

**【表紙】**

<b>【提出書類】</b>	有価証券届出書
<b>【提出先】</b>	関東財務局長殿
<b>【提出日】</b>	2020年10月14日提出
<b>【発行者名】</b>	アセットマネジメントOne株式会社
<b>【代表者の役職氏名】</b>	取締役社長 菅野 暁
<b>【本店の所在の場所】</b>	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
<b>【事務連絡者氏名】</b>	酒井 隆
<b>【電話番号】</b>	03-6774-5100
<b>【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】</b>	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型
<b>【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】</b>	5,000億円を上限とします。
<b>【縦覧に供する場所】</b>	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】

投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型  
(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」に記載の振替機関及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】

5,000億円を上限とします。

### (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。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

### (5)【申込手数料】

ありません。

### (6)【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2020年10月15日から2021年4月12日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社に買付代金を支払うものとします。

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

#### 振替受益権について

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

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

#### （参考）

##### 投資信託振替制度

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

#### <ファンドの特色>

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

- 主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)にマザーファンド\*<sup>1</sup>を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
- 外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ\*<sup>2</sup>を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

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

\*2 一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う[代替ヘッジ]を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

## 2 基準価額の変動リスク\*を年率2%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

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

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

### 運用プロセス

#### ■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%~100%)を決定します。

•基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。

•基本配分戦略は月次で行います。

※基本配分戦略に関して、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。

#### ■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

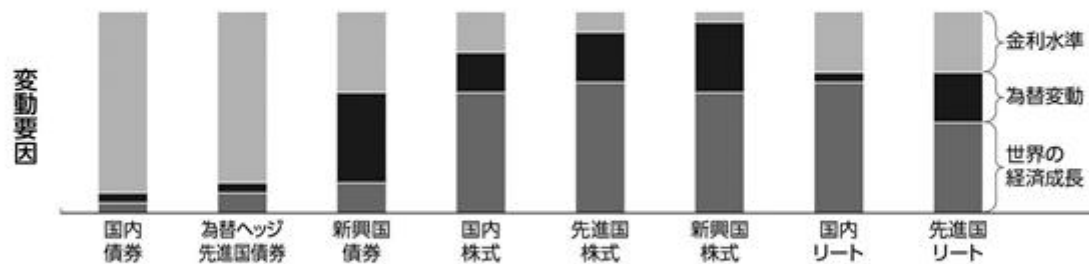
•機動的配分戦略は日次で行います。

## 基本配分戦略 (月次戦略)

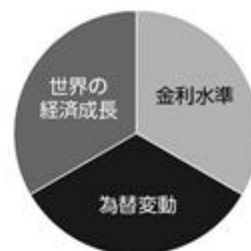
資産価格はさまざまな要因により変動し、またその要因も刻々と変化していきます。当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、この比率を均等に配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率を決定します。

### 当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

#### 各資産における変動要因と要因の比率(例)



#### 変動要因の比率を均等に配分



着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

#### 変動要因の配分から最適と判断される資産配分の比率を決定



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

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

## 機動的配分戦略 (日次戦略)

市場環境に応じて、組入資産を安定資産や現金等\*に入れ替えます。

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

\*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等です。

※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

### 価格下落局面における配分比率変更のイメージ

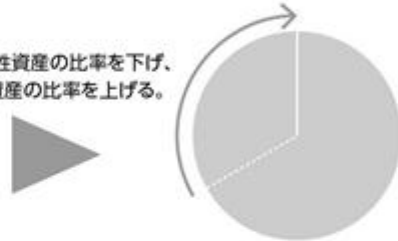
例

ある時点の基本配分比率



リスク性資産の価格下落局面\*1

リスク性資産の比率を下げ、  
安定資産の比率を上げる。



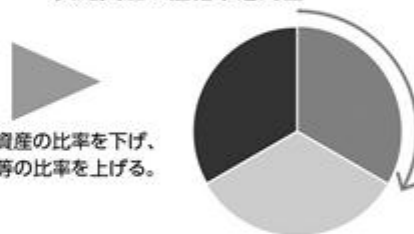
安定資産、リスク性資産の価格下落局面\*2

安定資産の比率を下げ、  
現金等の比率を上げる。



安定資産の価格下落局面\*1

安定資産の比率を下げ、  
現金等の比率を上げる。



リスク性資産をすべて売却し、  
安定資産、現金等の比率を  
上げる。

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

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

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

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

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

### 投資対象資産

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

## ■ 分配方針

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

- 将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- 分配金額は、分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

### 商品分類表

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 その他資産 ( ) 資産複合
	内外	

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

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

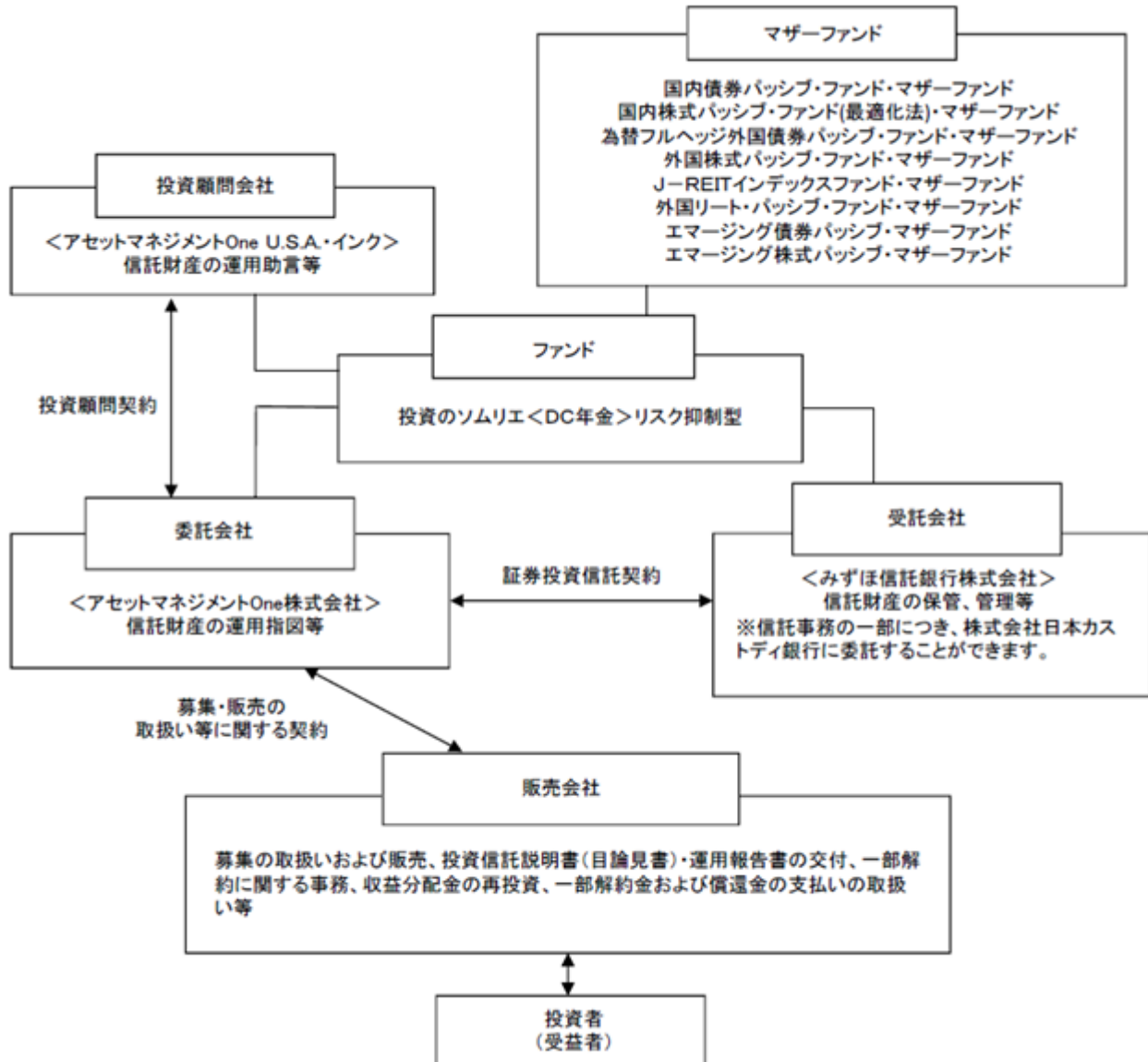
<p>その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (債券、株式、 不動産投信) 資産配分変更型))</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(債券、株式、不動産投信)を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(債券、株式、不動産投信)資産配分変更型))に分類されます。</p>
<p>年1回</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。</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>為替ヘッジあり</p>	<p>目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジ又は一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。</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/>)でご覧いただけます。

## (2) 【ファンドの沿革】

2015年10月30日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

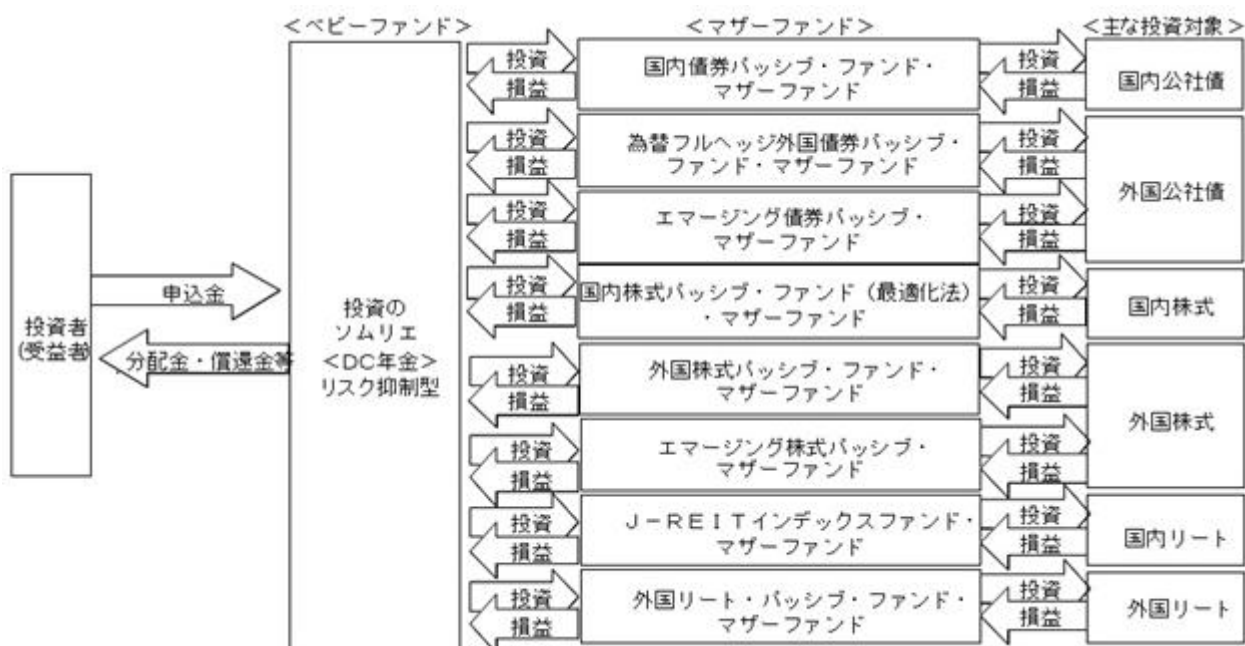
## ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間においては、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。



当ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産等に投資する場合があります。短期金融資産等への投資に際しては、市場環境によって残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

### 資本金の額

20億円（2020年7月31日現在）

### 委託会社の沿革

1985年7月1日	会社設立
1998年3月31日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブルユ・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7月31日現在)

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

1：A種種類株式(15,510株)を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

#### <投資対象>

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

#### <投資態度>

投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

- ・国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。
  - ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
  - ・国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

（それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

- ・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ<sup>\*</sup>を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

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

- ・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）、短期金融資産へ投資する場合があります。

基準価額の変動リスク<sup>\*</sup>を年率2%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

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

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

基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

- ・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
- ・基本配分戦略は月次で行います。

機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

短期金融資産等への投資に際しては、市場環境によって残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)

八.金銭債権

二.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

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

15. 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。)
  16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
  18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
  21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  23. 外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

#### (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

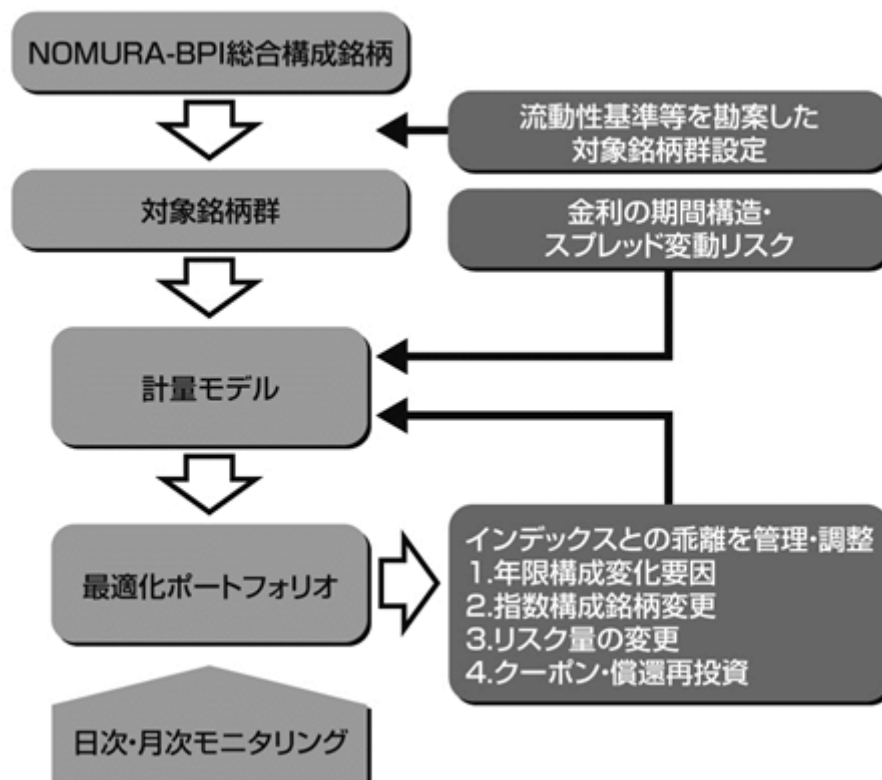
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。



投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2.公社債(債券先物取引等を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</li></ol> <div data-bbox="343 405 1361 600" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p></div>
------	--

## 運用プロセス

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



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

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

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

## 運用プロセス

## 1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

## 2.最適化法によるポートフォリオの構築

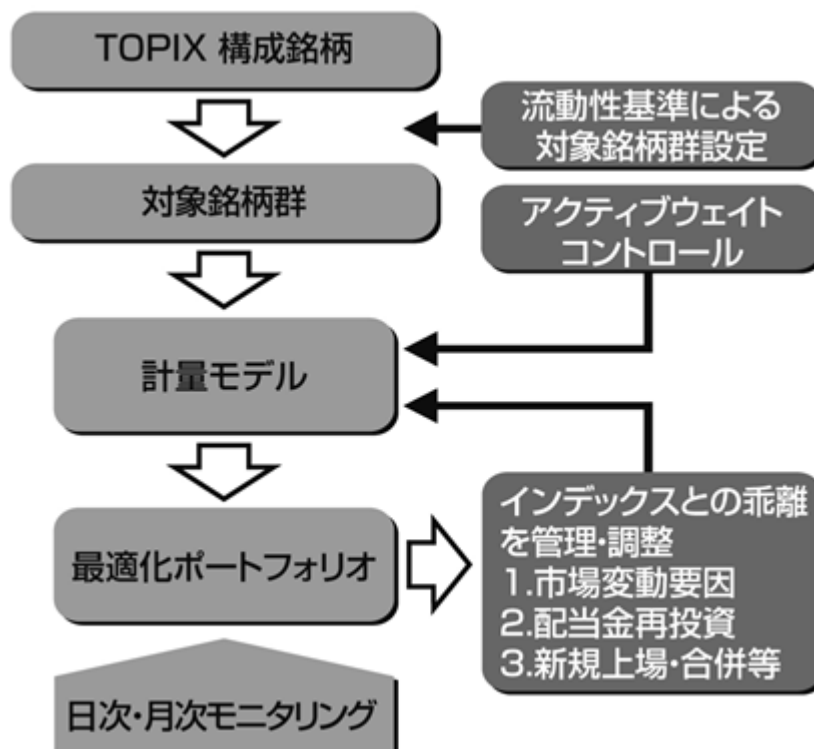
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

## 3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li> <li>3. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     E[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --&gt; A     F[金利期間構造] --&gt; C     D --&gt; G[インデックスとの乖離を管理・調整]     G --&gt; H[日次・月次モニタリング]     </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。</li> <li>2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>4. 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>5. 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>6. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

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

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



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

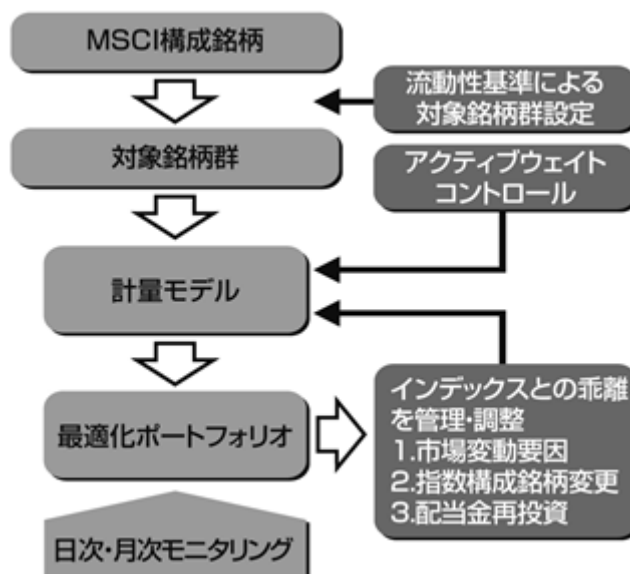
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

### 運用プロセス

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



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

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

## 投資態度

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

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

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

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

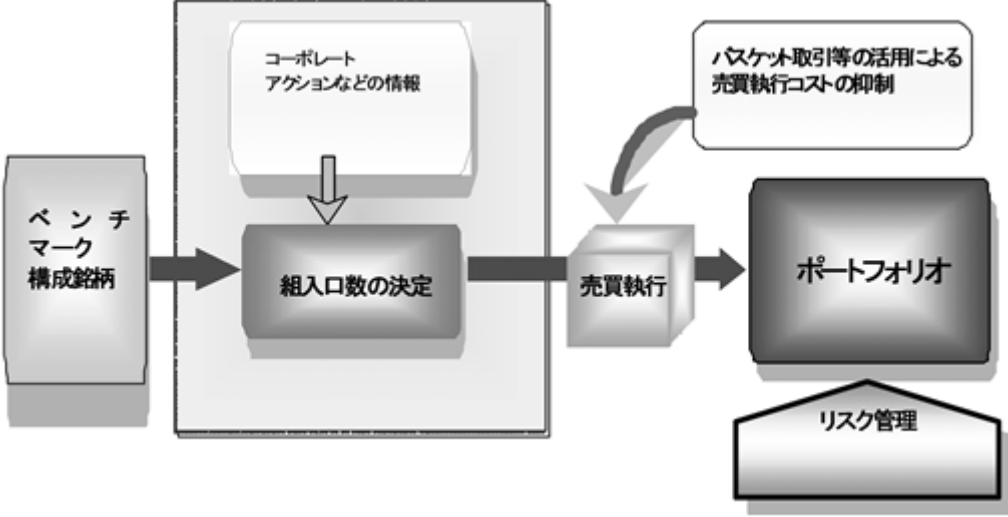
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

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

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

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

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

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

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



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

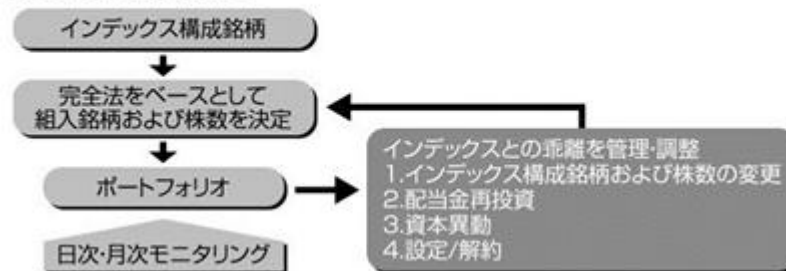
S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I T インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P



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

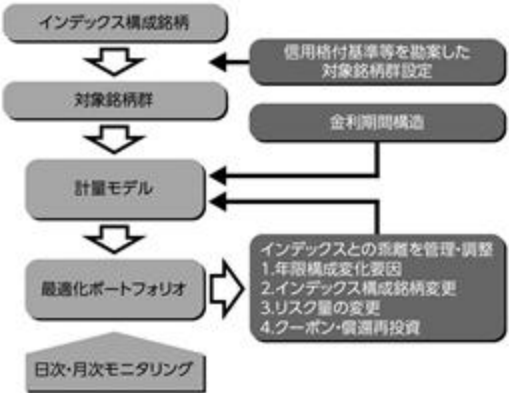
## 運用プロセス

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



## 主な投資制限

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

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

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

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

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

本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、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

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・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。</p> <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     E --&gt; D     D --&gt; F[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資]     F --&gt; G[日次・月次モニタリング]   </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>4. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>
<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。</p>	

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

## 運用計画の決定

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

## 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

#### 内部管理等のモニタリング

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

#### b．ファンドの関係法人に関する管理

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

#### c．運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2020年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

### （４）【分配方針】

#### 収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

##### (1)分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

##### (2)分配対象額についての分配方針

委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

##### (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

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

- 1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、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、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある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。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

委託会社は受託会社から交付を受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。

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

#### (5) 【投資制限】

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

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）

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

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）

スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限定します。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

一般社団法人投資信託協会の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実質比率は、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の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

投資する株式等の範囲（約款第20条）

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場におい

て取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

#### 信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

#### 先物取引等の運用指図(約款第22条)

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。))。
- 1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還

金とマザーファンドが限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

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

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

2) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券とマザーファンドの信託財産に属する外貨建有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を加えた額の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

1) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザー

ファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 8) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

#### デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

#### 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.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

#### 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

#### 外国為替予約取引の指図(約款第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、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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かかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額に

マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド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34条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

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

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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。

一般的に金利が上昇すると債券、リートの価格は下落します。当ファンドは、実質的に債券、リートに投資をしますので、金利変動により基準価額が上下します。

#### 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、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

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

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

#### 信用リスク

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

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。

#### カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドの実質的な投資対象国・地域における政治・経済情勢の変化等によっては、運用上の制約を受ける可能性があり、基準価額が下がる要因となります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### <その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。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。

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

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

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

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

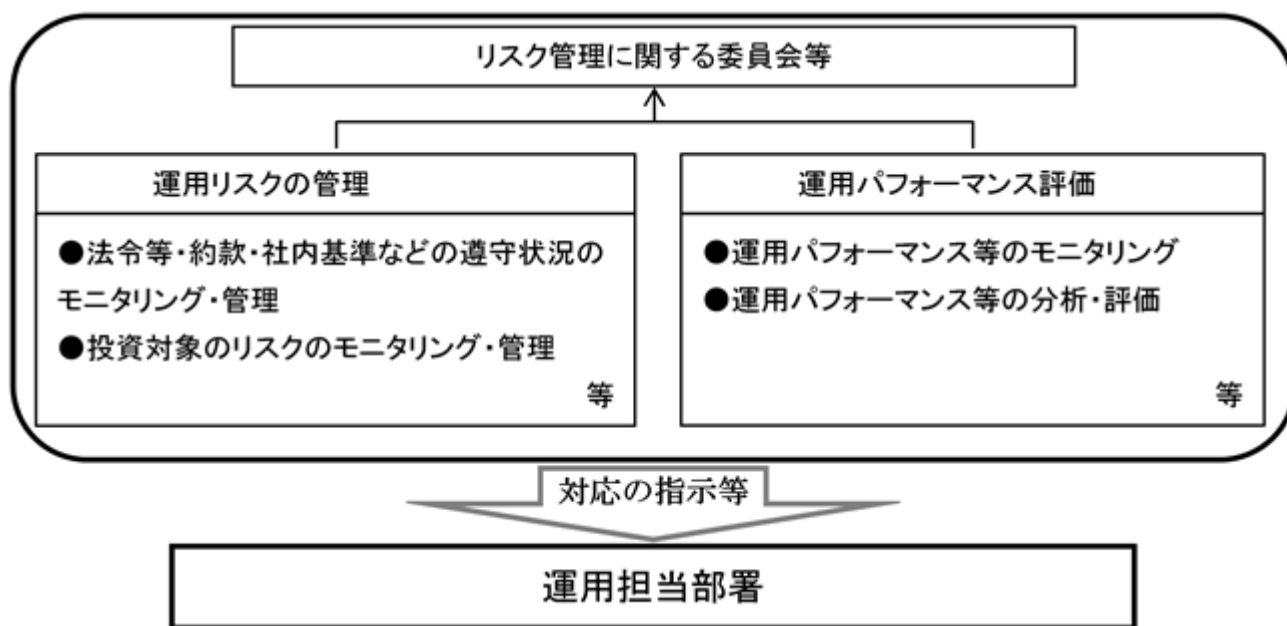
### 注意事項

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

### <リスク管理体制>

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

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



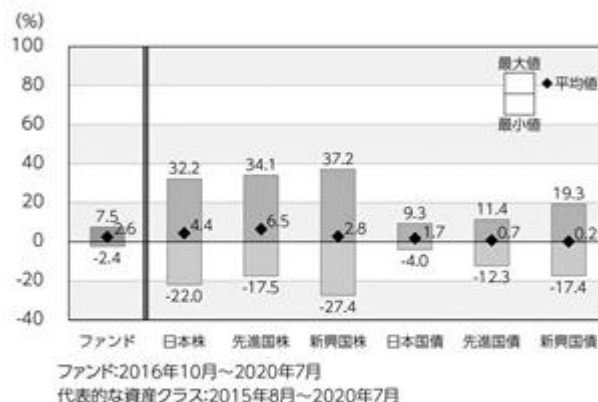
リスク管理体制は2020年7月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

## <参考情報>

### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



### 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(現東京証券取引所)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、現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0.649%（税抜0.59%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.28%	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0.28%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）に対する投資顧問報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.126%）が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## ・信託財産留保額

ありません。

## ・その他の費用

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

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

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

有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に関する費用は、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は、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### 損益通算について

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

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

##### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

上記は、2020年7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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	14,023,815,716	88.76
内 日本	14,023,815,716	88.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,776,676,603	11.24
純資産総額	15,800,492,319	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	172,352,343,600	80.13
内 日本	172,352,343,600	80.13
地方債証券	16,817,730,000	7.82
内 日本	16,817,730,000	7.82
特殊債券	15,347,203,615	7.14
内 日本	15,347,203,615	7.14
社債券	9,586,247,150	4.46
内 日本	9,183,311,150	4.27
内 フランス	402,936,000	0.19
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	989,011,216	0.46
純資産総額	215,092,535,581	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	206,304,233,240	98.22
内 日本	206,304,233,240	98.22
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,743,929,317	1.78
純資産総額	210,048,162,557	100.00

