルグループ	127,800	572.00	73,101,600	
芙蓉総合リース	10,700	5,700.00	60,990,000	
みずほリース	15,800	2,116.00	33,432,800	
東京センチュリー	20,700	3,815.00	78,970,500	

SBIホールディングス	114,700	2,164.00	248,210,800
日本証券金融	45,200	482.00	21,786,400
アイフル	157,100	245.00	38,489,500
日本アジア投資	9,100	228.00	2,074,800
長野銀行	3,400	1,146.00	3,896,400
名古屋銀行	7,700	2,294.00	17,663,800
北洋銀行	154,100	189.00	29,124,900
愛知銀行	3,700	3,170.00	11,729,000
中京銀行	4,300	2,076.00	8,926,800
大光銀行	3,600	1,506.00	5,421,600
愛媛銀行	14,500	1,104.00	16,008,000
トマト銀行	4,100	1,006.00	4,124,600
京葉銀行	43,600	516.00	22,497,600
栃木銀行	50,000	158.00	7,900,000
北日本銀行	3,200	1,923.00	6,153,600
東和銀行	18,100	657.00	11,891,700
福島銀行	10,300	169.00	1,740,700
大東銀行	5,500	597.00	3,283,500
リコーリース	8,000	2,917.00	23,336,000
イオンフィナンシャルサービス	62,800	1,118.00	70,210,400
アコム	206,300	444.00	91,597,200
ジャックス	11,300	1,830.00	20,679,000
オリエントコーポレーション	276,500	121.00	33,456,500
日立キャピタル	24,300	2,111.00	51,297,300
アプラスフィナンシャル	49,600	64.00	3,174,400
オリックス	642,000	1,319.50	847,119,000
三菱UFJリース	259,800	512.00	133,017,600
ジャフコ	15,800	3,495.00	55,221,000
九州リースサービス	4,800	453.00	2,174,400
トモニホールディングス	79,400	341.00	27,075,400
大和証券グループ本社	823,600	433.10	356,701,160
野村ホールディングス	1,805,900	424.10	765,882,190
岡三証券グループ	87,600	327.00	28,645,200
丸三証券	30,900	417.00	12,885,300
東洋証券	36,900	123.00	4,538,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	117,900	232.00	27,352,800
光世証券	2,400	515.00	1,236,000
水戸証券	30,100	196.00	5,899,600
いちよし証券	19,500	478.00	9,321,000
松井証券	58,800	774.00	45,511,200
SOMPOホールディングス	193,000	3,263.00	629,759,000
だいこう証券ビジネス	5,100	918.00	4,681,800
日本取引所グループ	294,700	2,099.00	618,575,300
マネックスグループ	75,900	231.00	17,532,900
極東証券	13,900	524.00	7,283,600
岩井コスモホールディングス	9,900	952.00	9,424,800
藍澤證券	18,600	695.00	12,927,000
フィデアホールディングス	101,300	108.00	10,940,400
池田泉州ホールディングス	118,400	171.00	20,246,400

アニコム ホールディングス	8,500	3,970.00	33,745,000	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	268,300	2,996.00	803,826,800	
ソニーフィナンシャルホールディング ス	84,300	2,081.00	175,428,300	
マネーパートナーズグループ	11,300	204.00	2,305,200	
スパークス・グループ	36,000	192.00	6,912,000	
小林洋行	3,000	240.00	720,000	
第一生命ホールディングス	580,700	1,332.00	773,492,400	
東京海上ホールディングス	362,900	4,507.00	1,635,590,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,100	815.00	4,156,500	
イー・ギャランティ	11,000	1,842.00	20,262,000	
アサックス	5,400	638.00	3,445,200	
NECキャピタルソリューション	4,100	1,913.00	7,843,300	
T & Dホールディングス	306,600	909.00	278,699,400	
アドバンスクリエイト	2,200	2,069.00	4,551,800	
三井不動産	506,200	1,996.50	1,010,628,300	
三菱地所	719,100	1,795.50	1,291,144,050	
平和不動産	18,900	2,951.00	55,773,900	
東京建物	108,100	1,280.00	138,368,000	
ダイビル	26,500	1,013.00	26,844,500	
京阪神ビルディング	16,700	1,448.00	24,181,600	
住友不動産	230,700	2,991.50	690,139,050	
太平洋興発	4,200	602.00	2,528,400	
テーオーシー	20,300	697.00	14,149,100	
東京楽天地	1,700	4,280.00	7,276,000	
レオパレス21	134,800	258.00	34,778,400	
スターツコーポレーション	13,900	2,101.00	29,203,900	
フジ住宅	11,900	499.00	5,938,100	
空港施設	10,100	431.00	4,353,100	
明和地所	5,200	433.00	2,251,600	
ゴールドクレスト	8,100	1,673.00	13,551,300	
リログループ	54,400	2,359.00	128,329,600	
エスリード	4,000	1,390.00	5,560,000	
日神グループホールディングス	15,400	406.00	6,252,400	
日本エスコン	18,800	758.00	14,250,400	
タカラレーベン	47,400	368.00	17,443,200	
A V A N T I A	5,800	731.00	4,239,800	
イオンモール	51,400	1,524.00	78,333,600	
毎日コムネット	2,600	811.00	2,108,600	
ファースト住建	4,400	925.00	4,070,000	
ランド	569,600	9.00	5,126,400	
カチタス	25,500	2,126.00	54,213,000	
東祥	6,300	1,205.00	7,591,500	
トーセイ	14,200	1,017.00	14,441,400	
穴吹興産	2,300	1,579.00	3,631,700	
サンフロンティア不動産	14,300	914.00	13,070,200	
エフ・ジェー・ネクスト	9,000	812.00	7,308,000	
インテリックス	2,900	567.00	1,644,300	
ランドビジネス	3,800	304.00	1,155,200	

日本社宅サービス	2,500	1,038.00	2,595,000
グランディハウス	8,100	354.00	2,867,400
東武鉄道	108,400	3,675.00	398,370,000
相鉄ホールディングス	33,200	2,838.00	94,221,600
東急	262,300	1,666.00	436,991,800
京浜急行電鉄	133,600	1,825.00	243,820,000
小田急電鉄	154,700	2,397.00	370,815,900
京王電鉄	54,000	5,830.00	314,820,000
京成電鉄	72,400	3,180.00	230,232,000
富士急行	14,200	3,270.00	46,434,000
新京成電鉄	2,700	2,142.00	5,783,400
東日本旅客鉄道	183,100	8,208.00	1,502,884,800
西日本旅客鉄道	92,700	6,725.00	623,407,500
東海旅客鉄道	86,500	17,920.00	1,550,080,000
西武ホールディングス	139,500	1,321.00	184,279,500
鴻池運輸	16,400	1,177.00	19,302,800
西日本鉄道	28,800	2,665.00	76,752,000
ハマキョウレックス	8,000	3,160.00	25,280,000
サカイ引越センター	5,500	5,600.00	30,800,000
近鉄グループホールディングス	98,500	5,300.00	522,050,000
阪急阪神ホールディングス	131,400	3,915.00	514,431,000
南海電気鉄道	46,700	2,507.00	117,076,900
京阪ホールディングス	43,900	4,830.00	212,037,000
神戸電鉄	2,400	3,835.00	9,204,000
名古屋鉄道	81,000	3,155.00	255,555,000
山陽電気鉄道	7,000	2,163.00	15,141,000
トランコム	2,800	6,620.00	18,536,000
日本通運	34,100	5,240.00	178,684,000
ヤマトホールディングス	172,800	1,922.00	332,121,600
山九	27,300	4,190.00	114,387,000
日新	8,500	1,626.00	13,821,000
丸運	5,800	227.00	1,316,600
丸全昭和運輸	8,000	2,478.00	19,824,000
センコーグループホールディングス	54,300	887.00	48,164,100
トナミホールディングス	2,400	5,140.00	12,336,000
ニッコンホールディングス	35,100	2,126.00	74,622,600
日本石油輸送	1,000	3,105.00	3,105,000
福山通運	12,600	3,770.00	47,502,000
セイノーホールディングス	73,700	1,310.00	96,547,000
エスライン	3,000	995.00	2,985,000
神奈川中央交通	2,500	4,085.00	10,212,500
日立物流	18,100	2,696.00	48,797,600
丸和運輸機関	10,400	3,310.00	34,424,000
C & F ロジホールディングス	10,000	1,396.00	13,960,000
日本郵船	82,300	1,448.00	119,170,400
商船三井	62,200	1,920.00	119,424,000
川崎汽船	30,400	1,121.00	34,078,400
NSユナイテッド海運	5,300	1,496.00	7,928,800
明治海運	10,800	335.00	3,618,000
飯野海運	46,500	325.00	15,112,500

共栄タンカー	1,800	896.00	1,612,800
九州旅客鉄道	86,400	2,985.00	257,904,000
S Gホールディングス	103,500	3,045.00	315,157,500
日本航空	174,300	1,967.00	342,848,100
A N Aホールディングス	180,200	2,418.00	435,723,600
パスコ	2,000	1,566.00	3,132,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	1,900	2,100.00	3,990,000
シルバーライフ	1,400	2,122.00	2,970,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	1,955.00	1,759,500
Genky Drug Stores	4,500	2,425.00	10,912,500
国際紙パルプ商事	24,600	316.00	7,773,600
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	652.00	1,173,600
ブックオフグループホールディングス	6,100	819.00	4,995,900
三菱倉庫	31,200	2,485.00	77,532,000
三井倉庫ホールディングス	11,200	1,460.00	16,352,000
住友倉庫	35,200	1,275.00	44,880,000
澁澤倉庫	5,400	2,216.00	11,966,400
ヤマタネ	5,100	1,249.00	6,369,900
東陽倉庫	17,900	340.00	6,086,000
乾汽船	5,700	1,194.00	6,805,800
日本トランスシティ	21,600	489.00	10,562,400
ケイヒン	1,900	1,275.00	2,422,500
中央倉庫	6,000	1,056.00	6,336,000
川西倉庫	1,900	1,025.00	1,947,500
安田倉庫	8,100	858.00	6,949,800
ファイズホールディングス	2,100	1,104.00	2,318,400
東洋埠頭	3,000	1,294.00	3,882,000
宇徳	8,400	462.00	3,880,800
上組	55,000	1,973.00	108,515,000
サンリツ	2,400	560.00	1,344,000
キムラユニティー	2,600	1,004.00	2,610,400
キューソー流通システム	2,500	1,754.00	4,385,000
近鉄エクスプレス	20,900	1,546.00	32,311,400
東海運	5,700	257.00	1,464,900
エーアイティー	7,200	752.00	5,414,400
内外トランスライン	3,600	1,131.00	4,071,600
ショーエイコーポレーション	1,400	740.00	1,036,000
日本コンセプト	3,200	1,441.00	4,611,200
東京放送ホールディングス	62,100	1,677.00	104,141,700
日本テレビホールディングス	85,100	1,215.00	103,396,500
朝日放送グループホールディングス	10,000	713.00	7,130,000
テレビ朝日ホールディングス	28,100	1,637.00	45,999,700
スカパーJ S A Tホールディングス	67,000	411.00	27,537,000
テレビ東京ホールディングス	8,300	2,416.00	20,052,800
日本BS放送	3,500	1,057.00	3,699,500
ビジョン	9,700	854.00	8,283,800
スマートバリュー	2,700	835.00	2,254,500
USEN - NEXT HOLDING S	4,000	1,379.00	5,516,000

ワイヤレスゲート	5,000	571.00	2,855,000
コネクシオ	5,800	1,555.00	9,019,000
日本通信	80,200	160.00	12,832,000
クロップス	2,100	711.00	1,493,100
日本電信電話	1,364,900	2,419.50	3,302,375,550
KDDI	761,000	3,158.00	2,403,238,000
ソフトバンク	927,900	1,470.00	1,364,013,000
光通信	10,500	22,440.00	235,620,000
NTTドコモ	754,300	3,079.00	2,322,489,700
エムティーアイ	10,100	576.00	5,817,600
GMOインターネット	40,300	2,334.00	94,060,200
ファイバーゲート	2,400	1,410.00	3,384,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	447.00	1,385,700
KADOKAWA	27,500	1,656.00	45,540,000
学研ホールディングス	13,700	1,769.00	24,235,300
ゼンリン	20,500	1,332.00	27,306,000
昭文社ホールディングス	4,700	393.00	1,847,100
インプレスホールディングス	8,700	164.00	1,426,800
東京電力ホールディングス	830,100	367.00	304,646,700
中部電力	318,300	1,432.00	455,805,600
関西電力	394,100	1,052.00	414,593,200
中国電力	150,100	1,438.00	215,843,800
北陸電力	95,100	727.00	69,137,700
東北電力	259,600	1,045.00	271,282,000
四国電力	93,400	809.00	75,560,600
九州電力	214,400	866.00	185,670,400
北海道電力	97,300	419.00	40,768,700
沖縄電力	19,300	2,087.00	40,279,100
電源開発	82,700	2,002.00	165,565,400
エフオン	6,000	539.00	3,234,000
イーレックス	14,900	1,525.00	22,722,500
レノバ	17,500	858.00	15,015,000
東京瓦斯	200,200	2,515.50	503,603,100
大阪瓦斯	202,000	2,043.00	412,686,000
東邦瓦斯	51,200	5,550.00	284,160,000
北海道瓦斯	5,600	1,570.00	8,792,000
広島ガス	21,400	359.00	7,682,600
西部瓦斯	11,700	2,627.00	30,735,900
静岡ガス	29,600	956.00	28,297,600
メタウォーター	5,000	4,335.00	21,675,000
アイネット	5,200	1,553.00	8,075,600
松竹	6,800	12,800.00	87,040,000
東宝	60,200	3,695.00	222,439,000
エイチ・アイ・エス	15,600	1,721.00	26,847,600
東映	3,800	14,120.00	53,656,000
ラックランド	2,400	1,995.00	4,788,000
エヌ・ティ・ティ・データ	272,100	1,164.00	316,724,400
共立メンテナンス	16,500	3,190.00	52,635,000
イチネンホールディングス	11,200	1,164.00	13,036,800

建設技術研究所	7,000	1,785.00	12,495,000
スペース	6,500	1,022.00	6,643,000
長 大	3,700	874.00	3,233,800
アインホールディングス	12,600	6,300.00	79,380,000
燦ホールディングス	4,400	1,287.00	5,662,800
ピー・シー・エー	1,500	3,815.00	5,722,500
スバル興業	500	7,870.00	3,935,000
東京テアトル	4,100	1,225.00	5,022,500
タナベ経営	1,900	1,232.00	2,340,800
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,763.00	4,973,400
ナガワ	3,100	7,510.00	23,281,000
よみうりランド	2,100	3,420.00	7,182,000
東京都競馬	6,500	3,710.00	24,115,000
常磐興産	4,000	1,408.00	5,632,000
カナモト	16,300	2,207.00	35,974,100
東京ドーム	40,300	846.00	34,093,800
D T S	22,900	2,168.00	49,647,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	43,600	4,675.00	203,830,000
シーイーシー	11,000	1,702.00	18,722,000
カブコン	48,200	3,585.00	172,797,000
西尾レントオール	9,200	2,263.00	20,819,600
アイ・エス・ビー	2,000	1,741.00	3,482,000
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	67,600	20.00	1,352,000
日本空港ビルデング	32,800	4,255.00	139,564,000
トランス・コスモス	9,500	2,202.00	20,919,000
乃村工藝社	42,800	861.00	36,850,800
ジャステック	6,600	1,164.00	7,682,400
S C S K	23,600	4,845.00	114,342,000
藤田観光	4,400	1,945.00	8,558,000
K N T - C Tホールディングス	6,300	1,045.00	6,583,500
日本管財	10,900	1,843.00	20,088,700
トーカイ	9,600	2,644.00	25,382,400
白洋舎	1,100	2,804.00	3,084,400
セコム	105,600	9,075.00	958,320,000
日本システムウエア	3,400	2,181.00	7,415,400
セントラル警備保障	4,800	4,525.00	21,720,000
アイネス	10,200	1,389.00	14,167,800
丹青社	19,100	726.00	13,866,600
メイテック	12,200	4,850.00	59,170,000
T K C	8,700	5,150.00	44,805,000
富士ソフト	13,100	3,920.00	51,352,000
応用地質	10,800	1,298.00	14,018,400
船井総研ホールディングス	20,600	2,459.00	50,655,400
N S D	32,900	1,617.00	53,199,300
進学会ホールディングス	4,100	528.00	2,164,800
丸紅建材リース	1,000	1,445.00	1,445,000
オオバ	7,400	674.00	4,987,600
コナミホールディングス	37,100	3,500.00	129,850,000

いであ	1,900	1,560.00	2,964,000	
学究社	3,000	1,126.00	3,378,000	
ベネッセホールディングス	33,100	3,140.00	103,934,000	
イオンディライト	12,300	3,190.00	39,237,000	
ナック	5,500	891.00	4,900,500	
福井コンピュータホールディングス	4,100	2,930.00	12,013,000	
ニチイ学館	14,200	1,455.00	20,661,000	
ダイセキ	16,800	2,506.00	42,100,800	
ステップ	3,700	1,398.00	5,172,600	
日鉄物産	7,300	3,425.00	25,002,500	
泉州電業	3,100	2,536.00	7,861,600	
元気寿司	2,600	2,527.00	6,570,200	
トラスコ中山	21,300	2,475.00	52,717,500	
ヤマダ電機	312,500	521.00	162,812,500	
オートバックスセブン	37,900	1,321.00	50,065,900	
モリト	7,400	676.00	5,002,400	
アークランドサカモト	16,100	1,094.00	17,613,400	
ニトリホールディングス	44,400	16,850.00	748,140,000	
グルメ杵屋	7,400	970.00	7,178,000	
愛眼	8,400	216.00	1,814,400	
ケーユーホールディングス	5,100	790.00	4,029,000	
吉野家ホールディングス	33,700	2,376.00	80,071,200	
加藤産業	14,800	3,635.00	53,798,000	
北恵	2,000	861.00	1,722,000	
イノテック	5,400	969.00	5,232,600	
イエローハット	19,300	1,494.00	28,834,200	
松屋フーズホールディングス	4,900	3,960.00	19,404,000	
JBCホールディングス	7,000	2,055.00	14,385,000	
JKホールディングス	9,300	755.00	7,021,500	
サガミホールディングス	13,800	1,313.00	18,119,400	
日伝	9,300	2,055.00	19,111,500	
関西スーパーマーケット	8,500	1,060.00	9,010,000	
ミロク情報サービス	9,100	2,689.00	24,469,900	
北沢産業	7,800	279.00	2,176,200	
杉本商事	5,500	1,780.00	9,790,000	
因幡電機産業	29,100	2,287.00	66,551,700	
王将フードサービス	7,500	6,060.00	45,450,000	
プレナス	11,500	1,874.00	21,551,000	
ミニストップ	7,600	1,523.00	11,574,800	
アークス	20,900	2,035.00	42,531,500	
パローホールディングス	22,700	2,028.00	46,035,600	
東テク	3,400	2,200.00	7,480,000	
ミスミグループ本社	128,500	2,640.00	339,240,000	
藤久	900	785.00	706,500	
アルテック	8,400	205.00	1,722,000	
ベルク	5,100	5,940.00	30,294,000	
大庄	5,600	1,327.00	7,431,200	
タキヒヨー	3,100	1,707.00	5,291,700	
ファーストリテイリング	13,700	53,580.00	734,046,000	
ソフトバンクグループ	810,200	4,685.00	3,795,787,000	

蔵王産業	2,000	1,435.00	2,870,000	
スズケン	43,400	3,975.00	172,515,000	
サンドラッグ	38,600	3,655.00	141,083,000	
サクスパー ホールディングス	8,900	564.00	5,019,600	
ジェコス	7,000	904.00	6,328,000	
ヤマザワ	2,400	1,718.00	4,123,200	
やまや	2,100	2,238.00	4,699,800	
グローセル	10,200	428.00	4,365,600	
ペルーナ	22,000	522.00	11,484,000	
合計	123,377,300		216,613,529,510	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,088,288,445
株式	306,904,085,892
投資信託受益証券	570,965,011
投資証券	7,480,968,622
派生商品評価勘定	190,161,938
未収入金	8,315,619,726
未収配当金	429,941,267
差入委託証拠金	3,122,661,172
流動資産合計	339,102,692,073
資産合計	339,102,692,073
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,025,981
前受金	5,421,542,062
未払金	211,807,036
未払解約金	12,645,791,000
流動負債合計	18,285,166,079
負債合計	18,285,166,079
純資産の部	
元本等	
元本	92,726,631,098
剰余金	
剰余金又は欠損金()	228,090,894,896
元本等合計	320,817,525,994
純資産合計	320,817,525,994
負債純資産合計	339,102,692,073