#### その他資産の投資状況

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	3,771,180,000	1.80
内 日本	3,771,180,000	1.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	382,820,034,828	99.38
内 アメリカ	169,704,209,760	44.06
内 フランス	39,844,112,135	10.34
内 イタリア	36,118,874,155	9.38
内 ドイツ	29,562,674,436	7.67
内 イギリス	25,509,002,160	6.62
内 スペイン	23,614,522,831	6.13
内 ベルギー	10,019,093,573	2.60
内 オーストラリア	8,476,967,395	2.20
内 オランダ	7,741,393,716	2.01
内 カナダ	7,054,255,676	1.83
内 オーストリア	6,027,742,314	1.56
内 アイルランド	3,135,950,180	0.81
内 メキシコ	2,759,167,458	0.72
内 フィンランド	2,383,898,357	0.62
内 ポーランド	2,310,936,908	0.60
内 デンマーク	1,982,419,379	0.51
内 マレーシア	1,749,692,723	0.45
内 シンガポール	1,594,238,141	0.41
内 イスラエル	1,365,074,516	0.35
内 スウェーデン	1,082,835,943	0.28
内 ノルウェー	782,973,072	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,384,204,563	0.62
純資産総額	385,204,239,391	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	343,938,173,385	95.35
内 アメリカ	234,810,515,188	65.10
内 イギリス	15,696,427,335	4.35
内 スイス	13,357,961,278	3.70
内 カナダ	12,342,311,153	3.42
内 フランス	12,059,361,177	3.34
内 ドイツ	11,048,091,122	3.06
内 オーストラリア	7,658,736,110	2.12
内 オランダ	6,757,670,407	1.87
内 アイルランド	6,364,114,866	1.76
内 スウェーデン	3,658,505,340	1.01
内 デンマーク	2,964,316,403	0.82
内 香港	2,807,031,865	0.78
内 スペイン	2,804,017,490	0.78
内 イタリア	2,228,481,833	0.62
内 フィンランド	1,405,016,302	0.39
内 バミューダ	1,138,583,925	0.32



内	ベルギー	1,124,669,766	0.31
内	ジャージー	1,084,821,041	0.30
内	シンガポール	1,068,659,071	0.30
内	イスラエル	741,255,729	0.21
内	ケイマン諸島	681,030,419	0.19
内	ノルウェー	643,933,446	0.18
内	ニュージーランド	388,982,964	0.11
内	ルクセンブルグ	264,119,369	0.07
内	オランダ領キュラソー	223,951,896	0.06
内	オーストリア	201,190,286	0.06
内	ポルトガル	187,047,094	0.05
内	リベリア	74,053,923	0.02
内	パナマ	61,773,017	0.02
内	マン島	46,499,225	0.01
内	パプアニューギニア	45,044,345	0.01
新株予約権証券		7,016,672	0.00
内	アメリカ	7,016,672	0.00
投資信託受益証券		684,849,730	0.19
内	オーストラリア	463,807,527	0.13
内	シンガポール	221,042,203	0.06
投資証券		7,984,612,093	2.21
内	アメリカ	7,385,861,786	2.05
内	イギリス	190,982,055	0.05
内	香港	140,423,625	0.04
内	フランス	131,882,792	0.04
内	オランダ	70,661,647	0.02
内	カナダ	64,800,188	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,094,032,085	2.24
純資産総額		360,708,683,965	100.00

#### その他資産の投資状況

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
株価指数先物取引（買建）	8,114,225,782	2.25	
内	アメリカ	5,929,845,912	1.64
内	ドイツ	1,335,271,375	0.37
内	イギリス	383,191,855	0.11
内	カナダ	273,274,689	0.08
内	オーストラリア	192,641,951	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	43,274,862,058	97.83
内 日本	43,274,862,058	97.83
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	960,893,101	2.17
純資産総額	44,235,755,159	100.00

## その他資産の投資状況

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	866,434,000	1.96
内 日本	866,434,000	1.96

（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7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	4,093,289,589	10.85
内 オーストラリア	2,446,741,817	6.48
内 シンガポール	1,646,547,772	4.36
投資証券	33,528,446,606	88.86
内 アメリカ	28,222,430,467	74.80
内 イギリス	1,974,305,584	5.23
内 カナダ	714,294,505	1.89
内 香港	621,215,173	1.65
内 フランス	561,688,544	1.49
内 ベルギー	475,393,383	1.26
内 オランダ	304,112,856	0.81
内 スペイン	179,466,606	0.48
内 ニューージーランド	176,463,611	0.47
内 ドイツ	102,936,357	0.27
内 ガーンジー	80,903,759	0.21
内 アイルランド	54,918,763	0.15
内 イスラエル	24,092,787	0.06
内 韓国	19,461,149	0.05
内 マン島	11,326,985	0.03
内 イタリア	5,436,077	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	108,254,238	0.29
純資産総額	37,729,990,433	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	112,251,118,399	97.35
内 メキシコ	17,916,218,009	15.54
内 インドネシア	15,405,369,361	13.36
内 ロシア	15,309,685,972	13.28
内 ブラジル	12,320,708,478	10.69
内 コロンビア	11,124,965,105	9.65
内 フィリピン	10,366,112,936	8.99
内 パナマ	6,474,354,599	5.62
内 南アフリカ	6,377,915,334	5.53
内 ペルー	5,030,965,864	4.36
内 ハンガリー	4,807,449,966	4.17
内 ルーマニア	4,397,638,930	3.81
内 クロアチア	2,719,733,845	2.36
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,053,325,969	2.65
純資産総額	115,304,444,368	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	35,546,849,249	86.35
内 ケイマン諸島	9,179,458,886	22.30
内 台湾	4,559,742,717	11.08
内 中国	4,322,595,410	10.50
内 韓国	4,143,773,489	10.07
内 インド	2,922,178,046	7.10
内 ブラジル	1,909,514,089	4.64
内 南アフリカ	1,301,037,984	3.16
内 ロシア	997,728,013	2.42
内 サウジアラビア	890,400,790	2.16
内 香港	860,182,392	2.09
内 タイ	714,890,277	1.74
内 マレーシア	617,935,361	1.50
内 インドネシア	508,044,708	1.23
内 メキシコ	450,497,199	1.09
内 パミュータ	312,762,951	0.76
内 カタール	280,966,633	0.68
内 フィリピン	268,211,866	0.65
内 ポーランド	244,548,310	0.59
内 チリ	205,439,273	0.50
内 アラブ首長国連邦	174,674,960	0.42
内 トルコ	134,465,209	0.33
内 アメリカ	124,374,770	0.30
内 ハンガリー	78,017,560	0.19
内 コロンビア	65,608,507	0.16
内 ルクセンブルグ	54,058,102	0.13

	内 ギリシャ	48,709,180	0.12
	内 チェコ	40,801,769	0.10
	内 ジャージー	32,282,160	0.08
	内 エジプト	30,350,338	0.07
	内 オランダ	26,983,636	0.07
	内 ベルー	14,797,177	0.04
	内 マン島	13,697,190	0.03
	内 シンガポール	7,203,600	0.02
	内 アルゼンチン	6,462,870	0.02
	内 パキスタン	4,453,827	0.01
新株予約権証券		28,536	0.00
	内 タイ	28,536	0.00
投資信託受益証券		201,529,780	0.49
	内 メキシコ	125,683,055	0.31
	内 ブラジル	75,846,725	0.18
投資証券		32,913,994	0.08
	内 南アフリカ	19,066,072	0.05
	内 メキシコ	13,847,922	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,386,003,324	13.08
純資産総額		41,167,324,883	100.00

#### その他資産の投資状況

令和2年7月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	5,424,299,730	13.18
	内 アメリカ	5,424,299,730

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

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

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,672,490,945	1.4363 9,583,947,697	1.4871 9,922,661,284	- -	62.80
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	1,296,616,376	1.3146 1,704,602,927	1.3104 1,699,086,099	- -	10.75
3	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	488,387,635	1.9554 955,000,000	2.0642 1,008,129,756	- -	6.38
4	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	281,072,361	0.9148 257,142,360	1.1425 321,125,172	- -	2.03
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	286,960,118	1.0083 289,367,793	1.1008 315,885,697	- -	2.00
6	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	80,752,036	3.1467 254,110,044	3.8177 308,287,047	- -	1.95
7	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	122,596,617	2.2501 275,861,032	2.4020 294,477,074	- -	1.86
8	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	81,762,709	1.8590 152,000,000	1.8855 154,163,587	- -	0.98

(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7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	88.76
合計	88.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,200,000,000	101.69 2,237,308,000	101.61 2,235,530,000	0.1 2028/3/20	1.04
2	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	101.36 2,108,329,600	0.1 2026/6/20	0.98
3	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,010,000,000	101.79 2,046,005,500	101.47 2,039,727,900	0.1 2026/12/20	0.95
4	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,980,000,000	101.52 2,010,172,000	101.42 2,008,135,800	0.1 2026/9/20	0.93
5	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	101.30 2,005,799,400	0.1 2026/3/20	0.93
6	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	102.70 1,992,418,800	0.5 2024/9/20	0.93
7	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	102.60 1,990,478,800	0.4 2025/6/20	0.93
8	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,910,000,000	101.92 1,946,672,000	101.59 1,940,483,600	0.1 2027/6/20	0.90
9	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	102.58 1,908,043,800	0.6 2023/12/20	0.89
10	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	102.49 1,875,585,300	0.4 2025/3/20	0.87
11	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	102.76 1,818,887,400	0.8 2023/6/20	0.85
12	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,750,000,000	103.02 1,803,005,000	102.73 1,797,897,500	0.4 2025/9/20	0.84
13	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,770,000,000	101.63 1,798,869,000	101.53 1,797,204,900	0.1 2027/3/20	0.84
14	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	101.63 1,788,828,800	0.1 2027/12/20	0.83
15	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	100.35 1,786,265,600	0.1 2021/12/20	0.83

16	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	101.55 1,746,763,200	0.1 2028/9/20	0.81
17	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,680,000,000	101.70 1,708,572,000	101.61 1,707,199,200	0.1 2027/9/20	0.79
18	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,670,000,000	101.41 1,693,674,500	101.38 1,693,162,900	0.1 2029/3/20	0.79
19	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,610,000,000	102.58 1,651,580,000	102.33 1,647,513,000	0.3 2025/12/20	0.77
20	142回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,620,000,000	101.14 1,638,556,200	101.05 1,637,123,400	0.1 2024/12/20	0.76
21	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	101.99 1,621,656,900	0.6 2023/3/20	0.75
22	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,560,000,000	101.61 1,585,116,000	101.58 1,584,772,800	0.1 2028/6/20	0.74
23	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,540,000,000	101.37 1,561,098,000	101.47 1,562,715,000	0.1 2028/12/20	0.73
24	132回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,500,000,000	100.57 1,508,601,000	100.48 1,507,200,000	0.1 2022/6/20	0.70
25	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,450,000,000	100.98 1,464,268,000	100.88 1,462,803,500	0.1 2023/12/20	0.68
26	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,420,000,000	101.39 1,439,820,400	101.29 1,438,346,400	0.1 2029/6/20	0.67
27	131回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,420,000,000	100.52 1,427,412,400	100.41 1,425,907,200	0.1 2022/3/20	0.66
28	141回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,410,000,000	101.08 1,425,298,500	101.03 1,424,649,900	0.1 2024/9/20	0.66
29	140回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	1,390,000,000	101.04 1,404,483,100	100.97 1,403,552,500	0.1 2024/6/20	0.65
30	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	1,330,000,000	103.14 1,371,878,000	102.92 1,368,915,800	0.6 2024/6/20	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7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	80.13
地方債証券	7.82
特殊債証券	7.14
社債証券	4.46
合計	99.54

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,097,900	7,649.68 8,398,589,130	6,217.00 6,825,644,300	- -	3.25
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	766,200	4,907.02 3,759,765,800	6,595.00 5,053,089,000	- -	2.41
3	ソニー 日本	株式 電気機器	616,400	7,605.09 4,687,778,154	8,076.00 4,978,046,400	- -	2.37
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	89,200	37,843.85 3,375,671,686	44,220.00 3,944,424,000	- -	1.88
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,290,800	2,799.22 3,613,233,555	2,443.50 3,154,069,800	- -	1.50
6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	818,700	4,318.95 3,535,927,565	3,756.00 3,075,037,200	- -	1.46
7	任天堂 日本	株式 その他製品	60,300	40,865.11 2,464,166,196	46,440.00 2,800,332,000	- -	1.33
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	6,639,200	553.41 3,674,259,182	393.20 2,610,533,440	- -	1.24
9	第一三共 日本	株式 医薬品	281,600	8,033.06 2,262,109,824	9,258.00 2,607,052,800	- -	1.24
10	ダイキン工業 日本	株式 機械	125,400	15,892.64 1,992,938,071	18,450.00 2,313,630,000	- -	1.10
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	704,000	3,365.43 2,369,269,010	3,259.00 2,294,336,000	- -	1.09



12	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	673,700	4,228.99 2,849,074,280	3,268.00 2,201,651,600	- -	1.05
13	HOYA 日本	株式 精密機器	195,200	10,028.12 1,957,489,652	10,420.00 2,033,984,000	- -	0.97
14	信越化学工業 日本	株式 化学	165,500	13,196.29 2,183,986,166	12,275.00 2,031,512,500	- -	0.97
15	NTTドコモ 日本	株式 情報・通信業	690,500	3,155.15 2,178,637,240	2,907.50 2,007,628,750	- -	0.96
16	日本電産 日本	株式 電気機器	236,900	7,137.36 1,690,842,592	8,375.00 1,984,037,500	- -	0.94
17	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	774,600	2,781.84 2,154,820,173	2,524.00 1,955,090,400	- -	0.93
18	村田製作所 日本	株式 電気機器	289,100	6,443.75 1,862,890,585	6,609.00 1,910,661,900	- -	0.91
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	671,200	3,760.62 2,524,130,129	2,800.00 1,879,360,000	- -	0.89
20	花王 日本	株式 化学	235,600	8,670.53 2,042,777,553	7,636.00 1,799,041,600	- -	0.86
21	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	62,400	23,881.16 1,490,184,532	28,800.00 1,797,120,000	- -	0.86
22	SMC 日本	株式 機械	30,800	50,129.01 1,543,973,642	55,070.00 1,696,156,000	- -	0.81
23	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	13,186,500	158.35 2,088,187,078	127.60 1,682,597,400	- -	0.80
24	ファナック 日本	株式 電気機器	92,500	19,914.26 1,842,069,746	17,705.00 1,637,712,500	- -	0.78
25	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	677,900	2,606.54 1,766,975,906	2,300.00 1,559,170,000	- -	0.74
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	343,200	6,014.09 2,064,037,219	4,436.00 1,522,435,200	- -	0.72
27	日立製作所 日本	株式 電気機器	472,800	4,074.41 1,926,384,141	3,128.00 1,478,918,400	- -	0.70
28	中外製薬 日本	株式 医薬品	307,800	4,128.76 1,270,833,911	4,736.00 1,457,740,800	- -	0.69
29	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	853,100	1,935.01 1,650,765,076	1,650.00 1,407,615,000	- -	0.67
30	三菱電機 日本	株式 電気機器	983,800	1,578.63 1,553,058,091	1,370.50 1,348,297,900	- -	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7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	98.22
合計	98.22

（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7月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
電気機器	国内	15.48
情報・通信業		10.62
化学		7.12
輸送用機器		6.91
医薬品		6.72
機械		5.28
サービス業		5.16
小売業		4.98
銀行業		4.74
卸売業		4.42
食料品		3.81
陸運業		3.48
精密機器		2.61
その他製品		2.47
建設業		2.44
不動産業		1.85
保険業		1.82
電気・ガス業		1.44
その他金融業		1.07
証券、商品先物取引業		0.81
ガラス・土石製品		0.73
非鉄金属		0.68
ゴム製品		0.54
金属製品		0.53
鉄鋼		0.53
繊維製品		0.47
石油・石炭製品		0.41
空運業		0.31
パルプ・紙		0.22
倉庫・運輸関連業		0.18
鉱業		0.17
海運業		0.13
水産・農林業		0.09
合計	98.22	

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証 券	2,184,048,000	101.67 2,220,647,861	101.60 2,219,026,882	1.5 2021/9/30	0.58
2	US T N/B 1.75 05/15/23 アメリカ	国債証 券	2,092,000,000	104.45 2,185,159,375	104.52 2,186,630,302	1.75 2023/5/15	0.57
3	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	2,092,000,000	103.39 2,163,013,588	103.42 2,163,667,338	1.625 2022/11/15	0.56
4	FRANCE OAT 3.0 04/25/22 フランス	国債証 券	1,629,826,900	106.65 1,738,366,852	106.35 1,733,356,764	3 2022/4/25	0.45
5	FRANCE OAT 0.5 05/25/26 フランス	国債証 券	1,591,346,600	105.54 1,679,532,663	106.12 1,688,738,603	0.5 2026/5/25	0.44
6	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証 券	1,521,930,000	107.99 1,643,561,625	109.13 1,660,925,003	1.5 2030/2/15	0.43
7	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	1,391,180,000	117.71 1,637,571,013	118.64 1,650,613,325	2.875 2028/5/15	0.43
8	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証 券	1,476,952,000	108.63 1,604,454,489	108.80 1,606,993,000	2.375 2024/8/15	0.42
9	FRANCE OAT 4.25 10/25/23 フランス	国債証 券	1,364,188,700	116.33 1,587,076,670	116.01 1,582,638,964	4.25 2023/10/25	0.41
10	US T N/B 1.625 05/15/26 アメリカ	国債証 券	1,467,538,000	106.92 1,569,233,787	107.56 1,578,520,561	1.625 2026/5/15	0.41
11	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	1,448,710,000	108.50 1,571,963,523	108.72 1,575,132,575	2.25 2024/11/15	0.41
12	US T N/B 2.5 01/15/22 アメリカ	国債証 券	1,497,872,000	103.58 1,551,526,238	103.41 1,548,951,770	2.5 2022/1/15	0.40
13	US T N/B 1.75 11/15/29 アメリカ	国債証 券	1,384,904,000	110.00 1,523,502,586	111.33 1,541,895,841	1.75 2029/11/15	0.40
14	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	1,394,318,000	108.46 1,512,290,366	108.53 1,513,379,678	2.75 2023/11/15	0.39
15	US T N/B 0.375 03/31/22 アメリカ	国債証 券	1,492,642,000	100.33 1,497,656,232	100.41 1,498,851,539	0.375 2022/3/31	0.39
16	US T N/B 2.25 08/15/49 アメリカ	国債証 券	1,185,118,000	119.92 1,421,282,183	126.12 1,494,730,077	2.25 2049/8/15	0.39
17	US T N/B 3.0 02/15/49 アメリカ	国債証 券	1,028,218,000	137.84 1,417,395,537	144.38 1,484,570,060	3 2049/2/15	0.39
18	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	1,412,100,000	104.82 1,480,167,625	104.82 1,480,167,625	2.125 2022/12/31	0.38
19	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	1,356,662,000	108.66 1,474,204,036	108.82 1,476,323,820	2.5 2024/5/15	0.38
20	ITALY BTPS 2.8 12/01/28 イタリア	国債証 券	1,254,954,300	112.91 1,416,971,410	115.97 1,455,396,855	2.8 2028/12/1	0.38
21	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	774,571,200	183.25 1,419,401,724	187.25 1,450,455,832	4.5 2041/4/25	0.38
22	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証 券	1,344,110,000	106.82 1,435,782,494	107.34 1,442,818,077	1.625 2026/2/15	0.37

23	US T N/B 2.25 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,261,476,000	112.30 1,416,696,672	113.20 1,428,030,252	2.25 2027/11/15	0.37
24	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	1,154,409,000	122.99 1,419,916,292	123.60 1,426,888,773	2.75 2027/10/25	0.37
25	US T N/B 2.875 10/15/21 アメリカ	国債証券	1,370,260,000	103.50 1,418,272,621	103.27 1,415,168,119	2.875 2021/10/15	0.37
26	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	923,527,200	151.24 1,396,832,119	152.10 1,404,696,877	5.5 2029/4/25	0.36
27	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,247,878,000	109.07 1,361,161,923	109.11 1,361,649,369	2.75 2024/2/15	0.35
28	US T N/B 1.625 04/30/23 アメリカ	国債証券	1,307,500,000	104.00 1,359,891,525	104.10 1,361,230,077	1.625 2023/4/30	0.35
29	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,203,946,000	110.10 1,325,599,942	110.39 1,329,137,564	2.25 2025/11/15	0.35
30	ITALY BTPS 5.0 03/01/25 イタリア	国債証券	1,086,137,500	119.83 1,301,522,693	120.90 1,313,194,544	5 2025/3/1	0.34

(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7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	99.38
合計	99.38

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	365,047	33,308.57 12,159,197,124	40,245.89 14,691,643,597	- -	4.07
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	602,715	19,137.14 11,534,245,629	21,327.93 12,854,669,357	- -	3.56
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	35,300	222,974.88 7,871,013,577	319,226.64 11,268,700,674	- -	3.12

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	200,842	21,914.80 4,401,413,824	24,528.69 4,926,393,165	- -	1.37
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	25,555	155,421.76 3,971,803,183	160,189.66 4,093,647,016	- -	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	25,023	154,960.53 3,877,577,350	160,913.50 4,026,538,560	- -	1.12
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	219,890	15,536.66 3,416,357,100	15,359.46 3,377,392,538	- -	0.94
8	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	248,407	12,299.59 3,055,306,215	12,655.08 3,143,612,842	- -	0.87
9	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	142,391	21,492.25 3,060,303,947	20,298.67 2,890,348,774	- -	0.80
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	205,989	13,064.38 2,691,119,194	13,746.53 2,831,634,380	- -	0.79
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	256,480	13,863.76 3,555,779,287	10,148.29 2,602,833,932	- -	0.72
12	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	91,083	25,102.36 2,286,399,012	27,856.02 2,537,210,416	- -	0.70
13	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	79,271	30,694.76 2,433,204,985	31,927.05 2,530,889,814	- -	0.70
14	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	74,706	34,687.99 2,591,401,460	32,321.39 2,414,602,508	- -	0.67
15	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	115,682	23,013.65 2,662,265,576	20,323.77 2,351,095,517	- -	0.65

16	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	51,124	30,521.21 1,560,366,484	44,408.97 2,270,364,489	- -	0.63
17	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	58,663	38,852.94 2,279,230,050	37,008.53 2,171,031,894	- -	0.60
18	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	345,153	6,081.73 2,099,130,000	5,993.57 2,068,702,117	- -	0.57
19	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	12,321	81,600.23 1,005,396,456	155,591.45 1,917,042,304	- -	0.53
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	93,015	12,668.83 1,178,391,966	20,136.54 1,873,000,826	- -	0.52
21	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	462,143	3,790.44 1,751,729,357	4,052.20 1,872,697,713	- -	0.52
22	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	36,626	39,874.00 1,460,425,368	50,814.67 1,861,138,469	- -	0.52
23	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	600,323	3,906.43 2,345,123,022	3,093.02 1,856,812,246	- -	0.51
24	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	40,249	39,086.87 1,573,207,509	45,906.84 1,847,704,725	- -	0.51
25	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	150,803	14,132.23 2,131,183,483	12,098.03 1,824,420,122	- -	0.51
26	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	358,015	6,919.97 2,477,454,084	5,019.75 1,797,147,228	- -	0.50
27	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	211,914	8,592.57 1,820,887,251	8,262.35 1,750,908,485	- -	0.49
28	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	379,157	4,704.59 1,783,781,609	4,567.88 1,731,944,435	- -	0.48
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	354,318	4,844.88 1,716,630,342	4,857.62 1,721,143,620	- -	0.48
30	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	655,488	3,500.54 2,294,564,049	2,598.26 1,703,130,872	- -	0.47

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.35
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.19
投資証券	2.21
合計	97.76

（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7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	7.18
医薬品		5.45
銀行		5.17
情報技術サービス		4.71
コンピュータ・周辺機器		4.31
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.92
インターネット販売・通信販売		3.83
半導体・半導体製造装置		3.78
ヘルスケア機器・用品		3.18
保険		3.08
石油・ガス・消耗燃料		2.98
資本市場		2.95
化学		2.20
バイオテクノロジー		2.16
電力		2.08
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.03
食品		1.99
飲料		1.81
各種電気通信サービス		1.78
専門小売り		1.73
機械		1.60
金属・鉱業		1.57
食品・生活必需品小売り		1.51
家庭用品		1.48
娯楽		1.46
航空宇宙・防衛		1.45
ホテル・レストラン・レジャー		1.40
繊維・アパレル・贅沢品		1.31
メディア		1.11
コングロマリット		1.09
自動車		1.06
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.03
陸運・鉄道		1.03
総合公益事業		1.01
各種金融サービス		0.87
専門サービス		0.76
通信機器		0.75

電気設備	0.75
タバコ	0.75
パーソナル用品	0.72
航空貨物・物流サービス	0.60
建設関連製品	0.53
電子装置・機器・部品	0.52
複合小売り	0.48
不動産管理・開発	0.44
商業サービス・用品	0.43
家庭用耐久財	0.36
消費者金融	0.32
無線通信サービス	0.29
商社・流通業	0.29
建設・土木	0.26
容器・包装	0.25
建設資材	0.25
自動車部品	0.22
ヘルスケア・テクノロジー	0.17
ガス	0.17
運送インフラ	0.15
エネルギー設備・サービス	0.13
水道	0.13
紙製品・林産品	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
海運業	0.06
販売	0.05
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.02
合計	95.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	4,837	672,192.76 3,251,396,413	592,000.00 2,863,504,000	- -	6.47
2	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	7,557	294,792.34 2,227,745,722	364,500.00 2,754,526,500	- -	6.23
3	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	4,994	589,834.37 2,945,632,881	540,000.00 2,696,760,000	- -	6.10
4	GLP投資法人 日本	投資証券	14,361	145,798.60 2,093,813,827	175,700.00 2,523,227,700	- -	5.70
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	16,151	145,379.28 2,348,020,813	130,800.00 2,112,550,800	- -	4.78
6	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	7,126	264,998.60 1,888,380,076	274,700.00 1,957,512,200	- -	4.43



7	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	4,744	315,939.05 1,498,814,900	341,000.00 1,617,704,000	- -	3.66
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	9,951	166,665.07 1,658,484,127	135,900.00 1,352,340,900	- -	3.06
9	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	6,440	162,857.05 1,048,799,433	197,400.00 1,271,256,000	- -	2.87
10	日本リテールファンド投資法人 日本	投資証券	9,439	159,682.37 1,507,241,924	126,900.00 1,197,809,100	- -	2.71
11	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	1,660	625,627.87 1,038,542,265	681,000.00 1,130,460,000	- -	2.56
12	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	10,681	129,499.32 1,383,182,303	102,900.00 1,099,074,900	- -	2.48
13	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	3,263	276,183.11 901,185,507	317,000.00 1,034,371,000	- -	2.34
14	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	14,690	72,143.41 1,059,786,792	69,100.00 1,015,079,000	- -	2.29
15	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	4,669	158,606.85 740,535,416	192,700.00 899,716,300	- -	2.03
16	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	1,545	627,336.33 969,234,631	578,000.00 893,010,000	- -	2.02
17	アクティブピア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	2,503	409,176.06 1,024,167,699	348,500.00 872,295,500	- -	1.97
18	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	3,110	360,615.30 1,121,513,608	278,300.00 865,513,000	- -	1.96
19	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	1,431	452,712.96 647,832,258	577,000.00 825,687,000	- -	1.87
20	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	5,746	145,195.07 834,290,876	137,100.00 787,776,600	- -	1.78
21	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	2,179	310,692.25 676,998,425	331,000.00 721,249,000	- -	1.63
22	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	6,301	95,689.97 602,942,504	107,000.00 674,207,000	- -	1.52
23	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	3,258	179,564.16 585,020,041	193,300.00 629,771,400	- -	1.42
24	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	16,089	51,296.95 825,316,768	38,150.00 613,795,350	- -	1.39
25	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,064	634,573.50 675,186,211	553,000.00 588,392,000	- -	1.33

26	プレミア投資法人 日本	投資証券	4,511	122,504.62 552,618,374	118,700.00 535,455,700	- -	1.21
27	イオンリート投資法人 日本	投資証券	5,066	119,976.61 607,801,534	104,000.00 526,864,000	- -	1.19
28	日本リート投資法人 日本	投資証券	1,622	384,945.73 624,381,980	319,500.00 518,229,000	- -	1.17
29	ジャパンエクセレント投資 法人 日本	投資証券	4,634	139,050.51 644,360,085	111,800.00 518,081,200	- -	1.17
30	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	20,884	32,001.98 668,329,401	24,200.00 505,392,800	- -	1.14

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	97.83
合計	97.83

（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7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	236,390	9,657.07 2,282,837,021	11,002.87 2,600,969,384	- -	6.89
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	28,332	74,502.51 2,110,805,173	81,373.56 2,305,475,985	- -	6.11
3	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	85,902	14,721.74 1,264,627,655	16,603.15 1,426,244,478	- -	3.78
4	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	48,140	19,972.46 961,474,394	20,680.46 995,557,633	- -	2.64
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	133,735	5,338.59 713,957,187	5,702.79 762,662,888	- -	2.02
6	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	40,426	17,352.87 701,507,373	18,423.19 744,776,202	- -	1.97
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	45,085	16,210.78 730,863,410	15,815.51 713,042,719	- -	1.89
8	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	110,022	6,409.43 705,178,387	6,333.52 696,827,637	- -	1.85
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	518,382	1,152.76 597,574,938	1,282.04 664,588,377	- -	1.76
10	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	97,591	6,997.55 682,898,840	6,654.65 649,434,143	- -	1.72

11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証 券	111,902	6,212.56 695,198,875	5,643.16 631,482,009	- -	1.67
12	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証 券	174,020	2,912.63 506,856,066	3,119.17 542,798,311	- -	1.44
13	LINK REIT 香港	投資証 券	658,520	883.17 581,590,648	814.05 536,068,206	- -	1.42
14	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	172,279	2,764.89 476,332,651	2,905.78 500,606,250	- -	1.33
15	SEGRO PLC イギリス	投資証 券	381,758	1,216.31 464,339,862	1,305.69 498,457,739	- -	1.32
16	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証 券	117,911	3,729.38 439,735,614	4,180.86 492,969,619	- -	1.31
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証 券	31,453	14,861.30 467,432,558	15,448.37 485,897,707	- -	1.29
18	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証 券	20,938	24,377.44 510,414,850	23,076.85 483,183,127	- -	1.28
19	VENTAS INC アメリカ	投資証 券	119,420	3,748.49 447,644,966	4,030.23 481,291,021	- -	1.28
20	MID AMERICA アメリカ	投資証 券	36,607	11,980.83 438,582,377	12,292.59 449,994,915	- -	1.19
21	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	41,327	9,755.24 403,155,146	10,617.94 438,807,854	- -	1.16
22	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	46,254	9,489.11 438,909,452	9,233.04 427,065,124	- -	1.13
23	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証 券	58,318	6,723.37 392,093,682	7,064.68 411,998,241	- -	1.09
24	WP CAREY INC アメリカ	投資証 券	55,204	7,195.73 397,233,461	7,377.43 407,264,087	- -	1.08
25	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証 券	169,480	2,008.23 340,354,944	2,152.66 364,834,172	- -	0.97
26	UDR INC アメリカ	投資証 券	94,603	3,940.42 372,776,262	3,776.05 357,226,604	- -	0.95
27	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証 券	150,352	2,329.47 350,241,871	2,265.63 340,642,903	- -	0.90
28	CYRUSONE INC アメリカ	投資証 券	36,969	8,021.82 296,559,001	8,699.58 321,614,846	- -	0.85
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証 券	30,868	9,750.16 300,967,981	9,724.66 300,180,866	- -	0.80
30	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証 券	91,281	2,749.92 251,015,549	2,954.94 269,730,790	- -	0.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.85
投資証券	88.86
合計	99.71

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	2,405,800,000	125.38 3,016,432,624	136.02 3,272,585,682	5.25 2047/6/23	2.84
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	1,569,000,000	119.40 1,873,486,416	124.65 1,955,786,742	5.1 2035/3/28	1.70
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44 メキシコ	国債証券	1,610,840,000	96.46 1,553,902,454	112.37 1,810,253,937	4.75 2044/3/8	1.57
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,464,400,000	103.40 1,514,241,900	122.32 1,791,393,198	5 2045/6/15	1.55
5	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,046,000,000	146.39 1,531,239,400	169.92 1,777,462,570	5.625 2050/11/18	1.54
6	INDONESIA 6.75 01/15/44 インドネシア	国債証券	993,700,000	137.23 1,363,739,759	154.49 1,535,258,490	6.75 2044/1/15	1.33
7	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,297,040,000	112.09 1,453,857,052	116.18 1,506,907,557	6 2024/1/26	1.31
8	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,297,040,000	111.52 1,446,557,332	114.66 1,487,218,490	4.375 2029/3/21	1.29
9	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,297,040,000	109.52 1,420,644,774	111.17 1,442,016,646	4.875 2023/9/16	1.25
10	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,046,000,000	127.73 1,336,129,020	136.10 1,423,680,266	5.625 2042/4/4	1.23
11	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,255,200,000	103.10 1,294,112,246	112.08 1,406,922,300	4.5 2029/4/22	1.22
12	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,192,440,000	110.74 1,320,560,983	115.62 1,378,712,244	4.75 2026/5/27	1.20
13	BRAZIL 4.25 01/07/25 ブラジル	国債証券	1,265,660,000	104.67 1,324,824,375	107.50 1,360,679,424	4.25 2025/1/7	1.18
14	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,035,540,000	113.16 1,171,890,388	128.92 1,335,116,544	6.05 2040/1/11	1.16
15	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	1,129,680,000	112.18 1,267,291,760	117.13 1,323,278,910	6 2026/4/7	1.15
16	HUNGARY 5.375 02/21/23 ハンガリー	国債証券	1,188,046,800	108.74 1,291,893,500	110.75 1,315,880,635	5.375 2023/2/21	1.14
17	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	732,200,000	163.75 1,199,030,636	174.58 1,278,277,688	7.625 2041/3/29	1.11

18	COLOMBIA 7.375 09/18/37 コロンビア	国債証券	878,640,000	127.71 1,122,148,800	145.25 1,276,224,600	7.375 2037/9/18	1.11
19	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	941,400,000	117.33 1,104,576,000	133.15 1,253,474,100	6.125 2041/1/18	1.09
20	BRAZIL 5.625 02/21/47 ブラジル	国債証券	1,108,760,000	102.61 1,137,734,200	113.02 1,253,225,884	5.625 2047/2/21	1.09
21	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	826,340,000	127.00 1,049,485,272	151.10 1,248,599,740	6.7 2036/1/26	1.08
22	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,129,680,000	104.14 1,176,475,948	108.81 1,229,312,127	4.625 2028/1/13	1.07
23	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	983,240,000	109.31 1,074,789,476	125.00 1,229,050,000	5.55 2045/1/21	1.07
24	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,087,840,000	108.57 1,181,112,656	112.78 1,226,955,154	4.25 2027/6/23	1.06
25	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,025,080,000	98.48 1,009,599,200	119.40 1,223,991,648	5.75 2110/10/12	1.06
26	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	1,087,840,000	108.54 1,180,795,091	111.48 1,212,826,288	5.5 2023/4/4	1.05
27	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	711,280,000	159.68 1,135,817,386	168.39 1,197,752,025	9.5 2030/2/2	1.04
28	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,087,840,000	101.43 1,103,425,400	110.08 1,197,575,860	4.15 2027/3/28	1.04
29	RUSSIAN FEDERATION 03/31/30 ロシア	国債証券	1,030,623,800	113.01 1,164,811,018	115.90 1,194,513,596	7.5 2030/3/31	1.04
30	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34 メキシコ	国債証券	857,720,000	124.40 1,067,060,164	135.88 1,165,469,936	6.75 2034/9/27	1.01

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.35
合計	97.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
----	-----------------	----------	----	---------------------	---------------------	------------------	-----------------

1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	101,997	22,004.69 2,244,412,410	26,436.60 2,696,454,298	- -	6.55
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	311,700	5,712.33 1,780,533,986	7,222.50 2,251,253,250	- -	5.47
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,336,083	1,093.72 1,461,313,753	1,545.03 2,064,301,678	- -	5.01
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	259,953	4,519.04 1,174,739,244	5,192.00 1,349,675,976	- -	3.28
5	MEITUAN DIANPING ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	193,800	1,853.46 359,201,848	2,632.50 510,178,500	- -	1.24
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	24,174	17,972.83 434,475,202	19,507.87 471,583,370	- -	1.15
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	155,439	1,716.28 266,777,150	2,973.47 462,194,524	- -	1.12
8	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,180,530	83.60 433,107,753	77.89 403,537,384	- -	0.98
9	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	318,500	1,068.28 340,248,678	1,115.77 355,374,337	- -	0.86
10	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	46,345	5,336.31 247,311,715	6,515.53 301,962,423	- -	0.73
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	186,657	922.03 172,104,513	1,355.64 253,040,535	- -	0.61

12	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	200,921	967.65 194,421,273	1,242.55 249,655,513	- -	0.61
13	CHINA MOBILE LIMITED 香港	株式 無線通信サービス	335,500	786.10 263,739,827	716.85 240,503,175	- -	0.58
14	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	90,553	2,400.34 217,358,787	2,553.01 231,183,303	- -	0.56
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	29,991	7,399.27 221,911,702	7,506.39 225,124,442	- -	0.55
16	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	4,496	39,112.17 175,848,317	47,197.61 212,200,463	- -	0.52
17	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,236,235	69.17 223,859,139	62.77 203,154,652	- -	0.49
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	82,507	1,496.72 123,490,540	2,431.47 200,614,120	- -	0.49
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	43,916	3,902.45 171,380,346	4,452.79 195,549,164	- -	0.48
20	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	681,225	274.87 187,251,895	277.68 189,162,558	- -	0.46
21	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	15,168	11,354.66 172,227,540	12,342.79 187,215,590	- -	0.45
22	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	150,108	1,137.16 170,697,925	1,232.71 185,039,782	- -	0.45
23	NAVER CORP 韓国	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	6,822	18,004.21 122,824,772	25,872.00 176,498,784	- -	0.43

24	TAL EDUCATION GROUP-ADR ケイマン諸島	株式 各種消費者サービス	21,099	5,774.46 121,835,347	8,158.79 172,142,521	- -	0.42
25	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	23,117	7,101.64 164,168,794	7,215.30 166,796,275	- -	0.41
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	324,951	544.92 177,073,237	511.91 166,346,445	- -	0.40
27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	49,238	2,629.43 129,468,117	3,214.09 158,255,609	- -	0.38
28	ITAU UNIBANCO HOLDING SA ブラジル	株式 銀行	269,347	480.29 129,364,956	563.98 151,908,152	- -	0.37
29	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO ブラジル	株式 資本市場	114,016	891.05 101,594,416	1,310.29 149,394,115	- -	0.36
30	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	4,188,200	39.73 166,435,638	35.37 148,136,634	- -	0.36

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。



## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	86.35
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.49
投資証券	0.08
合計	86.92

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

令和2年7月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
銀行	外国	10.48
インターネット販売・通信販売		10.42
半導体・半導体製造装置		7.09
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.90
石油・ガス・消耗燃料		4.95
コンピュータ・周辺機器		4.78
金属・鉱業		3.01
保険		2.82
電子装置・機器・部品		2.08
不動産管理・開発		2.04
無線通信サービス		1.97
化学		1.94
食品		1.77
自動車		1.52
情報技術サービス		1.47
医薬品		1.36
食品・生活必需品小売り		1.25
資本市場		1.20
娯楽		1.12
各種電気通信サービス		1.11
飲料		1.01
各種消費者サービス		0.88
コングロマリット		0.87
建設資材		0.83
電力		0.67
バイオテクノロジー		0.63
繊維・アパレル・贅沢品		0.63
パーソナル用品		0.59
貯蓄・抵当・不動産金融		0.58
ホテル・レストラン・レジャー		0.58
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.56
運送インフラ		0.54
建設・土木		0.53
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		0.51
ガス		0.50
機械		0.49
専門小売り		0.48

各種金融サービス	0.48
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.46
家庭用品	0.46
複合小売り	0.44
ヘルスケア機器・用品	0.40
電気設備	0.38
自動車部品	0.36
ソフトウェア	0.34
家庭用耐久財	0.29
タバコ	0.27
航空貨物・物流サービス	0.26
商業サービス・用品	0.24
ヘルスケア・テクノロジー	0.24
陸運・鉄道	0.22
通信機器	0.18
水道	0.17
紙製品・林産品	0.16
消費者金融	0.15
メディア	0.14
航空宇宙・防衛	0.12
旅客航空輸送業	0.11
レジャー用品	0.08
海運業	0.07
エネルギー設備・サービス	0.07
総合公益事業	0.04
商社・流通業	0.04
専門サービス	0.03
建設関連製品	0.02
容器・包装	0.01
合計	86.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0209月	買建	252	3,940,868,160	3,771,180,000	1.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep20	買建	349	5,701,499,144	5,929,845,912	1.64
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep20	買建	337	1,355,228,375	1,335,271,375	0.37
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep20	買建	47	395,656,697	383,191,855	0.11
	モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep20	買建	18	262,324,917	273,274,689	0.08
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Sep20	買建	17	190,422,305	192,641,951	0.05

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

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

## J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	T R E I T 先物 0 2 0 9月	買建	524	905,058,040	866,434,000	1.96

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

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

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep20	買建	963	5,144,703,930	5,424,299,730	13.18

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

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

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

直近日（令和2年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成28年1月12日)	10	10	0.9890	0.9890
第2計算期間末 (平成29年1月11日)	464	464	1.0361	1.0361
第3計算期間末 (平成30年1月11日)	3,804	3,804	1.0584	1.0584
第4計算期間末 (平成31年1月11日)	6,536	6,536	1.0394	1.0394
第5計算期間末 (令和2年1月14日)	12,208	12,208	1.1162	1.1162
令和1年7月末日	8,783	-	1.0933	-
8月末日	9,761	-	1.1123	-
9月末日	10,121	-	1.1126	-
10月末日	11,078	-	1.1088	-
11月末日	11,580	-	1.1121	-
12月末日	11,962	-	1.1121	-
令和2年1月末日	12,572	-	1.1227	-
2月末日	12,807	-	1.1189	-
3月末日	13,451	-	1.1185	-
4月末日	13,896	-	1.1217	-
5月末日	14,480	-	1.1272	-
6月末日	15,141	-	1.1328	-
7月末日	15,800	-	1.1405	-

## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
令和2年1月15日～令和2年7月14日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.1
第2計算期間	4.8
第3計算期間	2.2
第4計算期間	1.8
第5計算期間	7.4
令和2年1月15日～令和2年7月14日	1.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,458,049	0
第2計算期間	512,026,994	74,168,910
第3計算期間	3,462,195,098	315,640,002
第4計算期間	3,385,111,677	691,533,111
第5計算期間	5,623,631,913	974,358,433
令和2年1月15日～ 令和2年7月14日	3,872,265,868	1,278,240,398

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## &lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2020年7月31日

## 基準価額・純資産の推移 (2015年10月30日~2020年7月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2015年10月30日)

## 分配の推移(税引前)

2016年1月	0円
2017年1月	0円
2018年1月	0円
2019年1月	0円
2020年1月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

## 主要な資産の状況

## ■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	62.80
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.75
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.38
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.03
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.00
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.95
7	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	1.86
8	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	0.98

## ■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	1.04
2	343回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/6/20	0.98
3	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.95
4	344回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/9/20	0.93
5	342回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/3/20	0.93

## ■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	3.25
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.41
3	ソニー	株式	日本	電気機器	2.37
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.88
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.50

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2020年7月31日

## ■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	アメリカ	1.5	2021/9/30	0.58
2	US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	アメリカ	1.75	2023/5/15	0.57
3	US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	アメリカ	1.625	2022/11/15	0.56
4	FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	フランス	3	2022/4/25	0.45
5	FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	フランス	0.5	2026/5/25	0.44

## ■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.07
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.56
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	3.12
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	1.37
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

## ■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.47
2	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	6.23
3	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	6.10
4	GLP投資法人	投資証券	日本	5.70
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.78

## ■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	6.89
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	6.11
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	3.78
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.64
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.02

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。



データの基準日:2020年7月31日

## ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.84
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.70
3	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	国債証券	メキシコ	4.75	2044/3/8	1.57
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.55
5	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625	2050/11/18	1.54

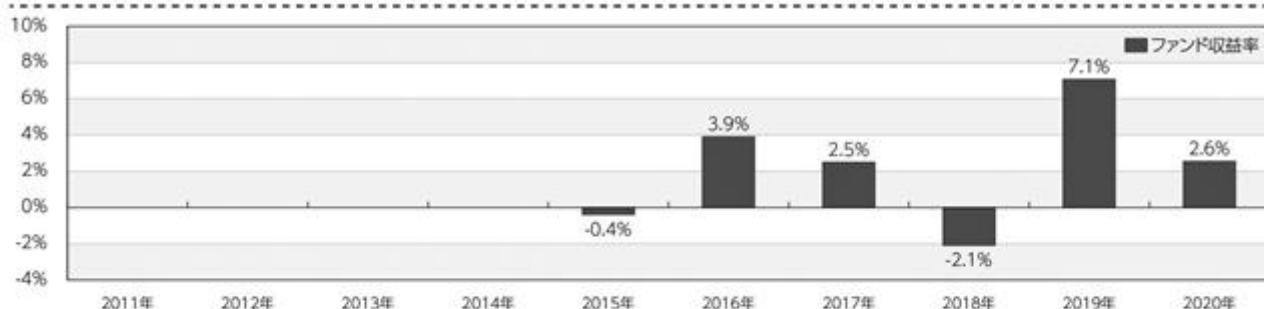
## ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	6.55
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.47
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	5.01
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.28
5	MEITUAN DIANPING	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.24

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および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。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

### < 基準価額の照会方法等 >

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

#### ・ お申込単位

1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)

収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

#### ・ お申込手数料

ありません。

#### ・ 払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

なお、受益者が解約の請求をするときは、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とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・解約単位

1口単位とします。

- ・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 <ul style="list-style-type: none"> <li>・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）</li> <li>・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。）</li> <li>・価格情報会社の提供する価額</li> </ul>
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2015年10月30日(設定日)から原則として無期限です。

下記(5)その他イ.償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

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

- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ．信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとし、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### ロ．信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- b. 委託会社は、上記a. の事項（上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 八. 関係法人との契約の更改

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

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

#### 二. 公告

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

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

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

#### ホ. 運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

#### 4【受益者の権利等】

##### (1) 収益分配金請求権

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

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

##### (2) 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

受益者が信託終了による償還金について支払開始日から10年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、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、委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。)に、原則として償還日(休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

##### (3) 一部解約請求権

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

##### (4) 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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



### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(平成31年1月12日から令和2年1月14日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 平成31年1月11日現在	第5期 令和2年1月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	999,116,841	1,303,453,107
親投資信託受益証券	5,461,668,331	10,986,755,988
派生商品評価勘定	40,964,866	18,040,807
未収入金	84,000,000	-
流動資産合計	6,585,750,038	12,308,249,902
資産合計	6,585,750,038	12,308,249,902
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	27,884,074	53,956,273
未払解約金	2,210,721	10,608,581
未払受託者報酬	967,757	1,765,409
未払委託者報酬	18,065,763	32,955,141
その他未払費用	125,113	222,972
流動負債合計	49,253,428	99,508,376
負債合計	49,253,428	99,508,376
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,288,449,795	10,937,723,275
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	248,046,815	1,271,018,251
（分配準備積立金）	124,089,428	524,192,584
元本等合計	6,536,496,610	12,208,741,526
純資産合計	6,536,496,610	12,208,741,526
負債純資産合計	6,585,750,038	12,308,249,902

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	平成30年1月12日 平成31年1月11日	自	平成31年1月12日 令和2年1月14日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		62,763,368		702,587,657
為替差損益		22,057,226		54,595,196
営業収益合計		40,706,142		647,992,461
<b>営業費用</b>				
支払利息		312,667		524,001
受託者報酬		1,685,161		2,953,712
委託者報酬		31,458,197		55,137,491
その他費用		220,782		373,404
営業費用合計		33,676,807		58,988,608
営業利益又は営業損失（ ）		74,382,949		589,003,853
経常利益又は経常損失（ ）		74,382,949		589,003,853
当期純利益又は当期純損失（ ）		74,382,949		589,003,853
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（ ）		8,057,245		39,321,072
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		209,910,280		248,046,815
剰余金増加額又は欠損金減少額		141,834,972		524,003,487
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		141,834,972		524,003,487
剰余金減少額又は欠損金増加額		37,372,733		50,714,832
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		37,372,733		50,714,832
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		248,046,815		1,271,018,251

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期	
	自 平成31年1月12日	至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、当計算期間末日を令和2年1月14日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	平成31年1月11日現在	令和2年1月14日現在
1. 期首元本額	3,594,871,229円	6,288,449,795円
期中追加設定元本額	3,385,111,677円	5,623,631,913円
期中一部解約元本額	691,533,111円	974,358,433円
2. 受益権の総数	6,288,449,795口	10,937,723,275口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(86,381,038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(123,957,387円)及び分配準備積立金(37,708,390円)より分配対象収益は248,046,815円(1万口当たり394.45円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(180,685,680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(232,977,140円)、信託約款に規定される収益調整金(746,825,667円)及び分配準備積立金(110,529,764円)より分配対象収益は1,271,018,251円(1万口当たり1,162.05円)ですが、分配を行っておりません。

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期	第5期
	自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 平成31年1月11日現在	第5期 令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第4期 平成31年1月11日現在	第5期 令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	28,083,656	276,864,827
合計	28,083,656	276,864,827

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第4期			
	平成31年1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	1,752,659,639	-	1,712,432,320	40,227,319
アメリカ・ドル	146,798,982	-	144,584,280	2,214,702
イギリス・ポンド	706,817,669	-	687,151,790	19,665,879
オーストラリア・ドル	174,385,310	-	170,583,500	3,801,810
カナダ・ドル	229,545,915	-	224,321,400	5,224,515
ユーロ	495,111,763	-	485,791,350	9,320,413
買 建	825,682,917	-	798,536,390	27,146,527
アメリカ・ドル	48,943,444	-	47,006,100	1,937,344
イギリス・ポンド	374,582,860	-	360,758,140	13,824,720
オーストラリア・ドル	41,582,833	-	40,352,250	1,230,583
カナダ・ドル	97,234,333	-	93,978,000	3,256,333
ユーロ	263,339,447	-	256,441,900	6,897,547
合計	2,578,342,556	-	2,510,968,710	13,080,792

種類	第5期			
	令和2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	2,447,580,253	-	2,501,535,630	53,955,377
アメリカ・ドル	299,235,003	-	304,752,700	5,517,697
イギリス・ポンド	646,179,792	-	656,324,100	10,144,308
オーストラリア・ドル	369,946,303	-	381,876,600	11,930,297
カナダ・ドル	366,613,659	-	377,592,150	10,978,491
ユーロ	765,605,496	-	780,990,080	15,384,584
買建	1,223,733,949	-	1,241,773,860	18,039,911
アメリカ・ドル	242,362,593	-	244,747,300	2,384,707
オーストラリア・ドル	196,739,205	-	201,039,650	4,300,445
カナダ・ドル	252,233,719	-	257,368,830	5,135,111
ユーロ	532,398,432	-	538,618,080	6,219,648
合計	3,671,314,202	-	3,743,309,490	35,915,466

(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)

	第4期 平成31年1月11日現在	第5期 令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0394円 (10,394円)	1.1162円 (11,162円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。



## (2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	405,673,887	1,117,753,260	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	598,062,219	785,793,949	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	102,228,276	242,761,487	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	61,454,097	252,287,504	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	221,005,042	309,672,264	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	4,312,627,675	6,046,735,263	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	492,518,284	631,851,706	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	764,113,361	1,599,900,555	
親投資信託受益証券 合計		6,957,682,841	10,986,755,988	
合計			10,986,755,988	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

#### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

##### 貸借対照表

（単位：円）

令和2年1月14日現在

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

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	235,499,717,802円
同期中追加設定元本額	122,293,547,955円
同期中一部解約元本額	186,869,780,982円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	21,001,536,888円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	71,157,976円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	68,506,951円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	19,042,033円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	985,360,087円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	253,839,832円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,875,383円
たわらノーロード 国内債券	9,656,870,485円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	583,915,819円
たわらノーロード バランス(堅実型)	175,042,417円
たわらノーロード バランス(標準型)	291,408,163円
たわらノーロード バランス(積極型)	36,976,397円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	13,435,371円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	420,157,231円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	425,902,786円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	109,049,333円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	24,663,912円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	5,458,523円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,353,318円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,438,123円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,409,866円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	221,133円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,009,672,579円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	6,845,985,408円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	9,411,035,879円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,756,253,312円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,826,757,940円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,022,079,346円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	313,662,654円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	85,252,670円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,373,109,117円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,459,038円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,511,003,330円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	990,847,613円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	206,249,963円
投資のソムリエ	6,696,073,247円
クルーズコントロール	2,772,942,619円
投資のソムリエ<DC年金>	646,801,998円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	2,995,596,010円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	343,239,462円
クルーズコントロール<DC年金>	2,525,895円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	9,120,665円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,189,413円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	598,062,219円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,424,565,583円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,319,951円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,558,213円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,942,495円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	8,985,300円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	184,133,805円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,759,163,243円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,156,661,942円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	647,370円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	542,330円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	542,331円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	485,154円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,190,488,437円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,839,142,793円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	414,011,447円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,071,969,240円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,050,603,156円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,102,756,119円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,076,506,178円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,113,422,319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)	223,167,454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)	170,577,343円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	61,717,869円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	149,099,794円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	73,771,910円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	30,044,426円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	80,718,622円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	167,859,728円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,674,455,144円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,614,559,772円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,996,458,712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)	529,172,657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)	244,545,493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)	2,873,345,395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)	256,408,719円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	14,008,431円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	59,724,434円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,644,569,344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)	76,101,841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)	542,859,017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)	935,154,369円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	5,607,727,769円

D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定)	394,177,784円
D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定)	112,665,586円
D I A Mバランス20 V A (適格機関投資家限定)	346,002,770円
D I A Mバランス40 V A (適格機関投資家限定)	739,037円
D I A Mバランス60 V A (適格機関投資家限定)	411,535円
計	170,923,484,775円
2. 受益権の総数	170,923,484,775口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	542,581,000
地方債証券	135,153,000
特殊債券	53,718,189
社債券	98,436,560
合計	829,888,749

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年2月15日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,565,679,213円
同期中追加設定元本額	40,900,299,959円
同期中一部解約元本額	56,503,525,603円
元本の内訳 ファンド名 One DC 国内株式インデックスファンド	13,611,439,882円

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

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	709,579円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	713,959円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	189,185円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	78,739,020円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	60,924,956円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	619,149,099円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	89,946,801円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	206,404,283円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,789,652円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	48,075,805円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,232,103円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,898,566円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,025,819円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,091,785円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	847,524,247円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	842,970,799円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,416,784,905円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	170,583,328円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	47,266,489円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	462,442,535円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	123,979,136円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,256,332円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,787,888円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	479,569,491円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	36,811,782円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	131,239,904円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	339,216,777円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,627,526,351円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	57,780,766円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,343,327円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	16,767,270円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	101,694円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	119,842円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	380,720,505円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,210,952,937円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,605,155,025円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	65,047,821円
計	96,962,453,569円
2. 受益権の総数	96,962,453,569口

3. 差入代用有価証券 株式	1,934,750,000円
-------------------	----------------

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。



## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年2月8日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

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

## (注)時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

す。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

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

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年1月14日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	2,913.00	14,856,300	
日本水産	145,800	626.00	91,270,800	
マルハニチロ	21,100	2,759.00	58,214,900	
ハウスイ	900	888.00	799,200	
カネコ種苗	4,500	1,439.00	6,475,500	
サカタのタネ	17,400	3,565.00	62,031,000	
ホクト	11,200	1,954.00	21,884,800	
ホクリヨウ	2,300	703.00	1,616,900	
ヒノキヤグループ	3,600	2,129.00	7,664,400	
ショーボンドホールディングス	20,800	4,650.00	96,720,000	
ミライト・ホールディングス	43,400	1,706.00	74,040,400	
タマホーム	6,900	1,540.00	10,626,000	
サンヨーホームズ	1,300	717.00	932,100	
日本アクア	5,800	601.00	3,485,800	
ファーストコーポレーション	4,500	593.00	2,668,500	
ベステラ	2,500	1,275.00	3,187,500	
T A T E R U	30,100	214.00	6,441,400	
スペースバリューホールディングス	18,000	584.00	10,512,000	
住石ホールディングス	29,500	147.00	4,336,500	
日鉄鉱業	3,300	4,775.00	15,757,500	
三井松島ホールディングス	5,700	1,208.00	6,885,600	
国際石油開発帝石	585,000	1,155.00	675,675,000	
石油資源開発	19,100	3,045.00	58,159,500	
K & O エナジーグループ	7,100	1,505.00	10,685,500	
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,145.00	3,206,000	
第一カッター興業	1,800	1,843.00	3,317,400	
安藤・間	86,800	966.00	83,848,800	
東急建設	42,800	758.00	32,442,400	
コムシスホールディングス	51,700	3,195.00	165,181,500	
ピーアールホールディングス	15,900	487.00	7,743,300	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,788.00	25,370,800	
東建コーポレーション	4,500	7,550.00	33,975,000	