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	90,492,519,767円
同期中追加設定元本額	20,860,263,428円
同期中一部解約元本額	18,626,152,097円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	4,977,283,313円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,443,607円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	11,383,730円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	12,730,791円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	48,543,130円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	45,630,569円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,155,456円
たわらノーロード 先進国株式	14,066,139,439円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	124,834,296円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,893,643,476円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	283,175,064円
たわらノーロード バランス(堅実型)	30,356,898円
たわらノーロード バランス(標準型)	233,071,860円
たわらノーロード バランス(積極型)	280,472,320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)	962,083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)	112,700,244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)	274,323,448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)	171,964,179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)	299,807,401円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	89,092円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,233,650円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,927,958円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,960,914円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,126,602円
たわらノーロード 全世界株式	57,585,091円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	44,062,458,386円
One DC 先進国株式インデックスファンド	243,406,885円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	198,233,231円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	981,732,765円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,168,180,193円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	124,067,315円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	366,859,098円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	305,189,382円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,179,401円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	822,239,250円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	179,025,158円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	244,994,360円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	182,686,407円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	288,487,295円
投資のソムリエ	1,160,395,950円
クルーズコントロール	151,798,298円
投資のソムリエ<DC年金>	111,749,568円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	215,592,601円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	115,175,589円
クルーズコントロール<DC年金>	172,908円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	827,983円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,226,157円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	81,878,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	779,584,572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)	298,326,639円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	857,236円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	572,790円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	749,012円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,713,773円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	24,382,030円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	227,788,422円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,819,469円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	176,737円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	78,833円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	112,827円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	76,569円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,458,874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)	263,347,847円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	86,085,641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)	1,773,575,252円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,245,416,513円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	205,910,044円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	16,196,082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)	1,951,920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)	62,682,650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)	136,747,695円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,697,685円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	47,732,962円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,503,150円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,953,955円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	18,055,438円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,396,754円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	406,579,503円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	533,309,090円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,702,673,497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)	596,707,398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)	99,286,740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)	658,431,312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)	27,948,895円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	7,009,193円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	9,527,191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)	224,948,025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)	26,605,559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)	98,393,384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)	167,850,599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)	274,715,654円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	11,278,545円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	229,211円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	260,737円
計	92,726,631,098円
2. 受益権の総数	92,726,631,098口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	45,096,408,869
投資信託受益証券	221,340,098
投資証券	1,915,563,770
合計	47,233,312,737

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和2年2月18日から令和2年5月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	722,357,598	-	727,958,400	5,600,802
イギリス・ポンド	630,491,205	-	635,639,400	5,148,195
デンマーク・クローネ	75,744,200	-	76,195,000	450,800
ユーロ	16,122,193	-	16,124,000	1,807
買建	35,798,680	-	35,798,160	520
アメリカ・ドル	30,584,840	-	30,584,840	-
オーストラリア・ドル	1,606,872	-	1,607,010	138
カナダ・ドル	3,606,968	-	3,606,310	658
合計	758,156,278	-	763,756,560	5,601,322

(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5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	5,549,856,046	-	5,739,593,325	189,737,279
合計	5,549,856,046	-	5,739,593,325	189,737,279

（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5月11日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.4598円 (34,598円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年5月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	34,687	2,379.610	82,541,532.070	
	ABBOTT LABORATORIES	145,550	93.700	13,638,035.000	
	AES CORP	56,917	12.870	732,521.790	
	ABIOMED INC	3,574	187.070	668,588.180	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	72,823	122.990	8,956,500.770	
	ADVANCED MICRO DEVICES	87,783	53.190	4,669,177.770	
	ADOBE INC	39,896	367.510	14,662,178.960	
	CHUBB LTD	37,578	101.950	3,831,077.100	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,617	233.480	4,346,697.160	
	ALLEGHANY CORP	1,058	530.500	561,269.000	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	128.000	774,656.000	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	72.080	246,657.760	
	ALLSTATE CORP	27,068	100.790	2,728,183.720	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,657	136.910	8,030,729.870	
	AMGEN INC	48,881	234.820	11,478,236.420	
	HESS CORP	21,951	48.480	1,064,184.480	
AMERICAN EXPRESS CO	57,195	89.500	5,118,952.500		

AMERICAN ELECTRIC POWER	40,368	79.860	3,223,788.480	
AFLAC INC	60,919	36.260	2,208,922.940	
AMERICAN INTL GROUP	74,200	27.650	2,051,630.000	
AMERCO	585	301.290	176,254.650	
ANALOG DEVICES	30,476	109.830	3,347,179.080	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,098	97.340	1,761,659.320	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	65,819	29.800	1,961,406.200	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	104.180	425,783.660	
VALERO ENERGY CORP	34,559	65.920	2,278,129.280	
APACHE CORP	25,616	12.450	318,919.200	
ANSYS INC	6,745	263.020	1,774,069.900	
APPLE INC	365,738	310.130	113,426,325.940	
APPLIED MATERIALS INC	76,886	53.810	4,137,235.660	
ALBEMARLE CORP	10,027	64.250	644,234.750	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,888	36.390	1,669,864.320	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	73.870	685,365.860	
AMEREN CORP	19,322	70.860	1,369,156.920	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	65.460	435,374.460	
AUTOLIV INC	5,913	61.140	361,520.820	
AUTODESK INC	18,410	184.290	3,392,778.900	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,591	146.000	5,196,286.000	
AUTOZONE INC	1,930	1,057.900	2,041,747.000	
AVERY DENNISON CORP	6,549	109.260	715,543.740	
BALL CORP	25,163	64.560	1,624,523.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	107,928	176.830	19,084,908.240	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,002	35.340	2,473,870.680	
BAXTER INTERNATIONAL INC	40,217	88.080	3,542,313.360	
BECTON DICKINSON & CO	22,260	254.480	5,664,724.800	
AMETEK INC	19,590	84.320	1,651,828.800	
VERIZON COMM INC	339,364	57.000	19,343,748.000	
WR BERKLEY CORP	12,511	51.730	647,194.030	
BEST BUY CO INC	18,980	78.630	1,492,397.400	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	456.350	848,354.650	
YUM! BRANDS INC	24,939	86.180	2,149,243.020	
FIRSTENERGY CORP	44,134	40.600	1,791,840.400	
BOEING CO	44,172	133.440	5,894,311.680	
ROBERT HALF INTL INC	11,645	47.380	551,740.100	
BORGWARNER INC	17,210	29.390	505,801.900	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	115,462	38.180	4,408,339.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,838	73.800	873,644.400	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,830	129.850	1,276,425.500	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,128	719.570	1,531,244.960	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	192,833	61.050	11,772,454.650	
INGREDION INC	5,305	84.110	446,203.550	
ONEOK INC	36,226	31.330	1,134,960.580	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	65.740	387,866.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	119.580	739,123.980	
SEMPRA ENERGY	22,975	124.230	2,854,184.250	
FEDEX CORP	20,489	120.440	2,467,695.160	
VERISIGN INC	8,769	210.040	1,841,840.760	
AMPHENOL CORP	24,606	89.560	2,203,713.360	
BROWN-FORMAN CORP	24,398	65.970	1,609,536.060	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	5.745	719,584.230	
CSX CORP	60,570	66.110	4,004,282.700	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	20.510	644,342.160	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	51.260	720,203.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	51.060	1,002,869.460	
CONSTELLATION BRANDS INC	13,685	166.060	2,272,531.100	
CARDINAL HEALTH INC	25,815	49.880	1,287,652.200	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	44,664	14.210	634,675.440	
CATERPILLAR INC	46,755	112.110	5,241,703.050	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	106.990	1,055,456.350	
CITRIX SYSTEMS INC	10,439	150.980	1,576,080.220	
CENTURYLINK INC	80,424	9.940	799,414.560	
CERNER CORP	25,177	68.750	1,730,918.750	
JPMORGAN CHASE & CO	257,738	92.700	23,892,312.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,723	73.350	1,446,682.050	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	55.730	717,356.560	
CINTAS CORP	7,294	218.210	1,591,623.740	
CISCO SYSTEMS INC	348,773	42.990	14,993,751.270	
CLOROX COMPANY	10,586	204.050	2,160,073.300	
COCA-COLA CO/THE	334,645	46.110	15,430,480.950	
COPART INC	16,749	83.790	1,403,398.710	
COGNEX CORP	15,179	57.520	873,096.080	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,822	69.370	4,774,182.140	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,559	87.170	1,966,468.030	
COMERICA INC	11,985	33.890	406,171.650	
NRG ENERGY, INC.	21,039	32.770	689,448.030	
COMCAST CORP-CL A	373,782	36.535	13,656,125.370	
CONAGRA BRANDS INC	40,291	33.520	1,350,554.320	
CONSOLIDATED EDISON INC	26,947	74.180	1,998,928.460	
CMS ENERGY CORP	23,184	55.290	1,281,843.360	

COOPER COS INC	3,984	304.520	1,213,207.680	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	38.890	642,190.570	
CORNING INC	65,417	21.620	1,414,315.540	
SEALED AIR CORP	13,870	29.640	411,106.800	
HEICO CORP-CL A	7,278	72.200	525,471.600	
CUMMINS INC	11,814	161.290	1,905,480.060	
DR HORTON INC	29,104	49.590	1,443,267.360	
DANAHER CORP	51,398	161.430	8,297,179.140	
MOODY'S CORP	14,130	251.750	3,557,227.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,276	57.160	2,587,976.160	
TARGET CORP	41,699	115.830	4,829,995.170	
DEERE & CO	24,765	137.000	3,392,805.000	
MORGAN STANLEY	103,292	40.080	4,139,943.360	
REPUBLIC SERVICES INC	18,180	81.310	1,478,215.800	
COSTAR GROUP INC	3,001	657.420	1,972,917.420	
THE WALT DISNEY CO	148,438	109.160	16,203,492.080	
DOLLAR TREE INC	18,676	78.050	1,457,661.800	
DOVER CORP	11,366	92.230	1,048,286.180	
OMNICOM GROUP	17,365	55.110	956,985.150	
DTE ENERGY CO	16,264	101.260	1,646,892.640	
DUKE ENERGY CORP	59,981	81.780	4,905,246.180	
FLOWSERVE CORP	9,882	26.780	264,639.960	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,790	74.720	880,948.800	
EBAY INC	62,570	42.150	2,637,325.500	
BANK OF AMERICA CORP	702,316	23.570	16,553,588.120	
CITIGROUP INC	179,174	46.320	8,299,339.680	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,121	62.530	757,926.130	
E*TRADE FINANCIAL CORP	20,757	41.210	855,395.970	
EATON CORP PLC	33,708	82.250	2,772,483.000	
EATON VANCE CORP	9,184	37.330	342,838.720	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,667	82.460	1,869,120.820	
DISH NETWORK CORP	23,723	25.730	610,392.790	
ECOLAB INC	21,194	197.760	4,191,325.440	
PERKINELMER INC	8,514	92.480	787,374.720	
ELECTRONIC ARTS INC	23,965	116.620	2,794,798.300	
SALESFORCE.COM INC	68,661	175.900	12,077,469.900	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	168.730	378,461.390	
EMERSON ELECTRIC CO	49,888	56.100	2,798,716.800	
ATMOS ENERGY CORP	9,937	97.330	967,168.210	
ENTERGY CORP	16,319	95.010	1,550,468.190	
EOG RESOURCES INC	48,085	51.450	2,473,973.250	
EQUIFAX INC	10,344	149.380	1,545,186.720	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,601	173.150	3,220,763.150	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,440	74.830	1,080,545.200	
EXXON MOBIL CORP	347,986	46.180	16,069,993.480	
FMC CORP	10,209	93.480	954,337.320	
NEXTERA ENERGY INC	40,110	229.730	9,214,470.300	

FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,373	276.080	931,217.840	
ASSURANT INC	4,594	98.800	453,887.200	
FASTENAL CO	49,297	39.050	1,925,047.850	
FIFTH THIRD BANCORP	58,016	18.095	1,049,799.520	
M&T BANK CORP	10,052	104.870	1,054,153.240	
FISERV INC	47,607	104.780	4,988,261.460	
FLIR SYSTEMS INC	12,717	48.090	611,560.530	
FORD MOTOR CO	311,272	5.240	1,631,065.280	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	19.200	455,289.600	
FREEMONT-MCMORAN INC	114,993	9.210	1,059,085.530	
FLEX LTD	35,127	10.010	351,621.270	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,924	86.400	1,375,833.600	
GAP INC/THE	18,295	8.100	148,189.500	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	40.650	747,390.900	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,788	135.350	2,813,655.800	
GENERAL MILLS INC	49,062	59.760	2,931,945.120	
GENUINE PARTS CO	11,605	76.440	887,086.200	
GILEAD SCIENCES INC	104,104	77.490	8,067,018.960	
GARTNER INC	7,522	122.580	922,046.760	
MCKESSON CORP	13,720	135.970	1,865,508.400	
NVIDIA CORP	47,864	312.500	14,957,500.000	
GENERAL ELECTRIC CO	718,001	6.290	4,516,226.290	
WW GRAINGER INC	3,745	285.450	1,069,010.250	
HALLIBURTON CO	69,816	10.700	747,031.200	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,591	65.780	2,143,835.980	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	26,120	185.390	4,842,386.800	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	21.450	276,726.450	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,195	180.950	3,292,385.250	
HASBRO INC	11,383	69.700	793,395.100	
HENRY SCHEIN INC	11,516	54.030	622,209.480	
HEICO CORP	3,623	90.430	327,627.890	
HERSHEY FOODS CORP	12,250	133.190	1,631,577.500	
HP INC	117,832	15.660	1,845,249.120	
F5 NETWORKS INC	4,874	149.020	726,323.480	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	63.070	660,469.040	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	23.680	661,595.520	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	31.210	369,994.550	
HOLOGIC INC	23,457	51.990	1,219,529.430	
UNUM GROUP	15,185	15.520	235,671.200	
HOME DEPOT INC	89,758	234.430	21,041,967.940	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14,356	95.200	1,366,691.200	
HORMEL FOODS CORP	23,263	47.240	1,098,944.120	
CENTERPOINT ENERGY INC	45,978	18.590	854,731.020	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	191.480	557,781.240	
HUMANA INC	10,903	377.500	4,115,882.500	

JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,392	103.250	763,224.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	96,195	8.650	832,086.750	
BIOGEN INC	14,850	314.020	4,663,197.000	
IDEX CORP	6,154	154.700	952,023.800	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,224	161.010	4,222,326.240	
INTUIT INC	21,446	280.360	6,012,600.560	
IDEXX LABORATORIES INC	6,933	287.900	1,996,010.700	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	54.400	596,224.000	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	19,760	84.390	1,667,546.400	
INTEL CORP	358,015	59.670	21,362,755.050	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,980	134.470	1,073,070.600	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,282	34.350	1,005,836.700	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,382	17.320	508,896.240	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,705	79.970	936,048.850	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,050	182.790	1,105,879.500	
INCYTE CORP	15,616	95.920	1,497,886.720	
JOHNSON & JOHNSON	216,556	148.700	32,201,877.200	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,620	36.350	1,076,687.000	
KLA CORPORATION	12,667	171.500	2,172,390.500	
DEVON ENERGY CORP	30,547	12.700	387,946.900	
KELLOGG CO	21,289	63.680	1,355,683.520	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	35.090	405,640.400	
KEYCORP	84,596	11.280	954,242.880	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,052	138.510	3,885,482.520	
BLACKROCK INC/NEW YORK	9,464	498.780	4,720,453.920	
KOHL'S CORP	11,910	18.200	216,762.000	
KROGER CO	66,283	33.340	2,209,875.220	
LAM RESEARCH CORP	11,670	265.400	3,097,218.000	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,160	332.720	1,051,395.200	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,197	98.140	706,313.580	
AKAMAI TECHNOLOGIES	12,894	101.150	1,304,228.100	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	29.800	325,654.400	
LENNAR CORP	23,510	54.010	1,269,775.100	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	14.100	293,209.500	
ELI LILLY & CO	71,162	153.510	10,924,078.620	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	36.650	562,357.600	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	57,639	94.830	5,465,906.370	

AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,430	79.710	2,027,025.300	
LOCKHEED MARTIN CORP	20,887	378.400	7,903,640.800	
LOEWS CORP	21,759	31.020	674,964.180	
LOWE'S COS INC	63,224	114.230	7,222,077.520	
DOMINION ENERGY INC	67,429	78.400	5,286,433.600	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	15.590	601,353.070	
MCCORMICK & CO INC	9,912	164.030	1,625,865.360	
MCDONALD'S CORPORATION	61,981	181.230	11,232,816.630	
S&P GLOBAL INC	20,062	297.650	5,971,454.300	
EVEREST RE GROUP LTD	3,795	176.800	670,956.000	
MANPOWERGROUP INC	4,555	71.840	327,231.200	
MARKEL CORPORATION	1,210	869.710	1,052,349.100	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	17,341	217.840	3,777,563.440	
MARSH & MCLENNAN COS	41,917	103.980	4,358,529.660	
MASCO CORP	25,107	42.140	1,058,008.980	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,480	176.590	967,713.200	
METLIFE INC	63,036	35.220	2,220,127.920	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,441	54.120	1,160,386.920	
MEDTRONIC PLC	110,181	99.030	10,911,224.430	
ACTIVISION BLIZZARD INC	63,057	73.140	4,611,988.980	
CVS HEALTH CORP	107,020	63.120	6,755,102.400	
MERCK & CO. INC.	209,451	76.400	16,002,056.400	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	17.120	559,584.320	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,070	167.260	1,349,788.200	
MICROSOFT CORP	596,511	184.680	110,163,651.480	
MICRON TECH INC	91,243	48.250	4,402,474.750	
MIDDLEBY CORP	4,188	64.350	269,497.800	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,442	89.700	1,833,647.400	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	54,337	26.850	1,458,948.450	
3M CO	47,265	148.510	7,019,325.150	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	84.860	422,263.360	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,413	131.270	1,891,994.510	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,737	136.630	1,057,106.310	
MYLAN NV	44,496	17.570	781,794.720	
ILLUMINA INC	12,073	309.870	3,741,060.510	
XCEL ENERGY INC	43,154	60.310	2,602,617.740	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,630	109.400	725,322.000	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	39,996	13.190	527,547.240	
NETAPP INC	17,963	44.900	806,538.700	
NEWELL BRANDS INC	33,317	12.410	413,463.970	

NEWMONT CORP	66,868	64.550	4,316,329.400	
NVR INC	316	3,119.670	985,815.720	
NIKE INC-CL B	102,432	90.460	9,265,998.720	
NOBLE ENERGY INC	39,436	10.030	395,543.080	
NORDSTROM INC	9,487	18.030	171,050.610	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,378	174.750	3,735,805.500	
EVERSOURCE ENERGY	26,491	77.790	2,060,734.890	
NISOURCE INC	31,427	23.270	731,306.290	
TAPESTRY INC	21,790	14.880	324,235.200	
NORTHERN TRUST CORP	15,687	75.990	1,192,055.130	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,038	327.650	4,271,900.700	
WELLS FARGO & CO	330,189	25.430	8,396,706.270	
NUCOR CORP	23,952	42.200	1,010,774.400	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	44.500	853,955.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	37,703	62.200	2,345,126.600	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	79,250	15.020	1,190,335.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,813	152.760	1,193,513.880	
OGE ENERGY CORP	16,028	31.050	497,669.400	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,222	402.510	2,504,417.220	
ORACLE CORP	189,155	53.570	10,133,033.350	
PACCAR INC	29,586	69.620	2,059,777.320	
PTC INC	10,059	71.550	719,721.450	
EXELON CORP	81,102	37.430	3,035,647.860	
PARKER HANNIFIN CORP	10,242	161.000	1,648,962.000	
PAYCHEX INC	26,101	67.110	1,751,638.110	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,181	210.030	1,298,195.430	
PPL CORPORATION	58,655	26.110	1,531,482.050	
PEPSICO INC	114,623	134.230	15,385,845.290	
PENTAIR PLC	12,511	35.100	439,136.100	
PFIZER INC	455,333	37.220	16,947,494.260	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,952	40.300	763,765.600	
CONOCOPHILLIPS	90,875	43.080	3,914,895.000	
PVH CORP	5,205	46.020	239,534.100	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,597	89.990	1,313,584.030	
ALTRIA GROUP INC	153,682	36.740	5,646,276.680	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	36,288	105.030	3,811,328.640	
BROWN & BROWN INC	21,068	37.600	792,156.800	
POLARIS INC	4,095	72.930	298,648.350	
GARMIN LTD	10,774	81.340	876,357.160	
PPG INDUSTRIES INC	18,740	91.980	1,723,705.200	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	152.060	396,572.480	
COSTCO WHOLESALE CORP	36,254	305.940	11,091,548.760	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,670	114.060	2,129,500.200	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	112.220	1,221,290.260	

PROCTER & GAMBLE CO	204,950	115.950	23,763,952.500	
PROGRESSIVE CORP	47,556	74.270	3,531,984.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	41,882	48.770	2,042,585.140	
PULTE GROUP INC	21,209	29.880	633,724.920	
GLOBAL PAYMENTS INC	25,029	175.040	4,381,076.160	
QUALCOMM INC	94,028	80.560	7,574,895.680	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	66.830	718,021.520	
EXACT SCIENCES CORP	11,306	82.010	927,205.060	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	160.370	649,819.240	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,648	563.400	3,745,483.200	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	95.010	479,040.420	
RESMED INC	11,940	162.750	1,943,235.000	
US BANCORP	122,180	34.750	4,245,755.000	
SEATTLE GENETICS INC /WA	10,232	157.670	1,613,279.440	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36,298	25.950	941,933.100	
ROSS STORES INC	30,427	91.460	2,782,853.420	
ROLLINS INC	12,378	42.290	523,465.620	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,534	358.360	3,058,244.240	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,434	192.450	1,815,573.300	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	39.920	561,874.000	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	68.830	757,405.320	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	47.180	181,548.640	
ACCENTURE PLC-CL A	52,201	188.560	9,843,020.560	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	118,034	50.900	6,007,930.600	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,300	197.350	2,032,705.000	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	20,802	97.340	2,024,866.680	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	50,542	128.230	6,481,000.660	
BOOKING HOLDINGS INC	3,447	1,430.830	4,932,071.010	
SCHLUMBERGER LTD	116,108	18.050	2,095,749.400	
SCHWAB (CHARLES) CORP	95,786	36.510	3,497,146.860	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	16,910	121.860	2,060,652.600	
BUNGE LTD	10,622	36.530	388,021.660	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	51.900	552,890.700	
ANTHEM INC	20,878	274.330	5,727,461.740	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,641	88.090	1,113,545.690	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	38.210	847,306.750	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,940	549.680	3,814,779.200	