ソネック	1,500	824.00	1,236,000	
ヤマウラ	6,400	936.00	5,990,400	
大成建設	112,300	4,585.00	514,895,500	
大林組	336,700	1,231.00	414,477,700	
清水建設	341,800	1,134.00	387,601,200	
飛島建設	9,700	1,461.00	14,171,700	
長谷工コーポレーション	130,300	1,476.00	192,322,800	
松井建設	13,200	807.00	10,652,400	
銭高組	1,400	4,090.00	5,726,000	
鹿島建設	264,400	1,422.00	375,976,800	
不動テトラ	8,800	1,617.00	14,229,600	
大末建設	3,900	970.00	3,783,000	
鉄建建設	7,300	2,804.00	20,469,200	
西松建設	25,900	2,450.00	63,455,000	
三井住友建設	81,400	628.00	51,119,200	
大豊建設	7,600	2,787.00	21,181,200	
前田建設工業	84,300	1,016.00	85,648,800	
佐田建設	7,300	485.00	3,540,500	
ナカノフドー建設	9,100	493.00	4,486,300	
奥村組	18,300	2,975.00	54,442,500	
東鉄工業	14,500	3,170.00	45,965,000	
イチケン	2,500	1,800.00	4,500,000	
富士ピー・エス	5,000	579.00	2,895,000	
浅沼組	3,800	4,855.00	18,449,000	
戸田建設	139,700	715.00	99,885,500	
熊谷組	15,600	3,275.00	51,090,000	
北野建設	2,100	2,581.00	5,420,100	
植木組	1,500	2,546.00	3,819,000	
矢作建設工業	14,900	806.00	12,009,400	
ピーエス三菱	11,100	714.00	7,925,400	
日本ハウスホールディングス	23,000	489.00	11,247,000	
大東建託	40,300	13,020.00	524,706,000	
新日本建設	14,300	921.00	13,170,300	
N I P P O	27,900	2,411.00	67,266,900	
東亜道路工業	2,100	3,540.00	7,434,000	
前田道路	35,700	2,653.00	94,712,100	
日本道路	3,300	6,650.00	21,945,000	
東亜建設工業	10,500	1,655.00	17,377,500	
日本国土開発	19,700	678.00	13,356,600	
若築建設	6,100	1,710.00	10,431,000	
東洋建設	37,800	512.00	19,353,600	
五洋建設	133,500	668.00	89,178,000	
世紀東急工業	16,200	915.00	14,823,000	
福田組	3,900	4,920.00	19,188,000	
日本ドライケミカル	2,600	1,923.00	4,999,800	
住友林業	85,300	1,581.00	134,859,300	
日本基礎技術	11,500	408.00	4,692,000	
巴コーポレーション	14,900	462.00	6,883,800	
大和ハウス工業	333,200	3,446.00	1,148,207,200	
ライト工業	19,300	1,560.00	30,108,000	

積水ハウス	368,500	2,391.50	881,267,750
日特建設	8,800	854.00	7,515,200
北陸電気工事	5,900	1,157.00	6,826,300
ユアテック	19,400	691.00	13,405,400
四電工	1,700	2,893.00	4,918,100
中電工	13,600	2,505.00	34,068,000
関電工	48,000	1,018.00	48,864,000
きんでん	80,000	1,658.00	132,640,000
東京エネシス	11,200	899.00	10,068,800
トーエネック	3,400	3,830.00	13,022,000
住友電設	9,500	2,755.00	26,172,500
日本電設工業	18,500	2,210.00	40,885,000
協和エクシオ	51,100	2,790.00	142,569,000
新日本空調	8,900	2,135.00	19,001,500
日本工営	6,900	3,520.00	24,288,000
九電工	23,700	3,235.00	76,669,500
三機工業	24,300	1,529.00	37,154,700
日揮ホールディングス	103,600	1,706.00	176,741,600
中外炉工業	3,600	1,815.00	6,534,000
ヤマト	10,800	774.00	8,359,200
太平電業	8,200	2,294.00	18,810,800
高砂熱学工業	29,300	1,916.00	56,138,800
三晃金属工業	1,400	2,627.00	3,677,800
N E C ネットズエスアイ	10,000	4,120.00	41,200,000
朝日工業社	2,200	3,470.00	7,634,000
明星工業	21,700	956.00	20,745,200
大気社	16,400	3,705.00	60,762,000
ダイダン	8,000	2,667.00	21,336,000
日比谷総合設備	10,800	1,923.00	20,768,400
日本製粉	31,600	1,702.00	53,783,200
日清製粉グループ本社	121,800	1,887.00	229,836,600
日東富士製粉	700	6,320.00	4,424,000
昭和産業	9,900	3,080.00	30,492,000
鳥越製粉	9,700	848.00	8,225,600
中部飼料	13,100	1,615.00	21,156,500
フィード・ワン	72,500	180.00	13,050,000
東洋精糖	1,700	1,222.00	2,077,400
日本甜菜製糖	5,700	1,981.00	11,291,700
三井製糖	9,500	2,227.00	21,156,500
塩水港精糖	11,100	226.00	2,508,600
日新製糖	5,000	2,043.00	10,215,000
L I F U L L	35,800	554.00	19,833,200
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,896.00	13,082,400
日本M & A センター	77,500	3,900.00	302,250,000
メンバーズ	3,000	2,173.00	6,519,000
中広	1,100	545.00	599,500
U T グループ	12,100	3,300.00	39,930,000
アイティメディア	3,100	909.00	2,817,900
タケエイ	9,800	1,233.00	12,083,400
E・Jホールディングス	1,200	1,840.00	2,208,000

ビーネックスグループ	11,300	1,313.00	14,836,900
コシダカホールディングス	24,700	1,565.00	38,655,500
アルトナー	2,500	840.00	2,100,000
パソナグループ	12,500	1,565.00	19,562,500
C D S	2,500	1,620.00	4,050,000
リンクアンドモチベーション	22,700	604.00	13,710,800
G C A	12,300	998.00	12,275,400
エス・エム・エス	31,900	3,050.00	97,295,000
サニーサイドアップグループ	2,300	1,102.00	2,534,600
パーソルホールディングス	102,600	2,090.00	214,434,000
リニカル	4,900	1,146.00	5,615,400
クックパッド	35,900	357.00	12,816,300
エスクリ	3,300	780.00	2,574,000
アイ・ケイ・ケイ	5,100	743.00	3,789,300
森永製菓	25,300	5,320.00	134,596,000
中村屋	2,700	4,310.00	11,637,000
江崎グリコ	32,000	4,915.00	157,280,000
名糖産業	5,200	1,368.00	7,113,600
井村屋グループ	4,600	1,950.00	8,970,000
不二家	6,000	2,148.00	12,888,000
山崎製パン	80,800	2,049.00	165,559,200
第一屋製パン	1,800	954.00	1,717,200
モロゾフ	1,800	5,100.00	9,180,000
亀田製菓	6,200	5,020.00	31,124,000
寿スピリッツ	10,400	8,780.00	91,312,000
カルビー	49,100	3,660.00	179,706,000
森永乳業	19,900	4,325.00	86,067,500
六甲バター	7,200	1,692.00	12,182,400
ヤクルト本社	74,100	6,110.00	452,751,000
明治ホールディングス	71,300	7,570.00	539,741,000
雪印メグミルク	26,000	2,539.00	66,014,000
プリマハム	16,900	2,555.00	43,179,500
日本ハム	41,200	4,680.00	192,816,000
林兼産業	3,700	678.00	2,508,600
丸大食品	11,500	2,216.00	25,484,000
S F o o d s	8,600	3,060.00	26,316,000
柿安本店	3,700	3,200.00	11,840,000
伊藤ハム米久ホールディングス	69,500	712.00	49,484,000
学情	3,600	2,412.00	8,683,200
スタジオアリス	5,200	1,959.00	10,186,800
クロスキャット	2,800	1,179.00	3,301,200
シミックホールディングス	5,700	1,775.00	10,117,500
エプコ	1,600	1,439.00	2,302,400
システナ	37,600	1,943.00	73,056,800
N J S	2,200	1,830.00	4,026,000
デジタルアーツ	5,200	6,050.00	31,460,000
日鉄ソリューションズ	15,800	3,820.00	60,356,000
総合警備保障	40,800	6,050.00	246,840,000
キューブシステム	5,600	810.00	4,536,000
いちご	134,800	460.00	62,008,000

エイジア	1,900	1,474.00	2,800,600
日本駐車場開発	116,800	147.00	17,169,600
コア	4,500	1,511.00	6,799,500
カカクコム	76,800	2,997.00	230,169,600
アイロムグループ	3,600	1,427.00	5,137,200
セントケア・ホールディング	6,800	485.00	3,298,000
サイネックス	1,700	705.00	1,198,500
ルネサンス	5,700	1,725.00	9,832,500
ディップ	14,500	3,495.00	50,677,500
SBSホールディングス	9,300	1,871.00	17,400,300
オプトホールディング	5,600	1,641.00	9,189,600
新日本科学	11,100	633.00	7,026,300
ツクイ	24,200	596.00	14,423,200
キャリアデザインセンター	2,600	1,404.00	3,650,400
ベネフィット・ワン	28,000	2,297.00	64,316,000
エムスリー	226,200	3,365.00	761,163,000
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	584.00	3,912,800
プラス	800	857.00	685,600
アウトソーシング	58,700	1,106.00	64,922,200
ウェルネット	9,800	717.00	7,026,600
ワールドホールディングス	3,400	1,768.00	6,011,200
ディー・エヌ・エー	50,300	1,810.00	91,043,000
博報堂DYホールディングス	142,700	1,742.00	248,583,400
ぐるなび	17,900	1,024.00	18,329,600
タカミヤ	11,000	681.00	7,491,000
ジャパンベストレスキューシステム	7,000	1,203.00	8,421,000
ファンコミュニケーションズ	28,300	477.00	13,499,100
ライク	4,100	1,622.00	6,650,200
ビジネス・ブレークスルー	4,300	423.00	1,818,900
エスプール	19,800	832.00	16,473,600
WDBホールディングス	4,700	2,751.00	12,929,700
ティア	6,100	598.00	3,647,800
CDG	1,100	1,427.00	1,569,700
バリューコマース	5,700	2,544.00	14,500,800
インフォマート	112,400	1,018.00	114,423,200
サッポロホールディングス	36,800	2,652.00	97,593,600
アサヒグループホールディングス	225,800	4,973.00	1,122,903,400
麒麟ホールディングス	457,100	2,446.50	1,118,295,150
宝ホールディングス	80,700	1,004.00	81,022,800
オエノンホールディングス	28,500	400.00	11,400,000
養命酒製造	3,300	1,988.00	6,560,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	75,700	2,881.00	218,091,700
サントリー食品インターナショナル	72,100	4,620.00	333,102,000
ダイドーグループホールディングス	5,500	4,545.00	24,997,500
伊藤園	32,700	5,580.00	182,466,000
キーコーヒー	10,700	2,285.00	24,449,500
ユニカフェ	2,900	979.00	2,839,100
ジャパンフーズ	1,500	1,293.00	1,939,500
日清オイリオグループ	13,900	3,815.00	53,028,500

不二製油グループ本社	26,300	2,986.00	78,531,800
かどや製油	1,100	3,845.00	4,229,500
J-オイルミルズ	5,600	4,300.00	24,080,000
ローソン	26,800	6,330.00	169,644,000
サンエー	8,800	4,620.00	40,656,000
カワチ薬品	8,200	2,161.00	17,720,200
エービーシー・マート	16,500	7,010.00	115,665,000
ハードオフコーポレーション	4,200	828.00	3,477,600
高千穂交易	4,100	1,217.00	4,989,700
アスクル	11,100	3,410.00	37,851,000
ゲオホールディングス	19,000	1,300.00	24,700,000
アダストリア	14,600	2,328.00	33,988,800
ジーフット	6,600	620.00	4,092,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,500	689.00	1,033,500
伊藤忠食品	2,400	5,170.00	12,408,000
くら寿司	5,500	5,370.00	29,535,000
キャンドウ	5,100	1,681.00	8,573,100
エレマテック	9,900	1,154.00	11,424,600
パルグループホールディングス	5,400	3,635.00	19,629,000
JALUX	3,000	2,488.00	7,464,000
エディオン	48,600	1,202.00	58,417,200
あらた	8,400	4,525.00	38,010,000
サーラコーポレーション	21,600	626.00	13,521,600
ワッツ	4,800	638.00	3,062,400
トーメンデバイス	1,600	3,670.00	5,872,000
ハローズ	4,000	2,603.00	10,412,000
J Pホールディングス	32,300	324.00	10,465,200
フジオフードシステム	9,000	1,803.00	16,227,000
あみやき亭	2,300	3,690.00	8,487,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,785.00	10,583,000
ひらまつ	19,500	283.00	5,518,500
フィールズ	8,100	642.00	5,200,200
双日	584,200	347.00	202,717,400
アルフレッサ ホールディングス	117,600	2,218.00	260,836,800
大黒天物産	2,600	3,330.00	8,658,000
ハニーズホールディングス	9,300	1,543.00	14,349,900
ファーマライズホールディングス	2,600	649.00	1,687,400
キッコーマン	77,600	5,430.00	421,368,000
味の素	238,100	1,820.50	433,461,050
キューピー	60,000	2,426.00	145,560,000
ハウス食品グループ本社	40,300	3,750.00	151,125,000
カゴメ	40,900	2,628.00	107,485,200
焼津水産化学工業	5,300	1,034.00	5,480,200
アリアケジャパン	9,800	7,860.00	77,028,000
ピエトロ	1,400	1,635.00	2,289,000
エバラ食品工業	2,500	2,221.00	5,552,500
やまみ	500	2,378.00	1,189,000
ニチレイ	51,300	2,646.00	135,739,800
横浜冷凍	29,800	985.00	29,353,000
東洋水産	55,500	4,575.00	253,912,500

イトアンド	3,800	1,840.00	6,992,000
大冷	1,400	1,964.00	2,749,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,900	1,221.00	7,203,900
日清食品ホールディングス	45,800	8,160.00	373,728,000
永谷園ホールディングス	5,300	2,170.00	11,501,000
一正蒲鉾	3,900	1,005.00	3,919,500
フジッコ	11,700	1,992.00	23,306,400
ロック・フィールド	11,600	1,554.00	18,026,400
日本たばこ産業	622,300	2,429.00	1,511,566,700
ケンコーマヨネーズ	6,100	2,457.00	14,987,700
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,912.00	13,575,200
なとり	6,100	1,710.00	10,431,000
イフジ産業	1,900	761.00	1,445,900
ピクルスコーポレーション	2,400	2,614.00	6,273,600
北の達人コーポレーション	37,600	738.00	27,748,800
ユーグレナ	46,000	790.00	36,340,000
スター・マイカ・ホールディングス	5,500	1,679.00	9,234,500
片倉工業	15,300	1,302.00	19,920,600
グンゼ	7,700	4,815.00	37,075,500
ヒューリック	226,200	1,317.00	297,905,400
神栄	1,500	733.00	1,099,500
ラサ商事	5,600	1,024.00	5,734,400
アルペン	8,100	1,746.00	14,142,600
ハブ	3,000	1,089.00	3,267,000
ラクーンホールディングス	5,100	922.00	4,702,200
クオールホールディングス	15,600	1,480.00	23,088,000
アルコニックス	11,200	1,409.00	15,780,800
神戸物産	36,500	4,035.00	147,277,500
ソリトンシステムズ	4,600	1,352.00	6,219,200
ジンズホールディングス	5,600	7,770.00	43,512,000
ビックカメラ	62,700	1,290.00	80,883,000
DCMホールディングス	57,100	1,043.00	59,555,300
ペッパーフードサービス	8,400	1,081.00	9,080,400
Monotaro	75,200	2,766.00	208,003,200
東京一番フーズ	2,600	633.00	1,645,800
DDホールディングス	4,200	1,481.00	6,220,200
あいホールディングス	15,100	1,966.00	29,686,600
ディービーエックス	3,700	935.00	3,459,500
きちりホールディングス	2,800	787.00	2,203,600
アークランドサービスホールディングス	7,700	2,046.00	15,754,200
J.フロントリテイリング	126,200	1,550.00	195,610,000
ドトール・日レスホールディングス	16,900	2,132.00	36,030,800
マツモトキヨシホールディングス	43,700	4,405.00	192,498,500
broncoビリー	5,500	2,787.00	15,328,500
Zozo	72,700	1,985.00	144,309,500
トレジャー・ファクトリー	3,100	965.00	2,991,500
物語コーポレーション	2,600	8,940.00	23,244,000
ココカラファイン	11,000	6,610.00	72,710,000
三越伊勢丹ホールディングス	184,800	1,003.00	185,354,400



東洋紡	41,500	1,578.00	65,487,000
ユニチカ	31,000	351.00	10,881,000
富士紡ホールディングス	5,100	3,505.00	17,875,500
日清紡ホールディングス	71,500	1,047.00	74,860,500
倉敷紡績	10,800	2,431.00	26,254,800
ダイワボウホールディングス	9,000	6,470.00	58,230,000
シキボウ	5,600	1,076.00	6,025,600
日東紡績	16,000	5,120.00	81,920,000
トヨタ紡織	31,300	1,714.00	53,648,200
マクニカ・富士エレホールディングス	25,200	1,853.00	46,695,600
H a m e e	3,200	1,586.00	5,075,200
ラクト・ジャパン	3,900	3,790.00	14,781,000
ウエルシアホールディングス	31,500	6,830.00	215,145,000
クリエイトSDホールディングス	15,600	2,822.00	44,023,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,000	1,034.00	20,680,000
八洲電機	8,300	915.00	7,594,500
メディアスホールディングス	6,000	880.00	5,280,000
レスターホールディングス	11,000	2,071.00	22,781,000
ジューテックホールディングス	2,300	1,170.00	2,691,000
丸善CHIホールディングス	12,200	367.00	4,477,400
大光	4,600	666.00	3,063,600
O C H Iホールディングス	3,000	1,474.00	4,422,000
T O K A Iホールディングス	55,900	1,073.00	59,980,700
黒谷	1,900	521.00	989,900
ミサワ	2,200	747.00	1,643,400
ティーライフ	1,400	887.00	1,241,800
C o m i n i x	1,800	829.00	1,492,200
エー・ピーカンパニー	2,100	675.00	1,417,500
三洋貿易	5,300	2,530.00	13,409,000
チムニー	3,200	2,345.00	7,504,000
シュッピン	7,200	1,304.00	9,388,800
ビューティガレージ	1,700	2,452.00	4,168,400
ウイン・パートナーズ	7,600	1,285.00	9,766,000
ネクステージ	15,100	1,211.00	18,286,100
ジョイフル本田	31,000	1,341.00	41,571,000
鳥貴族	3,500	2,380.00	8,330,000
キリン堂ホールディングス	4,200	1,993.00	8,370,600
ホットランド	7,100	1,284.00	9,116,400
すかいらくホールディングス	118,500	2,174.00	257,619,000
S F Pホールディングス	4,500	2,517.00	11,326,500
綿半ホールディングス	4,000	1,803.00	7,212,000
日本毛織	34,600	1,120.00	38,752,000
ダイトウボウ	18,400	86.00	1,582,400
トーア紡コーポレーション	4,000	530.00	2,120,000
ダイドーリミテッド	14,200	279.00	3,961,800
ヨシックス	1,700	2,802.00	4,763,400
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,800	971.00	29,906,800
三栄建築設計	4,300	1,599.00	6,875,700

野村不動産ホールディングス	64,200	2,738.00	175,779,600	
三重交通グループホールディングス	21,500	608.00	13,072,000	
サムティ	15,000	1,823.00	27,345,000	
ディア・ライフ	13,600	607.00	8,255,200	
コーセーアールイー	3,100	929.00	2,879,900	
エー・ディー・ワークス	197,900	29.00	5,739,100	
日本商業開発	6,700	1,703.00	11,410,100	
プレサンスコーポレーション	17,300	1,356.00	23,458,800	
ユニゾホールディングス	16,000	5,160.00	82,560,000	
THEグローバル社	5,600	464.00	2,598,400	
ハウスコム	1,400	1,570.00	2,198,000	
日本管理センター	7,000	1,277.00	8,939,000	
サンセイランディック	3,100	919.00	2,848,900	
エストラスト	1,400	839.00	1,174,600	
フージャースホールディングス	21,100	706.00	14,896,600	
オープンハウス	30,700	3,030.00	93,021,000	
東急不動産ホールディングス	288,000	738.00	212,544,000	
飯田グループホールディングス	88,400	1,956.00	172,910,400	
イーグランド	1,700	879.00	1,494,300	
ムゲンエステート	7,300	764.00	5,577,200	
帝国繊維	11,800	2,272.00	26,809,600	
日本コークス工業	91,800	79.00	7,252,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	663.00	3,248,700	
ミタチ産業	3,200	766.00	2,451,200	
B E E N O S	3,990	1,296.00	5,171,040	
あさひ	7,900	1,369.00	10,815,100	
日本調剤	3,200	3,820.00	12,224,000	
コスモス薬品	4,700	24,610.00	115,667,000	
シップヘルスケアホールディングス	17,000	5,020.00	85,340,000	
トーエル	5,200	789.00	4,102,800	
ソフトクリエイティブホールディングス	4,600	1,703.00	7,833,800	
オンリー	1,900	811.00	1,540,900	
セブン&アイ・ホールディングス	413,800	4,285.00	1,773,133,000	
クリエイティブ・レストランツ・ホールディングス	28,500	2,044.00	58,254,000	
明治電機工業	3,300	1,608.00	5,306,400	
ツルハホールディングス	23,000	13,900.00	319,700,000	
デリカフーズホールディングス	3,900	729.00	2,843,100	
スターティアホールディングス	2,400	815.00	1,956,000	
サンマルクホールディングス	8,400	2,324.00	19,521,600	
フェリシモ	2,300	1,045.00	2,403,500	
トリドールホールディングス	13,100	2,863.00	37,505,300	
帝人	85,800	2,036.00	174,688,800	
東レ	761,700	748.20	569,903,940	
クラレ	165,700	1,313.00	217,564,100	
旭化成	697,200	1,200.50	836,988,600	
サカイオーベックス	2,800	1,891.00	5,294,800	
T O K Y O B A S E	9,600	594.00	5,702,400	
稲葉製作所	6,100	1,420.00	8,662,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,200	1,972.00	6,310,400	

トーカロ	29,500	1,117.00	32,951,500	
アルファ	3,800	1,362.00	5,175,600	
SUMCO	127,100	1,904.00	241,998,400	
川田テクノロジーズ	2,200	6,580.00	14,476,000	
RS Technologies	3,000	3,515.00	10,545,000	
信和	4,600	1,147.00	5,276,200	
ピーロット	2,500	1,878.00	4,695,000	
ファーストブラザーズ	2,400	1,380.00	3,312,000	
ハウストゥ	5,900	1,443.00	8,513,700	
シーアールイー	2,600	1,192.00	3,099,200	
プロパティエージェント	1,700	1,185.00	2,014,500	
ケイアイスター不動産	3,300	2,032.00	6,705,600	
アグレ都市デザイン	1,500	592.00	888,000	
グッドコムアセット	2,500	2,000.00	5,000,000	
ジェイ・エス・ビー	1,100	5,840.00	6,424,000	
テンポイノベーション	2,400	977.00	2,344,800	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	636.00	1,081,200	
住江織物	3,000	2,693.00	8,079,000	
日本フェルト	5,600	499.00	2,794,400	
イチカワ	1,500	1,519.00	2,278,500	
エコナックホールディングス	18,800	142.00	2,669,600	
日東製網	1,200	1,787.00	2,144,400	
芦森工業	2,200	1,414.00	3,110,800	
アツギ	8,800	851.00	7,488,800	
ウイルプラスホールディングス	1,700	891.00	1,514,700	
ジャパンミート	5,300	2,282.00	12,094,600	
コメダホールディングス	23,000	2,223.00	51,129,000	
サツドラホールディングス	1,500	1,846.00	2,769,000	
アレンザホールディングス	5,300	995.00	5,273,500	
串カツ田中ホールディングス	1,600	2,331.00	3,729,600	
パロックジャパンリミテッド	7,400	1,026.00	7,592,400	
クスリのアオキホールディングス	10,500	6,910.00	72,555,000	
ダイニック	3,800	790.00	3,002,000	
共和レザー	5,800	819.00	4,750,200	
力の源ホールディングス	4,800	1,148.00	5,510,400	
スシローグローバルホールディングス	11,600	9,960.00	115,536,000	
LIXILピバ	10,400	1,980.00	20,592,000	
アセンテック	800	2,339.00	1,871,200	
セーレン	25,900	1,508.00	39,057,200	
ソトー	3,700	973.00	3,600,100	
東海染工	1,400	1,131.00	1,583,400	
小松マテーレ	17,200	788.00	13,553,600	
ワコールホールディングス	27,400	2,994.00	82,035,600	
ホギメディカル	12,000	3,605.00	43,260,000	
レナウン	27,600	113.00	3,118,800	
クラウドディアホールディングス	2,800	482.00	1,349,600	
T S Iホールディングス	35,400	538.00	19,045,200	
マツオカコーポレーション	3,000	2,274.00	6,822,000	
ワールド	14,900	2,645.00	39,410,500	
T I S	35,100	6,660.00	233,766,000	

ネオス	4,200	803.00	3,372,600	
電算システム	4,000	3,075.00	12,300,000	
グリー	72,600	483.00	35,065,800	
コーエーテクモホールディングス	21,500	2,959.00	63,618,500	
三菱総合研究所	4,500	4,365.00	19,642,500	
ボルテージ	1,900	605.00	1,149,500	
電算	1,200	2,232.00	2,678,400	
A G S	5,800	824.00	4,779,200	
ファインデックス	8,900	1,296.00	11,534,400	
ブレインパッド	2,200	5,950.00	13,090,000	
K L a b	20,300	839.00	17,031,700	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,700	969.00	12,306,300	
イーブクイニシアティブジャパン	1,500	2,034.00	3,051,000	
ネクソン	300,000	1,563.00	468,900,000	
アイスタイル	27,200	595.00	16,184,000	
エムアップ	3,000	3,015.00	9,045,000	
エイチーム	7,200	1,077.00	7,754,400	
エニグモ	7,500	942.00	7,065,000	
テクノスジャパン	8,300	502.00	4,166,600	
e n i s h	4,700	811.00	3,811,700	
コロプラ	34,500	1,191.00	41,089,500	
オルトプラス	7,800	923.00	7,199,400	
ブロードリーフ	52,200	639.00	33,355,800	
クロス・マーケティンググループ	4,800	385.00	1,848,000	
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,078.00	6,036,800	
システム情報	5,300	1,101.00	5,835,300	
メディアドゥホールディングス	3,300	4,045.00	13,348,500	
じげん	26,100	541.00	14,120,100	
ブイキューブ	6,500	654.00	4,251,000	
エンカレッジ・テクノロジー	1,700	938.00	1,594,600	
サイバーリンクス	1,600	1,268.00	2,028,800	
ディー・エル・イー	7,700	200.00	1,540,000	
フィックスターズ	11,200	1,679.00	18,804,800	
C A R T A H O L D I N G S	5,100	1,144.00	5,834,400	
オブティム	2,800	4,055.00	11,354,000	
セレス	3,500	1,236.00	4,326,000	
S H I F T	2,800	9,430.00	26,404,000	
特種東海製紙	6,700	4,000.00	26,800,000	
ティーガイア	9,300	2,680.00	24,924,000	
セック	1,500	4,095.00	6,142,500	
日本アジアグループ	11,100	376.00	4,173,600	
豆蔵ホールディングス	7,200	1,507.00	10,850,400	
テクマトリックス	7,400	2,493.00	18,448,200	
プロシップ	3,000	1,605.00	4,815,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,400	2,239.00	56,870,600	
G M O ペイメントゲートウェイ	17,300	8,030.00	138,919,000	
ザッパラス	5,500	405.00	2,227,500	
システムリサーチ	2,800	1,845.00	5,166,000	