CENTENE CORP	48,199	65.880	3,175,350.120	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	185.850	751,577.400	
IAC INTERACTIVE CORP	6,364	234.870	1,494,712.680	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	44.790	508,411.290	
ACUITY BRANDS INC	3,087	85.980	265,420.260	
SNAP-ON INC	5,301	127.330	674,976.330	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,741	58.980	1,931,064.180	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	124.850	661,330.450	
EDISON INTERNATIONAL	28,756	57.050	1,640,529.800	
SOUTHERN CO	85,878	55.410	4,758,499.980	
TRUIST FINANCIAL CORP	110,139	36.240	3,991,437.360	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	27.200	320,715.200	
AT&T INC	600,323	29.790	17,883,622.170	
CHEVRON CORP	155,665	95.470	14,861,337.550	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,100	117.330	1,537,023.000	
STATE STREET CORP	29,847	60.220	1,797,386.340	
STARBUCKS CORP	97,227	77.870	7,571,066.490	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	25.370	445,167.390	
STRYKER CORP	27,752	192.080	5,330,604.160	
NETFLIX INC	36,094	435.550	15,720,741.700	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	21.280	1,041,762.400	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	37.730	369,489.890	
SYNOPSIS INC	12,867	160.170	2,060,907.390	
SYSCO CORP	38,931	53.290	2,074,632.990	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,525	537.770	5,122,259.250	
TELEFLEX INC	3,899	340.300	1,326,829.700	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	11.290	997,155.380	
TERADYNE INC	14,447	65.090	940,355.230	
TEXAS INSTRUMENTS INC	76,945	115.000	8,848,675.000	
TEXTRON INC	16,304	27.300	445,099.200	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	32,987	333.010	10,985,000.870	
TIFFANY & CO	8,733	128.560	1,122,714.480	
GLOBE LIFE INC	9,042	77.750	703,015.500	
DAVITA INC	7,993	80.760	645,514.680	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	107.210	1,026,321.330	
TRIMBLE INC	20,073	37.000	742,701.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,294	330.230	1,087,777.620	
TYSON FOODS INC	25,079	60.390	1,514,520.810	
UGI CORP	19,841	30.890	612,888.490	
MARATHON OIL CORP	58,418	5.780	337,656.040	
UNION PACIFIC CORP	56,994	158.260	9,019,870.440	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	123,465	58.670	7,243,691.550	
UNITEDHEALTH GROUP INC	77,977	287.000	22,379,399.000	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	102.060	627,975.180	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	118.700	857,726.200	
VF CORP	26,912	58.230	1,567,085.760	
VIACOMCBS INC	45,361	18.080	820,126.880	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,177	271.630	5,752,308.510	
VULCAN MATERIALS CO	11,057	101.110	1,117,973.270	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,594	41.670	2,608,291.980	
WALMART INC	116,710	122.940	14,348,327.400	
WASTE MANAGEMENT INC	34,870	100.970	3,520,823.900	
WATERS CORP	5,211	186.980	974,352.780	
ALLERGAN PLC	26,999	193.020	5,211,346.980	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,024	200.010	1,204,860.240	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	116.080	1,065,150.080	
VAIL RESORTS INC	3,109	178.040	553,526.360	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	44.200	1,143,321.400	
WABTEC CORP	15,540	57.320	890,752.800	
WHIRLPOOL CORP	4,673	112.600	526,179.800	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,935	111.220	1,549,850.700	
WYNN RESORTS LTD	8,639	86.940	751,074.660	
NASDAQ INC	9,020	107.590	970,461.800	
CME GROUP INC	29,453	181.530	5,346,603.090	
WILLIAMS COS INC	99,729	19.470	1,941,723.630	
LKQ CORP	23,691	26.280	622,599.480	
ALLIANT ENERGY CORP	19,849	47.990	952,553.510	
WEC ENERGY GROUP INC	26,725	85.680	2,289,798.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	37.890	826,759.800	
CARMAX INC	14,208	76.690	1,089,611.520	
XILINX INC	20,663	86.860	1,794,788.180	
TJX COMPANIES INC	99,863	48.510	4,844,354.130	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,227	242.920	1,026,822.840	
ZIONS BANCORP NA	13,142	30.720	403,722.240	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	4.800	131,520.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.110	446,757.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,800	45.500	809,900.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	21.750	371,925.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,381	136.130	1,277,035.530	
SIGNATURE BANK	4,171	103.050	429,821.550	
CBRE GROUP INC	26,811	41.600	1,115,337.600	

LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	21.740	276,793.680	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	10.320	789,273.600	
DOMINO'S PIZZA INC	3,212	369.110	1,185,581.320	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	43.520	130,560.000	
T-MOBILE US INC	35,039	98.520	3,452,042.280	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,755	50.940	1,413,839.700	
MOSAIC CO/THE	28,249	11.910	336,445.590	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,218	484.320	1,558,541.760	
CELANESE CORP	10,139	82.720	838,698.080	
DEXCOM INC	7,700	405.500	3,122,350.000	
DISCOVERY INC-A	10,423	21.085	219,768.950	
EXPEDIA GROUP INC	12,120	69.270	839,552.400	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	29.030	536,329.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,651	125.610	1,337,872.110	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	21.390	727,751.970	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	45,683	93.520	4,272,274.160	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	9.980	146,666.080	
LIVE NATION	11,339	41.960	475,784.440	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,246	925.830	2,079,414.180	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	25.420	114,593.360	
TRANSDIGM GROUP INC	4,026	352.610	1,419,607.860	
MASTERCARD INC	73,917	282.440	20,877,117.480	
HANESBRANDS INC	27,619	9.470	261,551.930	
WESTERN UNION CO	35,367	19.930	704,864.310	
OWENS CORNING	7,611	43.620	331,991.820	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,057	102.700	1,135,553.900	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	30.420	267,908.940	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,067	20.490	144,802.830	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	16.740	290,439.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	116.810	1,071,848.560	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	40,369	12.060	486,850.140	
DELTA AIR LINES INC	11,158	22.720	253,509.760	
INSULET CORP	4,854	217.630	1,056,376.020	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	15.090	91,113.420	
DISCOVER FINANCIAL	24,889	42.720	1,063,258.080	
TE CONNECTIVITY LTD	27,638	76.750	2,121,216.500	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,401	58.640	961,754.640	
WABCO HOLDING INC	4,076	133.950	545,980.200	

LULULEMON ATHLETICA INC	8,968	237.990	2,134,294.320	
VMWARE INC	6,532	140.310	916,504.920	
MERCADOLIBRE INC	3,777	784.520	2,963,132.040	
ULTA BEAUTY INC	4,759	230.070	1,094,903.130	
INVESCO LTD	33,443	7.980	266,875.140	
MSCI INC	7,151	333.580	2,385,430.580	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	127,995	72.000	9,215,640.000	
VISA INC	140,942	185.090	26,086,954.780	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,441	118.030	1,822,501.230	
DISCOVERY INC-C	30,421	19.350	588,646.350	
MARATHON PETROLEUM CORP	53,851	33.030	1,778,698.530	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,110	56.090	679,249.900	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	170,954	15.350	2,624,143.900	
XYLEM INC	15,151	63.000	954,513.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	23,328	56.450	1,316,865.600	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	180.580	629,140.720	
SPLUNK INC	12,343	153.240	1,891,441.320	
EPAM SYSTEMS INC	4,738	223.300	1,057,995.400	
HCA HEALTHCARE INC	22,066	107.920	2,381,362.720	
VERISK ANALYTICS INC	12,587	159.570	2,008,507.590	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	110.440	471,910.120	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,037	240.000	1,688,880.000	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,975	103.910	1,452,142.250	
NXP SEMICONDUCTOR NV	22,860	104.840	2,396,642.400	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	72.980	851,457.660	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	13.800	262,724.400	
LEAR CORP	4,681	101.370	474,512.970	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	100.180	863,751.960	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,752	58.500	1,038,492.000	
DOLLAR GENERAL CORP	20,951	176.360	3,694,918.360	
FORTINET INC	12,393	136.840	1,695,858.120	
TESLA INC	11,133	819.420	9,122,602.860	
GENERAL MOTORS CO	109,268	23.930	2,614,783.240	
XPO LOGISTICS INC	7,614	68.400	520,797.600	
TRIPADVISOR INC	9,263	17.910	165,900.330	
ALLY FINANCIAL INC	34,101	15.780	538,113.780	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	15.010	182,191.380	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	44.890	461,154.970	
APTIV PLC	21,364	68.150	1,455,956.600	

PHILLIPS 66	36,678	77.060	2,826,406.680	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,589	97.240	737,954.360	
FACEBOOK INC	198,237	212.350	42,095,626.950	
IQVIA HOLDINGS INC	13,446	137.650	1,850,841.900	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,424	42.080	480,721.920	
SERVICENOW INC	15,570	377.260	5,873,938.200	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,043	213.960	1,720,880.280	
WORKDAY INC	13,271	165.550	2,197,014.050	
ABBVIE INC	121,664	83.960	10,214,909.440	
ZOETIS INC	39,197	125.470	4,918,047.590	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	12.430	210,054.570	
COTY INC	23,813	5.200	123,827.600	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	10.930	330,774.590	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	29.560	416,057.000	
CDW CORP	11,478	108.540	1,245,822.120	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	10.140	103,417.860	
HOWMET AEROSPACE INC	30,749	12.620	388,052.380	
TWILIO INC	9,468	179.690	1,701,304.920	
SNAP INC	65,366	18.230	1,191,622.180	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,890	30.710	580,111.900	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	33.180	166,099.080	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	32.890	467,202.450	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	8.940	137,765.400	
OKTA INC	8,556	169.380	1,449,215.280	
BLACK KNIGHT INC	12,793	72.700	930,051.100	
BAKER HUGHES CO	51,005	15.010	765,585.050	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	61.540	811,158.740	
ALTICE USA INC-A	14,073	23.400	329,308.200	
TECHNIPFMC LTD	31,257	7.920	247,555.440	
BROADCOM INC	32,660	275.030	8,982,479.800	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,250	266.730	1,667,062.500	
MONGODB INC	3,594	176.490	634,305.060	
BURLINGTON STORES INC	5,912	179.070	1,058,661.840	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	19.840	710,748.160	
VEEVA SYSTEMS INC	10,594	192.340	2,037,649.960	
TWITTER INC	63,023	29.930	1,886,278.390	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	36.710	485,085.940	
EVERGY INC	18,388	57.500	1,057,310.000	
ALLEGION PLC	7,469	102.270	763,854.630	
STERIS PLC	6,604	148.250	979,043.000	
DOCUSIGN INC	8,601	116.560	1,002,532.560	
WIX.COM LTD	4,000	159.950	639,800.000	
DROPBOX INC	17,573	21.880	384,497.240	
KKR & CO INC	42,982	26.660	1,145,900.120	
PERRIGO CO PLC	10,553	52.640	555,509.920	

HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,987	72.190	1,659,431.530	
ARAMARK	18,632	26.080	485,922.560	
CIGNA CORP	30,755	189.270	5,820,998.850	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	43.650	565,704.000	
DOW INC	60,823	34.330	2,088,053.590	
AMCOR PLC	130,000	8.970	1,166,100.000	
PINTEREST INC	21,582	19.790	427,107.780	
XEROX HOLDINGS CORP	13,360	18.130	242,216.800	
FOX CORP-A	31,825	26.000	827,450.000	
FOX CORP-B	13,009	25.730	334,721.570	
CARRIER GLOBAL CORP	65,428	18.360	1,201,258.080	
OTIS WORLDWIDE CORP	32,714	52.950	1,732,206.300	
UBER TECHNOLOGIES INC	37,739	32.790	1,237,461.810	
CORTEVA INC	59,019	25.980	1,533,313.620	
BLACKSTONE GROUP INC	53,700	52.870	2,839,119.000	
GRUBHUB INC	8,158	46.820	381,957.560	
INGERSOLL RAND INC	28,361	29.170	827,290.370	
PAYCOM SOFTWARE INC	3,923	272.030	1,067,173.690	
SABRE CORP	19,809	6.725	133,215.520	
AON PLC	19,230	189.760	3,649,084.800	
ARISTA NETWORKS INC	4,385	218.010	955,973.850	
IHS MARKIT LTD	31,844	67.070	2,135,777.080	
FNF GROUP	21,372	25.840	552,252.480	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,491	18.620	847,042.420	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	36,972	22.200	820,778.400	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	109.060	377,020.420	
CDK GLOBAL INC	9,969	40.780	406,535.820	
WAYFAIR INC	5,091	188.050	957,362.550	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,555	100.690	1,566,232.950	
QORVO INC	9,133	103.000	940,699.000	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	127.110	1,055,902.770	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	19.610	333,722.980	
GODADDY INC	14,540	75.050	1,091,227.000	
NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	14.150	370,786.600	
TRANSUNION	15,196	79.110	1,202,155.560	
SQUARE INC	28,837	76.050	2,193,053.850	
DUPONT DE NEMOURS INC	61,980	46.930	2,908,721.400	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	20,048	39.400	789,891.200	
WESTROCK CO	22,778	27.000	615,006.000	
KRAFT HEINZ CO	56,143	29.560	1,659,587.080	
FORTIVE CORP	25,025	59.270	1,483,231.750	
MATCH GROUP INC	4,599	79.990	367,874.010	
WASTE CONNECTIONS INC	22,092	92.670	2,047,265.640	

	ALPHABET INC-CL A	24,919	1,384.340	34,496,368.460	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	105,599	10.250	1,082,389.750	
	PAYPAL HOLDINGS INC	91,876	144.960	13,318,344.960	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	37,687	17.850	672,712.950	
	DXC TECHNOLOGY CO	20,848	17.650	367,967.200	
	ZILLOW GROUP INC-C	10,805	52.970	572,340.850	
	ALPHABET INC-CL C	25,221	1,388.370	35,016,079.770	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	156.810	495,362.790	
	LINDE PLC	43,850	188.410	8,261,778.500	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	27.300	323,423.100	
	ROKU INC	7,054	126.660	893,459.640	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,394	515.280	6,386,380.320	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	18.900	567,000.000	
アメリカ・ドル	小計	24,703,113		2,058,441,056.840 (220,150,271,028)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	8.058	256,228.280	
	ASHTED GROUP	38,255	22.160	847,730.800	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	24.170	440,304.890	
	BHP GROUP PLC	181,953	13.766	2,504,764.990	
	BARCLAYS PLC	1,420,719	1.054	1,497,437.820	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	5.308	436,758.160	
	BT GROUP PLC	723,199	1.049	758,635.750	
	BUNZL PLC	28,834	17.305	498,972.370	
	EASYJET PLC	13,628	5.314	72,419.190	
	AVIVA PLC	318,596	2.473	787,887.900	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	49.660	516,017.060	
	DIAGEO PLC	192,869	27.780	5,357,900.820	
	SCHRODERS PLC	11,354	27.910	316,890.140	
	DCC PLC	7,898	58.280	460,295.440	
	NATIONAL GRID PLC	287,812	9.212	2,651,324.140	
	KINGFISHER PLC	165,680	1.561	258,626.480	
	BAE SYSTEMS PLC	269,245	5.122	1,379,072.890	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	188,646	29.770	5,615,991.420	
	HALMA PLC	31,901	22.330	712,349.330	
	NEXT PLC	12,524	48.820	611,421.680	
	IMPERIAL BRANDS PLC	78,235	16.270	1,272,883.450	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	19.550	293,582.350	
	ANGLO AMERICAN PLC	87,429	14.670	1,282,583.430	
	COMPASS GROUP PLC	128,420	12.870	1,652,765.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,670,501	4.127	6,894,157.620	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	517,170	2.050	1,060,198.500	
	CENTRICA PLC	471,340	0.399	188,064.660	
	UNILEVER PLC	90,590	40.830	3,698,789.700	
	MEGGITT PLC	62,181	2.577	160,240.430	

MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	224,069	1.871	419,233.090	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.996	490,165.050	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	3.936	318,280.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	17.660	550,391.560	
PEARSON PLC	65,009	4.496	292,280.460	
PERSIMMON PLC	28,006	22.820	639,096.920	
PRUDENTIAL PLC	216,909	11.230	2,435,888.070	
RIO TINTO PLC	91,243	37.255	3,399,257.960	
VODAFONE GROUP PLC	2,229,795	1.129	2,517,438.550	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	58,131	66.480	3,864,548.880	
RELX PLC	160,493	18.590	2,983,564.870	
RENTOKIL INITIAL PLC	146,366	4.821	705,630.480	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	2.871	399,838.420	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	423,054	1.141	482,704.610	
ST JAMES'S PLACE PLC	38,985	8.492	331,060.620	
SSE PLC	81,857	12.355	1,011,343.230	
BP PLC	1,667,927	3.159	5,268,981.390	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	6.420	559,252.620	
SMITHS GROUP PLC	31,720	12.500	396,500.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	93.700	517,036.600	
STANDARD CHARTERED PLC	220,443	4.134	911,311.360	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,664,012	0.312	1,767,171.740	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	1.519	383,223.950	
TESCO PLC	798,198	2.373	1,894,123.850	
3I GROUP PLC	76,643	7.650	586,318.950	
SMITH & NEPHEW PLC	69,875	16.575	1,158,178.120	
GLAXOSMITHKLINE PLC	410,454	16.746	6,873,462.680	
WEIR GROUP	19,161	9.626	184,443.780	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	25,594	78.280	2,003,498.320	
WPP PLC	107,148	6.050	648,245.400	
ASTRAZENECA PLC	108,001	85.590	9,243,805.590	
WHITBREAD PLC	9,814	28.580	280,484.120	
CARNIVAL PLC	13,350	9.370	125,089.500	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	0.951	168,070.230	
INTERTEK GROUP PLC	14,390	47.220	679,495.800	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	13.850	438,851.100	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,397	35.940	553,368.180	
ITV PLC	254,308	0.733	186,407.760	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	1.927	264,413.300	
G4S PLC	122,250	0.969	118,460.250	

	ADMIRAL GROUP PLC	15,893	24.150	383,815.950	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,271	42.680	481,046.280	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	339,119	13.206	4,478,405.510	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	311,410	12.636	3,934,976.760	
	TUI AG-DI	29,824	2.650	79,033.600	
	AVEVA GROUP PLC	5,704	39.100	223,026.400	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.195	452,857.030	
	EXPERIAN PLC	74,660	26.010	1,941,906.600	
	MONDI PLC	39,767	13.610	541,228.870	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	15.050	421,565.550	
	OCADO GROUP PLC	39,210	18.640	730,874.400	
	INFORMA PLC	135,291	4.543	614,627.010	
	GLENCORE PLC	880,918	1.481	1,304,639.550	
	GVC HOLDINGS PLC	49,618	7.928	393,371.500	
	EVRAZ PLC	48,765	2.700	131,665.500	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.806	316,219.360	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	18.965	288,419.720	
	FERGUSON PLC	19,440	57.000	1,108,080.000	
	M&G PLC	204,940	1.316	269,701.040	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,086	5.542	177,820.610	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	4.769	124,470.900	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	4.798	366,317.700	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	0.960	350,145.600	
イギリス・ポンド	小計	24,612,944		117,649,428.590 (15,629,726,588)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	23.010	2,355,280.590	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	19.430	2,539,559.290	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	483.600	851,136.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	11.600	1,184,754.400	
	ICL GROUP LTD	49,411	12.850	634,931.350	
	NICE LTD	4,902	616.900	3,024,043.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	71.260	744,239.440	
	AZRIELI GROUP	2,291	199.000	455,909.000	
イスラエル・シュケル	小計	404,004		11,789,853.870 (358,883,152)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,975	60.910	973,037.250	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	232,231	15.730	3,652,993.630	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	294,468	15.510	4,567,198.680	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	12.040	1,392,570.480	

TELSTRA CORP LTD	364,409	3.030	1,104,159.270	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	5.890	229,792.460	
AMP LTD	302,414	1.410	426,403.740	
ASX LTD	15,573	82.300	1,281,657.900	
BHP GROUP LTD	241,065	31.400	7,569,441.000	
CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	24.500	513,177.000	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	89,512	3.030	271,221.360	
COMPUTERSHARE LT	38,040	11.430	434,797.200	
CSL LIMITED	37,367	301.180	11,254,193.060	
REA GROUP LTD	4,119	95.170	392,005.230	
TRANSURBAN GROUP	223,753	13.600	3,043,040.800	
COCA-COLA AMATIL LTD	52,458	8.660	454,286.280	
COCHLEAR LTD	5,533	181.660	1,005,124.780	
ORIGIN ENERGY LTD	132,860	5.530	734,715.800	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	145,744	59.600	8,686,342.400	
BORAL LIMITED	86,101	2.750	236,777.750	
RIO TINTO LIMITED	30,466	83.000	2,528,678.000	
APA GROUP	94,106	11.260	1,059,633.560	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	24.980	1,132,168.540	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	177,176	5.280	935,489.280	
TPG TELECOM LTD	28,719	7.260	208,499.940	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	10.760	35,239.000	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	21.630	733,819.380	
ORICA LTD	40,893	16.260	664,920.180	
CIMIC GROUP LTD	8,709	23.030	200,568.270	
LEND LEASE CORP LTD	62,116	11.220	696,941.520	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	10.070	371,995.870	
SYDNEY AIRPORT	85,130	5.450	463,958.500	
MACQUARIE GROUP LTD	27,219	105.190	2,863,166.610	
WORLEY LTD	27,772	8.560	237,728.320	
SUNCORP GROUP LTD	110,775	8.910	987,005.250	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,896	16.080	4,259,527.680	
NEWCREST MINING LTD	70,138	27.600	1,935,808.800	
OIL SEARCH LTD	197,895	2.870	567,958.650	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	2.190	298,772.940	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	3.400	211,758.800	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,359	7.560	887,234.040	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	4.760	217,565.320	
SANTOS LTD	132,862	4.850	644,380.700	
SONIC HEALTHCARE	34,684	25.900	898,315.600	