インターネットイニシアティブ	15,600	2,961.00	46,191,600
さくらインターネット	11,300	739.00	8,350,700
ヴィンクス	3,000	1,262.00	3,786,000
GMOクラウド	2,000	2,635.00	5,270,000
SRAホールディングス	5,600	2,600.00	14,560,000
システムインテグレータ	3,300	911.00	3,006,300
朝日ネット	7,500	642.00	4,815,000
eBASE	6,300	1,470.00	9,261,000
アバント	7,500	1,091.00	8,182,500
アドソル日進	3,700	2,285.00	8,454,500
フリービット	6,300	1,014.00	6,388,200
コムチュア	11,800	2,480.00	29,264,000
サイバーコム	1,900	2,366.00	4,495,400
アステリア	6,400	617.00	3,948,800
アイル	3,800	2,138.00	8,124,400
王子ホールディングス	439,500	588.00	258,426,000
日本製紙	46,500	1,841.00	85,606,500
三菱製紙	12,100	480.00	5,808,000
北越コーポレーション	69,700	550.00	38,335,000
中越パルプ工業	4,500	1,639.00	7,375,500
巴川製紙所	3,200	924.00	2,956,800
大王製紙	46,200	1,480.00	68,376,000
阿波製紙	2,700	542.00	1,463,400
マークライズ	5,300	2,134.00	11,310,200
メディカル・データ・ビジョン	8,000	862.00	6,896,000
gumi	13,500	854.00	11,529,000
ショーケース	2,400	694.00	1,665,600
モバイルファクトリー	2,400	1,385.00	3,324,000
テラスカイ	3,800	2,573.00	9,777,400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,789.00	8,408,300
PCIホールディングス	2,100	2,303.00	4,836,300
パイプドHD	1,400	2,096.00	2,934,400
アイビーシー	1,900	1,439.00	2,734,100
ネオジャパン	2,000	1,107.00	2,214,000
PR TIMES	900	2,668.00	2,401,200
ランドコンピュータ	1,600	1,144.00	1,830,400
ダブルスタンダード	1,300	4,900.00	6,370,000
オーブンドア	5,200	1,489.00	7,742,800
マイネット	3,400	702.00	2,386,800
アカツキ	3,700	5,900.00	21,830,000
ベネフィットジャパン	800	1,874.00	1,499,200
Ubicomホールディングス	2,300	1,371.00	3,153,300
LINE	24,100	5,390.00	129,899,000
カナミックネットワーク	6,500	846.00	5,499,000
ノムラシステムコーポレーション	2,300	543.00	1,248,900
レンゴー	99,400	828.00	82,303,200
トーモク	6,500	1,841.00	11,966,500
ザ・バック	8,000	3,930.00	31,440,000
チェンジ	2,100	3,045.00	6,394,500

シンクロ・フード	4,500	589.00	2,650,500
オークネット	6,500	1,310.00	8,515,000
セグエグループ	1,700	960.00	1,632,000
エイトレッド	1,300	1,738.00	2,259,400
AOI TYO HOLDINGS	10,600	743.00	7,875,800
マクロミル	18,800	1,050.00	19,740,000
ピーグリー	2,100	1,233.00	2,589,300
オロ	2,800	3,840.00	10,752,000
テモナ	1,300	554.00	720,200
ニーズウェル	1,200	792.00	950,400
サインポスト	1,600	2,007.00	3,211,200
昭和電工	74,900	2,763.00	206,948,700
住友化学	772,900	485.00	374,856,500
住友精化	4,700	3,380.00	15,886,000
日産化学	58,800	4,730.00	278,124,000
ラサ工業	3,700	1,516.00	5,609,200
クレハ	9,000	6,700.00	60,300,000
多木化学	3,100	4,645.00	14,399,500
テイカ	7,800	2,012.00	15,693,600
石原産業	18,900	1,009.00	19,070,100
片倉コープアグリ	2,900	1,209.00	3,506,100
日本曹達	15,600	3,000.00	46,800,000
東ソー	162,600	1,678.00	272,842,800
トクヤマ	30,300	2,825.00	85,597,500
セントラル硝子	21,500	2,534.00	54,481,000
東亜合成	66,100	1,239.00	81,897,900
大阪ソーダ	10,800	3,010.00	32,508,000
関東電化工業	25,000	979.00	24,475,000
デンカ	38,400	3,155.00	121,152,000
イビデン	65,800	2,746.00	180,686,800
信越化学工業	180,600	12,365.00	2,233,119,000
日本カーバイド工業	3,600	1,482.00	5,335,200
堺化学工業	6,800	2,411.00	16,394,800
第一稀元素化学工業	11,500	906.00	10,419,000
エア・ウォーター	88,400	1,600.00	141,440,000
大陽日酸	101,100	2,471.00	249,818,100
日本化学工業	3,300	3,105.00	10,246,500
東邦アセチレン	1,500	1,325.00	1,987,500
日本パーカライジング	53,200	1,134.00	60,328,800
高圧ガス工業	16,900	827.00	13,976,300
チタン工業	1,300	2,579.00	3,352,700
四国化成工業	16,300	1,344.00	21,907,200
戸田工業	2,500	2,169.00	5,422,500
ステラ ケミファ	5,700	3,165.00	18,040,500
保土谷化学工業	3,900	4,170.00	16,263,000
日本触媒	16,400	6,600.00	108,240,000
大日精化工業	9,400	3,045.00	28,623,000
カネカ	27,300	3,495.00	95,413,500
協和キリン	108,000	2,663.00	287,604,000
三菱瓦斯化学	99,300	1,663.00	165,135,900

三井化学	95,600	2,630.00	251,428,000
J S R	98,100	2,061.00	202,184,100
東京応化工業	18,100	4,400.00	79,640,000
大阪有機化学工業	9,700	1,738.00	16,858,600
三菱ケミカルホールディングス	703,400	817.50	575,029,500
K Hネオケム	18,500	2,288.00	42,328,000
ダイセル	144,000	1,032.00	148,608,000
住友ベークライト	16,600	4,140.00	68,724,000
積水化学工業	226,200	1,887.00	426,839,400
日本ゼオン	94,900	1,334.00	126,596,600
アイカ工業	31,600	3,585.00	113,286,000
宇部興産	53,100	2,329.00	123,669,900
積水樹脂	18,900	2,240.00	42,336,000
タキロンシーアイ	22,700	718.00	16,298,600
旭有機材	6,000	1,717.00	10,302,000
日立化成	48,600	4,595.00	223,317,000
ニチバン	5,500	1,847.00	10,158,500
リケンテクノス	26,800	520.00	13,936,000
大倉工業	5,000	1,868.00	9,340,000
積水化成成品工業	14,200	794.00	11,274,800
群栄化学工業	2,400	2,665.00	6,396,000
タイガースポリマー	5,600	596.00	3,337,600
ミライアル	3,700	1,377.00	5,094,900
ダイキアクシス	3,700	905.00	3,348,500
ダイキョーニシカワ	22,200	822.00	18,248,400
竹本容器	3,800	965.00	3,667,000
森六ホールディングス	5,700	2,310.00	13,167,000
日本化薬	65,100	1,351.00	87,950,100
カーリットホールディングス	11,400	618.00	7,045,200
E P S ホールディングス	15,400	1,376.00	21,190,400
ソルクシーズ	4,500	1,023.00	4,603,500
レグス	2,500	1,626.00	4,065,000
プレステージ・インターナショナル	38,400	998.00	38,323,200
フェイス	3,700	795.00	2,941,500
プロトコーポレーション	9,500	1,276.00	12,122,000
ハイマックス	1,200	2,072.00	2,486,400
アミューズ	5,600	3,030.00	16,968,000
野村総合研究所	176,100	2,374.00	418,061,400
ドリームインキュベータ	3,100	1,574.00	4,879,400
サイバネットシステム	7,500	936.00	7,020,000
クイック	6,400	1,594.00	10,201,600
T A C	6,600	227.00	1,498,200
C E ホールディングス	6,200	509.00	3,155,800
ケネディクス	97,700	559.00	54,614,300
日本システム技術	1,700	1,546.00	2,628,200
電通グループ	105,800	3,800.00	402,040,000
インテージホールディングス	13,100	930.00	12,183,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,900	1,152.00	4,492,800
東邦システムサイエンス	2,800	931.00	2,606,800
ぴあ	2,800	4,605.00	12,894,000

イオンファンタジー	4,000	2,641.00	10,564,000	
ソースネクスト	50,000	590.00	29,500,000	
シーティーエス	11,600	747.00	8,665,200	
ネクシィーズグループ	3,600	1,805.00	6,498,000	
インフォコム	11,500	2,843.00	32,694,500	
メディカルシステムネットワーク	10,300	546.00	5,623,800	
日本精化	8,600	1,255.00	10,793,000	
扶桑化学工業	10,700	3,185.00	34,079,500	
トリケミカル研究所	2,300	9,850.00	22,655,000	
ラクスル	5,600	3,725.00	20,860,000	
F I G	11,400	310.00	3,534,000	
システムサポート	900	2,139.00	1,925,100	
A D E K A	48,500	1,593.00	77,260,500	
日油	39,600	3,515.00	139,194,000	
ミヨシ油脂	4,300	1,226.00	5,271,800	
新日本理化	17,900	208.00	3,723,200	
ハリマ化成グループ	8,800	1,170.00	10,296,000	
イーソル	3,800	2,364.00	8,983,200	
アルテリア・ネットワークス	11,700	1,889.00	22,101,300	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,400	1,511.00	3,626,400	
花王	257,100	9,131.00	2,347,580,100	
第一工業製薬	3,900	4,400.00	17,160,000	
石原ケミカル	2,900	2,022.00	5,863,800	
日華化学	3,700	870.00	3,219,000	
ニイタカ	1,700	1,786.00	3,036,200	
三洋化成工業	6,300	5,260.00	33,138,000	
武田薬品工業	893,500	4,408.00	3,938,548,000	
アステラス製薬	944,600	1,895.50	1,790,489,300	
大日本住友製薬	79,600	2,166.00	172,413,600	
塩野義製薬	137,300	6,928.00	951,214,400	
田辺三菱製薬	131,000	2,004.00	262,524,000	
わかもと製薬	12,700	265.00	3,365,500	
あすか製薬	12,200	1,281.00	15,628,200	
日本新薬	28,100	10,120.00	284,372,000	
バイオフェルミン製薬	1,700	2,385.00	4,054,500	
中外製薬	112,000	10,450.00	1,170,400,000	
科研製薬	18,400	5,980.00	110,032,000	
エーザイ	128,500	8,106.00	1,041,621,000	
理研ビタミン	5,100	3,980.00	20,298,000	
ロート製薬	55,100	3,445.00	189,819,500	
小野薬品工業	246,600	2,599.50	641,036,700	
久光製薬	28,400	5,940.00	168,696,000	
有機合成薬品工業	8,300	289.00	2,398,700	
持田製薬	14,900	4,375.00	65,187,500	
参天製薬	200,000	2,161.00	432,200,000	
扶桑薬品工業	3,800	2,025.00	7,695,000	
日本ケミファ	1,400	2,903.00	4,064,200	
ツムラ	33,300	3,175.00	105,727,500	
日医工	30,400	1,325.00	40,280,000	



テルモ	303,900	3,932.00	1,194,934,800
みらかホールディングス	28,700	2,671.00	76,657,700
キッセイ薬品工業	19,000	3,075.00	58,425,000
生化学工業	20,800	1,233.00	25,646,400
栄研化学	18,900	2,143.00	40,502,700
日水製薬	4,600	1,277.00	5,874,200
鳥居薬品	6,700	3,195.00	21,406,500
JCRファーマ	7,600	9,330.00	70,908,000
東和薬品	13,700	2,810.00	38,497,000
富士製薬工業	7,300	1,281.00	9,351,300
沢井製薬	22,000	7,090.00	155,980,000
ゼリア新薬工業	19,500	2,078.00	40,521,000
第一三共	307,300	7,200.00	2,212,560,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,934.00	45,835,800
大幸薬品	4,300	3,535.00	15,200,500
ダイト	6,300	3,170.00	19,971,000
大塚ホールディングス	204,600	4,948.00	1,012,360,800
大正製薬ホールディングス	22,700	8,130.00	184,551,000
ペプチドリーム	54,300	5,740.00	311,682,000
大日本塗料	12,000	1,169.00	14,028,000
日本ペイントホールディングス	86,800	5,760.00	499,968,000
関西ペイント	118,200	2,742.00	324,104,400
神東塗料	8,600	221.00	1,900,600
中国塗料	30,000	1,029.00	30,870,000
日本特殊塗料	7,900	1,399.00	11,052,100
藤倉化成	14,500	576.00	8,352,000
太陽ホールディングス	7,800	4,585.00	35,763,000
DIC	44,500	3,020.00	134,390,000
サカタインクス	23,000	1,163.00	26,749,000
東洋インキSCホールディングス	22,300	2,546.00	56,775,800
T&K TOKA	8,400	1,028.00	8,635,200
アルプス技研	9,000	2,021.00	18,189,000
サニックス	18,100	353.00	6,389,300
ダイオーズ	2,100	1,383.00	2,904,300
日本空調サービス	10,700	820.00	8,774,000
オリエンタルランド	109,100	16,010.00	1,746,691,000
フォーカスシステムズ	6,500	1,002.00	6,513,000
ダスキン	26,300	3,065.00	80,609,500
パーク24	56,900	2,599.00	147,883,100
明光ネットワークジャパン	12,100	1,020.00	12,342,000
ファルコホールディングス	5,700	1,800.00	10,260,000
クレスコ	3,200	3,905.00	12,496,000
フジ・メディア・ホールディングス	101,500	1,551.00	157,426,500
秀英予備校	2,300	468.00	1,076,400
田谷	2,000	619.00	1,238,000
ラウンドワン	28,700	1,056.00	30,307,200
リゾートトラスト	47,100	1,808.00	85,156,800
オービック	36,500	15,780.00	575,970,000
ジャストシステム	17,100	6,320.00	108,072,000
TDCソフト	9,200	1,148.00	10,561,600

Zホールディングス	1,447,000	470.00	680,090,000	
ビー・エム・エル	13,200	3,015.00	39,798,000	
ワタベウェディング	1,600	564.00	902,400	
トレンドマイクロ	46,800	5,710.00	267,228,000	
りらいあコミュニケーションズ	18,600	1,432.00	26,635,200	
IDホールディングス	4,000	1,643.00	6,572,000	
リソー教育	47,000	377.00	17,719,000	
日本オラクル	21,400	10,110.00	216,354,000	
早稲田アカデミー	3,400	1,179.00	4,008,600	
アルファシステムズ	3,300	2,851.00	9,408,300	
フューチャー	12,700	1,943.00	24,676,100	
CAC Holdings	6,800	1,524.00	10,363,200	
SBテクノロジー	3,800	2,262.00	8,595,600	
トーセ	2,900	912.00	2,644,800	
ユー・エス・エス	114,900	2,035.00	233,821,500	
オービックビジネスコンサルタント	10,800	5,100.00	55,080,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,000	3,270.00	156,960,000	
アイティフォー	12,800	900.00	11,520,000	
東京個別指導学院	3,600	682.00	2,455,200	
東計電算	1,500	3,680.00	5,520,000	
サイバーエージェント	59,000	3,935.00	232,165,000	
楽天	478,300	918.00	439,079,400	
エクスネット	1,600	993.00	1,588,800	
クリーク・アンド・リバー社	5,300	1,138.00	6,031,400	
テー・オー・ダブリュー	9,000	969.00	8,721,000	
大塚商会	57,000	4,485.00	255,645,000	
サイボウズ	12,300	1,713.00	21,069,900	
ソフトブレイン	6,200	651.00	4,036,200	
山田コンサルティンググループ	5,000	1,613.00	8,065,000	
セントラルスポーツ	3,800	3,170.00	12,046,000	
パラカ	2,700	2,041.00	5,510,700	
電通国際情報サービス	6,500	4,585.00	29,802,500	
デジタルガレージ	18,900	4,560.00	86,184,000	
イーエムシステムズ	14,800	991.00	14,666,800	
ウェザーニューズ	3,600	3,745.00	13,482,000	
C I J	7,800	950.00	7,410,000	
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,165.00	3,798,000	
日本エンタープライズ	11,000	248.00	2,728,000	
WOWOW	5,100	2,700.00	13,770,000	
スカラ	7,500	793.00	5,947,500	
インテリジェント ウェイブ	4,000	813.00	3,252,000	
フルキャストホールディングス	10,300	2,564.00	26,409,200	
エン・ジャパン	18,200	4,945.00	89,999,000	
富士フイルムホールディングス	205,900	5,792.00	1,192,572,800	
コニカミノルタ	234,700	716.00	168,045,200	
資生堂	213,400	7,963.00	1,699,304,200	
ライオン	139,600	2,107.00	294,137,200	
高砂香料工業	6,800	2,496.00	16,972,800	
マンダム	24,100	3,020.00	72,782,000	
ミルボン	14,400	6,270.00	90,288,000	

ファンケル	43,500	3,110.00	135,285,000
コーセー	20,200	17,420.00	351,884,000
コタ	5,600	1,608.00	9,004,800
シーボン	1,200	2,510.00	3,012,000
ポーラ・オルビスホールディングス	45,800	2,644.00	121,095,200
ノエビアホールディングス	10,300	5,900.00	60,770,000
アジュバンコスメジャパン	2,300	1,007.00	2,316,100
エステー	6,900	1,715.00	11,833,500
アグロ カネショウ	3,400	1,477.00	5,021,800
コニシ	17,700	1,529.00	27,063,300
長谷川香料	14,300	2,146.00	30,687,800
星光PMC	6,200	959.00	5,945,800
小林製薬	30,100	9,270.00	279,027,000
荒川化学工業	9,700	1,585.00	15,374,500
メック	7,400	1,490.00	11,026,000
日本高純度化学	3,100	2,641.00	8,187,100
タカラバイオ	28,100	2,145.00	60,274,500
JCU	13,000	3,235.00	42,055,000
新田ゼラチン	6,900	685.00	4,726,500
OATアグリオ	1,900	1,604.00	3,047,600
デクセリアルズ	27,800	1,087.00	30,218,600
アース製薬	8,100	5,670.00	45,927,000
北興化学工業	11,200	558.00	6,249,600
大成ラミック	3,200	2,946.00	9,427,200
クミアイ化学工業	44,500	989.00	44,010,500
日本農薬	19,400	579.00	11,232,600
富士興産	3,200	663.00	2,121,600
ニチレキ	12,700	1,343.00	17,056,100
ユシロ化学工業	6,000	1,429.00	8,574,000
ビービー・カストロール	3,800	1,460.00	5,548,000
富士石油	28,900	238.00	6,878,200
MORESCO	4,000	1,415.00	5,660,000
出光興産	120,800	2,958.00	357,326,400
JXTGホールディングス	1,615,300	492.90	796,181,370
コスモエネルギーホールディングス	31,100	2,470.00	76,817,000
横浜ゴム	62,200	2,049.00	127,447,800
TOYO TIRE	61,700	1,458.00	89,958,600
ブリヂストン	330,100	3,990.00	1,317,099,000
住友ゴム工業	96,500	1,284.00	123,906,000
藤倉コンポジット	9,600	474.00	4,550,400
オカモト	6,500	4,000.00	26,000,000
アキレス	7,400	1,803.00	13,342,200
フコク	4,700	739.00	3,473,300
ニッタ	12,100	3,100.00	37,510,000
クリエートメディック	3,600	1,052.00	3,787,200
住友理工	20,900	911.00	19,039,900
三ツ星ベルト	14,100	2,010.00	28,341,000
パンドー化学	18,900	887.00	16,764,300
AGC	106,200	3,870.00	410,994,000
日本板硝子	51,300	675.00	34,627,500

石塚硝子	1,900	2,527.00	4,801,300	
有沢製作所	17,000	1,024.00	17,408,000	
日本山村硝子	4,500	1,297.00	5,836,500	
日本電気硝子	43,100	2,352.00	101,371,200	
オハラ	4,300	1,425.00	6,127,500	
住友大阪セメント	20,300	4,630.00	93,989,000	
太平洋セメント	67,800	3,035.00	205,773,000	
リソルホールディングス	1,000	4,145.00	4,145,000	
日本ヒューム	10,800	818.00	8,834,400	
日本コンクリート工業	23,300	282.00	6,570,600	
三谷セキサン	4,900	3,825.00	18,742,500	
アジアパイルホールディングス	15,300	582.00	8,904,600	
東海カーボン	112,500	1,036.00	116,550,000	
日本カーボン	5,500	4,015.00	22,082,500	
東洋炭素	6,300	2,310.00	14,553,000	
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	4,495.00	26,520,500	
TOTO	76,700	4,780.00	366,626,000	
日本碍子	131,000	1,985.00	260,035,000	
日本特殊陶業	83,600	2,136.00	178,569,600	
ダントーホールディングス	7,800	116.00	904,800	
MARUWA	4,100	8,770.00	35,957,000	
品川リフクトリーズ	2,800	3,240.00	9,072,000	
黒崎播磨	2,100	6,410.00	13,461,000	
ヨータイ	8,500	720.00	6,120,000	
イソライト工業	5,500	645.00	3,547,500	
東京窯業	13,800	340.00	4,692,000	
ニッカトー	4,900	752.00	3,684,800	
フジインコーポレーテッド	9,600	3,075.00	29,520,000	
クニミネ工業	4,400	1,316.00	5,790,400	
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,510.00	2,718,000	
ニチアス	29,400	2,758.00	81,085,200	
日本製鉄	475,300	1,680.50	798,741,650	
神戸製鋼所	194,300	579.00	112,499,700	
中山製鋼所	14,800	530.00	7,844,000	
合同製鐵	5,700	2,738.00	15,606,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	286,800	1,485.00	425,898,000	
東京製鐵	51,800	770.00	39,886,000	
共英製鋼	12,000	2,096.00	25,152,000	
大和工業	22,600	2,676.00	60,477,600	
東京鐵鋼	4,400	1,482.00	6,520,800	
大阪製鐵	5,700	1,526.00	8,698,200	
淀川製鋼所	14,400	1,956.00	28,166,400	
丸一鋼管	34,500	3,095.00	106,777,500	
モリ工業	3,100	2,592.00	8,035,200	
大同特殊鋼	17,400	4,705.00	81,867,000	
日本高周波鋼業	4,300	424.00	1,823,200	
日本冶金工業	8,800	2,302.00	20,257,600	
山陽特殊製鋼	7,700	1,540.00	11,858,000	
愛知製鋼	6,000	3,760.00	22,560,000	

日立金属	114,400	1,662.00	190,132,800
日本金属	2,500	919.00	2,297,500
大太平洋金属	7,200	2,582.00	18,590,400
新日本電工	68,700	167.00	11,472,900
栗本鐵工所	5,200	2,107.00	10,956,400
虹 技	1,600	1,454.00	2,326,400
日本鑄鉄管	1,100	1,605.00	1,765,500
日本製鋼所	32,200	2,170.00	69,874,000
三菱製鋼	8,000	1,051.00	8,408,000
日垂鋼業	15,900	341.00	5,421,900
日本精線	1,700	3,280.00	5,576,000
エンビプロ・ホールディングス	4,000	818.00	3,272,000
大紀アルミニウム工業所	17,500	765.00	13,387,500
日本軽金属ホールディングス	268,700	224.00	60,188,800
三井金属鉱業	28,700	2,910.00	83,517,000
東邦亜鉛	5,400	2,077.00	11,215,800
三菱マテリアル	70,200	2,931.00	205,756,200
住友金属鉱山	135,800	3,563.00	483,855,400
D O W Aホールディングス	26,900	4,195.00	112,845,500
古河機械金属	18,900	1,415.00	26,743,500
エス・サイエンス	48,900	47.00	2,298,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	1,512.00	16,783,200
東邦チタニウム	19,000	937.00	17,803,000
U A C J	16,100	2,418.00	38,929,800
C Kサンエツ	1,900	3,445.00	6,545,500
古河電気工業	33,000	2,752.00	90,816,000
住友電気工業	396,900	1,637.00	649,725,300
フジクラ	128,200	446.00	57,177,200
昭和電線ホールディングス	12,300	1,463.00	17,994,900
東京特殊電線	1,600	2,371.00	3,793,600
タツタ電線	21,100	629.00	13,271,900
カナレ電気	1,700	1,822.00	3,097,400
平河ヒューテック	4,000	1,700.00	6,800,000
リョービ	13,100	1,937.00	25,374,700
アーレスティ	13,900	558.00	7,756,200
アサヒホールディングス	18,600	2,736.00	50,889,600
東洋製罐グループホールディングス	67,700	1,941.00	131,405,700
ホッカンホールディングス	5,900	2,046.00	12,071,400
コロナ	6,000	1,051.00	6,306,000
横河ブリッジホールディングス	19,800	1,880.00	37,224,000
O S J Bホールディングス	53,000	266.00	14,098,000
駒井ハルテック	1,900	1,908.00	3,625,200
高田機工	900	2,666.00	2,399,400
三和ホールディングス	101,900	1,230.00	125,337,000
文化シャッター	31,300	910.00	28,483,000
三協立山	14,700	1,473.00	21,653,100
アルインコ	7,700	1,269.00	9,771,300
東洋シャッター	2,500	703.00	1,757,500
L I X I Lグループ	156,700	1,919.00	300,707,300
日本ファイルコン	8,300	560.00	4,648,000

ノーリツ	22,000	1,436.00	31,592,000
長府製作所	10,800	2,337.00	25,239,600
リンナイ	20,700	8,460.00	175,122,000
ユニプレス	20,800	1,506.00	31,324,800
ダイニチ工業	5,600	695.00	3,892,000
日東精工	14,700	637.00	9,363,900
三洋工業	1,400	2,010.00	2,814,000
岡部	21,500	902.00	19,393,000
ジーテクト	13,200	1,714.00	22,624,800
東ブレ	19,800	1,737.00	34,392,600
高周波熱錬	20,500	884.00	18,122,000
東京製綱	7,600	1,227.00	9,325,200
サンコール	6,000	573.00	3,438,000
モリテックスチール	8,400	397.00	3,334,800
パイオラックス	15,700	2,089.00	32,797,300
エイチワン	10,400	808.00	8,403,200
日本発条	113,900	983.00	111,963,700
中央発條	1,200	3,005.00	3,606,000
アドバネクス	1,300	1,710.00	2,223,000
三浦工業	46,000	3,840.00	176,640,000
タクマ	36,000	1,244.00	44,784,000
テクノプロ・ホールディングス	20,600	7,550.00	155,530,000
アトラ	2,300	335.00	770,500
インターワークス	1,900	534.00	1,014,600
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	5,320.00	22,344,000
Keeper 技研	3,800	1,365.00	5,187,000
ファーストロジック	2,300	602.00	1,384,600
三機サービス	2,200	1,088.00	2,393,600
Gunosy	7,200	1,478.00	10,641,600
デザインワン・ジャパン	2,000	302.00	604,000
イー・ガーディアン	5,200	2,019.00	10,498,800
リブセンス	6,600	292.00	1,927,200
ジャパンマテリアル	31,600	1,923.00	60,766,800
ベクトル	12,800	1,256.00	16,076,800
ウチヤマホールディングス	5,300	544.00	2,883,200
チャーム・ケア・コーポレーション	7,600	988.00	7,508,800
ライクキッズ	2,500	815.00	2,037,500
キャリアリンク	3,300	616.00	2,032,800
IBJ	7,000	1,369.00	9,583,000
アサンテ	4,100	2,020.00	8,282,000
N・フィールド	7,100	644.00	4,572,400
バリューHR	2,000	3,165.00	6,330,000
M&Aキャピタルパートナーズ	7,300	4,720.00	34,456,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	2,109.00	8,225,100
ERIホールディングス	2,900	770.00	2,233,000
アビスト	1,600	2,720.00	4,352,000
シグマクシス	7,000	2,133.00	14,931,000
ウィルグループ	6,700	1,276.00	8,549,200

エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	232.00	3,294,400	
リクルートホールディングス	735,100	4,214.00	3,097,711,400	
エラン	6,100	1,651.00	10,071,100	
ツガミ	22,000	1,210.00	26,620,000	
オークマ	12,400	5,540.00	68,696,000	
東芝機械	12,000	2,964.00	35,568,000	
アマダホールディングス	135,000	1,261.00	170,235,000	
アイダエンジニアリング	27,800	950.00	26,410,000	
滝澤鉄工所	3,300	1,389.00	4,583,700	
F U J I	45,600	2,042.00	93,115,200	
牧野フライス製作所	12,400	4,795.00	59,458,000	
オーエスジー	49,100	2,015.00	98,936,500	
ダイジェット工業	1,200	1,462.00	1,754,400	
旭ダイヤモンド工業	27,900	636.00	17,744,400	
D M G 森精機	67,200	1,677.00	112,694,400	
ソディック	24,900	970.00	24,153,000	
ディスコ	14,400	26,990.00	388,656,000	
日東工器	5,800	2,312.00	13,409,600	
日進工具	3,100	2,831.00	8,776,100	
パンチ工業	9,600	519.00	4,982,400	
富士ダイス	4,500	773.00	3,478,500	
土木管理総合試験所	4,400	452.00	1,988,800	
ネットマーケティング	3,700	957.00	3,540,900	
日本郵政	841,200	1,030.50	866,856,600	
ベルシステム24ホールディングス	17,200	1,650.00	28,380,000	
鎌倉新書	7,600	1,730.00	13,148,000	
S M N	1,600	908.00	1,452,800	
一蔵	1,100	806.00	886,600	
L I T A L I C O	3,500	2,596.00	9,086,000	
グローバルキッズCOMPANY	1,600	773.00	1,236,800	
エアトリ	4,600	1,957.00	9,002,200	
アトラエ	2,700	3,860.00	10,422,000	
ストライク	3,900	5,420.00	21,138,000	
ソラスト	28,300	1,237.00	35,007,100	
セラク	3,200	881.00	2,819,200	
インソース	5,000	3,485.00	17,425,000	
豊田自動織機	86,900	6,330.00	550,077,000	
豊和工業	5,800	858.00	4,976,400	
O K K	4,400	659.00	2,899,600	
石川製作所	2,600	1,776.00	4,617,600	
東洋機械金属	7,600	548.00	4,164,800	
津田駒工業	2,100	1,260.00	2,646,000	
エンシュウ	2,600	1,344.00	3,494,400	
島精機製作所	17,100	2,390.00	40,869,000	
オプトラ	11,800	3,205.00	37,819,000	
N C ホールディングス	3,300	695.00	2,293,500	
イワキ	5,100	1,277.00	6,512,700	
フリー	10,400	1,183.00	12,303,200	
ヤマシンフィルタ	23,100	861.00	19,889,100	
日阪製作所	13,100	959.00	12,562,900	

やまびこ	20,600	1,131.00	23,298,600
平田機工	5,000	7,260.00	36,300,000
ペガサスミシン製造	10,700	501.00	5,360,700
マルマエ	4,400	970.00	4,268,000
タツモ	5,000	1,408.00	7,040,000
ナブテスコ	62,600	3,465.00	216,909,000
三井海洋開発	11,300	2,658.00	30,035,400
レオン自動機	10,400	1,583.00	16,463,200
S M C	33,700	53,950.00	1,818,115,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	622.00	5,784,600
ホソカワミクロン	3,700	4,765.00	17,630,500
ユニオンツール	4,000	3,320.00	13,280,000
オイレス工業	13,800	1,648.00	22,742,400
日精エー・エス・ビー機械	3,600	4,410.00	15,876,000
サトーホールディングス	15,100	3,340.00	50,434,000
技研製作所	9,300	4,680.00	43,524,000
日本エアーテック	3,400	805.00	2,737,000
カワタ	3,100	1,107.00	3,431,700
日精樹脂工業	8,900	1,008.00	8,971,200
オカダアイヨン	3,400	1,281.00	4,355,400
ワイエイシイホールディングス	4,600	738.00	3,394,800
小松製作所	486,400	2,642.00	1,285,068,800
住友重機械工業	61,500	3,140.00	193,110,000
日立建機	43,000	3,360.00	144,480,000
日工	14,700	807.00	11,862,900
巴工業	4,600	2,217.00	10,198,200
井関農機	10,800	1,614.00	17,431,200
T O W A	10,800	1,175.00	12,690,000
丸山製作所	2,200	1,186.00	2,609,200
北川鉄工所	4,800	2,338.00	11,222,400
シンニッタン	16,600	463.00	7,685,800
ローツェ	4,700	4,660.00	21,902,000
タカキタ	3,600	620.00	2,232,000
クボタ	569,700	1,722.00	981,023,400
荏原実業	2,700	2,304.00	6,220,800
東洋エンジニアリング	14,100	663.00	9,348,300
三菱化工機	3,700	1,913.00	7,078,100
月島機械	19,800	1,627.00	32,214,600
帝国電機製作所	8,800	1,467.00	12,909,600
東京機械製作所	4,600	365.00	1,679,000
新東工業	25,400	999.00	25,374,600
澁谷工業	9,400	3,050.00	28,670,000
アイチコーポレーション	18,600	757.00	14,080,200
小森コーポレーション	27,200	1,105.00	30,056,000
鶴見製作所	8,400	1,933.00	16,237,200
住友精密工業	1,600	3,315.00	5,304,000
日本ギア工業	3,600	407.00	1,465,200
酒井重工業	2,000	2,806.00	5,612,000
荏原製作所	44,400	3,385.00	150,294,000



石井鐵工所	1,400	2,688.00	3,763,200	
西島製作所	10,900	913.00	9,951,700	
北越工業	11,100	1,327.00	14,729,700	
ダイキン工業	136,800	15,580.00	2,131,344,000	
オルガノ	3,900	7,670.00	29,913,000	
トーヨーカネツ	4,700	2,279.00	10,711,300	
栗田工業	58,100	3,310.00	192,311,000	
椿本チエイン	15,300	3,820.00	58,446,000	
大同工業	5,200	806.00	4,191,200	
日機装	32,200	1,430.00	46,046,000	
木村化工機	8,900	692.00	6,158,800	
レイズネクスト	18,100	1,346.00	24,362,600	
アネスト岩田	16,700	1,042.00	17,401,400	
ダイフク	54,900	7,210.00	395,829,000	
サムコ	3,000	1,924.00	5,772,000	
加藤製作所	5,900	1,617.00	9,540,300	
油研工業	1,700	1,763.00	2,997,100	
タダノ	51,800	989.00	51,230,200	
フジテック	39,000	1,736.00	67,704,000	
C K D	29,900	2,022.00	60,457,800	
キトー	8,100	1,672.00	13,543,200	
平和	30,000	2,273.00	68,190,000	
理想科学工業	9,500	1,894.00	17,993,000	
S A N K Y O	23,900	3,770.00	90,103,000	
日本金銭機械	11,800	894.00	10,549,200	
マースグループホールディングス	6,800	2,028.00	13,790,400	
フクシマガリレイ	6,600	4,085.00	26,961,000	
オーイズミ	4,500	603.00	2,713,500	
ダイコク電機	4,900	1,655.00	8,109,500	
竹内製作所	17,900	1,895.00	33,920,500	
アマノ	28,100	3,285.00	92,308,500	
J U K I	14,900	855.00	12,739,500	
サンデンホールディングス	14,100	774.00	10,913,400	
蛇の目ミシン工業	9,900	417.00	4,128,300	
ブラザー工業	131,100	2,318.00	303,889,800	
マックス	16,400	2,133.00	34,981,200	
モリタホールディングス	18,800	1,720.00	32,336,000	
グローリー	27,600	3,380.00	93,288,000	
新晃工業	10,000	1,860.00	18,600,000	
大和冷機工業	15,600	1,183.00	18,454,800	
セガサミーホールディングス	106,500	1,597.00	170,080,500	
日本ピストンリング	3,900	1,567.00	6,111,300	
リケン	5,000	3,955.00	19,775,000	
T P R	14,400	2,039.00	29,361,600	
ツバキ・ナカシマ	21,900	1,435.00	31,426,500	
ホシザキ	31,400	9,990.00	313,686,000	
大豊工業	8,900	810.00	7,209,000	
日本精工	202,100	1,028.00	207,758,800	
N T N	248,500	343.00	85,235,500	
ジェイテクト	103,000	1,285.00	132,355,000	

不二越	10,000	4,685.00	46,850,000
ミネベアミツミ	199,300	2,405.00	479,316,500
日本トムソン	31,800	490.00	15,582,000
THK	62,500	3,170.00	198,125,000
ユーシン精機	8,300	1,044.00	8,665,200
前澤給装工業	3,900	2,264.00	8,829,600
イーグル工業	13,200	1,064.00	14,044,800
前澤工業	7,200	404.00	2,908,800
日本ビラー工業	10,900	1,544.00	16,829,600
キッツ	43,600	746.00	32,525,600
日立製作所	516,000	4,587.00	2,366,892,000
三菱電機	1,073,800	1,532.50	1,645,598,500
富士電機	64,700	3,330.00	215,451,000
東洋電機製造	4,300	1,559.00	6,703,700
安川電機	115,600	4,475.00	517,310,000
シンフォニアテクノロジー	13,900	1,356.00	18,848,400
明電舎	19,700	2,337.00	46,038,900
オリジン	2,900	1,686.00	4,889,400
山洋電気	5,200	5,530.00	28,756,000
デンヨー	9,200	2,078.00	19,117,600
ベйкаレント・コンサルティング	6,200	5,810.00	36,022,000
Orchestra Holdings	2,000	1,205.00	2,410,000
アイモバイル	3,200	776.00	2,483,200
キャリアインデックス	4,300	423.00	1,818,900
MS-Japan	3,300	1,583.00	5,223,900
船場	1,700	1,081.00	1,837,700
グレイステクノロジー	4,700	2,889.00	13,578,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,800	2,764.00	29,851,200
フルテック	1,200	1,349.00	1,618,800
グリーンズ	3,900	1,141.00	4,449,900
ツナググループ・ホールディングス	1,200	807.00	968,400
GAMEWITH	2,200	775.00	1,705,000
ソウルドアウト	1,600	1,958.00	3,132,800
MS&Consulting	1,400	1,023.00	1,432,200
日総工産	6,800	1,171.00	7,962,800
キュービーネットホールディングス	6,300	2,444.00	15,397,200
RPAホールディングス	5,800	1,034.00	5,997,200
三櫻工業	13,600	1,203.00	16,360,800
マキタ	140,000	4,105.00	574,700,000
東芝テック	13,400	4,545.00	60,903,000
芝浦メカトロニクス	1,900	3,970.00	7,543,000
マブチモーター	29,700	4,220.00	125,334,000
日本電産	129,200	15,540.00	2,007,768,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,600	492.00	3,247,200
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,719.00	10,657,800
東光高岳	6,000	1,194.00	7,164,000
ダブル・スコープ	16,400	1,041.00	17,072,400
宮越ホールディングス	4,000	1,095.00	4,380,000

ダイヘン	11,800	3,500.00	41,300,000
ヤーマン	15,600	737.00	11,497,200
JVCケンウッド	87,700	265.00	23,240,500
ミマキエンジニアリング	9,600	527.00	5,059,200
第一精工	3,900	2,644.00	10,311,600
日新電機	25,200	1,337.00	33,692,400
大崎電気工業	21,400	687.00	14,701,800
オムロン	96,300	6,540.00	629,802,000
日東工業	15,800	2,559.00	40,432,200
I D E C	15,500	2,264.00	35,092,000
正興電機製作所	2,500	995.00	2,487,500
不二電機工業	1,200	1,302.00	1,562,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35,800	2,400.00	85,920,000
サクサホールディングス	2,500	2,020.00	5,050,000
メルコホールディングス	3,700	3,005.00	11,118,500
テクノメディカ	2,400	2,054.00	4,929,600
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,800	965.00	1,737,000
日本電気	130,300	5,080.00	661,924,000
富士通	103,500	11,245.00	1,163,857,500
沖電気工業	43,600	1,488.00	64,876,800
岩崎通信機	4,700	846.00	3,976,200
電気興業	5,200	3,360.00	17,472,000
サンケン電気	11,700	3,385.00	39,604,500
ナカヨ	1,900	1,651.00	3,136,900
アイホン	6,100	1,817.00	11,083,700
ルネサスエレクトロニクス	512,800	811.00	415,880,800
セイコーエプソン	133,200	1,631.00	217,249,200
ワコム	72,200	461.00	33,284,200
アルバック	21,400	4,305.00	92,127,000
アクセル	4,500	1,035.00	4,657,500
E I Z O	8,300	3,885.00	32,245,500
ジャパンディスプレイ	310,500	76.00	23,598,000
日本信号	27,300	1,440.00	39,312,000
京三製作所	25,100	627.00	15,737,700
能美防災	14,200	2,429.00	34,491,800
ホーチキ	7,800	1,665.00	12,987,000
星和電機	5,300	581.00	3,079,300
エレコム	11,600	4,580.00	53,128,000
パナソニック	1,226,900	1,058.50	1,298,673,650
シャープ	124,200	1,711.00	212,506,200
アンリツ	69,100	2,222.00	153,540,200
富士通ゼネラル	29,100	2,590.00	75,369,000
ソニー	678,900	8,036.00	5,455,640,400
T D K	51,800	12,590.00	652,162,000
帝国通信工業	4,700	1,234.00	5,799,800
タムラ製作所	35,900	730.00	26,207,000
アルプスアルパイン	95,100	2,565.00	243,931,500
池上通信機	3,500	1,204.00	4,214,000
日本電波工業	9,800	553.00	5,419,400

鈴木	5,800	815.00	4,727,000
日本トリム	1,500	4,765.00	7,147,500
ローランド ディー・ジー	5,900	2,097.00	12,372,300
フォスター電機	11,300	1,960.00	22,148,000
SMK	2,800	3,180.00	8,904,000
ヨコオ	7,000	3,360.00	23,520,000
ティアック	8,100	216.00	1,749,600
ホシデン	29,400	1,392.00	40,924,800
ヒロセ電機	16,600	14,260.00	236,716,000
日本航空電子工業	24,600	2,292.00	56,383,200
TOA	11,500	1,135.00	13,052,500
マクセルホールディングス	23,100	1,499.00	34,626,900
古野電気	13,800	1,356.00	18,712,800
ユニデンホールディングス	3,000	1,989.00	5,967,000
スミダコーポレーション	8,300	1,247.00	10,350,100
アイコム	5,900	2,737.00	16,148,300
リオン	4,500	3,710.00	16,695,000
本多通信工業	9,200	585.00	5,382,000
船井電機	10,900	689.00	7,510,100
横河電機	98,500	2,044.00	201,334,000
新電元工業	3,800	3,770.00	14,326,000
アズビル	67,800	3,040.00	206,112,000
東亜ディーケーケー	5,300	1,038.00	5,501,400
日本光電工業	44,400	3,045.00	135,198,000
チノー	3,700	1,435.00	5,309,500
共和電業	11,300	435.00	4,915,500
日本電子材料	4,300	1,192.00	5,125,600
堀場製作所	21,300	7,330.00	156,129,000
アドバンテスト	79,800	6,330.00	505,134,000
小野測器	4,100	560.00	2,296,000
エスベック	9,500	2,266.00	21,527,000
キーエンス	97,300	40,470.00	3,937,731,000
日置電機	5,600	3,850.00	21,560,000
シスメックス	76,700	7,700.00	590,590,000
日本マイクロニクス	18,700	1,429.00	26,722,300
メガチップス	10,000	1,895.00	18,950,000
OBARA GROUP	5,600	3,750.00	21,000,000
IMAGICA GROUP	9,000	610.00	5,490,000
澤藤電機	1,300	2,310.00	3,003,000
デンソー	236,400	4,885.00	1,154,814,000
原田工業	5,100	1,020.00	5,202,000
コーセル	13,100	1,204.00	15,772,400
イリソ電子工業	9,000	4,750.00	42,750,000
オブテックスグループ	17,600	1,558.00	27,420,800
千代田インテグレ	5,000	2,171.00	10,855,000
アイ・オー・データ機器	4,000	1,070.00	4,280,000
レーザーテック	44,000	5,930.00	260,920,000
スタンレー電気	75,500	3,150.00	237,825,000
岩崎電気	4,200	1,507.00	6,329,400
ウシオ電機	62,400	1,761.00	109,886,400

岡谷電機産業	8,500	388.00	3,298,000
ヘリオス テクノ ホールディング	10,000	468.00	4,680,000
エノモト	3,200	1,380.00	4,416,000
日本セラミック	10,900	2,705.00	29,484,500
遠藤照明	5,500	722.00	3,971,000
古河電池	7,700	835.00	6,429,500
双信電機	5,300	496.00	2,628,800
山一電機	7,800	1,729.00	13,486,200
図研	7,000	2,636.00	18,452,000
日本電子	21,200	3,610.00	76,532,000
カシオ計算機	95,000	2,293.00	217,835,000
ファナック	102,000	20,915.00	2,133,330,000
日本シイエムケイ	25,300	607.00	15,357,100
エンプラス	5,500	3,370.00	18,535,000
大真空	3,900	1,910.00	7,449,000
ローム	47,700	9,030.00	430,731,000
浜松ホトニクス	77,000	4,575.00	352,275,000
三井ハイテック	11,900	1,724.00	20,515,600
新光電気工業	36,000	1,373.00	49,428,000
京セラ	151,100	7,721.00	1,166,643,100
協栄産業	1,200	1,490.00	1,788,000
太陽誘電	47,700	3,610.00	172,197,000
村田製作所	315,500	6,870.00	2,167,485,000
双葉電子工業	17,000	1,350.00	22,950,000
日東電工	74,100	6,220.00	460,902,000
北陸電気工業	4,300	1,336.00	5,744,800
東海理化電機製作所	28,300	2,083.00	58,948,900
ニチコン	36,400	1,078.00	39,239,200
日本ケミコン	8,200	2,018.00	16,547,600
K O A	16,200	1,386.00	22,453,200
三井E & Sホールディングス	38,800	949.00	36,821,200
日立造船	85,200	410.00	34,932,000
三菱重工業	180,000	4,300.00	774,000,000
川崎重工業	83,600	2,405.00	201,058,000
I H I	77,400	2,890.00	223,686,000
名村造船所	34,600	258.00	8,926,800
サノヤスホールディングス	13,400	180.00	2,412,000
スプリックス	3,500	1,142.00	3,997,000
マネジメントソリューションズ	1,100	3,155.00	3,470,500
日本車輛製造	3,900	3,190.00	12,441,000
三菱ロジスネクスト	14,200	1,510.00	21,442,000
近畿車輛	1,700	1,651.00	2,806,700
F P G	32,700	1,034.00	33,811,800
島根銀行	2,100	657.00	1,379,700
じもとホールディングス	72,000	112.00	8,064,000
全国保証	29,800	4,745.00	141,401,000
めぶきフィナンシャルグループ	550,100	265.00	145,776,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,300	1,424.00	20,363,200
九州フィナンシャルグループ	173,800	466.00	80,990,800
かんぽ生命保険	37,600	1,934.00	72,718,400

ゆうちょ銀行	300,200	1,033.00	310,106,600	
富山第一銀行	25,400	332.00	8,432,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	622,800	436.00	271,540,800	
ジェイリース	3,100	390.00	1,209,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,100	794.00	57,247,400	
マーキュリアインベストメント	4,700	751.00	3,529,700	
イントラスト	3,700	774.00	2,863,800	
日本モーゲージサービス	2,100	1,866.00	3,918,600	
CASA	3,700	1,482.00	5,483,400	
アルヒ	16,900	2,290.00	38,701,000	
プレミアグループ	5,700	2,257.00	12,864,900	
日産自動車	1,266,700	618.00	782,820,600	
いすゞ自動車	311,200	1,243.00	386,821,600	
トヨタ自動車	1,198,265	7,739.00	9,273,372,835	代用有価証券 250,000株
日野自動車	134,100	1,149.00	154,080,900	
三菱自動車工業	397,400	452.00	179,624,800	
エフテック	7,500	818.00	6,135,000	
レシップホールディングス	4,300	677.00	2,911,100	
GMB	2,000	801.00	1,602,000	
ファルテック	1,900	1,158.00	2,200,200	
武蔵精密工業	23,900	1,463.00	34,965,700	
日産車体	21,000	1,057.00	22,197,000	
新明和工業	28,900	1,469.00	42,454,100	
極東開発工業	19,900	1,551.00	30,864,900	
日信工業	21,800	2,231.00	48,635,800	
トピー工業	8,800	1,951.00	17,168,800	
ティラド	3,900	1,956.00	7,628,400	
曙ブレーキ工業	59,000	247.00	14,573,000	
タチエス	17,600	1,407.00	24,763,200	
NOK	57,700	1,615.00	93,185,500	
フタバ産業	29,900	718.00	21,468,200	
KYB	12,000	3,160.00	37,920,000	
市光工業	16,100	720.00	11,592,000	
大同メタル工業	20,600	728.00	14,996,800	
プレス工業	53,300	405.00	21,586,500	
ミクニ	13,700	347.00	4,753,900	
太平洋工業	22,500	1,494.00	33,615,000	
ケーヒン	24,700	2,574.00	63,577,800	
河西工業	14,500	823.00	11,933,500	
アイシン精機	88,400	3,905.00	345,202,000	
マツダ	315,900	959.00	302,948,100	
今仙電機製作所	10,000	951.00	9,510,000	
本田技研工業	845,500	3,074.00	2,599,067,000	
スズキ	212,900	4,637.00	987,217,300	
SUBARU	333,400	2,677.00	892,511,800	
安永	5,200	1,219.00	6,338,800	
ヤマハ発動機	140,000	2,129.00	298,060,000	

ショーワ	25,300	2,278.00	57,633,400
小糸製作所	64,300	5,040.00	324,072,000
T B K	12,800	494.00	6,323,200
エクセディ	14,600	2,414.00	35,244,400
ミツバ	19,700	687.00	13,533,900
豊田合成	34,700	2,758.00	95,702,600
愛三工業	16,900	748.00	12,641,200
盟和産業	1,600	1,139.00	1,822,400
日本プラスト	8,400	721.00	6,056,400
ヨロズ	10,000	1,460.00	14,600,000
エフ・シー・シー	17,500	2,342.00	40,985,000
新家工業	2,400	1,473.00	3,535,200
シマノ	40,200	17,390.00	699,078,000
テイ・エス テック	24,900	3,330.00	82,917,000
関西みらいフィナンシャルグループ	62,200	666.00	41,425,200
三十三フィナンシャルグループ	9,800	1,653.00	16,199,400
第四北越フィナンシャルグループ	18,400	2,909.00	53,525,600
ジャムコ	5,400	1,467.00	7,921,800
小野建	9,500	1,403.00	13,328,500
はるやまホールディングス	4,400	876.00	3,854,400
南陽	2,100	1,912.00	4,015,200
ノジマ	18,800	2,217.00	41,679,600
佐島電機	7,800	922.00	7,191,600
カッパ・クリエイト	14,900	1,503.00	22,394,700
エコートレーディング	2,300	572.00	1,315,600
伯東	6,500	1,341.00	8,716,500
コンドーテック	8,200	1,160.00	9,512,000
中山福	6,100	549.00	3,348,900
ライトオン	7,900	584.00	4,613,600
ナガイレーベン	15,300	2,345.00	35,878,500
ジーンズメイト	3,300	310.00	1,023,000
三菱食品	11,600	3,165.00	36,714,000
良品計画	140,400	2,128.00	298,771,200
三城ホールディングス	11,300	302.00	3,412,600
松田産業	7,800	1,593.00	12,425,400
第一興商	15,700	5,620.00	88,234,000
メディカルホールディングス	114,200	2,438.00	278,419,600
アドヴァン	16,200	1,222.00	19,796,400
S P K	2,200	2,870.00	6,314,000
萩原電気ホールディングス	4,000	2,750.00	11,000,000
アルビス	4,000	2,249.00	8,996,000
アズワン	6,900	10,050.00	69,345,000
スズデン	3,700	1,479.00	5,472,300
尾家産業	3,000	1,467.00	4,401,000
シモジマ	6,500	1,191.00	7,741,500
ドウシシャ	10,000	1,702.00	17,020,000
小津産業	2,300	1,804.00	4,149,200
コナカ	12,600	420.00	5,292,000
高速	6,300	1,242.00	7,824,600
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,667.00	2,167,100

G - 7ホールディングス	6,200	2,488.00	15,425,600	
たけびし	3,400	1,480.00	5,032,000	
イオン北海道	10,700	793.00	8,485,100	
コジマ	18,200	551.00	10,028,200	
ヒマラヤ	3,400	848.00	2,883,200	
コーナン商事	15,000	2,455.00	36,825,000	
ネットワンシステムズ	40,200	2,854.00	114,730,800	
エコス	3,900	1,727.00	6,735,300	
ワタミ	12,500	1,289.00	16,112,500	
マルシェ	2,800	782.00	2,189,600	
リックス	2,300	1,737.00	3,995,100	
システムソフト	25,800	104.00	2,683,200	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	253,500	1,867.00	473,284,500	
丸文	9,400	632.00	5,940,800	
西松屋チェーン	23,200	937.00	21,738,400	
ゼンショーホールディングス	50,700	2,503.00	126,902,100	
ハビネット	8,900	1,398.00	12,442,200	
幸楽苑ホールディングス	6,700	2,218.00	14,860,600	
ハークスレイ	2,000	1,324.00	2,648,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	1,910.00	4,011,000	
日本ライフライン	31,300	1,494.00	46,762,200	
サイゼリヤ	17,400	2,639.00	45,918,600	
タカショー	5,300	525.00	2,782,500	
エクセル	3,000	1,592.00	4,776,000	
V Tホールディングス	44,000	471.00	20,724,000	
マルカ	3,700	2,290.00	8,473,000	
アルゴグラフィックス	8,900	3,415.00	30,393,500	
魚力	2,900	1,588.00	4,605,200	
I D O M	28,600	576.00	16,473,600	
日本エム・ディ・エム	6,200	2,595.00	16,089,000	
ポブラ	2,700	507.00	1,368,900	
フジ・コーポレーション	2,800	2,198.00	6,154,400	
ユナイテッドアローズ	11,100	2,920.00	32,412,000	
進和	6,300	2,366.00	14,905,800	
エスケイジャパン	2,200	481.00	1,058,200	
ダイトロン	4,500	1,979.00	8,905,500	
ハイデイ日高	15,300	2,013.00	30,798,900	
シークス	13,400	1,463.00	19,604,200	
京都きもの友禅	6,900	352.00	2,428,800	
コロワイド	35,200	2,305.00	81,136,000	
ピーシーデポコーポレーション	14,000	587.00	8,218,000	
田中商事	3,400	779.00	2,648,600	
オーハシテクニカ	6,000	1,635.00	9,810,000	
壱番屋	7,400	5,930.00	43,882,000	
白銅	3,800	1,543.00	5,863,400	
トップカルチャー	4,100	337.00	1,381,700	
P L A N T	2,900	620.00	1,798,000	
スギホールディングス	21,100	5,680.00	119,848,000	
薬王堂ホールディングス	4,600	2,320.00	10,672,000	