	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	15,775	17.740	279,848.500	
	TABCORP HOLDINGS LTD	158,601	3.140	498,007.140	
	WESFARMERS LTD	92,712	37.450	3,472,064.400	
	ALUMINA LIMITED	184,613	1.525	281,534.820	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,277	21.890	1,757,263.530	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	102,184	34.700	3,545,784.800	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	55.000	549,725.000	
	SEEK LTD	25,899	17.410	450,901.590	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.955	322,704.030	
	AGL ENERGY LTD	49,076	16.490	809,263.240	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.580	1,345,416.280	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	9.340	306,921.740	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	4.490	674,173.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	9.840	567,443.280	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.830	585,555.300	
	SOUTH32 LTD(AUD)	472,144	1.850	873,466.400	
	COLES GROUP LTD	109,456	15.200	1,663,731.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	19.910	159,280.000	
	オーストラリア・ドル 小計	6,380,591		89,407,155.570 (6,247,772,031)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	19,234	91.780	1,765,296.520	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	73,988	40.500	2,996,514.000	
	BARRICK GOLD CORP	145,340	38.130	5,541,814.200	
	ATCO LTD	7,193	37.710	271,248.030	
	BANK OF MONTREAL	53,051	68.340	3,625,505.340	
	BANK OF NOVA SCOTIA	100,112	52.950	5,300,930.400	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,047	55.500	1,612,108.500	
	BCE INC	11,673	56.750	662,442.750	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	109,906	46.500	5,110,629.000	
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,415	23.370	477,098.550	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	0.440	66,710.600	
	SAPUTO INC	18,601	34.590	643,408.590	
	BLACKBERRY LTD	39,652	6.550	259,720.600	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	46,369	19.000	881,011.000	
	CGI INC	21,239	90.650	1,925,315.350	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	44.000	498,960.000	
	CAE INC	19,684	22.030	433,638.520	
	CAMECO CORP	32,627	14.970	488,426.190	
	ROGERS COMM-CL B	30,750	56.920	1,750,290.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	36,403	83.230	3,029,821.690	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,962	22.840	2,305,972.080	

CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	100.090	486,637.580	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	32.290	294,452.510	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,741	114.140	6,704,697.740	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	19.220	305,809.420	
OPEN TEXT CORP	21,795	55.110	1,201,122.450	
EMPIRE CO LTD	15,093	30.970	467,430.210	
KINROSS GOLD CORP	99,741	9.790	976,464.390	
FORTIS INC	35,862	53.250	1,909,651.500	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	8.890	491,581.440	
TELUS CORP	31,890	22.850	728,686.500	
GREAT WEST LIFECO INC	19,881	21.550	428,435.550	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	21.200	456,690.400	
ENBRIDGE INC	166,537	44.650	7,435,877.050	
IGM FINANCIAL INC	10,692	28.090	300,338.280	
MANULIFE FINANCIAL CORP	158,209	17.080	2,702,209.720	
LOBLAW CO LTD	15,136	69.260	1,048,319.360	
MAGNA INTERNATIONAL INC	24,355	55.250	1,345,613.750	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,404	48.410	2,343,237.640	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	348.090	721,242.480	
METRO INC	19,949	57.670	1,150,458.830	
HUSKY ENERGY INC	28,749	4.090	117,583.410	
EMERA INC	19,138	54.410	1,041,298.580	
METHANEX CORP	5,281	22.160	117,026.960	
ONEX CORP	6,646	66.000	438,636.000	
POWER CORP OF CANADA	46,551	20.970	976,174.470	
QUEBECOR INC-B	17,237	29.910	515,558.670	
ROYAL BANK OF CANADA	117,632	85.340	10,038,714.880	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,307	319.160	3,608,742.120	
SHAW COMM INC-B	36,251	22.980	833,047.980	
SUNCOR ENERGY INC	125,040	23.830	2,979,703.200	
LUNDIN MINING CORP	43,480	6.340	275,663.200	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	12.740	522,543.840	
THOMSON REUTERS CORP	16,252	95.040	1,544,590.080	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	148,799	57.030	8,486,006.970	
TC ENERGY CORP	78,207	64.220	5,022,453.540	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	40.110	228,466.560	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	97.890	605,351.760	
INTACT FINANCIAL CORP	10,997	138.040	1,518,025.880	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,085	60.380	2,178,812.300	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,707	1,465.090	2,500,908.630	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,080	199.400	3,206,352.000	
CI FINANCIAL CORP	27,105	14.630	396,546.150	

KEYERA CORP	16,668	20.790	346,527.720	
PARKLAND FUEL CORP	10,583	33.300	352,413.900	
ALTAGAS LTD	23,944	16.450	393,878.800	
PEMBINA PIPELINE CORP	43,740	31.830	1,392,244.200	
DOLLARAMA INC	23,536	43.950	1,034,407.200	
STARS GROUP INC	18,529	37.490	694,652.210	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	5.380	434,278.980	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23,762	59.780	1,420,492.360	
INTER PIPELINE LTD	27,946	11.020	307,964.920	
NUTRIEN LTD	48,340	49.400	2,387,996.000	
CRONOS GROUP INC	16,000	7.520	120,320.000	
WSP GLOBAL INC	8,400	88.540	743,736.000	
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	41.680	337,774.720	
OVINTIV INC	19,278	8.050	155,187.900	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	9.590	143,475.990	
AIR CANADA	10,722	17.050	182,810.100	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	22,446	71.970	1,615,438.620	
AURORA CANNABIS INC	66,562	0.910	60,571.420	
SHOPIFY INC	8,459	989.060	8,366,458.540	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	21.340	397,649.560	
HYDRO ONE LTD	27,340	25.570	699,083.800	
カナダ・ドル 小計	3,298,403		139,885,388.830 (10,734,804,739)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.310	413,750.000	
SEBACORP INDUSTRIES	81,400	1.600	130,240.000	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	1.540	190,498.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	144,100	19.700	2,838,770.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	8.000	291,200.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	20.340	120,900.960	
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	2.970	141,966.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.810	675,909.000	
CAPITALAND LTD	204,515	2.930	599,228.950	
GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.765	326,502.000	
KEPPEL CORP LTD	134,900	6.040	814,796.000	
COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	1.590	282,861.000	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	8.880	2,412,278.640	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.720	1,840,955.840	
SINGAPORE AIRLINES LTD	124,500	4.410	549,045.000	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	104,000	19.880	2,067,520.000	
UOL GROUP LIMITED	40,500	6.960	281,880.000	
VENTURE CORP LTD	21,000	15.740	330,540.000	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	3.470	493,781.000	

	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.990	186,912.000	
シンガポール・ドル 小計		3,146,934		14,989,534.390 (1,134,258,067)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	210,342	8.154	1,715,128.660	
	NESTLE SA-REGISTERED	244,715	105.000	25,695,075.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,393	55.760	2,419,593.680	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	57,829	341.250	19,734,146.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	214.200	742,631.400	
	SIKA INHABER	10,155	166.750	1,693,346.250	
	SGS SA-REG	478	2,180.000	1,042,040.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	176,770	82.690	14,617,111.300	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,199	138.800	582,821.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	1,852.000	490,780.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	17.885	357,324.410	
	SWISSCOM AG-REG	2,192	500.000	1,096,000.000	
	ABB LTD	151,150	17.760	2,684,424.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	41.640	538,988.160	
	GEBERIT AG	2,931	432.700	1,268,243.700	
	LONZA GROUP AG-REG	6,137	445.800	2,735,874.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	7,830.000	743,850.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	81,800.000	736,200.000	
	GIVAUDAN-REG	768	3,322.000	2,551,296.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,200	291.300	3,553,860.000	
	LAFARGEHOLCIM LTD	40,497	39.650	1,605,706.050	
	TEMENOS GROUP	5,723	132.050	755,722.150	
	SONOVA HOLDING AG	4,667	186.700	871,328.900	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	136.800	618,062.400	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	744.000	590,736.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,829	187.150	529,447.350	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	36.260	166,505.920	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	210.000	349,230.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,830	333.000	942,390.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	152.850	529,625.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	638.500	404,170.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	94.300	564,857.000	
PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	68.850	206,550.000		
DUFREY GROUP	3,138	27.660	86,797.080		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,515	788.400	1,194,426.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	37.580	670,765.420		
SWISS RE LTD	24,292	66.400	1,612,988.800		
ALCON INC	34,580	52.680	1,821,674.400		
UBS GROUP AG	318,832	9.618	3,066,526.170		
スイス・フラン 小計		1,441,425		101,586,244.000 (11,194,804,089)	

スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,126	344.600	18,307,219.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,341	312.000	10,402,392.000	
	ERICSSON LM-B SHS	253,072	83.620	21,161,880.640	
	LUNDBERGS B	7,382	418.200	3,087,152.400	
	SKF AB-B SHS	28,812	156.700	4,514,840.400	
	SANDVIK AB	98,784	150.000	14,817,600.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	75.380	9,861,739.260	
	SKANSKA AB-B SHS	25,018	184.700	4,620,824.600	
	SWEDBANK AB	71,958	108.300	7,793,051.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,411	87.440	11,053,377.840	
	VOLVO AB-B SHS	119,911	126.650	15,186,728.150	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	620.200	8,026,008.200	
	TELE2 AB-B SHS	44,518	126.900	5,649,334.200	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	203.000	2,314,809.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	137.950	2,647,398.450	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	120.000	2,891,760.000	
	INVESTOR AB-B SHS	38,580	483.600	18,657,288.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	62,087	132.450	8,223,423.150	
	ASSA ABLOY AB-B	80,174	187.450	15,028,616.300	
	TELIA CO AB	230,897	32.700	7,550,331.900	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	226.200	3,333,961.800	
	BOLIDEN AB	21,855	199.000	4,349,145.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	187.000	4,365,141.000	
	KINNEVIK AB-B	18,310	221.000	4,046,510.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,844	239.800	1,880,991.200	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	415.900	3,746,843.100	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	58.300	1,964,243.600		
HEXAGON AB	21,145	472.900	9,999,470.500		
EPIROC AB-A	63,371	101.350	6,422,650.850		
EPIROC AB-B	30,899	101.400	3,133,158.600		
ESSITY AB-B	52,640	312.600	16,455,264.000		
NORDEA BANK ABP	262,037	59.600	15,617,405.200		
スウェーデン・クローナ 小計	2,031,415		267,110,560.340 (2,916,847,319)		
デンマーク・ク ローネ	CARLSBERG AS-B	8,776	829.800	7,282,324.800	
	A P MOLLER A/S	491	6,340.000	3,112,940.000	
	AP MOLLER MAERSK A	435	5,910.000	2,570,850.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	77.260	3,942,886.840	
	GENMAB A/S	5,646	1,820.000	10,275,720.000	
	NOVOZYMES-B SHS	18,310	349.400	6,397,514.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	145,838	432.000	63,002,016.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	15,504	593.600	9,203,174.400	
	COLOPLAST-B	9,511	1,052.000	10,005,572.000	
	DSV PANALPINA A S	17,572	692.400	12,166,852.800	

	DEMANT A/S	7,244	171.800	1,244,519.200	
	H LUNDBECK A/S	4,840	242.600	1,174,184.000	
	TRYG A/S	11,107	182.500	2,027,027.500	
	PANDORA A/S	8,251	272.000	2,244,272.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,258	611.000	5,656,638.000	
	ISS A/S	11,107	101.350	1,125,694.450	
	ORSTED A/S	15,144	696.000	10,540,224.000	
デンマーク・クローネ 小計		340,068		151,972,409.990 (2,363,170,975)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	5.680	484,191.600	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	12.140	362,913.160	
	A2 MILK CO LTD	55,091	19.530	1,075,927.230	
	FISHER & PAYKEL	50,218	29.800	1,496,496.400	
	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	3.400	217,953.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.600	734,265.800	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	4.800	296,323.200	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.700	583,561.400	
ニュージーランド・ドル 小計		630,071		5,251,632.390 (344,559,601)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	180.000	6,332,940.000	
	DNB ASA	83,164	118.100	9,821,668.400	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	24.100	2,244,649.900	
	TELENOR ASA	56,638	150.350	8,515,523.300	
	ORKLA ASA	65,283	84.860	5,539,915.380	
	EQUINOR ASA	83,149	140.750	11,703,221.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	16,390	337.100	5,525,069.000	
	AKER BP ASA	8,552	174.850	1,495,317.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	177.900	2,967,905.700	
	SCHIBSTED ASA	7,445	213.400	1,588,763.000	
ノルウェー・クローネ 小計		465,626		55,734,973.630 (581,873,125)	
ユーロ	CRH PLC	63,087	27.080	1,708,395.960	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,350	114.050	724,217.500	
	KERRY GROUP PLC-A	13,521	101.500	1,372,381.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,741	49.500	581,179.500	
	UMICORE	17,654	36.970	652,668.380	
	AIR LIQUIDE	38,523	119.900	4,618,907.700	
	AIRBUS SE	47,905	56.070	2,686,033.350	
	AXA	158,477	16.226	2,571,447.800	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,117	19.635	866,237.290	
	ADIDAS AG	15,061	207.900	3,131,181.900	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,009	12.975	1,128,941.770	
	DASSAULT AVIATION SA	137	722.500	98,982.500	
	DANONE	50,891	64.060	3,260,077.460	

SAFRAN SA	28,002	81.120	2,271,522.240	
INTESA SANPAOLO	1,245,487	1.414	1,761,118.610	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	27,741	51.420	1,426,442.220	
ACCOR SA	12,018	22.970	276,053.460	
BOUYGUES	17,572	27.610	485,162.920	
BNP PARIBAS	91,607	28.815	2,639,655.700	
THALES SA	8,549	69.920	597,746.080	
CAPGEMINI SA	12,619	88.960	1,122,586.240	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	35.300	150,519.200	
INGENICO GROUP	4,498	123.500	555,503.000	
UNICREDIT SPA	173,574	6.580	1,142,116.920	
NATIXIS	70,166	2.174	152,540.880	
KONINKLIJKE DSM NV	14,867	114.900	1,708,218.300	
COMMERZBANK AG	83,118	3.244	269,634.790	
EIFFAGE	6,461	77.640	501,632.040	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,713	40.170	1,394,421.210	
UNITED INTERNET	9,882	31.950	315,729.900	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	35.060	194,442.760	
PUBLICIS GROUPE	20,157	26.240	528,919.680	
FAURECIA	6,117	32.900	201,249.300	
IBERDROLA SA	509,958	8.800	4,487,630.400	
ENI SPA	211,633	8.631	1,826,604.420	
JERONIMO MARTINS	19,517	15.450	301,537.650	
KBC GROUPE	21,124	48.810	1,031,062.440	
HANNOVER RUECK SE	4,868	139.000	676,652.000	
WARTSILA OYJ	34,935	6.708	234,343.980	
L'OREAL	20,541	253.500	5,207,143.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	22,871	352.250	8,056,309.750	
GEA GROUP AG	11,838	22.200	262,803.600	
BOLLORE	71,347	2.530	180,507.910	
MEDIOBANCA SPA	39,713	5.196	206,348.740	
MICHELIN(CGDE)-B	13,862	89.280	1,237,599.360	
CONTINENTAL AG	8,640	79.120	683,596.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	81,177	26.780	2,173,920.060	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	13.600	216,036.000	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	19.080	179,332.920	
OMV AG	12,817	30.940	396,557.980	
VERBUND AG	4,908	44.660	219,191.280	
PERNOD-RICARD	17,836	136.700	2,438,181.200	
PEUGEOT SA	44,683	13.425	599,869.270	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,649	47.000	594,503.000	
RENAULT SA	14,917	17.526	261,435.340	
REPSOL SA	117,630	8.634	1,015,617.420	
REMY COINTREAU	1,860	100.300	186,558.000	

MERCK KGAA	11,125	106.100	1,180,362.500	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	40,642	25.400	1,032,306.800	
RWE AG	46,489	27.130	1,261,246.570	
SEB SA	1,551	112.000	173,712.000	
SOCIETE GENERALE-A	68,153	13.268	904,254.000	
VINCI S.A.	42,889	76.800	3,293,875.200	
SODEXO	7,075	65.460	463,129.500	
SOLVAY SA	5,563	73.760	410,326.880	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,310	80.420	3,643,830.200	
VIVENDI SA	68,572	19.960	1,368,697.120	
SAP SE	81,005	107.740	8,727,478.700	
TELEFONICA S.A	394,836	4.215	1,664,233.740	
TOTAL SA	197,864	32.985	6,526,544.040	
VALEO	19,653	20.700	406,817.100	
E.ON SE	190,255	9.172	1,745,018.860	
VOEST-ALPINE AG	9,875	18.955	187,180.620	
HENKEL AG & CO KGAA	7,455	71.300	531,541.500	
SIEMENS AG-REG	63,204	88.330	5,582,809.320	
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	25.330	1,135,518.570	
ING GROEP NV-CVA	316,722	5.070	1,605,780.540	
PUMA AG	7,534	60.100	452,793.400	
BAYER AG	81,034	57.990	4,699,161.660	
STORA ENSO OYJ-R SHS	54,622	10.640	581,178.080	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,452	79.600	1,229,979.200	
DAIMLER AG	75,045	31.655	2,375,549.470	
BASF SE	75,006	46.240	3,468,277.440	
BEIERSDORF AG	8,371	94.280	789,217.880	
HOCHTIEF AG	1,707	70.950	121,111.650	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	44.250	532,371.750	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,156	71.780	1,303,237.680	
ORANGE	161,909	10.725	1,736,474.020	
SAMPO OYJ-A SHS	36,389	30.060	1,093,853.340	
RANDSTAD NV	9,074	36.360	329,930.640	
ALLIANZ SE	34,364	157.680	5,418,515.520	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	4.124	831,423.140	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,232	22.640	2,088,132.480	
HERMES INTL	2,676	679.800	1,819,144.800	
ENDESA S.A.	29,748	20.280	603,289.440	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	7.778	125,194.680	
ERSTE GROUP BANK AG	27,125	19.610	531,921.250	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,862	191.050	2,266,235.100	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	10.294	634,048.630	
DASSAULT SYSTEMES SA	10,824	140.350	1,519,148.400	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	23.740	478,052.380	
HEINEKEN NV	21,110	75.000	1,583,250.000	
AKZO NOBEL	16,843	70.720	1,191,136.960	
ASML HOLDING NV	35,038	278.400	9,754,579.200	
AEGON NV	150,349	2.199	330,617.450	
BANKINTER S.A.	57,960	3.514	203,671.440	
VOLKSWAGEN AG	2,758	139.000	383,362.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,582	128.920	2,008,831.440	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	556,319	2.727	1,517,081.910	
KERING	6,324	447.500	2,829,990.000	
CNP ASSURANCES	13,987	9.210	128,820.270	
FORTUM OYJ	39,409	15.590	614,386.310	
AGEAS	14,365	32.660	469,160.900	
UCB SA	10,571	84.300	891,135.300	
THYSSENKRUPP AG	27,110	5.280	143,140.800	
CARREFOUR SA	49,926	13.295	663,766.170	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	16.635	392,785.620	
ATOS SE	7,304	66.140	483,086.560	
NOKIA OYJ	473,158	3.294	1,558,582.450	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	74,827	39.600	2,963,149.200	
WOLTERS KLUWER-CVA	22,583	67.480	1,523,900.840	
SANOFI	92,813	89.570	8,313,260.410	
STMICROELECTRONICS NV	56,474	23.380	1,320,362.120	
ELISA OYJ	10,787	54.620	589,185.940	
BANCO SANTANDER SA	1,388,012	1.998	2,773,247.970	
METSO OYJ	8,585	26.410	226,729.850	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	15.500	536,238.000	
QIAGEN N.V.	17,974	39.450	709,074.300	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	6.537	976,523.200	
BMW VORZUG	4,116	42.480	174,847.680	
ENEL SPA	670,875	6.200	4,159,425.000	
COLRUYT NV	4,673	55.460	259,164.580	
VOPAK (KON.)	5,364	49.870	267,502.680	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	277,656	13.660	3,792,780.960	
SARTORIUS AG	2,712	286.400	776,716.800	
LEONARDO SPA	28,316	6.100	172,727.600	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	73.900	567,995.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	101,376	18.310	1,856,194.560	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	95.300	359,376.300	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.116	615,817.360	
EUROFINS SCIENTIFIC	899	563.200	506,316.800	
TELEPERFORMANCE	5,018	225.100	1,129,551.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,488	148.550	2,300,742.400	
EURAZEO	2,748	44.300	121,736.400	
BANCO SABADELL	413,631	0.331	136,911.860	

GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	71.040	475,186.560	
FRAPORT AG	3,149	37.760	118,906.240	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	69.950	699,779.800	
INDITEX	88,189	23.120	2,038,929.680	
JC DECAUX SA	6,058	19.100	115,707.800	
ANDRITZ AG	6,265	30.860	193,337.900	
MAPFRE SA	84,474	1.616	136,509.980	
ESSILORLUXOTTICA	23,278	110.700	2,576,874.600	
SNAM SPA	171,294	4.026	689,629.640	
CREDIT AGRICOLE SA	105,610	7.260	766,728.600	
ENAGAS	18,095	20.590	372,576.050	
WENDEL	2,220	75.150	166,833.000	
WIRECARD AG	10,105	84.180	850,638.900	
TENARIS SA	36,959	6.230	230,254.570	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.346	263,885.550	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.348	173,163.400	
ATLANTIA SPA	37,690	13.950	525,775.500	
ILIAD SA	1,046	143.300	149,891.800	
PROXIMUS	13,739	18.180	249,775.020	
SES FDR	28,847	6.140	177,120.580	
TERNA SPA	113,654	5.776	656,465.500	
BIOMERIEUX	3,248	120.900	392,683.200	
GRIFOLS SA	23,518	29.220	687,195.960	
FERROVIAL SA	39,634	23.500	931,399.000	
LANXESS AG	6,856	46.810	320,929.360	
NESTE OYJ	33,181	31.280	1,037,901.680	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	15.830	152,617.030	
RECORDATI SPA	9,977	41.400	413,047.800	
GALAPAGOS NV	3,426	201.400	689,996.400	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	58,858	7.194	423,424.450	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	124.200	517,665.600	
KONE OYJ	28,802	56.400	1,624,432.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,554	236.000	602,744.000	
ENGIE	150,782	9.798	1,477,362.030	
ALSTOM	15,712	36.320	570,659.840	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	35.540	129,152.360	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	9.226	115,712.490	
ELECTRICITE DE FRANCE	43,173	7.200	310,845.600	
IPSEN SA	3,646	68.500	249,751.000	
DEUTSCHE WOHNEN	30,347	38.390	1,165,021.330	
ARKEMA SA	4,996	75.800	378,696.800	
LEGRAND SA	22,725	59.900	1,361,227.500	
UNILEVER NV	120,278	45.000	5,412,510.000	
ADP	2,313	81.000	187,353.000	
ORION OYJ	8,051	45.330	364,951.830	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.260	411,302.880	
SYMRISE AG	11,342	95.100	1,078,624.200	
SCOR SE	15,667	24.200	379,141.400	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	29.220	508,340.340	
PRYSMIAN SPA	22,328	18.140	405,029.920	
CAIXABANK	307,331	1.650	507,096.150	
BUREAU VERITAS SA	23,179	18.735	434,258.560	
GETLINK	37,646	11.400	429,164.400	
SUEZ SA	26,620	10.305	274,319.100	
AMADEUS IT GROUP SA	34,412	40.690	1,400,224.280	
BRENTAG AG	12,353	44.520	549,955.560	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	22.360	382,713.760	
EDENRED	19,188	39.430	756,582.840	
BANKIA SA	100,675	0.910	91,614.250	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.742	168,745.420	
KION GROUP AG	4,567	45.960	209,899.320	
VONOVIA SE	41,349	48.600	2,009,561.400	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	1.644	135,228.860	
KNORR-BREMSE AG	4,265	81.350	346,957.750	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	40.840	468,353.120	
FERRARI NV	9,758	146.450	1,429,059.100	
METRO AG	10,774	7.620	82,097.880	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	5.170	403,006.670	
AROUNDTOWN SA	113,665	5.074	576,736.210	
AIB GROUP PLC	41,352	1.085	44,866.920	
MONCLER SPA	14,353	32.780	470,491.340	
PROSUS NV	40,745	73.600	2,998,832.000	
WORLDLINE SA	11,987	66.140	792,820.180	
NN GROUP NV	26,416	25.750	680,212.000	
FINECOBANK SPA	45,048	9.678	435,974.540	
ZALANDO SE	10,377	53.400	554,131.800	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	97,919	7.770	760,830.630	
AENA SME SA	5,338	107.900	575,970.200	
CELLNEX TELECOM SAU	19,780	51.200	1,012,736.000	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	9,000	98.080	882,720.000	
ABN AMRO BANK NV	34,251	6.818	233,523.310	
EXOR NV	7,971	48.500	386,593.500	
ALTICE EUROPE NV	56,763	3.740	212,293.620	
COVESTRO AG	17,056	30.990	528,565.440	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	62,590	39.965	2,501,409.350	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	7.398	296,030.970	
AMUNDI SA	4,119	60.000	247,140.000	
ADYEN NV	818	981.000	802,458.000	
PIRELLI & C SPA	34,086	3.669	125,061.530	

	UNIPER SE	14,388	25.220	362,865.360	
	DELIVERY HERO SE	9,719	87.420	849,634.980	
ユーロ 小計		16,073,543		273,257,408.430 (31,697,859,378)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	82.650	2,719,185.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.620	2,725,680.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.160	1,678,377.600	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	80.000	10,760,000.000	
	PCCW LTD	331,000	4.760	1,575,560.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	45.400	2,247,300.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	97,540	242.800	23,682,712.000	
	MTR CORP	126,000	42.700	5,380,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	64,900	135.200	8,774,480.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	30.500	3,521,225.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,500	50.400	5,216,400.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	850,755	13.780	11,723,403.900	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	177,000	53.700	9,504,900.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	68,500	21.800	1,493,300.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	24.050	7,635,875.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	7.760	1,047,600.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	13.040	658,520.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	9.110	4,411,663.260	
	SINO LAND CO	255,400	10.900	2,783,860.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	133,500	102.400	13,670,400.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	49.850	2,467,575.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	116,000	64.900	7,528,400.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	28.200	1,974,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	57.750	3,696,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.100	1,263,600.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	14.140	1,759,016.000	
	AIA GROUP LTD	990,827	69.650	69,011,100.550	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	12.660	3,658,740.000	
	SANDS CHINA LTD	198,800	31.100	6,182,680.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	21.550	2,245,510.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	33.600	3,217,200.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	8.010	1,842,300.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	101,900	22.350	2,277,465.000	

	WH GROUP LTD	731,500	7.130	5,215,595.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	227,332	56.800	12,912,457.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	220,332	48.700	10,730,168.400	
香港・ドル	小計	7,565,112		257,192,449.310 (3,549,255,800)	
合計		91,093,249		306,904,085,892 (306,904,085,892)	

(2) 株式以外の有価証券

令和2年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	84,575.000	748,488.750	
		GOODMAN GROUP	134,222.000	1,927,427.920	
		GPT GROUP	158,232.000	634,510.320	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	721,425.420	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	924,589.600	
		STOCKLAND	194,018.000	531,609.320	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	386,733.490	
	オーストラリア・ドル	小計	1,591,176.000	5,874,784.820 (410,529,963)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	272,806.000	799,321.580	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	328,017.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	368,150.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	365,370.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	259,335.000	
	シンガポール・ドル	小計	1,062,506.000	2,120,193.580 (160,435,048)	
投資信託受益証券	合計		2,653,682	570,965,011 (570,965,011)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	584,785.740	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,520.000	1,447,040.000	
		AMERICAN TOWER CORP	36,404.000	8,677,257.440	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	109,087.000	677,430.270	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,231.000	1,841,434.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	13,487.000	1,172,155.170	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,458.000	748,194.680	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	34,148.000	5,385,139.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	21,885.000	3,174,638.100	
		DUKE REALTY TRUST	31,185.000	1,057,795.200	
		EQUINIX INC	7,004.000	4,749,832.640	

	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	836,091.360	
	EQUITY RESIDENTIAL	29,639.000	1,903,416.580	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,736.000	1,414,784.400	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	10,566.000	968,796.540	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	468,720.000	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	41,581.000	1,008,339.250	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	609,582.960	
	INVITATION HOMES INC	42,384.000	1,056,633.120	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	604,200.870	
	KIMCO REALTY	32,980.000	359,482.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	39,953.000	715,158.700	
	MID AMERICA	8,932.000	1,032,271.240	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	450,689.980	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	490,124.180	
	PROLOGIS INC	60,432.000	5,437,067.040	
	PUBLIC STORAGE	12,738.000	2,424,550.920	
	REALTY INCOME CORP	28,267.000	1,550,727.620	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	608,378.040	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,254.000	2,700,872.440	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	25,461.000	1,477,247.220	
	SL GREEN	7,748.000	375,855.480	
	SUN COMMUNITIES INC	7,418.000	995,273.060	
	UDR INC	25,967.000	995,574.780	
	VENTAS INC	31,091.000	935,839.100	
	VEREIT INC	82,604.000	452,669.920	
	VICI PROPERTIES INC	34,267.000	585,623.030	
	VORNADO REALTY TRUST	12,714.000	501,058.740	
	WELLTOWER INC	31,958.000	1,423,728.900	
	WEYERHAEUSER CO	65,842.000	1,306,963.700	
	WP CAREY INC	15,548.000	973,149.320	
アメリカ・ドル	小計	1,136,769.000	64,178,574.090 (6,863,898,500)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	271,595.910	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	359,517.230	
	SEGRO PLC	87,247.000	717,519.320	
イギリス・ポンド	小計	212,909.000	1,348,632.460 (179,165,822)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	390,859.560	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,935.000	168,543.050	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	101,138.680	

	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	201,062.310	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	61,892.060	
カナダ・ドル 小計		48,171.000	923,495.660 (70,869,057)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	250,869.400	
	GECINA SA	3,670.000	412,508.000	
	ICADE	2,234.000	149,454.600	
	KLEPIERRE	17,099.000	293,846.310	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	652,718.400	
ユーロ 小計		40,586.000	1,759,396.710 (204,090,018)	
香港・ドル	LINK REIT	172,500.000	11,807,625.000	
香港・ドル 小計		172,500.000	11,807,625.000 (162,945,225)	
投資証券 合計		1,610,935	7,480,968,622 (7,480,968,622)	
合計			8,051,933,633 (8,051,933,633)	

(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	68.62	-	-	72.08
	投資証券 41銘柄	-	-	2.14	
イギリス・ポンド	株式 92銘柄	4.87	-	-	5.02
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
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	1.95	-	-	2.11
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 84銘柄	3.35	-	-	3.43
	投資証券 5銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式 20銘柄	0.35	-	-	0.41
	投資信託受益証券 5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.49	-	-	3.55
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.91	-	-	0.93
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.74	-	-	0.75
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	0.11	-	-	0.11
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.18	-	-	0.18
ユーロ	株式 236銘柄	9.88	-	-	10.13
	投資証券 5銘柄	-	-	0.06	
香港・ドル	株式 36銘柄	1.11	-	-	1.18
	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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,968,992,966
国債証券	181,358,009,300
地方債証券	17,577,991,000
特殊債証券	15,702,711,847
社債証券	9,876,577,040
未収利息	417,954,051
前払費用	26,862,876
流動資産合計	227,929,099,080
資産合計	227,929,099,080
負債の部	
流動負債	
未払解約金	2,459,327,000
流動負債合計	2,459,327,000
負債合計	2,459,327,000
純資産の部	
元本等	
元本	171,890,787,271
剰余金	
剰余金又は欠損金()	53,578,984,809
元本等合計	225,469,772,080
純資産合計	225,469,772,080
負債純資産合計	227,929,099,080

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	176,800,196,123円
同期中追加設定元本額	61,320,489,781円
同期中一部解約元本額	66,229,898,633円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	19,170,323,122円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	58,765,912円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	58,706,805円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	13,974,609円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	824,255,105円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	235,495,520円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	20,914,441円
たわらノーロード 国内債券	10,637,702,601円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	690,581,945円
たわらノーロード バランス(堅実型)	239,171,604円
たわらノーロード バランス(標準型)	375,085,366円
たわらノーロード バランス(積極型)	44,926,622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)	17,395,750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)	463,938,386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)	441,945,351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)	104,311,091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)	8,222,133円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,643,137円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	9,223,379円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	11,008,531円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,093,218円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	231,259円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,985,125,445円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	6,698,328,172円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	8,807,200,875円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,404,276,906円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,786,419,407円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,889,584,511円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	317,013,647円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	75,324,315円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,202,944,320円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	5,536,922円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,349,501,474円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	927,783,157円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	203,004,179円
投資のソムリエ	6,755,207,584円
クルーズコントロール	772,283,506円
投資のソムリエ<DC年金>	650,795,263円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,950,121,600円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	350,975,540円
クルーズコントロール<DC年金>	880,213円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	2,156,128円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	7,399,322円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,268,066,596円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	12,080,728,726円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,987,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,333,805円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	11,617,556円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	9,973,451円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	322,227,216円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	867,012,621円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,358,188,706円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,027,146円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	455,295円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	651,485円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	480,677円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,401,009円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	10,102,131,950円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	574,578,764円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	327,868,981円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,293,250,059円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,271,883,975円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,324,036,938円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,297,786,997円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,308,458,386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)	2,429,108円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	198,474,958円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	143,993,175円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	53,536,255円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	125,866,386円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	59,430,093円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,135,556円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	71,415,218円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	156,624,271円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,291,396,842円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,411,267,510円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,489,759,729円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	474,733,428円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	219,505,381円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	2,604,646,337円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	221,388,986円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	12,337,885円
D I A M世界バランスファンド3 5 V A (適格機関投資家限定)	50,302,490円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	2,367,137,591円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	70,157,758円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	519,051,604円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	881,990,280円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	1,207,627,514円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	327,410,720円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	104,863,390円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	97,690,500円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	704,369円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	381,380円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,683,151,841円
計	171,890,787,271円
2. 受益権の総数	171,890,787,271口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券		1,512,764,900
地方債証券		70,721,000
特殊債券		91,657,345
社債券		60,045,590
合計		1,735,188,835

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和2年2月15日から令和2年5月11日まで）に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年5月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3117円 (13,117円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和2年5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	406回 利付国庫債券(2年)	990,000,000	994,237,200	
	408回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,680,000	
	409回 利付国庫債券(2年)	1,020,000,000	1,024,936,800	
	410回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	502,530,000	
	129回 利付国庫債券(5年)	2,120,000,000	2,127,928,800	
	130回 利付国庫債券(5年)	1,780,000,000	1,787,885,400	
	131回 利付国庫債券(5年)	1,420,000,000	1,427,398,200	
	132回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,207,104,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,187,823,400	

134回 利付国庫債券(5年)	1,180,000,000	1,188,649,400	
135回 利付国庫債券(5年)	1,040,000,000	1,048,205,600	
136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,260,537,500	
137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,412,530,000	
138回 利付国庫債券(5年)	1,450,000,000	1,463,673,500	
139回 利付国庫債券(5年)	720,000,000	727,113,600	
140回 利付国庫債券(5年)	1,390,000,000	1,404,358,700	
141回 利付国庫債券(5年)	1,410,000,000	1,424,833,200	
142回 利付国庫債券(5年)	1,600,000,000	1,617,056,000	
143回 利付国庫債券(5年)	500,000,000	505,370,000	
2回 利付国庫債券(40年)	280,000,000	410,379,200	
3回 利付国庫債券(40年)	390,000,000	577,219,500	
4回 利付国庫債券(40年)	430,000,000	642,579,100	
5回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	696,009,600	
6回 利付国庫債券(40年)	450,000,000	645,070,500	
7回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	663,091,200	
8回 利付国庫債券(40年)	520,000,000	673,909,600	
9回 利付国庫債券(40年)	880,000,000	857,146,400	
10回 利付国庫債券(40年)	780,000,000	889,551,000	
11回 利付国庫債券(40年)	580,000,000	643,573,800	
12回 利付国庫債券(40年)	550,000,000	553,597,000	
315回 利付国庫債券(10年)	700,000,000	710,668,000	
316回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	507,065,000	
317回 利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,119,096,000	
318回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,422,400,000	
319回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	816,512,000	
320回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	917,127,000	
321回 利付国庫債券(10年)	800,000,000	817,560,000	
322回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	510,045,000	

3 2 3 回 利付国庫債券(10年)	750,000,000	767,205,000	
3 2 4 回 利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,071,871,500	
3 2 5 回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,353,383,000	
3 2 6 回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	511,460,000	
3 2 7 回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,230,648,000	
3 2 8 回 利付国庫債券(10年)	1,590,000,000	1,625,345,700	
3 2 9 回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,823,330,100	
3 3 0 回 利付国庫債券(10年)	450,000,000	464,665,500	
3 3 1 回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	666,789,500	
3 3 2 回 利付国庫債券(10年)	1,860,000,000	1,911,298,800	
3 3 3 回 利付国庫債券(10年)	1,890,000,000	1,945,320,300	
3 3 4 回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,989,810,700	
3 3 5 回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,994,436,400	
3 3 6 回 利付国庫債券(10年)	1,000,000,000	1,029,440,000	
3 3 7 回 利付国庫債券(10年)	1,340,000,000	1,366,706,200	
3 3 8 回 利付国庫債券(10年)	1,830,000,000	1,877,378,700	
3 3 9 回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,992,341,200	
3 4 0 回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,953,808,000	
3 4 1 回 利付国庫債券(10年)	1,910,000,000	1,955,840,000	
3 4 2 回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	2,005,680,600	
3 4 3 回 利付国庫債券(10年)	2,080,000,000	2,108,142,400	
3 4 4 回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,956,576,100	
3 4 5 回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,785,185,600	
3 4 6 回 利付国庫債券(10年)	1,820,000,000	1,846,390,000	
3 4 7 回 利付国庫債券(10年)	2,210,000,000	2,243,238,400	

348回 利付国庫債券(10年)	2,030,000,000	2,060,856,000	
349回 利付国庫債券(10年)	1,760,000,000	1,786,980,800	
350回 利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,283,817,500	
351回 利付国庫債券(10年)	1,660,000,000	1,684,368,800	
352回 利付国庫債券(10年)	1,720,000,000	1,744,578,800	
353回 利付国庫債券(10年)	1,540,000,000	1,561,313,600	
354回 利付国庫債券(10年)	1,470,000,000	1,488,948,300	
355回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,467,211,500	
356回 利付国庫債券(10年)	1,580,000,000	1,597,016,600	
357回 利付国庫債券(10年)	1,460,000,000	1,474,731,400	
358回 利付国庫債券(10年)	250,000,000	252,337,500	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	126,264,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,467,000	
3回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	245,730,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,092,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,136,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	241,630,000	
11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	240,156,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,240,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,588,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	377,791,700	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,198,000	
16回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	198,709,500	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,824,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	416,944,000	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,396,000	
20回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	268,144,000	
21回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,774,000	

22回 利付国庫債券(30年)	220,000,000	296,619,400	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	270,512,000	
24回 利付国庫債券(30年)	190,000,000	257,590,600	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,378,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	538,652,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	575,303,400	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	661,200,000	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	765,962,400	
30回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	774,122,700	
31回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	808,572,000	
32回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	838,609,700	
33回 利付国庫債券(30年)	910,000,000	1,204,503,300	
34回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	971,904,800	
35回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,094,314,600	
36回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	1,072,336,000	
37回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,165,252,000	
38回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	744,898,800	
39回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	678,988,500	
40回 利付国庫債券(30年)	450,000,000	590,256,000	
41回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	594,117,600	
42回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	659,404,500	
43回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	544,231,800	
44回 利付国庫債券(30年)	490,000,000	635,618,200	
45回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	626,020,000	
46回 利付国庫債券(30年)	630,000,000	789,339,600	

47回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	754,114,400	
48回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	726,673,500	
49回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	764,013,600	
50回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	717,651,000	
51回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	550,021,500	
52回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	617,911,700	
53回 利付国庫債券(30年)	640,000,000	664,390,400	
54回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	652,656,000	
55回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	565,333,600	
56回 利付国庫債券(30年)	550,000,000	598,345,000	
57回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	641,495,200	
58回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	934,501,800	
59回 利付国庫債券(30年)	580,000,000	615,409,000	
60回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	556,585,000	
61回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	530,335,000	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	503,810,000	
63回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	559,067,400	
64回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	490,335,000	
65回 利付国庫債券(30年)	530,000,000	519,680,900	
66回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	98,038,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	384,296,500	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	373,571,600	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	155,213,800	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	209,720,100	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	267,441,600	

85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	497,446,400	
88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	401,982,000	
90回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	344,376,000	
92回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	997,985,700	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	286,332,500	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	518,508,000	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	410,270,000	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	585,250,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	525,694,500	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	708,408,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	432,673,200	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	472,780,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	416,626,000	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	474,552,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	467,636,000	
109回 利付国庫債券(20年)	220,000,000	257,925,800	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	392,752,800	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	349,052,700	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	656,975,000	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	922,621,700	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	661,292,500	
115回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	242,392,000	
116回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	389,184,000	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	784,127,500	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	371,910,100	

119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	353,859,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	463,744,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	644,279,400	
122回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	413,973,000	
123回 利付国庫債券(20年)	520,000,000	633,152,000	
124回 利付国庫債券(20年)	390,000,000	470,745,600	
125回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	443,559,600	
126回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	411,576,800	
127回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	479,888,000	
128回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	661,655,500	
129回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	345,671,300	
130回 利付国庫債券(20年)	580,000,000	693,071,000	
131回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	355,104,000	
132回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	676,202,400	
133回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	682,757,400	
134回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	516,245,100	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	416,094,000	
136回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	353,133,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	416,986,500	
138回 利付国庫債券(20年)	280,000,000	326,888,800	
139回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	412,800,500	
140回 利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,265,502,200	
141回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	777,556,000	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	483,464,000	
143回 利付国庫債券(20年)	560,000,000	664,076,000	