島津製作所	128,300	3,395.00	435,578,500
JMS	9,100	787.00	7,161,700
クボテック	2,700	406.00	1,096,200
長野計器	7,800	940.00	7,332,000
ブイ・テクノロジー	5,000	5,390.00	26,950,000
スター精密	16,500	1,536.00	25,344,000
東京計器	6,800	1,082.00	7,357,600
愛知時計電機	1,300	4,405.00	5,726,500
インターアクション	5,800	3,070.00	17,806,000
オーバル	10,200	256.00	2,611,200
東京精密	19,400	4,310.00	83,614,000
マニー	42,800	3,035.00	129,898,000
ニコン	173,700	1,387.00	240,921,900
トプコン	54,100	1,688.00	91,320,800
オリンパス	594,200	1,733.50	1,030,045,700
理研計器	9,500	2,241.00	21,289,500
SCREENホールディングス	18,600	8,150.00	151,590,000
キヤノン電子	11,300	2,074.00	23,436,200
タムロン	8,700	2,609.00	22,698,300
HOYA	214,500	10,730.00	2,301,585,000
シード	4,600	1,114.00	5,124,400
ノーリツ鋼機	7,200	1,490.00	10,728,000
エー・アンド・デイ	9,800	1,056.00	10,348,800
朝日インテック	91,200	3,300.00	300,960,000
キヤノン	578,100	3,079.00	1,779,969,900
リコー	273,200	1,265.00	345,598,000
シチズン時計	125,700	581.00	73,031,700
リズム時計工業	3,400	953.00	3,240,200
大研医器	7,500	721.00	5,407,500
メニコン	14,700	4,760.00	69,972,000
シンシア	1,100	640.00	704,000
中本パックス	2,700	1,652.00	4,460,400
スノーピーク	5,000	1,117.00	5,585,000
パラマウントベッドホールディングス	11,300	4,635.00	52,375,500
トランザクション	6,900	1,121.00	7,734,900
粧美堂	3,100	395.00	1,224,500
ニホンフラッシュ	5,000	2,870.00	14,350,000
前田工織	11,800	2,199.00	25,948,200
永大産業	14,300	350.00	5,005,000
アートネイチャー	11,500	854.00	9,821,000
バンダイナムコホールディングス	111,000	6,695.00	743,145,000
アイフィスジャパン	2,800	757.00	2,119,600
共立印刷	18,400	172.00	3,164,800
SHOEI	5,200	5,130.00	26,676,000
フランスベッドホールディングス	15,300	971.00	14,856,300
マーベラス	16,100	723.00	11,640,300
パイロットコーポレーション	17,500	4,450.00	77,875,000
萩原工業	6,000	1,660.00	9,960,000
エイベックス	18,100	1,244.00	22,516,400
トッパン・フォームズ	23,000	1,171.00	26,933,000

フジシールインターナショナル	24,100	2,373.00	57,189,300
タカラトミー	48,200	1,289.00	62,129,800
廣濟堂	7,500	805.00	6,037,500
エステールホールディングス	2,700	687.00	1,854,900
アーク	40,700	94.00	3,825,800
レック	11,500	1,294.00	14,881,000
タカノ	4,100	800.00	3,280,000
三光合成	12,500	377.00	4,712,500
プロネクサス	9,200	1,247.00	11,472,400
ホクシン	7,100	159.00	1,128,900
ウッドワン	3,400	1,262.00	4,290,800
大建工業	7,200	1,924.00	13,852,800
きもと	18,600	179.00	3,329,400
凸版印刷	151,500	2,228.00	337,542,000
大日本印刷	140,500	2,977.00	418,268,500
共同印刷	3,300	3,000.00	9,900,000
N I S S H A	22,100	1,099.00	24,287,900
光村印刷	900	1,772.00	1,594,800
藤森工業	9,700	3,500.00	33,950,000
ヴィア・ホールディングス	13,000	677.00	8,801,000
TAKARA & COMPANY	5,200	1,728.00	8,985,600
前澤化成工業	6,900	1,194.00	8,238,600
未来工業	5,800	2,171.00	12,591,800
アシックス	88,600	1,620.00	143,532,000
ツツミ	3,400	2,161.00	7,347,400
ウェーブロックホールディングス	3,800	835.00	3,173,000
J S P	6,300	1,903.00	11,988,900
ニチハ	15,000	2,513.00	37,695,000
エフピコ	11,800	6,600.00	77,880,000
小松ウオール工業	3,300	2,211.00	7,296,300
ヤマハ	63,900	6,150.00	392,985,000
河合楽器製作所	3,300	3,895.00	12,853,500
クリナップ	10,100	737.00	7,443,700
ビジョン	64,900	4,200.00	272,580,000
天馬	7,200	1,999.00	14,392,800
オリバー	2,300	3,615.00	8,314,500
兼松サステック	700	1,814.00	1,269,800
キングジム	9,000	882.00	7,938,000
象印マホービン	31,500	2,201.00	69,331,500
リンテック	25,500	2,401.00	61,225,500
信越ポリマー	19,300	1,045.00	20,168,500
東リ	26,900	300.00	8,070,000
イトーキ	22,900	504.00	11,541,600
任天堂	65,800	43,200.00	2,842,560,000
三菱鉛筆	17,700	1,658.00	29,346,600
松風	4,900	1,908.00	9,349,200
タカラスタANDARD	22,200	1,935.00	42,957,000
コクヨ	51,500	1,658.00	85,387,000
ナカバヤシ	10,600	623.00	6,603,800
ニフコ	39,400	2,977.00	117,293,800

立川ブラインド工業	4,700	1,329.00	6,246,300
グロープライド	4,800	2,544.00	12,211,200
オカムラ	37,500	1,095.00	41,062,500
バルカー	8,700	2,525.00	21,967,500
MUTOHホールディングス	1,400	1,697.00	2,375,800
伊藤忠商事	739,800	2,580.50	1,909,053,900
丸紅	1,100,800	821.80	904,637,440
スクロール	16,200	384.00	6,220,800
高島	1,600	2,003.00	3,204,800
ヨンドシーホールディングス	10,800	2,506.00	27,064,800
三陽商会	5,500	1,340.00	7,370,000
長瀬産業	59,600	1,596.00	95,121,600
ナイガイ	3,900	462.00	1,801,800
蝶理	6,800	2,138.00	14,538,400
豊田通商	118,000	3,795.00	447,810,000
オンワードホールディングス	63,100	631.00	39,816,100
三共生興	16,100	598.00	9,627,800
兼松	39,400	1,445.00	56,933,000
美津濃	9,800	2,709.00	26,548,200
ツカモトコーポレーション	1,800	1,123.00	2,021,400
ファミリーマート	84,500	2,738.00	231,361,000
ルックホールディングス	3,600	1,177.00	4,237,200
三井物産	929,700	1,972.50	1,833,833,250
日本紙パルプ商事	6,000	4,160.00	24,960,000
東京エレクトロン	71,600	25,300.00	1,811,480,000
日立ハイテクノロジーズ	36,700	7,890.00	289,563,000
カメイ	13,800	1,215.00	16,767,000
東都水産	1,400	2,741.00	3,837,400
OUGホールディングス	1,600	2,687.00	4,299,200
スターゼン	3,900	4,315.00	16,828,500
セイコーホールディングス	15,200	2,956.00	44,931,200
山善	41,200	1,064.00	43,836,800
椿本興業	2,000	4,225.00	8,450,000
住友商事	667,300	1,623.50	1,083,361,550
日本ユニシス	32,900	3,500.00	115,150,000
内田洋行	4,500	7,840.00	35,280,000
三菱商事	742,200	2,907.00	2,157,575,400
第一実業	5,200	3,665.00	19,058,000
キヤノンマーケティングジャパン	30,200	2,549.00	76,979,800
西華産業	6,000	1,348.00	8,088,000
佐藤商事	8,700	985.00	8,569,500
菱洋エレクトロ	10,700	2,070.00	22,149,000
東京産業	9,600	635.00	6,096,000
ユアサ商事	10,000	3,585.00	35,850,000
神鋼商事	2,600	2,738.00	7,118,800
小林産業	6,200	302.00	1,872,400
阪和興業	19,800	2,829.00	56,014,200
正栄食品工業	6,800	3,995.00	27,166,000
カナデン	8,600	1,401.00	12,048,600
菱電商事	7,600	1,676.00	12,737,600

ニプロ	74,400	1,286.00	95,678,400
フルサト工業	5,900	1,739.00	10,260,100
岩谷産業	23,500	3,675.00	86,362,500
すてきナイスグループ	4,500	1,274.00	5,733,000
昭光通商	3,500	722.00	2,527,000
ニチモウ	1,700	1,993.00	3,388,100
極東貿易	3,000	2,180.00	6,540,000
イワキ	14,000	499.00	6,986,000
兼松エレクトロニクス	5,700	3,595.00	20,491,500
三愛石油	26,000	1,139.00	29,614,000
稲畑産業	23,200	1,579.00	36,632,800
G S Iクレオス	2,600	1,309.00	3,403,400
明和産業	9,800	607.00	5,948,600
クワザワ	3,800	711.00	2,701,800
キムラタン	56,800	29.00	1,647,200
ゴールドウイン	19,100	8,040.00	153,564,000
ユニ・チャーム	207,000	3,839.00	794,673,000
デサント	20,500	2,037.00	41,758,500
キング	5,000	558.00	2,790,000
ワキタ	22,600	1,089.00	24,611,400
ヤマトインターナショナル	6,200	407.00	2,523,400
東邦ホールディングス	34,000	2,424.00	82,416,000
サンゲツ	29,100	2,036.00	59,247,600
ミツウロコグループホールディングス	15,600	1,178.00	18,376,800
シナネンホールディングス	4,400	1,934.00	8,509,600
伊藤忠エネクス	23,500	907.00	21,314,500
サンリオ	29,700	2,154.00	63,973,800
サンワテクノス	7,500	1,144.00	8,580,000
リョーサン	11,700	2,730.00	31,941,000
新光商事	16,700	905.00	15,113,500
トーヨー	4,800	1,949.00	9,355,200
三信電気	5,700	1,770.00	10,089,000
東陽テクニカ	12,200	1,315.00	16,043,000
モスフードサービス	13,900	2,999.00	41,686,100
加賀電子	10,500	2,519.00	26,449,500
三益半導体工業	9,500	2,291.00	21,764,500
ソーダニッカ	10,600	632.00	6,699,200
立花エレテック	7,800	1,831.00	14,281,800
木曽路	13,800	2,946.00	40,654,800
S R Sホールディングス	12,500	1,049.00	13,112,500
千趣会	19,100	469.00	8,957,900
タカキュー	8,700	186.00	1,618,200
ケーヨー	21,700	551.00	11,956,700
上新電機	12,500	2,484.00	31,050,000
日本瓦斯	16,700	3,295.00	55,026,500
ロイヤルホールディングス	18,500	2,452.00	45,362,000
東天紅	800	1,313.00	1,050,400
いなげや	13,100	1,461.00	19,139,100
島忠	19,900	3,265.00	64,973,500
チヨダ	11,100	1,549.00	17,193,900

ライフコーポレーション	8,000	2,430.00	19,440,000
リンガーハット	13,000	2,546.00	33,098,000
MrMaxHD	14,600	473.00	6,905,800
テンアライド	9,600	444.00	4,262,400
AOKIホールディングス	21,200	1,075.00	22,790,000
オークワ	16,600	1,462.00	24,269,200
コメリ	16,300	2,234.00	36,414,200
青山商事	21,900	1,514.00	33,156,600
しまむら	12,300	8,190.00	100,737,000
はせがわ	5,200	402.00	2,090,400
高島屋	77,100	1,220.00	94,062,000
松屋	21,300	834.00	17,764,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,100	1,194.00	59,819,400
近鉄百貨店	3,900	3,825.00	14,917,500
パルコ	10,100	1,848.00	18,664,800
丸井グループ	96,900	2,737.00	265,215,300
クレディセゾン	74,200	1,899.00	140,905,800
アクシアル リテイリング	8,800	3,770.00	33,176,000
井筒屋	6,000	256.00	1,536,000
イオン	407,000	2,339.00	951,973,000
イズミ	21,500	3,830.00	82,345,000
フォーバル	4,700	1,195.00	5,616,500
平和堂	21,500	2,032.00	43,688,000
フジ	12,800	1,833.00	23,462,400
ヤオコー	12,000	5,520.00	66,240,000
ゼビオホールディングス	12,800	1,252.00	16,025,600
ケーズホールディングス	102,000	1,418.00	144,636,000
PALTAC	17,000	5,540.00	94,180,000
三谷産業	14,200	341.00	4,842,200
Olympicグループ	5,500	643.00	3,536,500
日産東京販売ホールディングス	16,100	285.00	4,588,500
新生銀行	77,800	1,632.00	126,969,600
あおぞら銀行	63,100	2,930.00	184,883,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,291,100	579.00	4,221,546,900
りそなホールディングス	1,162,300	468.30	544,305,090
三井住友トラスト・ホールディングス	200,200	4,219.00	844,643,800
三井住友フィナンシャルグループ	732,500	3,998.00	2,928,535,000
千葉銀行	364,200	633.00	230,538,600
群馬銀行	208,000	371.00	77,168,000
武蔵野銀行	15,800	1,782.00	28,155,600
千葉興業銀行	29,000	375.00	10,875,000
筑波銀行	44,100	225.00	9,922,500
七十七銀行	35,700	1,721.00	61,439,700
青森銀行	8,200	2,781.00	22,804,200
秋田銀行	6,800	2,118.00	14,402,400
山形銀行	11,900	1,520.00	18,088,000
岩手銀行	7,000	2,716.00	19,012,000
東邦銀行	94,800	255.00	24,174,000
東北銀行	5,100	1,033.00	5,268,300
みちのく銀行	6,900	1,479.00	10,205,100

ふくおかフィナンシャルグループ	89,200	2,040.00	181,968,000	
静岡銀行	262,200	794.00	208,186,800	
十六銀行	13,300	2,418.00	32,159,400	
スルガ銀行	108,400	457.00	49,538,800	
八十二銀行	255,500	447.00	114,208,500	
山梨中央銀行	12,300	1,113.00	13,689,900	
大垣共立銀行	21,000	2,286.00	48,006,000	
福井銀行	9,000	1,805.00	16,245,000	
北國銀行	10,900	3,250.00	35,425,000	
清水銀行	4,400	2,170.00	9,548,000	
富山銀行	2,000	2,287.00	4,574,000	
滋賀銀行	21,200	2,689.00	57,006,800	
南都銀行	17,600	2,673.00	47,044,800	
百五銀行	95,400	332.00	31,672,800	
京都銀行	37,900	4,575.00	173,392,500	
紀陽銀行	37,500	1,591.00	59,662,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	70,400	1,100.00	77,440,000	
広島銀行	156,400	510.00	79,764,000	
山陰合同銀行	62,800	633.00	39,752,400	
中国銀行	91,100	1,037.00	94,470,700	
鳥取銀行	3,700	1,362.00	5,039,400	
伊予銀行	151,000	597.00	90,147,000	
百十四銀行	11,300	2,046.00	23,119,800	
四国銀行	16,100	986.00	15,874,600	
阿波銀行	17,300	2,338.00	40,447,400	
大分銀行	6,100	2,676.00	16,323,600	
宮崎銀行	7,000	2,563.00	17,941,000	
佐賀銀行	6,400	1,648.00	10,547,200	
沖縄銀行	9,700	3,490.00	33,853,000	
琉球銀行	24,400	1,120.00	27,328,000	
セブン銀行	353,800	337.00	119,230,600	
みずほフィナンシャルグループ	14,393,200	166.60	2,397,907,120	
高知銀行	3,900	877.00	3,420,300	
山口フィナンシャルグループ	132,200	697.00	92,143,400	
芙蓉総合リース	11,100	7,220.00	80,142,000	
みずほリース	16,300	3,380.00	55,094,000	
東京センチュリー	21,300	5,740.00	122,262,000	
SBIホールディングス	118,300	2,417.00	285,931,100	
日本証券金融	46,700	520.00	24,284,000	
アイフル	161,700	300.00	48,510,000	
日本アジア投資	9,100	276.00	2,511,600	
長野銀行	3,500	1,619.00	5,666,500	
名古屋銀行	8,600	3,180.00	27,348,000	
北洋銀行	159,500	226.00	36,047,000	
愛知銀行	3,800	3,645.00	13,851,000	
中京銀行	4,400	2,210.00	9,724,000	
大光銀行	3,700	1,688.00	6,245,600	
愛媛銀行	14,800	1,126.00	16,664,800	
トマト銀行	4,100	1,064.00	4,362,400	
京葉銀行	45,100	598.00	26,969,800	

栃木銀行	51,000	223.00	11,373,000
北日本銀行	3,300	2,230.00	7,359,000
東和銀行	18,600	840.00	15,624,000
福島銀行	10,200	264.00	2,692,800
大東銀行	5,500	636.00	3,498,000
リコーリース	8,300	4,220.00	35,026,000
イオンフィナンシャルサービス	64,800	1,717.00	111,261,600
アコム	212,800	514.00	109,379,200
ジャックス	11,700	2,761.00	32,303,700
オリエントコーポレーション	286,700	171.00	49,025,700
日立キャピタル	24,900	3,035.00	75,571,500
アプラスフィナンシャル	51,700	97.00	5,014,900
オリックス	662,500	1,853.00	1,227,612,500
三菱UFJリース	268,800	697.00	187,353,600
ジャフコ	16,300	4,230.00	68,949,000
九州リースサービス	4,900	601.00	2,944,900
トモニホールディングス	81,900	400.00	32,760,000
大和証券グループ本社	849,700	577.70	490,871,690
野村ホールディングス	1,863,600	580.70	1,082,192,520
岡三証券グループ	90,200	391.00	35,268,200
丸三証券	31,400	489.00	15,354,600
東洋証券	38,200	148.00	5,653,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	121,500	346.00	42,039,000
光世証券	2,500	655.00	1,637,500
水戸証券	31,000	219.00	6,789,000
いちよし証券	19,800	648.00	12,830,400
松井証券	60,500	888.00	53,724,000
SOMPOホールディングス	199,200	4,213.00	839,229,600
だいこう証券ビジネス	5,100	672.00	3,427,200
日本取引所グループ	304,000	2,017.00	613,168,000
マネックスグループ	80,000	284.00	22,720,000
極東証券	14,300	762.00	10,896,600
岩井コスモホールディングス	9,900	1,300.00	12,870,000
藍澤証券	19,000	730.00	13,870,000
フィデアホールディングス	103,000	131.00	13,493,000
池田泉州ホールディングス	122,200	201.00	24,562,200
アニコムホールディングス	8,800	3,685.00	32,428,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	277,000	3,670.00	1,016,590,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	87,000	2,639.00	229,593,000
マネーパートナーズグループ	11,600	246.00	2,853,600
スパークス・グループ	36,600	275.00	10,065,000
小林洋行	3,100	268.00	830,800
第一生命ホールディングス	599,300	1,747.00	1,046,977,100
東京海上ホールディングス	378,700	6,147.00	2,327,868,900
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	1,015.00	5,278,000
イー・ギャランティ	11,400	1,276.00	14,546,400
アサックス	5,600	748.00	4,188,800

NECキャピタルソリューション	4,300	2,504.00	10,767,200	
T&Dホールディングス	316,500	1,321.00	418,096,500	
アドバンスクリエイト	2,400	1,833.00	4,399,200	
三井不動産	522,400	2,767.00	1,445,480,800	
三菱地所	742,200	2,097.50	1,556,764,500	
平和不動産	19,400	3,065.00	59,461,000	
東京建物	115,700	1,723.00	199,351,100	
ダイビル	27,300	1,295.00	35,353,500	
京阪神ビルディング	17,200	1,385.00	23,822,000	
住友不動産	238,100	3,830.00	911,923,000	
太平洋興発	4,000	810.00	3,240,000	
テーオーシー	20,800	909.00	18,907,200	
東京楽天地	1,400	6,180.00	8,652,000	
レオパレス21	138,800	388.00	53,854,400	
スターツコーポレーション	14,400	2,722.00	39,196,800	
フジ住宅	12,400	694.00	8,605,600	
空港施設	10,900	552.00	6,016,800	
明和地所	5,900	634.00	3,740,600	
ゴールドクレスト	8,400	2,108.00	17,707,200	
リログループ	56,100	3,015.00	169,141,500	
エスリード	4,100	2,068.00	8,478,800	
日神グループホールディングス	15,600	547.00	8,533,200	
日本エスコン	19,100	933.00	17,820,300	
タカラレーベン	48,500	490.00	23,765,000	
AVANTIA	6,000	1,045.00	6,270,000	
イオンモール	53,100	1,869.00	99,243,900	
毎日コムネット	2,300	944.00	2,171,200	
ファースト住建	4,500	1,245.00	5,602,500	
ランド	578,000	12.00	6,936,000	
カチタス	13,100	4,685.00	61,373,500	
東祥	6,400	2,401.00	15,366,400	
トーセイ	14,600	1,420.00	20,732,000	
穴吹興産	2,200	1,738.00	3,823,600	
サンフロンティア不動産	14,700	1,313.00	19,301,100	
エフ・ジェー・ネクスト	9,300	1,125.00	10,462,500	
インテリックス	3,100	756.00	2,343,600	
ランドビジネス	4,200	729.00	3,061,800	
日本社宅サービス	2,700	1,134.00	3,061,800	
グランディハウス	8,400	499.00	4,191,600	
東武鉄道	113,300	3,975.00	450,367,500	
相鉄ホールディングス	34,300	2,952.00	101,253,600	
東急	270,900	1,971.00	533,943,900	
京浜急行電鉄	137,900	2,111.00	291,106,900	
小田急電鉄	159,700	2,549.00	407,075,300	
京王電鉄	55,700	6,550.00	364,835,000	
京成電鉄	74,700	4,350.00	324,945,000	
富士急行	14,600	4,080.00	59,568,000	
新京成電鉄	2,800	2,371.00	6,638,800	
東日本旅客鉄道	189,000	9,958.00	1,882,062,000	
西日本旅客鉄道	95,700	9,455.00	904,843,500	



東海旅客鉄道	89,300	21,945.00	1,959,688,500	
西武ホールディングス	144,200	1,834.00	264,462,800	
鴻池運輸	17,100	1,606.00	27,462,600	
西日本鉄道	29,800	2,483.00	73,993,400	
ハマキョウレックス	8,200	3,510.00	28,782,000	
サカイ引越センター	5,600	6,670.00	37,352,000	
近鉄グループホールディングス	101,700	6,000.00	610,200,000	
阪急阪神ホールディングス	135,600	4,705.00	637,998,000	
南海電気鉄道	48,200	2,982.00	143,732,400	
京阪ホールディングス	45,300	5,350.00	242,355,000	
神戸電鉄	2,400	3,985.00	9,564,000	
名古屋鉄道	83,700	3,395.00	284,161,500	
山陽電気鉄道	7,300	2,190.00	15,987,000	
トランコム	2,800	8,020.00	22,456,000	
日本通運	35,900	6,370.00	228,683,000	
ヤマトホールディングス	178,300	1,861.00	331,816,300	
山九	28,300	5,590.00	158,197,000	
日新	8,800	1,814.00	15,963,200	
丸運	5,800	337.00	1,954,600	
丸全昭和運輸	8,300	3,095.00	25,688,500	
センコーグループホールディングス	56,100	910.00	51,051,000	
トナミホールディングス	2,400	5,090.00	12,216,000	
ニッコンホールディングス	36,400	2,640.00	96,096,000	
日本石油輸送	1,100	2,912.00	3,203,200	
福山通運	13,000	3,940.00	51,220,000	
セイノーホールディングス	76,200	1,438.00	109,575,600	
エスライン	3,000	1,022.00	3,066,000	
神奈川中央交通	2,500	4,030.00	10,075,000	
日立物流	18,700	3,205.00	59,933,500	
丸和運輸機関	10,700	2,411.00	25,797,700	
C & F ロジホールディングス	10,300	1,366.00	14,069,800	
日本郵船	85,000	1,932.00	164,220,000	
商船三井	64,300	2,938.00	188,913,400	
川崎汽船	31,300	1,693.00	52,990,900	
NSユナイテッド海運	5,600	2,134.00	11,950,400	
明治海運	10,000	380.00	3,800,000	
飯野海運	48,000	361.00	17,328,000	
共栄タンカー	1,800	994.00	1,789,200	
九州旅客鉄道	90,700	3,665.00	332,415,500	
SGホールディングス	106,800	2,438.00	260,378,400	
日本航空	183,100	3,445.00	630,779,500	
ANAホールディングス	185,900	3,590.00	667,381,000	
パスコ	2,000	2,065.00	4,130,000	
西本Wismettacホールディングス	1,900	3,615.00	6,868,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	900	2,310.00	2,079,000	
Genky DrugStores	5,200	2,314.00	12,032,800	
国際紙パルプ商事	25,200	296.00	7,459,200	
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	1,354.00	2,437,200	
総合メディカルホールディングス	9,200	2,063.00	18,979,600	

ブックオフグループホールディングス	6,200	990.00	6,138,000	
三菱倉庫	32,300	2,804.00	90,569,200	
三井倉庫ホールディングス	11,600	1,980.00	22,968,000	
住友倉庫	37,400	1,495.00	55,913,000	
澁澤倉庫	5,600	2,325.00	13,020,000	
ヤマタネ	5,300	1,596.00	8,458,800	
東陽倉庫	18,500	331.00	6,123,500	
乾汽船	5,900	1,152.00	6,796,800	
日本トランスシティ	22,400	534.00	11,961,600	
ケイヒン	1,800	1,338.00	2,408,400	
中央倉庫	6,300	1,195.00	7,528,500	
川西倉庫	1,900	1,042.00	1,979,800	
安田倉庫	8,400	1,042.00	8,752,800	
ファイズホールディングス	2,200	529.00	1,163,800	
東洋埠頭	3,000	1,400.00	4,200,000	
宇徳	8,500	584.00	4,964,000	
上組	58,300	2,375.00	138,462,500	
サンリツ	2,300	736.00	1,692,800	
キムラユニティー	2,700	1,142.00	3,083,400	
キューソー流通システム	2,600	1,875.00	4,875,000	
近鉄エクスプレス	21,600	1,882.00	40,651,200	
東海運	5,700	292.00	1,664,400	
エーアイティー	7,200	1,058.00	7,617,600	
内外トランスライン	3,600	1,387.00	4,993,200	
ショーエイコーポレーション	1,200	788.00	945,600	
日本コンセプト	3,200	1,551.00	4,963,200	
東京放送ホールディングス	64,100	1,895.00	121,469,500	
日本テレビホールディングス	87,900	1,465.00	128,773,500	
朝日放送グループホールディングス	10,400	760.00	7,904,000	
テレビ朝日ホールディングス	28,900	2,024.00	58,493,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	69,300	476.00	32,986,800	
テレビ東京ホールディングス	8,600	2,444.00	21,018,400	
日本BS放送	3,600	1,165.00	4,194,000	
ビジョン	9,800	1,850.00	18,130,000	
スマートパリュー	3,100	806.00	2,498,600	
USEN-NEXT HOLDINGS	4,000	1,782.00	7,128,000	
ワイヤレスゲート	5,000	720.00	3,600,000	
コネクシオ	6,000	1,710.00	10,260,000	
日本通信	81,400	239.00	19,454,600	
クロップス	1,900	726.00	1,379,400	
日本電信電話	1,408,600	2,792.00	3,932,811,200	
KDDI	785,300	3,283.00	2,578,139,900	
ソフトバンク	957,800	1,485.50	1,422,811,900	
光通信	10,900	27,820.00	303,238,000	
NTTドコモ	778,400	3,110.00	2,420,824,000	
エムティーアイ	10,200	736.00	7,507,200	
GMOインターネット	41,500	2,239.00	92,918,500	
ファイバーゲート	2,000	1,403.00	2,806,000	

アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	711.00	2,204,100	
KADOKAWA	28,400	2,073.00	58,873,200	
学研ホールディングス	3,500	7,370.00	25,795,000	
ゼンリン	21,000	1,731.00	36,351,000	
昭文社	5,100	392.00	1,999,200	
インプレスホールディングス	8,600	187.00	1,608,200	
東京電力ホールディングス	857,200	435.00	372,882,000	
中部電力	328,700	1,449.00	476,286,300	
関西電力	407,000	1,229.50	500,406,500	
中国電力	148,600	1,411.00	209,674,600	
北陸電力	98,300	763.00	75,002,900	
東北電力	268,500	1,020.00	273,870,000	
四国電力	96,800	1,014.00	98,155,200	
九州電力	221,400	895.00	198,153,000	
北海道電力	100,600	508.00	51,104,800	
沖縄電力	19,900	1,986.00	39,521,400	
電源開発	85,500	2,572.00	219,906,000	
エフオン	5,100	760.00	3,876,000	
イーレックス	15,300	1,815.00	27,769,500	
レノバ	17,800	1,136.00	20,220,800	
東京瓦斯	206,600	2,582.00	533,441,200	
大阪瓦斯	208,400	1,981.00	412,840,400	
東邦瓦斯	52,800	4,360.00	230,208,000	
北海道瓦斯	5,800	1,622.00	9,407,600	
広島ガス	22,600	357.00	8,068,200	
西部瓦斯	12,100	2,491.00	30,141,100	
静岡ガス	30,500	934.00	28,487,000	
メタウォーター	5,200	4,285.00	22,282,000	
アイネット	5,400	1,645.00	8,883,000	
松竹	7,000	16,650.00	116,550,000	
東宝	63,000	4,550.00	286,650,000	
エイチ・アイ・エス	16,000	3,020.00	48,320,000	
東映	3,900	16,390.00	63,921,000	
ラックランド	2,100	2,219.00	4,659,900	
エヌ・ティ・ティ・データ	280,600	1,546.00	433,807,600	
共立メンテナンス	17,000	5,020.00	85,340,000	
イチネンホールディングス	11,500	1,571.00	18,066,500	
建設技術研究所	7,100	2,320.00	16,472,000	
スペース	6,700	1,258.00	8,428,600	
長大	3,800	1,312.00	4,985,600	
アインホールディングス	14,200	6,590.00	93,578,000	
燦ホールディングス	4,500	1,433.00	6,448,500	
ピー・シー・エー	1,400	5,250.00	7,350,000	
スバル興業	600	10,120.00	6,072,000	
東京テアトル	4,100	1,386.00	5,682,600	
タナベ経営	1,900	1,284.00	2,439,600	
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,533.00	4,559,400	
ナガワ	3,300	7,880.00	26,004,000	
よみうりランド	2,200	4,510.00	9,922,000	