144回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	410,623,500	
145回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,068,694,200	
146回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	1,022,541,500	
147回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,167,944,400	
148回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	1,109,218,800	
149回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,063,431,000	
150回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	1,110,664,000	
151回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,119,091,400	
152回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,016,922,900	
153回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	1,031,287,500	
154回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	973,029,000	
155回 利付国庫債券(20年)	930,000,000	1,037,108,100	
156回 利付国庫債券(20年)	840,000,000	858,555,600	
157回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	841,457,500	
158回 利付国庫債券(20年)	860,000,000	890,985,800	
159回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	893,868,500	
160回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	907,451,500	
161回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	840,416,000	
162回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	797,612,400	
163回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	807,953,300	
164回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	938,455,700	
165回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	762,792,000	
166回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	799,417,500	
167回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	823,840,000	
168回 利付国庫債券(20年)	700,000,000	708,064,000	

	169回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	744,615,000	
	170回 利付国庫債券(20年)	780,000,000	774,329,400	
	171回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	655,142,400	
	172回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	131,449,500	
国債証券 合計		166,080,000,000	181,358,009,300	
地方債証券	697回 東京都公募公債	500,000,000	505,955,000	
	701回 東京都公募公債	700,000,000	709,086,000	
	708回 東京都公募公債	500,000,000	509,065,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	307,770,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	410,024,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	110,007,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	228,418,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	342,270,000	
	30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	301,146,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	305,955,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	306,288,000	
	356回 大阪府公募公債	200,000,000	203,322,000	
	364回 大阪府公募公債	300,000,000	305,352,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	308,589,000	
	26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	357,017,500	
	26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,888,000	
	1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	312,972,000	
	23年度9回 静岡県公募公債	200,000,000	203,130,000	
	8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	213,022,000	
	1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	111,239,000	
	23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	509,890,000	
	25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	307,512,000	
	30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	199,822,000	
	26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	409,612,000	
	14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	349,584,000	
	25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	204,968,000	
	24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	349,434,000	
	24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	305,568,000	
	25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	205,290,000	
	14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,688,000	

99回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	708,953,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,818,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,965,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	712,754,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,735,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,935,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,627,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,115,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,264,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,588,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,395,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,665,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	200,582,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	460,930,500	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	115,228,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	303,201,000	
23年度4回 横浜市公募公債	450,000,000	456,876,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	410,812,000	
25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	204,746,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	200,992,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,926,000	
地方債証券 合計	17,050,000,000	17,577,991,000	
特殊債券			
78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,372,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	228,927,000	
26回 高速道路機構債	200,000,000	275,254,000	
96回 高速道路機構債	700,000,000	712,817,000	
116回 高速道路機構債	100,000,000	102,324,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	196,474,000	
18回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,724,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	586,870,000	
149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	406,412,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,905,000	

193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,660,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	339,570,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,543,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	510,500,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	239,946,000	
309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	804,720,000	
319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,062,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	532,696,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	232,662,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	236,870,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,442,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,872,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	408,936,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	514,290,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	556,709,880	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,888,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	227,232,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,524,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	235,806,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	214,638,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,820,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	421,078,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,674,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,883,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,837,000	37,985,946	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	25,942,000	26,860,606	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,775,000	40,204,246	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	41,250,000	43,130,587	

13回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	12,076,000	12,245,909	
14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	60,530,000	61,253,333	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,651,000	14,332,730	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,564,000	54,756,444	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,171,000	40,750,374	
1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,725,000	66,754,776	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	137,250,000	147,796,290	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,600,000	243,580,344	
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,367,000	255,865,221	
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	268,182,000	271,247,320	
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	268,404,000	271,278,606	
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,417,000	275,959,778	
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	273,051,000	275,593,104	
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	280,920,000	284,875,353	
い第828号 利付商工債	100,000,000	99,879,000	
325回 利附信金中金債	400,000,000	399,868,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	117,658,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	511,735,000	
特殊債券 合計	14,742,712,000	15,702,711,847	
社債券			
1回 B P C E S A円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,206,000	
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,666,000	
34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,276,000	
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,716,000	
6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	102,796,000	
14回 プリズトン社債	200,000,000	199,184,000	
23回 ジェイ エフ イーホールディングス社債	100,000,000	99,655,000	
13回 パナソニック社債	100,000,000	100,531,000	
14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,450,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,326,000	
94回 丸紅社債	100,000,000	102,116,000	
45回 住友商事社債	100,000,000	101,636,000	
47回 住友商事社債	100,000,000	101,745,000	

48回	クレディセゾン社債	100,000,000	102,336,000	
57回	東京三菱銀行社債	200,000,000	210,262,000	
32回	三菱東京UFJ銀行劣後社債	300,000,000	304,356,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,332,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	101,785,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	202,878,000	
56回	三菱UFJリース社債	200,000,000	199,902,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	108,673,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	199,442,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	106,859,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	99,339,000	
19回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,066,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,523,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	327,831,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	220,026,000	
9回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	208,180,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	319,125,000	
6回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,066,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	308,001,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	213,550,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,920,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	135,460,800	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,214,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	412,508,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	102,863,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	104,227,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	413,852,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	205,046,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	207,152,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	412,476,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	201,358,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	164,999,240	
340回	北海道電力社債	300,000,000	300,804,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	216,870,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	308,016,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	308,142,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	103,500,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	101,986,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,348,000	
社債券 合計		9,581,000,000	9,876,577,040	
合計			224,515,289,187	

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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,620,737,189
コール・ローン	1,055,423,584
国債証券	115,525,754,692
派生商品評価勘定	3,982,994
未収利息	837,591,316
前払費用	39,805,824
流動資産合計	120,083,295,599
資産合計	120,083,295,599
負債の部	
流動負債	
未払金	831,084,864
未払解約金	27,442,200
流動負債合計	858,527,064
負債合計	858,527,064
純資産の部	
元本等	
元本	62,628,193,993
剰余金	
剰余金又は欠損金()	56,596,574,542
元本等合計	119,224,768,535
純資産合計	119,224,768,535
負債純資産合計	120,083,295,599

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	76,506,608,672円
同期中追加設定元本額	7,180,672,772円
同期中一部解約元本額	21,059,087,451円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,871,177,326円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	4,778,150円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	16,743,311円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	16,534,415円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	67,926,801円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	67,177,261円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	24,742,414円
たわらノーロード 先進国債券	7,077,273,511円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	136,050,581円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	504,355,889円
たわらノーロード バランス（堅実型）	14,169,297円
たわらノーロード バランス（標準型）	63,745,966円
たわらノーロード バランス（積極型）	12,598,827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）	2,328,512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）	145,007,043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）	184,992,747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）	59,412,105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）	34,225,325円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	80,909円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,751,748円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	4,522,648円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,533,285円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,255,767円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,873,437,517円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	5,365,523円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	572,620,323円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,729,391,688円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,699,015,286円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	366,899,989円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	768,509,806円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	583,944,416円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,884,013円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	521,348,662円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	17,411,191円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,271,635円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	89,589,782円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	139,048,634円
クルーズコントロール	789,354,745円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	109,167,362円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	176,400,729円
クルーズコントロール<DC年金>	898,881円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,181,504円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	7,517,700円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	65,173,221円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	124,710,104円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	134,418円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,140,095,937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)	525,896,862円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,040,134,260円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,965,490,662円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,197,384,837円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,689,634,902円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	69,009,785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)	640,266,930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)	549,077,204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)	399,148,188円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	37,042,233円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	58,044,008円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,441,447円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,515,248円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	49,416,430円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	72,220,847円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,598,171,624円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,807,451,362円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,106,221,895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)	547,611,423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)	212,658,734円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,389,462,866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)	554,234,012円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,259,281円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	78,284,399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)	408,470,947円

D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	610,277,995円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	668,378,958円
D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	68,507,846円
D I A Mバランス20 V A (適格機関投資家限定)	20,216,862円
D I A Mバランス40 V A (適格機関投資家限定)	347,345円
D I A Mバランス60 V A (適格機関投資家限定)	157,697円
計	62,628,193,993円
2. 受益権の総数	62,628,193,993口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,077,179,897
合計	2,077,179,897

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和2年2月22日から令和2年5月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	694,120,000	-	698,102,994	3,982,994
アメリカ・ドル	343,570,000	-	345,476,029	1,906,029
イギリス・ポンド	33,900,000	-	34,184,354	284,354
ユーロ	316,650,000	-	318,442,611	1,792,611
合計	694,120,000	-	698,102,994	3,982,994

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年5月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9037円 (19,037円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和2年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,539,315.610	
		US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,442,975.000	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,584,343.750	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,161,101.550	
		US T N/B 1.375 09/30/23	3,100,000.000	3,218,187.500	
		US T N/B 1.5 01/31/27	490,000.000	522,079.680	

US T N/B 1.5 02/15/30	900,000.000	969,539.050	
US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,246,536.320	
US T N/B 1.5 08/15/26	4,290,000.000	4,561,476.560	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	773,291.010	
US T N/B 1.5 09/30/21	5,120,000.000	5,215,399.980	
US T N/B 1.5 10/31/21	3,890,000.000	3,966,736.310	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,465,089.040	
US T N/B 1.625 05/15/26	4,290,000.000	4,589,629.680	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	3,024,382.790	
US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,108,261.700	
US T N/B 1.625 08/15/29	4,380,000.000	4,762,565.610	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,519,273.430	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,822,627.300	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,020,000.000	1,094,029.680	
US T N/B 1.625 12/31/21	5,000,000.000	5,119,238.000	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,189,704.660	
US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,199,700.000	
US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,572,335.910	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,740,970.290	
US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	857,526.160	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,420,714.050	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,916,012.500	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,446,054.680	
US T N/B 1.75 11/15/29	3,440,000.000	3,784,000.000	
US T N/B 1.75 12/31/26	740,000.000	800,067.180	
US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,731,843.740	
US T N/B 1.875 06/30/26	720,000.000	781,481.240	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,573,857.010	
US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,824,612.480	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,330,356.230	
US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,744,944.070	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,587,134.370	
US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,719,859.370	
US T N/B 2.0 02/15/50	1,950,000.000	2,241,662.100	
US T N/B 2.0 05/31/21	10,130,000.000	10,329,038.590	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	5,100,918.750	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,618,681.250	
US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,690,062.440	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,538,798.410	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,893,242.930	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,391,304.680	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,373,250.000	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,150,000.000	5,605,050.750	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,254,199.200	
US T N/B 2.125 06/30/22	6,530,000.000	6,803,953.870	
US T N/B 2.125 09/30/21	8,840,000.000	9,081,718.750	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,163,026.560	
US T N/B 2.125 12/31/21	9,160,000.000	9,454,837.500	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,800,743.720	

US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	375,812.500	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,960,191.380	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,414,450.000	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,557,554.670	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	3,019,525.000	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,970,000.000	2,342,914.820	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,897,249.990	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	5,097,443.750	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,711,027.310	
US T N/B 2.25 11/15/27	4,040,000.000	4,545,631.250	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,960,062.490	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,496,218.750	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,235,890.620	
US T N/B 2.375 08/15/24	6,420,000.000	6,985,260.890	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	3,433,934.370	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	4,000,841.760	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,213,356.250	
US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,113,928.500	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,569,450.000	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,446,724.580	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,852,214.830	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,087,495.300	
US T N/B 2.5 05/15/24	6,240,000.000	6,791,362.460	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,510,000.000	3,119,753.290	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,649,337.500	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,452,840.620	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,808,700.000	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,388,683.580	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,956,642.170	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,917,412.880	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,323,207.790	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,572,492.950	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,816,256.250	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	5,094,805.430	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,851,418.750	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,676,944.510	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,521,892.180	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	886,219.520	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,534,921.070	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,430,000.000	1,829,394.520	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,462,065.610	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,349,703.120	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,844,359.360	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,020,000.000	6,547,690.620	
US T N/B 2.75 11/15/42	370,000.000	473,397.650	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,640,000.000	3,462,524.990	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	5,224,631.250	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,200,000.000	1,566,656.230	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	4,192,140.180	

US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,850,203.120	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,101,364.050	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,680,000.000	5,537,390.570	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,090,000.000	2,760,514.440	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	914,484.370	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	4,025,847.630	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	5,079,584.330	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,220,000.000	2,960,404.660	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,540,000.000	3,469,778.870	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	3,484,860.130	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	4,249,071.870	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,304,242.180	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,630,000.000	2,192,350.000	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,350,000.000	3,211,697.240	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,210,000.000	4,422,401.910	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,606,739.060	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,190,000.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	2,290,000.000	3,070,389.060	
US T N/B 3.0 11/15/45	1,640,000.000	2,216,242.160	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,380,000.000	1,872,703.120	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,951,762.490	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,737,300.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,388,750.000	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,840,000.000	5,846,946.820	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	1,027,959.370	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,330,000.000	1,883,352.710	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,260,000.000	3,328,821.060	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,278,492.170	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,389,223.430	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,439,113.270	
US T N/B 3.75 08/15/41	410,000.000	603,821.090	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	2,025,550.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,654,593.750	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,255,626.560	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,110,000.000	1,734,591.790	
US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	855,701.170	
US T N/B 4.375 05/15/40	200,000.000	316,585.930	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,654,046.860	
US T N/B 4.375 11/15/39	410,000.000	646,390.620	
US T N/B 4.5 02/15/36	730,000.000	1,118,896.080	
US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	852,778.120	
US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,262,765.620	
US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,218,662.090	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,989,140.610	
US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	820,996.090	
US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	684,660.150	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,178,910.150	
US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,489,218.750	
US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	908,070.310	

	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,108,406.250	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,272,304.680	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,095,840.620	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,196,875.000	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,716,953.070	
アメリカ・ドル	小計	451,460,000.000 (48,283,647,000)	509,353,751.930 (54,475,383,769)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,920,000.000	1,941,523.200	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	610,000.000	627,134.900	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,596,451.580	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	710,000.000	755,195.050	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	850,930.400	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	960,000.000	1,039,113.600	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	981,144.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,310,000.000	1,623,221.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,830,000.000	2,060,029.520	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	510,000.000	692,349.880	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	580,000.000	930,314.200	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	890,000.000	1,172,041.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	960,000.000	1,381,536.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,592,010.900	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,240,000.000	1,494,200.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	874,214.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,267,801.440	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,080,000.000	2,001,273.690	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,380,000.000	1,541,487.600	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,410,000.000	2,245,002.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	2,142,336.000		
UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	2,256,384.000		
UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,846,160.000		
UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,998,390.000		
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,130,000.000	1,783,705.000		

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,110,000.000	1,621,155.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,551,120.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	1,021,051.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,654,080.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	2,022,798.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	990,000.000	1,989,009.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,000,000.000	2,231,200.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	1,411,470.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,080,000.000	1,984,500.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	940,000.000	1,382,928.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,280,000.000	2,246,912.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,610,000.000	1,991,924.200	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,138,107.600	
	イギリス・ボンド 小計	40,740,000.000 (5,412,309,000)	58,940,203.960 (7,830,206,096)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,159,302.880	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,840,825.790	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	670,000.000	948,113.650	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,920,000.000	3,254,369.200	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,820,000.000	3,126,669.000	
	イスラエル・シュケル 小計	10,050,000.000 (305,922,000)	12,329,280.520 (375,303,299)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	640,000.000	637,192.440	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,000,000.000	1,056,553.100	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,740,000.000	1,940,100.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	935,432.540	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,200,000.000	1,384,583.390	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,170,861.300	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	140,000.000	168,195.370	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	638,860.460	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,330,000.000	1,531,362.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,780,000.000	2,068,468.750	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,823,640.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	1,111,440.220	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,520,000.000	1,733,433.530	

	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,820,000.000	3,410,293.390	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	720,000.000	925,906.890	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	1,028,206.280	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,452,131.250	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,130,000.000	1,601,478.940	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,670,000.000	2,140,616.850	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,710,000.000	1,974,245.610	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	1,180,000.000	1,321,628.790	
オーストラリア・ドル 小計		27,180,000.000 (1,899,338,400)	32,054,631.100 (2,239,977,621)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	230,000.000	350,986.900	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	604,014.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	830,328.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	813,928.000	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	729,890.000	
	CANADA 1.25 06/01/30	450,000.000	480,159.000	
	CANADA 1.5 05/01/22	920,000.000	942,880.400	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,256,790.700	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	853,600.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,209,671.200	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,142,420.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	782,483.400	
	CANADA 2.0 12/01/51	660,000.000	811,186.200	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	569,262.400	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,642,245.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	704,397.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,741,616.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,355,852.800	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	1,179,749.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	545,184.500	
CANADA 3.5 12/01/45	1,020,000.000	1,546,585.200		
CANADA 4.0 06/01/41	880,000.000	1,363,718.400		
CANADA 5.0 06/01/37	740,000.000	1,214,021.800		
CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,612,534.000		
CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,166,832.000		
カナダ・ドル 小計		22,230,000.000 (1,705,930,200)	26,450,336.800 (2,029,798,846)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	228,480.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	231,400.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	370,090.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	557,340.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	490,580.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	234,870.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	439,560.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	607,585.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,699,200.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	616,540.800	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	864,320.000	

シンガポール・ドル 小計		5,480,000.000 (414,671,600)	6,339,965.800 (479,745,212)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,740,000.000	4,021,266.700	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,343,925.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,600,072.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	7,065,594.000	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	5,155,514.700	
スウェーデン・クローナ 小計		19,610,000.000 (214,141,200)	23,186,373.400 (253,195,198)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,638,329.070	
	DENMARK 0.5 11/15/29	1,670,000.000	1,803,316.100	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,909,057.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	6,000,136.460	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,880,000.000	14,848,827.720	
デンマーク・クローネ 小計		27,500,000.000 (427,625,000)	36,199,666.350 (562,904,812)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	1,730,000.000	1,895,310.150	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	4,070,619.800	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,389,947.790	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	4,113,460.100	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,345,931.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,918,270.000	
ノルウェー・クローネ 小計		21,540,000.000 (224,877,600)	23,733,538.840 (247,778,145)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,132,995.200	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,416,633.700	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,442,123.090	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,440,000.000	2,618,985.220	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,280,000.000	2,451,424.080	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	2,079,763.930	
	POLAND 2.75 10/25/29	950,000.000	1,052,181.620	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,644,989.200	
	POLAND 4.0 10/25/23	1,820,000.000	2,024,167.600	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,953,385.630	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,927,690.000	
ポーランド・ズロチ 小計		22,570,000.000 (575,535,000)	24,744,339.270 (630,980,651)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,077,328.300	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,260,051.500	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,131,226.000	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,300,303.510	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	861,242.000	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	2,045,844.330	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,595,824.900	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,366,630.760	

	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	2,034,856.800	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,406,633.000	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,882,636.800	
マレーシア・リンギット 小計		20,980,000.000 (517,786,400)	22,962,577.900 (566,716,423)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,795,981.350	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	27,596,000.000	33,100,850.080	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	15,182,629.020	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	20,098,204.780	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	11,261,400.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	14,643,000.000	15,921,333.900	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,914,200.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,586,150.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,342,040.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,109,000.000	17,817,439.340	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	13,029,043.750	
メキシコ・ペソ 小計		145,488,000.000 (659,060,640)	166,049,272.220 (752,203,203)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	360,013.040	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	549,310.940	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	882,812.820	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	180,000.000	197,555.590	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	580,000.000	621,961.840	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	356,510.000	
	AUSTRIA 07/15/24	2,370,000.000	2,422,822.560	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	477,364.900	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	697,691.840	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	370,000.000	480,820.550	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	216,615.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	592,780.620	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	750,000.000	811,509.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	667,380.350	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	634,556.060	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	370,000.000	622,698.710	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	816,607.020	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,420,000.000	1,498,810.000	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	280,000.000	303,576.000		
AUSTRIA 3.8 01/26/62	180,000.000	407,744.110		
AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,482,740.000		

AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	773,428.050	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	985,188.100	
BELGIUM 0.0 10/22/27	500,000.000	505,370.650	
BELGIUM 0.1 06/22/30	240,000.000	241,800.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	676,038.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	420,000.000	403,785.750	
BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	551,897.790	
BELGIUM 0.8 06/22/25	900,000.000	953,989.370	
BELGIUM 0.8 06/22/27	650,000.000	695,383.000	
BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	945,560.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	610,000.000	662,139.140	
BELGIUM 1.0 06/22/26	720,000.000	776,268.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	890,951.400	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	577,886.040	
BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	174,341.850	
BELGIUM 1.6 06/22/47	640,000.000	781,262.330	
BELGIUM 1.7 06/22/50	590,000.000	739,553.840	
BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	683,122.000	
BELGIUM 2.15 06/22/66	320,000.000	472,048.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	160,000.000	174,105.280	
BELGIUM 2.25 06/22/57	320,000.000	466,829.080	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,183,516.950	
BELGIUM 3.0 06/22/34	470,000.000	646,479.830	
BELGIUM 3.75 06/22/45	550,000.000	944,017.250	
BELGIUM 4.0 03/28/22	420,000.000	456,615.180	
BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	769,833.900	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,040,000.000	1,783,194.400	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,240,000.000	1,322,482.320	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,328,867.160	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,060,000.000	1,361,874.220	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,070,000.000	1,793,603.550	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,795,686.160	
BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	649,978.050	
BUNDESOBL 04/08/22	1,340,000.000	1,360,301.000	
BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,156,858.740	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,426,915.000	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,315,635.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,169,747.750	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,781,919.100	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	330,000.000	337,943.100	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,460,000.000	1,556,447.600	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	3,500,000.000	3,770,113.880	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,547,625.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,360,000.000	1,444,537.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,260,000.000	1,352,421.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,561,531.400	

DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,740,701.600	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,270,000.000	1,329,137.550	
DEUTSCHLAND 08/15/29	910,000.000	959,369.760	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,444,492.930	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,937,813.700	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,820,000.000	2,524,592.980	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	970,000.000	1,032,946.210	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	850,000.000	909,796.650	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,010,000.000	1,104,919.800	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,739,065.350	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,646,785.500	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,624,904.820	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	1,650,000.000	1,726,015.500	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	950,000.000	1,038,231.820	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,111,483.900	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,560,000.000	2,586,121.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,150,000.000	3,659,031.250	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	900,000.000	1,603,953.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,590,000.000	2,767,026.120	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	840,000.000	1,585,869.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	867,750.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,220,000.000	2,136,915.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,580,000.000	3,215,758.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,056,626.800	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	860,000.000	1,281,950.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,058,862.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,189,022.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,082,316.900	
FINLAND 0.125 04/15/36	210,000.000	209,647.140	
FINLAND 0.5 04/15/26	300,000.000	316,363.110	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	317,051.700	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	254,189.040	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	286,109.280	
FINLAND 0.75 04/15/31	380,000.000	414,743.400	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	321,428.400	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	323,960.800	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	234,635.650	

FINLAND 1.125 04/15/34	230,000.000	263,566.200	
FINLAND 1.375 04/15/47	130,000.000	166,862.640	
FINLAND 1.5 04/15/23	340,000.000	361,267.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	421,464.800	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	308,551.880	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	532,687.400	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	473,028.560	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	530,789.850	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,307,452.130	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,450,000.000	2,459,803.420	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,250,000.000	4,401,583.890	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,620,000.000	2,747,384.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,176,803.720	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,190,000.000	2,307,243.840	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,250,000.000	2,417,255.090	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	280,000.000	280,722.400	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,140,000.000	2,302,066.480	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,931,711.380	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,776,230.560	
FRANCE OAT 03/25/25	1,270,000.000	1,297,872.800	
FRANCE OAT 05/25/22	2,190,000.000	2,217,087.450	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,650,000.000	1,795,356.250	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,854,090.510	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	1,980,823.300	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,990,000.000	2,275,167.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	2,290,000.000	2,659,253.340	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,560,000.000	1,895,621.520	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	1,930,000.000	2,068,853.850	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	740,000.000	1,011,662.880	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,690,000.000	2,092,051.000	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,956,098.960	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,490,000.000	1,991,910.970	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,205,027.000	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,030,000.000	3,243,833.760	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,340,000.000	2,933,922.420	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	1,880,000.000	2,302,418.700	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,850,000.000	3,050,765.400	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,500,000.000	2,421,060.000	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	2,980,000.000	3,145,283.310	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,320,000.000	2,854,412.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	960,000.000	1,919,040.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	790,000.000	1,661,879.390	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,489,487.920	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,191,517.420	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,080,000.000	3,738,348.420	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,737,614.000	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,823,761.720	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,560,000.000	4,346,168.320	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,436,058.800	

IRISH 0.2 05/15/27	350,000.000	355,137.300	
IRISH 0.4 05/15/35	220,000.000	216,397.630	
IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	378,592.510	
IRISH 0.9 05/15/28	430,000.000	459,597.760	
IRISH 1.0 05/15/26	680,000.000	726,006.480	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	369,924.760	
IRISH 1.3 05/15/33	260,000.000	290,226.270	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	234,601.760	
IRISH 1.5 05/15/50	200,000.000	232,555.000	
IRISH 1.7 05/15/37	320,000.000	378,117.440	
IRISH 10/18/22	220,000.000	222,229.920	
IRISH 2.0 02/18/45	500,000.000	643,422.000	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	768,205.800	
IRISH 3.4 03/18/24	510,000.000	583,459.780	
IRISH 3.9 03/20/23	1,570,000.000	1,763,350.040	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	1,018,760.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	3,780,000.000	3,633,333.580	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,696,715.600	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	972,777.400	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,300,000.000	1,246,960.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	984,802.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	924,735.240	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,075,457.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	670,000.000	616,534.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	778,454.600	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,333,671.750	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,040,000.000	999,519.040	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	980,000.000	993,675.900	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,520,000.000	1,375,600.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,554,117.180	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,526,938.500	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,053,226.720	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,708,559.580	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,516,200.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,090,000.000	1,059,425.500	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	834,543.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,430,649.160	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,004,119.750	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	940,000.000	970,866.020	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	130,000.000	134,947.800	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,680,000.000	1,722,336.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	520,000.000	542,620.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,028,058.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,148,320.800	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	370,000.000	357,346.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	583,443.960	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,026,121.290	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,048,254.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	750,000.000	759,000.000	

ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,522,388.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,018,678.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,468,981.010	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	574,608.320	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,114,002.450	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	790,000.000	906,624.540	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,187,127.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,640,000.000	1,884,204.200	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,332,288.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,119,160.800	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	920,665.960	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,130,000.000	1,393,855.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,230,431.560	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,911,175.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,551,462.360	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,131,610.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,608,468.200	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	990,000.000	1,225,272.510	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,343,100.410	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,834,810.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,103,876.500	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,165,450.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	1,860,537.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,150,000.000	1,608,735.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,274,125.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,276,040.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,188,086.960	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,801,984.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,357,903.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,398,779.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,464,156.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,519,511.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,065,479.760	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	832,650.750	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	340,000.000	374,834.020	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	1,001,288.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	700,000.000	761,972.120	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	821,512.500	
NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	465,288.620	
NETHERLANDS 01/15/24	830,000.000	850,522.160	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,110,000.000	1,196,918.550	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	912,149.220	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	880,000.000	937,301.200	

NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,049,741.850	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	900,000.000	1,549,178.100	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	1,943,716.970	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	300,000.000	335,880.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,210,000.000	2,200,928.290	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,599,705.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,238,875.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	342,187.560	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,120,000.000	1,133,613.600	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,588,369.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,359,624.300	
SPAIN 0.5 04/30/30	850,000.000	827,174.100	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,080,000.000	1,066,403.460	
SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,720,553.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,600,000.000	1,628,160.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	770,000.000	660,493.530	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,770,000.000	1,835,313.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,070,000.000	1,131,406.120	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,316,820.480	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,210,000.000	1,281,027.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,458,821.470	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,480,000.000	1,577,163.480	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,295,123.500	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,549,965.900	
SPAIN 1.85 07/30/35	790,000.000	868,981.830	
SPAIN 1.95 04/30/26	570,000.000	623,947.650	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,623,711.260	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,580,000.000	1,740,938.800	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,140,000.000	1,327,074.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,084,007.280	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,720,073.740	
SPAIN 2.9 10/31/46	870,000.000	1,128,281.850	
SPAIN 3.45 07/30/66	660,000.000	1,014,730.200	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,457,661.550	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,180,000.000	1,720,774.750	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,430,000.000	1,649,745.240	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,683,192.960	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,070,000.000	1,724,319.980	
SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,330,805.520	
SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,903,005.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	880,000.000	1,202,168.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	830,000.000	1,452,939.900	
SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,679,386.900	
SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,902,423.470	
SPAIN 5.85 01/31/22	1,810,000.000	1,998,504.260	

	SPAIN 5.9 07/30/26	1,170,000.000	1,565,015.400	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,288,799.530	
	ユーロ 小計	328,450,000.000 (38,100,200,000)	388,634,150.150 (45,081,561,417)	
国債証券 合計		98,741,044,040 (98,741,044,040)	115,525,754,692 (115,525,754,692)	
合計			115,525,754,692 (115,525,754,692)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 158銘柄	45.69	47.15
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.57	6.78
イスラエル・シケル	国債証券 5銘柄	0.31	0.32
オーストラリア・ドル	国債証券 21銘柄	1.88	1.94
カナダ・ドル	国債証券 25銘柄	1.70	1.76
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.40	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.21	0.22
デンマーク・クローネ	国債証券 5銘柄	0.47	0.49
ノルウェー・クローネ	国債証券 6銘柄	0.21	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.53	0.55
マレーシア・リングギット	国債証券 11銘柄	0.48	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.63	0.65
ユーロ	国債証券 292銘柄	37.81	39.02

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,082,189,018
投資証券	37,591,113,030
派生商品評価勘定	5,788,650
未収配当金	279,111,169
前払金	90,682,000
差入委託証拠金	105,062,000
流動資産合計	50,153,945,867
資産合計	50,153,945,867
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	83,428,290
未払金	11,149,159,714
未払解約金	370,919,000
流動負債合計	11,603,507,004
負債合計	11,603,507,004
純資産の部	
元本等	
元本	20,464,359,150
剰余金	
剰余金又は欠損金()	18,086,079,713
元本等合計	38,550,438,863
純資産合計	38,550,438,863
負債純資産合計	50,153,945,867

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,448,816,585円
同期中追加設定元本額	17,346,441,166円
同期中一部解約元本額	14,330,898,601円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	378,112円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,263,381円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,402,669円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	5,322,154円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	5,059,919円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	2,113,621円
たわらノーロード 国内リート	3,828,411,852円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	782,914,155円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	536,532,143円
たわらノーロード バランス(堅実型)	10,039,142円
たわらノーロード バランス(標準型)	169,483,917円
たわらノーロード バランス(積極型)	174,212,336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)	36,161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)	91,454,502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)	178,937,223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)	91,286,228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)	122,636,568円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,422,066円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,844,626円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,383,182円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,849,745円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,809,922円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	344,889,012円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	121,041,592円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	128,615,446円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	230,121,833円
投資のソムリエ	4,780,125,027円
投資のソムリエ<DC年金>	460,767,407円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	116,385,910円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	74,908,386円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	712,976,935円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	3,529,856円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,360,423円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	684,415円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,059,712円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	224,997,898円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	103,278,415円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	727,528円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	323,346円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	463,462円
Jリートインデックスファンド(DC)	28,416,200円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	85,872,687円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	776,201,858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)	70,945,024円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	174,025,929円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	5,227,622,000円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	11,905,437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)	86,413,425円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	658,204,822円
計	20,464,359,150円
2. 受益権の総数	20,464,359,150口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有していません。
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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資証券	3,924,032,707
合計	3,924,032,707

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月7日から令和2年5月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	令和2年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	955,544,000	-	877,962,000	77,582,000
合計	955,544,000	-	877,962,000	77,582,000

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 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。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年5月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.8838円 (18,838円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和2年5月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	814	123,972,200	
	GLP投資法人	10,779	1,460,554,500	
	MCUBS MidCity投 資法人	5,552	473,585,600	
	Oneリート投資法人	675	176,040,000	
	SOSILA物流リート投資法 人	964	125,320,000	
	いちごオフィスリート投資法人	3,351	248,309,100	
	いちごホテルリート投資法人	717	47,895,600	
	さくら総合リート投資法人	936	73,756,800	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	2,169	801,445,500	
	アドバンス・レジデンス投資法 人	4,105	1,330,020,000	
	イオンリート投資法人	4,671	558,184,500	

インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	27,804	428,737,680	
インヴィンシブル投資法人	18,984	586,605,600	
エスコンジャパンリート投資法人	526	56,702,800	
オリックス不動産投資法人	8,623	1,258,095,700	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,005	299,598,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,339	798,044,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,823	485,273,700	
ケネディクス商業リート投資法人	1,672	324,033,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,884	601,938,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	866	87,119,600	
サンケイリアルエステート投資法人	627	64,894,500	
ザイマックス・リート投資法人	628	61,230,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	13,942	584,169,800	
ジャパンエクセレント投資法人	4,003	504,378,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	4,328	2,653,064,000	
スターアジア不動産投資法人	1,436	129,958,000	
スターツプロシード投資法人	674	130,216,800	
タカラレーベン不動産投資法人	1,228	109,783,200	
トーセイ・リート投資法人	942	99,852,000	
ヒューリックリート投資法人	3,681	484,051,500	
フロンティア不動産投資法人	1,537	531,033,500	
プレミアム投資法人	3,909	462,434,700	
ヘルスケア&メディカル投資法人	923	113,067,500	
マリモ地方創生リート投資法人	427	45,219,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	9,717	1,214,625,000	
ラサールロジポート投資法人	4,024	639,413,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	901	117,039,900	
阪急阪神リート投資法人	1,955	263,729,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,232	574,112,000	
三菱地所物流リート投資法人	852	318,222,000	
産業ファンド投資法人	5,574	884,036,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,015	96,729,500	
森トラスト総合リート投資法人	3,093	406,110,900	
森ヒルズリート投資法人	4,979	702,039,000	
星野リゾート・リート投資法人	659	265,906,500	

積水ハウス・リート投資法人	12,654	866,799,000	
大江戸温泉リート投資法人	735	49,980,000	
大和ハウスリート投資法人	6,175	1,611,057,500	
大和証券オフィス投資法人	999	634,365,000	
大和証券リビング投資法人	5,297	505,930,350	
投資法人みらい	4,922	198,356,600	
東急リアル・エステート投資法人	2,902	448,939,400	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,438	911,692,000	
日本ビルファンド投資法人	4,191	2,828,925,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,844	944,208,000	
日本プロロジスリート投資法人	6,512	1,893,038,400	
日本リート投資法人	1,406	498,427,000	
日本リテールファンド投資法人	8,180	1,208,186,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,828	798,910,000	
福岡リート投資法人	2,238	286,016,400	
平和不動産リート投資法人	2,695	283,783,500	
野村不動産マスターファンド投資法人	13,972	1,821,948,800	
投資証券 合計	254,533	37,591,113,030	
合計		37,591,113,030	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

令和2年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,885,942,611
コール・ローン	1,780,252,059
投資信託受益証券	3,286,499,679
投資証券	29,350,450,779
派生商品評価勘定	8,444,757
未収入金	5,140,065
未収配当金	39,480,450
流動資産合計	40,356,210,400
資産合計	
40,356,210,400	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	29,751
未払金	7,335,490,825
未払解約金	176,106,000
流動負債合計	7,511,626,576
負債合計	
7,511,626,576	
純資産の部	
元本等	
元本	31,952,777,143
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	891,806,681
元本等合計	32,844,583,824
純資産合計	
32,844,583,824	
負債純資産合計	
40,356,210,400	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 令和1年11月12日 至 令和2年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,743,134,014円
同期中追加設定元本額	33,540,797,520円
同期中一部解約元本額	41,331,154,391円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	76,819,261円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	32,743,796円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,070,177円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	20,094,008円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	22,416,966円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	85,401,591円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	80,522,698円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	33,732,261円
たわらノーロード 先進国リート	5,913,532,150円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	770,756,680円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	253,166,983円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	960,986,227円
たわらノーロード バランス(堅実型)	8,989,804円

たわらノーロード バランス(標準型)	151,670,843円
たわらノーロード バランス(積極型)	287,812,752円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	65,313,896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)	233,550,690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)	152,704,662円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	267,043,209円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,797,416円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,908,852円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,982,882円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,438,315円
One DC 先進国リートインデックスファンド	49,146,216円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,914,119円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	613,134,632円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	67,093,669円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	220,950,023円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	230,365,659円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	392,983,551円
投資のソムリエ	3,927,432,217円
投資のソムリエ<DC年金>	378,787,879円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	207,835,560円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	277,113,238円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,636,562,999円
ワールドアセットバランス(基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	557,429,997円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	2,900,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	1,933,812円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,531,898円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	5,801,436円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	883,051,813円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	178,910,790円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	598,087円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	269,139円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	378,788円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	725,528,421円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	89,903,657円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04 (適格機関投資家限定)	660,813,403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)	183,586,741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)	368,452,198円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格 機関投資家限定)	4,035,962,084円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,418,271,468円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	556,553,750円
計	31,952,777,143円
2. 受益権の総数	31,952,777,143口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	令和2年5月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	451,599,850
投資証券	3,895,799,834
合計	4,347,399,684

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月25日から令和2年5月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	令和2年5月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	17,270,071	-	17,269,200	871	
イギリス・ポンド	17,270,071	-	17,269,200	871	
買建	1,566,744,165	-	1,575,158,300	8,414,135	
アメリカ・ドル	211,761,198	-	211,741,200	19,998	
イギリス・ポンド	388,618,250	-	391,878,000	3,259,750	
オーストラリア・ドル	451,274,850	-	454,155,000	2,880,150	
カナダ・ドル	767,404	-	767,300	104	
シンガポール・ドル	299,935,400	-	301,126,800	1,191,400	
ニュージーランド・ドル	33,151,599	-	33,456,000	304,401	
ユーロ	13,919,964	-	13,920,000	36	
韓国・ウォン	2,624,100	-	2,634,000	9,900	
香港・ドル	164,691,400	-	165,480,000	788,600	
合計	1,584,014,236	-	1,592,427,500	8,415,006	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年5月11日現在	
1口当たり純資産額	1.0279円
(1万口当たり純資産額)	(10,279円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和2年5月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ARA US HOSPITALITY TRUST	104,600.000	42,363.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	9,959.900		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	445,700.000	314,218.500		
		PRIME US REIT	143,600.000	101,956.000		
		アメリカ・ドル	小計	766,600.000	468,497.400 (50,105,797)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	86,155.000	213,664.400		
		APN INDUSTRIA REIT	21,692.000	44,685.520		
		ARENA REIT	93,469.000	201,893.040		
		BWP TRUST	145,963.000	512,330.130		
		CENTURIA OFFICE REIT	115,908.000	218,486.580		
		CHARTER HALL GROUP	138,238.000	1,027,108.340		
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	127,939.000	519,432.340		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	136,991.000	420,562.370		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	75,176.000	170,649.520		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	570,442.000	424,979.290		
		DEXUS	321,197.000	2,842,593.450		
		GDI PROPERTY GROUP	103,999.000	108,158.960		
		GOODMAN GROUP	474,027.000	6,807,027.720		
		GPT GROUP	571,756.000	2,292,741.560		
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	86,456.000	253,316.080		
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD		27,894.000	71,408.640			
INGENIA COMMUNITIES GROUP		58,699.000	211,903.390			
MIRVAC GROUP		1,173,685.000	2,570,370.150			
NATIONAL STORAGE REIT		239,821.000	381,315.390			
RURAL FUNDS GROUP	101,989.000	194,798.990				
SCENTRE GROUP	1,577,318.000	3,470,099.600				
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	314,416.000	672,850.240				
STOCKLAND	723,013.000	1,981,055.620				
VICINITY CENTRES	957,048.000	1,368,578.640				
VIVA ENERGY REIT	208,852.000	497,067.760				
	オーストラリア・ドル	小計	8,452,143.000	27,477,077.720 (1,920,098,190)		

シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	140,595.000	160,278.300	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	240,880.000	124,053.200	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	888,360.000	2,602,894.800	
	ASCOTT TRUST	558,116.000	477,189.180	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	849,379.000	1,350,512.610	
	CAPITALAND MALL TRUST	844,260.000	1,561,881.000	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	232,580.000	313,983.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	250,900.000	235,846.000	
	ESR REIT	636,530.000	219,602.850	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	271,300.000	132,937.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	180,100.000	147,682.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	219,400.000	456,352.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	235,700.000	113,136.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	719,164.000	762,313.840	
	KEPPEL DC REIT	365,500.000	858,925.000	
	KEPPEL REIT	578,300.000	589,866.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	409,900.000	56,156.300	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	639,900.000	1,215,810.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	452,420.000	1,149,146.800	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	891,320.000	1,604,376.000	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	643,500.000	569,497.500	
	OUÉ COMMERCIAL REIT	773,055.000	301,491.450	
	PARKWAY LIFE REIT	119,300.000	390,111.000	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	155,700.000	50,602.500	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	101,200.000	73,370.000	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	150,400.000	55,648.000	
SPH REIT	207,400.000	163,846.000		
STARHILL GLOBAL REIT	329,400.000	158,112.000		
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	693,990.000	936,886.500		
シンガポール・ドル 小計	12,778,549.000	16,832,506.830 (1,273,715,792)		

	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	425,000.000	3,085,500.000	
	香港・ドル	小計	425,000.000	3,085,500.000 (42,579,900)	
投資信託受益証券 合計			22,422,292	3,286,499,679 (3,286,499,679)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	26,754.000	323,455.860	
		AGREE REALTY CORP	14,310.000	927,574.200	
		ALEXANDER'S INC.	658.000	166,191.060	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	36,866.000	5,603,632.000	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	14,433.000	401,526.060	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	40,807.000	1,265,017.000	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	32,571.000	242,979.660	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	76,832.000	1,907,738.560	
		AMERICOLD REALTY TRUST	57,827.000	2,036,088.670	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	44,912.000	1,699,470.080	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	63,003.000	576,477.450	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,083.000	6,993.910	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	41,987.000	6,884,188.520	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	3,795.000	24,591.600	
		BOSTON PROPERTIES INC	43,270.000	3,760,595.700	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,335.000	14,777.950	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	52,754.000	547,586.520	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	88,632.000	1,006,859.520	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	18,575.000	177,391.250	
		BRT APARTMENTS CORP	1,170.000	11,512.800	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	29,165.000	2,579,935.900	
		CARETRUST REIT INC	28,677.000	502,421.040	
		CBL & ASSOCIATES	14,685.000	3,304.120	
		CEDAR REALTY TRUST INC	13,779.000	11,932.610	
		CHATHAM LODGING TRUST	15,244.000	106,708.000	
		CITY OFFICE REIT INC	17,131.000	179,361.570	
		CLIPPER REALTY INC	1,939.000	10,761.450	
		COLONY CAPITAL INC	149,819.000	302,634.380	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	35,108.000	471,851.520	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	6,190.000	239,553.000	

CORECIVIC INC	35,793.000	441,327.690	
COREPOINT LODGING INC	7,534.000	33,149.600	
CORESITE REALTY CORP	11,960.000	1,469,764.400	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	33,379.000	855,503.770	
COUSINS PROPERTIES INC	43,594.000	1,256,379.080	
CUBESMART	57,449.000	1,536,760.750	
CYRUSONE INC	34,097.000	2,507,152.410	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	60,643.000	331,717.210	
DIGITAL REALTY TRUST INC	78,987.000	11,457,854.220	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	72,676.000	235,470.240	
DOUGLAS EMMETT INC	48,928.000	1,444,354.560	
DUKE REALTY TRUST	110,607.000	3,751,789.440	
EAST GROUP	11,410.000	1,254,187.200	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	22,179.000	582,864.120	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	45,046.000	369,377.200	
EPR PROPERTIES	23,439.000	641,759.820	
EQUINIX INC	25,620.000	17,374,459.200	
EQUITY COMMONWEALTH	36,211.000	1,231,174.000	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	54,799.000	3,362,466.640	
EQUITY RESIDENTIAL	104,946.000	6,739,632.120	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	26,537.000	353,472.840	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,875.000	4,902,168.750	
EXTRA SPACE STORAGE INC	38,977.000	3,573,801.130	
FARMLAND PARTNERS INC	9,378.000	61,519.680	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,012.000	1,641,457.440	
FIRST INDUSTRIAL RT	37,687.000	1,387,635.340	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	20,693.000	454,004.420	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,124.000	177,544.640	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	15,771.000	108,031.350	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	61,519.000	1,716,380.100	
GEO GROUP INC	36,455.000	419,232.500	
GETTY REALTY CORP	10,380.000	284,723.400	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,478.000	175,087.380	
GLADSTONE LAND CORP	6,064.000	87,139.680	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	12,189.000	128,106.390	
GLOBAL NET LEASE INC	26,964.000	381,540.600	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	39,735.000	1,218,275.100	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	61,469.000	1,561,312.600	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	148,954.000	3,612,134.500	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	12,444.000	58,984.560	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	30,836.000	1,142,165.440	
HOST HOTELS & RESORTS INC	216,047.000	2,389,479.820	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	46,069.000	1,080,778.740	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	28,091.000	277,539.080	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	19,666.000	357,724.540	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	5,123.000	386,837.730	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,559.000	221,796.880	
INVITATION HOMES INC	161,973.000	4,037,986.890	
IRON MOUNTAIN INC	86,534.000	2,126,140.380	
JBG SMITH PROPERTIES	35,078.000	1,142,841.240	
KILROY REALTY CORP	29,414.000	1,779,547.000	
KIMCO REALTY	125,405.000	1,366,914.500	
KITE REALTY GROUP TRUST	25,625.000	265,475.000	
LEXINGTON REALTY TRUST	73,916.000	765,769.760	
LIFE STORAGE INC	13,860.000	1,285,515.000	
LTC PROPERTIES INC	11,953.000	421,701.840	
MACK CALI	27,227.000	429,914.330	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	155,829.000	2,789,339.100	
MID AMERICA	34,320.000	3,966,362.400	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	29,217.000	382,450.530	
NATIONAL HEALTH INVS INC	13,125.000	691,687.500	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	51,783.000	1,709,874.660	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	17,791.000	527,325.240	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	27,590.000	80,011.000	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,893.000	225,607.890	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	14,519.000	377,494.000	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	65,900.000	1,817,522.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,097.000	83,335.950	
PARAMOUNT GROUP INC	60,326.000	533,885.100	

PARK HOTELS & RESORTS INC	71,606.000	624,404.320	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	39,288.000	445,918.800	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,333.000	9,166.300	
PHYSICIANS REALTY TRUST	58,668.000	934,581.240	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	37,594.000	639,849.880	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,986.000	69,754.140	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	14,783.000	113,829.100	
PROLOGIS INC	221,780.000	19,953,546.600	
PS BUSINESS PARKS	5,974.000	733,248.760	
PUBLIC STORAGE	45,153.000	8,594,422.020	
QTS REALTY TRUST INC	17,268.000	1,126,218.960	
REALTY INCOME CORP	103,051.000	5,653,377.860	
REGENCY CENTERS CORP	50,511.000	2,119,441.560	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	35,098.000	329,219.240	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	64,534.000	345,902.240	
RETAIL VALUE INC	3,092.000	43,906.400	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	32,932.000	1,344,942.880	
RLJ LODGING TRUST	51,281.000	466,144.290	
RPT REALTY	25,390.000	158,179.700	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,325.000	512,768.250	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	61,232.000	765,400.000	
SAFEHOLD INC	4,045.000	208,196.150	
SAUL CENTERS INC	3,788.000	118,829.560	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	10,990.000	89,678.400	
SERVICE PROPERTIES TRUST	49,829.000	324,885.080	
SIMON PROPERTY GROUP INC	92,282.000	5,354,201.640	
SITE CENTERS CORP	45,456.000	257,280.960	
SL GREEN	24,229.000	1,175,348.790	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	29,706.000	887,318.220	
STAG INDUSTRIAL INC	44,187.000	1,140,466.470	
STORE CAPITAL CORP	63,472.000	1,268,170.560	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,011.000	196,085.340	
SUN COMMUNITIES INC	27,890.000	3,742,001.300	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	67,286.000	569,912.420	
TANGER FACTORY OUTLET	28,639.000	188,158.230	

	TAUBMAN CENTERS INC	18,243.000	806,705.460	
	TERRENO REALTY CORP	19,923.000	1,032,609.090	
	THE MACERICH COMPANY	33,643.000	230,118.120	
	UDR INC	88,202.000	3,381,664.680	
	UMH PROPERTIES INC	11,534.000	148,211.900	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,813.000	381,452.520	
	URBAN EDGE PROPERTIES	34,791.000	346,170.450	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	9,558.000	131,422.500	
	VENTAS INC	112,209.000	3,377,490.900	
	VEREIT INC	322,049.000	1,764,828.520	
	VICI PROPERTIES INC	138,893.000	2,373,681.370	
	VORNADO REALTY TRUST	47,768.000	1,882,536.880	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	35,703.000	25,777.560	
	WASHINGTON REIT	24,141.000	534,240.330	
	WEINGARTEN REALTY INVST	36,165.000	639,397.200	
	WELLTOWER INC	122,028.000	5,436,347.400	
	WHITESTONE REIT	13,415.000	83,173.000	
	WP CAREY INC	51,858.000	3,245,792.220	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,147.000	308,347.410	
	アメリカ・ドル 小計	6,628,851.000	230,470,554.740 (24,648,825,830)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	26,338.000	16,856.320	
	ASSURA PLC	716,838.000	561,284.150	
	BIG YELLOW GROUP PLC	46,335.000	472,617.000	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	245,021.000	156,813.440	
	BRITISH LAND CO PLC	279,565.000	1,087,507.850	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	256,006.000	407,049.540	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	9,186.000	10,012.740	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	189,831.000	186,034.380	
	DERWENT LONDON PLC	31,287.000	907,323.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	186,961.000	126,385.630	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	75,862.000	507,820.220	
	HAMMERSON PLC	175,084.000	93,669.940	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	11,552.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	222,749.000	1,434,058.060	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	251,104.000	483,877.400	
	LXI REIT PLC	159,926.000	153,049.180	
	NEWRIVER REIT PLC	50,958.000	30,880.540	

	PICTON PROPERTY INCOME LTD	170,446.000	110,108.110	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	362,286.000	568,789.020	
	RDI REIT PLC	54,386.000	28,226.330	
	REGIONAL REIT LTD	84,238.000	65,705.640	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	62,671.000	430,236.410	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	113,883.000	39,403.510	
	SEGRO PLC	324,528.000	2,668,918.270	
	SHAFTESBURY PLC	66,395.000	372,475.950	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	110,038.000	104,536.100	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	508,768.000	633,416.160	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	254,022.000	151,651.130	
	UNITE GROUP PLC	108,069.000	886,165.800	
	WORKSPACE GROUP PLC	38,577.000	288,555.960	
	イギリス・ポンド 小計	5,412,398.000	12,994,979.780 (1,726,383,064)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	52,551.000	917,014.950	
	イスラエル・シュケル 小計	52,551.000	917,014.950 (27,913,935)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	18,013.000	758,167.170	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,186.000	173,937.060	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	7,095.000	188,868.900	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	24,721.000	1,214,789.940	
	CHOICE PROPERTIES REIT	45,738.000	567,151.200	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	28,103.000	223,418.850	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	13,784.000	175,194.640	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,101.000	206,575.830	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	22,509.000	222,163.830	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,627.000	181,770.890	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,493.000	423,383.790	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,981.000	519,084.240	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	42,497.000	399,896.770	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18,272.000	267,136.640	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,740.000	256,181.200	

	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,997.000	100,939.400	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	4,142.000	58,277.940	
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	9,997.000	348,695.360	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,249.000	236,912.730	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	46,582.000	695,469.260	
	SLATE OFFICE REIT	5,199.000	19,028.340	
	SLATE RETAIL REIT	3,667.000	32,452.950	
	SMARTCENTRES REIT	21,276.000	429,349.680	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	20,873.000	209,773.650	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	8,735.000	48,479.250	
	カナダ・ドル 小計	471,577.000	7,957,099.510 (610,627,816)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	188,858.000	196,412.320	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	332,721.000	753,613.060	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	476,210.000	442,875.300	
	PRECINCT PROPERTIES	326,171.000	489,256.500	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	106,603.000	247,851.970	
	ニュージーランド・ドル 小計	1,430,563.000	2,130,009.150 (139,749,900)	
ユーロ	AEDIFICA	8,062.000	732,029.600	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	47,082.000	639,373.560	
	ALTAREA	1,115.000	129,340.000	
	BEFIMMO	6,929.000	270,231.000	
	COFINIMMO SA	7,401.000	913,283.400	
	COVIVIO	13,249.000	712,796.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,831.000	134,212.260	
	GECINA SA	16,529.000	1,857,859.600	
	HAMBORNER REIT AG	21,542.000	171,474.320	
	HIBERNIA REIT PLC	208,204.000	230,690.030	
	ICADE	8,394.000	561,558.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	14,335.000	49,957.470	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	72,831.000	585,925.390	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,779.000	150,154.850	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	120,644.000	146,944.390	
KLEPIERRE	62,122.000	1,067,566.570		

	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	20,955.000	77,952.600	
	MERCIALYS	7,165.000	48,578.700	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	109,072.000	842,035.840	
	MONTEA SCA	3,259.000	259,416.400	
	NSI NV	5,133.000	176,831.850	
	RETAIL ESTATES	3,407.000	163,024.950	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	41,471.000	2,095,114.920	
	VASTNED RETAIL	5,249.000	91,332.600	
	WAREHOUSES DE PAUW	38,482.000	900,478.800	
	WERELDHAVE NV	11,998.000	90,584.900	
	ユーロ 小計	874,240.000	13,098,748.800 (1,519,454,861)	
	韓国・ウォン			
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10,894.000	68,959,020.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	498.000	193,224.000	
	韓国・ウォン 小計	11,392.000	69,152,244.000 (6,071,567)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	602,070.000	2,709,315.000	
	LINK REIT	619,920.000	42,433,524.000	
	PROSPERITY REIT	251,000.000	609,930.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	313,000.000	1,230,090.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	448,000.000	1,671,040.000	
	香港・ドル 小計	2,233,990.000	48,653,899.000 (671,423,806)	
投資証券 合計		17,115,562	29,350,450,779 (29,350,450,779)	
合計			32,636,950,458 (32,636,950,458)	

(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)

- 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。
- 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。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄 投資証券 153銘柄	0.15 -	- 75.05	75.68
イギリス・ポンド	投資証券 30銘柄	-	5.26	5.29
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.08	0.09
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	5.85	-	5.88
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-	1.86	1.87

シンガポール・ドル	投資信託受益証券	29銘柄	3.88	-	3.90
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	-	0.43	0.43
ユーロ	投資証券	26銘柄	-	4.63	4.66
韓国・ウォン	投資証券	2銘柄	-	0.02	0.02
香港・ドル	投資信託受益証券	1銘柄	0.13	-	2.19
	投資証券	5銘柄	-	2.04	

(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5月29日現在

資産総額	383,216,472円
負債総額	131,974円
純資産総額(-)	383,084,498円
発行済数量	372,019,301口
1口当たり純資産額(/)	1.0297円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産総額	237,499,548,281円
負債総額	405,528,924円
純資産総額(-)	237,094,019,357円
発行済数量	94,580,550,979口
1口当たり純資産額(/)	2.5068円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産総額	341,165,216,886円
負債総額	76,402,601円
純資産総額(-)	341,088,814,285円
発行済数量	94,111,272,513口
1口当たり純資産額(/)	3.6243円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産総額	232,360,489,153円
負債総額	4,131,668,000円
純資産総額(-)	228,228,821,153円
発行済数量	174,066,556,851口
1口当たり純資産額(/)	1.3112円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産総額	124,056,508,494円
負債総額	1,168,664,478円
純資産総額(-)	122,887,844,016円
発行済数量	63,547,132,894口
1口当たり純資産額(/)	1.9338円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産総額	40,208,674,085円
負債総額	667,893,790円
純資産総額(-)	39,540,780,295円
発行済数量	20,678,634,495口
1口当たり純資産額(/)	1.9122円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年5月29日現在

資産総額	35,007,094,431円
負債総額	32,324,849円
純資産総額(-)	34,974,769,582円
発行済数量	32,726,611,936口
1口当たり純資産額(/)	1.0687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5月29日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2020年5月29日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年5月29日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,160,565,284,561
追加型株式投資信託	863	13,062,656,894,856
単位型公社債投資信託	36	97,205,646,710
単位型株式投資信託	185	1,287,535,891,479
合計	1,110	15,607,963,717,606

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。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第35期事業年度(自2019年4月1日至2020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ております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	41,087,475	32,932,013
金銭の信託	18,773,228	28,548,165
有価証券	153,518	996
未収委託者報酬	12,438,085	11,487,393
未収運用受託報酬	3,295,109	4,674,225
未収投資助言報酬	327,064	331,543
未収収益	56,925	11,674
前払費用	573,874	480,129
その他	491,914	2,815,351
流動資産計	77,197,195	81,281,494
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,461,316	1,278,455
建物	1 1,096,916	1 1,006,793
器具備品	1 364,399	1 270,768
建設仮勘定	-	894
無形固定資産		
ソフトウェア	2,411,540	3,524,781
ソフトウェア仮勘定	885,545	3,299,065
ソフトウェア仮勘定	1,522,040	221,784
電話加入権	3,931	3,931
電信電話専用施設利用権	23	-
投資その他の資産		
投資有価証券	9,269,808	9,482,127
関係会社株式	1,611,931	261,361
長期差入保証金	4,499,196	5,299,196
繰延税金資産	1,312,328	1,302,402
繰延税金資産	1,748,459	2,508,004
その他	97,892	111,162
固定資産計	13,142,665	14,285,364
資産合計	90,339,861	95,566,859

(単位:千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	2,183,889	3,702,906
未払金	5,697,942	4,803,140
未払収益分配金	1,053	966
未払償還金	48,968	9,999
未払手数料	4,883,723	4,582,140
その他未払金	764,196	210,034
未払費用	6,724,986	6,673,320
未払法人税等	3,341,238	4,090,268
未払消費税等	576,632	1,338,183
賞与引当金	1,344,466	1,373,328
役員賞与引当金	48,609	65,290
流動負債計	19,917,766	22,046,438
固定負債		
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
時効後支払損引当金	177,851	174,139
固定負債計	2,073,009	2,293,087
負債合計	21,990,776	24,339,526
(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	45,949,372	49,674,383
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	45,826,079	49,551,090
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	14,146,079	17,871,090
株主資本計	67,502,329	71,227,341
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	846,755	7
評価・換算差額等計	846,755	7
純資産合計	68,349,085	71,227,333
負債・純資産合計	90,339,861	95,566,859

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,812,585		84,426,075	
運用受託報酬	16,483,356		16,912,305	
投資助言報酬	1,235,553		1,208,954	
その他営業収益	113,622		68,156	
営業収益計		102,645,117		102,615,492
営業費用				
支払手数料	36,100,556		34,980,736	
広告宣伝費	387,028		340,791	
公告費	375		375	
調査費	24,389,003		25,132,268	
調査費	9,956,757		10,586,542	
委託調査費	14,432,246		14,545,725	
委託計算費	936,075		698,723	
営業雑経費	1,254,114		990,002	
通信費	47,007		44,209	
印刷費	978,185		738,330	
協会費	63,558		71,386	
諸会費	22,877		22,790	
支払販売手数料	142,485		113,286	
営業費用計		63,067,153		62,142,897
一般管理費				
給料	10,859,354		10,817,861	
役員報酬	189,198		174,795	
給料・手当	9,098,957		9,087,800	
賞与	1,571,197		1,555,264	
交際費	60,115		40,436	
寄付金	7,255		8,906	
旅費交通費	361,479		320,037	
租税公課	588,172		651,265	
不動産賃借料	1,511,876		1,479,503	
退職給付費用	521,184		505,189	
固定資産減価償却費	590,667		882,526	
福利厚生費	45,292		44,352	
修繕費	16,247		1,843	
賞与引当金繰入額	1,344,466		1,373,328	
役員賞与引当金繰入額	48,609		65,290	
機器リース料	130		233	
事務委託費	3,302,806		3,625,424	
事務用消耗品費	131,074		104,627	
器具備品費	8,112		1,620	
諸経費	188,367		197,094	
一般管理費計		19,585,212		20,119,543
営業利益		19,992,752		20,353,050

(単位:千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	1,749		4,440	
受取配当金	73,517		11,185	
時効成立分配金・償還金	8,582		49,164	
投資信託償還益	-		5,528	
受取負担金	177,066		297,886	
雑収入	24,919		7,394	
時効後支払損引当金戻入額	19,797		3,473	
営業外収益計		305,633		379,073
営業外費用				
為替差損	17,542		19,750	
投資信託償還損	-		1	
金銭の信託運用損	175,164		169,505	
システム解約料	-		31,680	
雑損失	5,659		104	
営業外費用計		198,365		221,042
経常利益		20,100,019		20,511,082
特別利益				
投資有価証券売却益	353,644		1,169,758	
特別利益計		353,644		1,169,758
特別損失				
固定資産除却損	1 19,121		1 16,085	
特別損失計		19,121		16,085
税引前当期純利益		20,434,543		21,664,754
法人税、住民税及び事業税		6,386,793		7,045,579
法人税等調整額		71,767		385,835
法人税等合計		6,315,026		6,659,743
当期純利益		14,119,516		15,005,011

(3)【株主資本等変動計算書】

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
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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
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	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	846,755	846,755	68,349,085
当期変動額			
剰余金の配当			11,280,000
当期純利益			15,005,011
株主資本以外の 項目の当期 変動額(純額)	846,763	846,763	846,763
当期変動額合計	846,763	846,763	2,878,247
当期末残高	7	7	71,227,333

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>
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

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
建物	229,897	320,020
器具備品	927,688	949,984

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第34期 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	1,550	-
器具備品	439	9,609
ソフトウエア	17,130	6,475

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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
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
2020年6月17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
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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	-

第35期(2020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	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非上場株式	276,764	259,369
関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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。

(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34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020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	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

（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34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円）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276,764千円）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35期（2020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	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
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	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

（注）非上場株式（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。

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

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	-	-	-

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

(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、償還によるものであります。

(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。

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,154,607	2,289,044
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の発生額	10,147	18,448
退職給付の支払額	158,018	187,749
その他	438	1,476
退職給付債務の期末残高	2,289,044	2,422,901

(2) 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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未積立退職給付債務	2,289,044	2,422,901
未認識数理計算上の差異	150,568	130,155
未認識過去勤務費用	243,317	173,798
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947
退職給付引当金	1,895,158	2,118,947
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,895,158	2,118,947

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	300,245	302,546
利息費用	1,918	2,087
数理計算上の差異の費用処理額	43,920	38,861
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,519
その他	3,640	11,303
確定給付制度に係る退職給付費用	411,963	401,711

(4) 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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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. 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104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

(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34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	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
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円

(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	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

(2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64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	5,241,252千円	5,149,555千円

(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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)及び第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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	-	-
子 会 社	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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020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	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
								子会社株式 の取得	10,294,840	未払 手数料	1,231,431
子 会 社	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	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	1,708,727円13銭	1,780,683円32銭
1株当たり当期純利益金額	352,987円92銭	375,125円27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34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
当期純利益金額	14,119,516千円	15,005,011千円
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	14,119,516千円	15,005,011千円
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。

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

(注) 資本金の額は2019年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

a. 名称

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社

b. 資本金の額

2019年3月末日現在 9,557.5万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社は、委託会社との投資顧問契約に基づき、当ファンドの信託財産の運用助言等を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2020年5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
東京事務所指定有限責任社員
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

監査意見

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。

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2020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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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6月19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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印
業務執行社員

監査意見

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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の令和1年11月12日から令和2年5月11日までの特定期間の財務諸表、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。

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、マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>の令和2年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、アセットマネジメントOne株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。