東京都競馬	6,700	3,310.00	22,177,000
常磐興産	4,200	1,682.00	7,064,400
カナモト	16,800	2,789.00	46,855,200
東京ドーム	41,600	1,082.00	45,011,200
D T S	23,500	2,545.00	59,807,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	44,900	5,680.00	255,032,000
シーイーシー	11,300	2,244.00	25,357,200
カブコン	49,700	3,120.00	155,064,000
西尾レントオール	10,400	3,035.00	31,564,000
アイ・エス・ピー	2,000	2,168.00	4,336,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	67,700	33.00	2,234,100
日本空港ビルデング	33,800	5,760.00	194,688,000
トランス・コスモス	9,800	2,820.00	27,636,000
乃村工藝社	44,000	1,321.00	58,124,000
ジャステック	6,700	1,181.00	7,912,700
S C S K	24,300	5,910.00	143,613,000
藤田観光	4,500	2,796.00	12,582,000
K N T - C Tホールディングス	6,400	1,485.00	9,504,000
日本管財	11,000	1,969.00	21,659,000
トーカイ	9,900	2,643.00	26,165,700
白洋舎	1,100	2,833.00	3,116,300
セコム	108,900	9,734.00	1,060,032,600
日本システムウェア	3,500	2,602.00	9,107,000
セントラル警備保障	4,900	6,120.00	29,988,000
アイネス	10,400	1,415.00	14,716,000
丹青社	19,400	1,318.00	25,569,200
メイテック	12,700	6,310.00	80,137,000
T K C	8,900	5,250.00	46,725,000
富士ソフト	13,500	4,380.00	59,130,000
応用地質	11,000	1,443.00	15,873,000
船井総研ホールディングス	21,200	2,673.00	56,667,600
N S D	34,600	1,772.00	61,311,200
進学会ホールディングス	4,000	531.00	2,124,000
丸紅建材リース	1,000	1,821.00	1,821,000
オオバ	8,000	895.00	7,160,000
コナミホールディングス	38,300	4,460.00	170,818,000
いであ	1,900	2,715.00	5,158,500
学究社	3,000	1,425.00	4,275,000
ベネッセホールディングス	34,200	2,959.00	101,197,800
イオンディライト	12,600	3,795.00	47,817,000
ナック	5,700	1,021.00	5,819,700
福井コンピュータホールディングス	4,100	3,655.00	14,985,500
ニチイ学館	14,600	1,589.00	23,199,400
ダイセキ	17,200	3,065.00	52,718,000
ステップ	3,800	1,593.00	6,053,400
日鉄物産	7,500	5,120.00	38,400,000
泉州電業	3,200	3,490.00	11,168,000
元気寿司	2,700	2,983.00	8,054,100

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	219,411,521,246円
同期中追加設定元本額	379,206,818,837円
同期中一部解約元本額	257,385,558,700円
元本の内訳	

ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	4,342,108,643円
たわらノーロード バランス(堅実型)	152,863,948円
たわらノーロード バランス(標準型)	381,614,953円
たわらノーロード バランス(積極型)	180,637,331円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	8,586,260円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	401,557,194円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	454,093,712円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	140,160,758円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	61,776,675円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	2,721,858円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,614,762円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	10,542,669円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,728,218円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,496,693円
投資のソムリエ	60,896,910,118円
投資のソムリエ<DC年金>	5,881,123,531円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	4,312,627,675円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	46,322,625,995円
ワールドアセットバランス(基本コース)	3,767,411,635円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	14,228,040,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	31,589,625円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	25,996,099円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	35,609,160円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	74,187,802円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	34,305,858,359円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,964,633,891円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	4,713,093円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	3,982,914円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	3,975,221円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,995,551,897円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	126,825,937,640円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	620,586,714円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	71,469,284円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	509,813,984円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	1,097,867,905円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	5,267,014,567円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	97,542,910円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,214,770,125円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,322,284,999円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	3,074,286,387円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	124,865,887円
計	341,232,781,383円
2. 受益権の総数	341,232,781,383口



## （金融商品に関する注記）

## 1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	907,104,535
合計	907,104,535

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月25日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

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

(注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

(注)

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

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	101,086,948,774円
同期中追加設定元本額	24,452,019,169円
同期中一部解約元本額	37,431,836,695円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,162,706,135円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,302,789円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	6,656,001円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	9,940,477円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,881,982円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	25,017,559円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,623,238円
たわらノーロード 先進国株式	11,809,238,051円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	150,071,838円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	1,596,535,622円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	200,508,862円
たわらノーロード バランス(堅実型)	18,782,937円
たわらノーロード バランス(標準型)	153,344,523円
たわらノーロード バランス(積極型)	191,257,433円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	543,342円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	61,618,843円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	150,020,802円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	108,189,218円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	197,605,673円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	62,885円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	962,323円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,165,079円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,943,824円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,194,798円
たわらノーロード 全世界株式	40,296,163円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	41,971,548,421円
One DC 先進国株式インデックスファンド	158,390,449円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	182,117,600円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	890,094,905円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,074,127,877円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	121,293,280円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	351,391,297円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	303,037,953円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	28,528,935円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	792,953,460円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	188,130,353円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	210,547,152円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	158,784,063円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	276,422,391円
投資のソムリエ	1,339,864,604円
クルーズコントロール	508,131,840円
投資のソムリエ<DC年金>	129,857,747円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	177,362,285円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	97,150,357円
クルーズコントロール<DC年金>	463,021円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,355,822円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	6,339,563円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	61,454,097円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	661,708,981円
ワールドアセットバランス(基本コース)	439,823,625円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,692,948,609円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	985,886円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	830,800円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	503,436円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,464,149円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	11,605,153円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	485,574,541円



9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	139,394,788円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	148,714円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	127,023円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	127,110円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	64,132円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	58,135,690円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	260,647,287円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	85,332,913円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	2,005,373,363円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,251,704,867円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	205,978,288円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	17,613,255円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	60,719,983円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	139,335,187円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,633,928円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	48,694,438円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,799,444円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,904,235円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,569,194円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,798,349円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	381,320,695円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	497,918,493円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,631,582,946円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	584,384,254円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	97,183,743円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	624,789,738円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	27,858,453円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,958,579円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	9,944,125円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	215,784,254円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	24,850,534円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	88,595,498円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	152,634,896円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,099,344,567円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	34,166,364円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	206,560円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	242,312円
計	88,107,131,248円
2. 受益権の総数	88,107,131,248口

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
----	-----------------------------

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	50,309,168,879
投資信託受益証券	55,553,307
投資証券	861,754,954
合計	51,226,477,140

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年2月16日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	令和2年1月14日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	5,901,082,012	-	-	6,008,360,314	107,278,302
合計	5,901,082,012	-	-	6,008,360,314	107,278,302

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

令和2年1月14日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4,1053円 (41,053円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年1月14日現在

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 609銘柄 投資証券 42銘柄	66.12 -	- -	- 2.16	69.61
イギリス・ポンド	株式 93銘柄 投資証券 3銘柄	5.65 -	- -	- 0.07	5.83
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 投資信託受益証券 7銘柄	2.25 -	- 0.17	- -	2.47
カナダ・ドル	株式 85銘柄 投資証券 5銘柄	3.56 -	- -	- 0.03	3.66
シンガポール・ドル	株式 20銘柄 投資信託受益証券 5銘柄	0.40 -	- 0.05	- -	0.46
スイス・フラン	株式 39銘柄	3.27	-	-	3.33
スウェーデン・クローナ	株式 32銘柄	0.94	-	-	0.96
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.64	-	-	0.65
ニュージーランド・ドル	株式 8銘柄	0.10	-	-	0.10
ノルウェー・クローネ	株式 10銘柄	0.22	-	-	0.22
ユーロ	株式 237銘柄 投資証券 5銘柄	11.06 -	- -	- 0.11	11.39
香港・ドル	株式 36銘柄 投資証券 1銘柄	1.13 -	- -	- 0.05	1.20

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,353,251,443円
同期中追加設定元本額	25,358,848,700円
同期中一部解約元本額	25,323,856,815円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	257,195円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	738,770円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,096,761円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	3,558,545円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	2,776,726円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,391,460円
たわらノーロード 国内リート	3,789,552,247円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	640,927,567円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	338,632,945円
たわらノーロード バランス(堅実型)	5,492,026円
たわらノーロード バランス(標準型)	98,312,824円
たわらノーロード バランス(積極型)	107,008,681円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	153,183円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	65,184,831円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	139,969,003円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	82,477,874円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	136,322,411円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,629,349円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,101,831円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,037,083円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,428,625円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,828,475円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	328,184,484円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	103,553,542円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	105,960,037円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	207,630,366円
投資のソムリエ	2,599,573,576円
投資のソムリエ<DC年金>	251,388,659円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	82,866,098円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	102,228,276円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,095,626,393円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	2,160,188円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	1,776,229円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	843,544円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	4,495,474円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	807,672,633円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	69,681,272円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	321,602円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	270,974円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	270,996円
Jリートインデックスファンド(DC)	25,591,945円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	87,369,628円



DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	785,828,086円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	6,903,006円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,513,492,931円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	353,769,449円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,411,203,987円
計	17,388,243,328円
2. 受益権の総数	17,388,243,328口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年1月14日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	1,501,902,383	
合計	1,501,902,383	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月7日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

## 不動産投信関連

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

## (注)時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

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

す。

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

令和2年1月14日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3747円 (23,747円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	514	75,044,000	
	GLP投資法人	9,127	1,227,581,500	
	MCUBS MidCity投 資法人	4,701	558,008,700	
	Oneリート投資法人	571	198,708,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,838	310,761,000	
	いちごホテルリート投資法人	607	83,948,100	
	さくら総合リート投資法人	793	75,969,400	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	1,836	962,064,000	
	アドバンス・レジデンス投資法 人	3,476	1,183,578,000	
	イオンリート投資法人	3,955	593,645,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人	23,543	514,649,980	
	インヴィンシブル投資法人	16,074	986,943,600	
	エスコンジャパンリート投資法 人	376	48,917,600	
	オリックス不動産投資法人	7,302	1,716,700,200	
	グローバル・ワン不動産投資法 人	2,545	349,683,000	
	ケネディクス・オフィス投資法 人	1,134	936,684,000	
	ケネディクス・レジデンシャ ル・ネクスト投資法人	2,281	470,114,100	
	ケネディクス商業リート投資法 人	1,415	382,333,000	

コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,526	526,470,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	734	84,189,800	
サンケイリアルエステート投資法人	531	67,543,200	
ザイマックス・リート投資法人	532	74,320,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,805	950,302,500	
ジャパンエクセレント投資法人	3,282	587,806,200	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,665	2,664,455,000	
スターアジア不動産投資法人	1,216	140,812,800	
スターツプロシード投資法人	571	114,257,100	
タカラレーベン不動産投資法人	1,040	130,832,000	
トーセイ・リート投資法人	798	105,575,400	
ヒューリックリート投資法人	3,117	606,879,900	
フロンティア不動産投資法人	1,302	584,598,000	
プレミア投資法人	3,310	503,451,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	782	107,134,000	
マリモ地方創生リート投資法人	315	40,572,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,228	1,675,220,800	
ラサールロジポート投資法人	3,407	545,460,700	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	567	68,096,700	
阪急阪神リート投資法人	1,655	277,047,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	902	427,548,000	
三菱地所物流リート投資法人	721	251,989,500	
産業ファンド投資法人	4,720	777,856,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	860	129,602,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,619	504,943,200	
森ヒルズリート投資法人	4,216	749,604,800	
星野リゾート・リート投資法人	558	318,618,000	
積水ハウス・リート投資法人	10,715	958,992,500	
大江戸温泉リート投資法人	623	58,375,100	
大和ハウスリート投資法人	4,940	1,387,646,000	
大和証券オフィス投資法人	846	698,796,000	
投資法人みらい	4,167	250,436,700	
東急リアル・エステート投資法人	2,457	501,228,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,218	825,804,000	
日本ビルファンド投資法人	3,549	2,881,788,000	
日本プライムリアルティ投資法人	2,320	1,104,320,000	
日本プロロジスリート投資法人	5,265	1,477,359,000	
日本ヘルスケア投資法人	178	37,789,400	

日本リート投資法人	1,190	553,945,000	
日本リートファンド投資法人	6,926	1,609,602,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,394	665,532,000	
日本賃貸住宅投資法人	4,122	432,397,800	
福岡リート投資法人	1,895	350,196,000	
平和不動産リート投資法人	2,282	300,539,400	
野村不動産マスターファンド投資法人	11,830	2,179,086,000	
投資証券 合計	212,984	39,964,352,980	
合計		39,964,352,980	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	33,176,902,219円
同期中追加設定元本額	51,901,372,311円
同期中一部解約元本額	55,438,020,826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)	149,781,513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)	90,546,901円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,123,577円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	12,000,264円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	17,835,829円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	57,101,122円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	44,818,485円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,588,234円
たわらノーロード 先進国リート	4,849,254,458円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	440,597,624円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	225,123,794円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	587,830,256円
たわらノーロード バランス(堅実型)	4,775,176円

たわらノーロード バランス(標準型)	85,485,169円
たわらノーロード バランス(積極型)	171,118,815円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	42,183,342円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	175,669,559円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	131,384,126円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	250,936,816円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,249,786円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,892,582円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,515,537円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,607,105円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,813,361円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,760,242円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	520,836,657円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	51,197,652円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	177,352,318円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	184,756,360円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	361,025,820円
投資のソムリエ	5,144,639,393円
投資のソムリエ<DC年金>	497,171,326円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	143,623,510円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	221,005,042円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,374,491,688円
ワールドアセットバランス(基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,152,334,046円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2045)	7,867,234円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2055)	6,495,377円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,827,884円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2035)	12,066,338円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,766,404,334円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	121,836,794円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2040)	1,172,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2050)	995,914円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤ-2060)	995,529円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	775,884,681円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	69,243,183円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	162,964,865円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	314,933,341円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,338,675,061円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,461,256,521円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	557,083,637円
計	29,640,253,704円
2. 受益権の総数	29,640,253,704口



## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	14,916,964
投資証券	458,433,866
合計	473,350,830

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(令和1年6月25日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	36,700,886	-	36,701,950	1,064
イギリス・ポンド	30,840,768	-	30,842,000	1,232
オーストラリア・ドル	3,578,510	-	3,578,750	240
オーストラリア・ドル	2,281,608	-	2,281,200	408
合計	36,700,886	-	36,701,950	1,064

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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1月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4012円 (14,012円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	ARA US HOSPITALITY TRUST	137,800.000	119,197.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	150,000.000	80,250.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	418,500.000	410,130.000	
		PRIME US REIT	100,000.000	98,000.000	

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

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

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

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

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



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

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

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

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

(6,458,984)

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

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

(注)

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

## 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	0.19	-	73.68
	投資証券 154銘柄	-	72.99	
イギリス・ポンド	投資証券 29銘柄	-	5.41	5.45
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.08	0.08
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	6.54	-	6.58
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-	2.00	2.02
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.81	-	3.83
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.44	0.44
ユーロ	投資証券 26銘柄	-	5.83	5.87
韓国・ウォン	投資証券 1銘柄	-	0.02	0.02
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.12	-	2.04
	投資証券 5銘柄	-	1.90	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,757,465,400円
同期中追加設定元本額	102,490,908,717円
同期中一部解約元本額	89,279,512,094円
元本の内訳 ファンド名	

D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファン ドラップ)	238,935,831円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	388,079,129円
たわらノーロード バランス(堅実型)	25,222,173円
たわらノーロード バランス(標準型)	67,823,758円
たわらノーロード バランス(積極型)	28,300,459円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	366,786円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,453,122円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,939,812円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	898,583円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	842,467円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	60,377,569円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	196,542,262円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	205,341,164円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	398,187,302円
投資のソムリエ	12,832,312,781円
クルーズコントロール	903,464,493円
投資のソムリエ<DC年金>	1,240,056,409円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	162,888,920円
クルーズコントロール<DC年金>	826,207円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	5,969,792円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	11,260,350円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	764,113,361円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,209,494,788円
ワールドアセットバランス(基本コース)	861,941,970円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,290,579,793円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,207,593円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	6,819,680円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,311,720円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	17,081,431円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,117,047,604円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	135,331,066円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,226,098円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,047,404円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,042,078円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	17,428,485,393円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,905,774,544円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	87,105,454円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	209,528,153円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	148,258,087円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格 機関投資家限定)	4,766,384,756円
P - O n eマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,231,991,681円
計	65,968,862,023円
2. 受益権の総数	65,968,862,023口

(金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
----	-----------------------------



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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	令和2年1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	1,439,788,531
合計	1,439,788,531

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年4月19日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	550,000,000	-	549,999,999	1
	550,000,000	-	549,999,999	1
合計	550,000,000	-	549,999,999	1

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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1月14日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0938円 (20,938円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	17,800,000.000	17,915,700.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	22,100,000.000	23,601,916.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	4,000,000.000	4,282,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	13,800,000.000	14,983,488.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	11,390,706.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	11,100,000.000	12,595,114.500	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	14,600,000.000	16,730,797.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	5,800,000.000	6,801,254.000	

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

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

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

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 115銘柄	97.39	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</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1月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,032,611,492円
同期中追加設定元本額	57,577,650,275円
同期中一部解約元本額	52,921,591,840円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	5,719,998,358円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	544,648,507円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	1,908,111円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,260,061円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	8,596,952円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,421,819円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	27,008,214円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	10,892,741円
たわらノーロード 新興国株式	5,535,853,929円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,028,623,684円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	651,314,093円
たわらノーロード バランス(堅実型)	5,290,743円
たわらノーロード バランス(標準型)	19,005,777円
たわらノーロード バランス(積極型)	31,769,994円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	293,572円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	31,688,232円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	73,307,342円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	49,785,741円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	89,780,866円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	347,151円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,623,743円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,203,180円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,349,759円
たわらノーロード 全世界株式	19,817,522円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	869,397円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	427,674,355円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	350,917,341円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	344,598,722円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	679,488,887円
投資のソムリエ	10,026,770,001円
クルーズコントロール	1,678,815,178円
投資のソムリエ< D C 年金>	968,603,743円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	299,779,433円
クルーズコントロール< D C 年金>	1,523,360円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	27,708,745円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	52,242,534円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制型	492,518,284円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,293,585,817円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,472,750,905円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	5,759,678,172円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,376,463円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	6,092,969円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	4,073,248円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,362,046円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,913,100,332円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	225,504,688円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,096,639円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	932,343円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	931,981円
エマージング株式パッシブファンドV A(適格機関投資家専用)	150,579,268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)	350,443,551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)	247,861,434円
計	47,688,669,927円
2. 受益権の総数	47,688,669,927口

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成31年1月12日 至 令和2年1月14日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<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1月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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1月14日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
株式	3,659,705,693
新株予約権証券	13,539
投資信託受益証券	32,961,950
投資証券	2,781,749
合計	3,689,872,355

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(平成31年4月19日から令和2年1月14日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和2年1月14日現在				
	契約額等（円）	うち		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	1,015,477,721	-	1,015,621,992	144,271	
アメリカ・ドル	1,014,239,502	-	1,014,391,910	152,408	
コロンビア・ペソ	64,628	-	64,820	192	
ブラジル・リアル	1,173,591	-	1,165,262	8,329	
買建	1,238,219	-	1,232,381	5,838	
アメリカ・ドル	1,238,219	-	1,232,381	5,838	
合計	1,016,715,940	-	1,016,854,373	150,109	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 株式関連

種類	令和2年1月14日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引					
買建	12,386,154,657	-	12,840,517,288	454,362,631	
合計	12,386,154,657	-	12,840,517,288	454,362,631	

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年1月14日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1,2829円 (12,829円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

令和2年1月14日現在

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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



## (2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

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

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計 金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 58銘柄	11.20	-	-	-	14.48
アラブ首長国連邦・ディ ルハム	株式 7銘柄	0.42	-	-	-	0.54
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.05	-	-	-	0.06
インド・ルピー	株式 85銘柄	6.69	-	-	-	8.66
インドネシア・ルピア	株式 28銘柄	1.49	-	-	-	1.93
オフショア・人民元	株式 162銘柄	3.12	-	-	-	4.04
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.69	-	-	-	0.90
コロンビア・ペソ	株式 7銘柄	0.28	-	-	-	0.36
サウジアラビア・リアル	株式 33銘柄	1.97	-	-	-	2.55
タイ・バート	株式 41銘柄	1.92	-	-	-	2.48
	新株予約権 証券 1銘柄	-	0.00	-	-	
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.11	-	-	-	0.14
チリ・ペソ	株式 17銘柄	0.59	-	-	-	0.76
トルコ・リラ	株式 15銘柄	0.39	-	-	-	0.50
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22	-	-	-	0.28
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.03	-	-	-	0.04
フィリピン・ペソ	株式 21銘柄	0.71	-	-	-	0.92
ブラジル・レアル	株式 50銘柄	5.33	-	-	-	7.18
	投資信託受 益証券 5銘柄	-	-	0.22	-	
ポーランド・ズロチ	株式 18銘柄	0.67	-	-	-	0.87
マレーシア・リンギット	株式 40銘柄	1.37	-	-	-	1.77
メキシコ・ペソ	株式 19銘柄	1.28	-	-	-	2.30
	投資信託受 益証券 5銘柄	-	-	0.44	-	
	投資証券 1銘柄	-	-	-	0.06	
ユーロ	株式 9銘柄	0.21	-	-	-	0.28
韓国・ウォン	株式 111銘柄	9.11	-	-	-	11.78
香港・ドル	株式 210銘柄	16.36	-	-	-	21.15
台湾・ドル	株式 88銘柄	8.93	-	-	-	11.55
南アフリカ・ランド	株式 44銘柄	3.37	-	-	-	4.49
	投資証券 3銘柄	-	-	-	0.11	

（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。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(令和2年1月15日から令和2年7月14日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 【中間財務諸表】

## 【投資のソムリエ&lt;DC年金&gt;リスク抑制型】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 令和2年1月14日現在	第6期中間計算期間末 令和2年7月14日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,303,453,107	1,654,152,967
親投資信託受益証券	10,986,755,988	13,784,931,683
派生商品評価勘定	18,040,807	281,892
流動資産合計	12,308,249,902	15,439,366,542
資産合計	12,308,249,902	15,439,366,542
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	53,956,273	35,288,956
未払解約金	10,608,581	7,552,893
未払受託者報酬	1,765,409	2,235,742
未払委託者報酬	32,955,141	41,734,549
その他未払費用	222,972	268,954
流動負債合計	99,508,376	87,081,094
負債合計	99,508,376	87,081,094
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	10,937,723,275	13,531,748,745
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,271,018,251	1,820,536,703
(分配準備積立金)	524,192,584	471,417,559
元本等合計	12,208,741,526	15,352,285,448
純資産合計	12,208,741,526	15,352,285,448
負債純資産合計	12,308,249,902	15,439,366,542

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 平成31年1月12日 至 令和1年7月11日	第6期中間計算期間 自 令和2年1月15日 至 令和2年7月14日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	377,977,771	286,590,465
為替差損益	6,931,075	12,276,966
営業収益合計	384,908,846	274,313,499
<b>営業費用</b>		
支払利息	98,072	401,502
受託者報酬	1,188,303	2,235,742
委託者報酬	22,182,350	41,734,549
その他費用	150,432	268,954
営業費用合計	23,619,157	44,640,747
営業利益又は営業損失( )	361,289,689	229,672,752
経常利益又は経常損失( )	361,289,689	229,672,752
中間純利益又は中間純損失( )	361,289,689	229,672,752
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	7,784,463	5,774,965
期首剰余金又は期首欠損金( )	248,046,815	1,271,018,251
剰余金増加額又は欠損金減少額	125,296,121	474,990,673
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	125,296,121	474,990,673
剰余金減少額又は欠損金増加額	14,124,839	149,370,008
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	14,124,839	149,370,008
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	712,723,323	1,820,536,703

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自	至
	令和2年1月15日	令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を令和2年1月14日、当中間計算期間末日を令和2年7月14日としております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	令和2年1月14日現在	令和2年7月14日現在
1. 期首元本額	6,288,449,795円	10,937,723,275円
期中追加設定元本額	5,623,631,913円	3,872,265,868円
期中一部解約元本額	974,358,433円	1,278,240,398円
2. 受益権の総数	10,937,723,275口	13,531,748,745口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期 令和2年1月14日現在	第6期中間計算期間末 令和2年7月14日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表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。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(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。	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。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。	同左



(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	第5期 令和2年1月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	2,447,580,253	-	2,501,535,630	53,955,377
アメリカ・ドル	299,235,003	-	304,752,700	5,517,697
イギリス・ポンド	646,179,792	-	656,324,100	10,144,308
オーストラリア・ドル	369,946,303	-	381,876,600	11,930,297
カナダ・ドル	366,613,659	-	377,592,150	10,978,491
ユーロ	765,605,496	-	780,990,080	15,384,584
買建	1,223,733,949	-	1,241,773,860	18,039,911
アメリカ・ドル	242,362,593	-	244,747,300	2,384,707
オーストラリア・ドル	196,739,205	-	201,039,650	4,300,445
カナダ・ドル	252,233,719	-	257,368,830	5,135,111
ユーロ	532,398,432	-	538,618,080	6,219,648
合計	3,671,314,202	-	3,743,309,490	35,915,466

種類	第6期中間計算期間末 令和2年7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	1,170,289,539	-	1,205,245,080	34,955,541
アメリカ・ドル	79,211,624	-	79,328,000	116,376
イギリス・ポンド	555,504,062	-	567,793,020	12,288,958
オーストラリア・ドル	227,242,920	-	242,604,050	15,361,130
カナダ・ドル	231,950,315	-	238,945,550	6,995,235
ユーロ	76,380,618	-	76,574,460	193,842
買建	65,731,103	-	65,679,580	51,523
アメリカ・ドル	3,565,815	-	3,537,600	28,215
イギリス・ポンド	33,724,252	-	33,914,160	189,908
オーストラリア・ドル	15,377,961	-	15,316,100	61,861
カナダ・ドル	13,063,075	-	12,911,720	151,355
合計	1,236,020,642	-	1,270,924,660	35,007,064

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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。

（1口当たり情報に関する注記）

	第5期 令和2年1月14日現在	第6期中間計算期間末 令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1162円 (11,162円)	1,1345円 (11,345円)

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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7月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,147,706,475
国債証券	167,044,422,500
地方債証券	16,815,883,000
特殊債証券	15,644,523,555
社債証券	9,582,870,570
未収利息	376,454,221
前払費用	13,730,403
流動資産合計	210,625,590,724
資産合計	210,625,590,724
負債の部	
流動負債	
未払解約金	744,548,000
流動負債合計	744,548,000
負債合計	744,548,000
純資産の部	
元本等	
元本	160,662,227,289
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	49,218,815,435
元本等合計	209,881,042,724
純資産合計	209,881,042,724
負債純資産合計	210,625,590,724

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	170,923,484,775円
同期中追加設定元本額	52,851,180,036円
同期中一部解約元本額	63,112,437,522円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	19,417,045,498円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	76,387,550円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	62,545,953円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	14,180,445円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	843,489,961円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	246,008,369円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,737,433円
たわらノーロード 国内債券	11,275,000,617円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	865,493,214円
たわらノーロード バランス(堅実型)	290,128,412円
たわらノーロード バランス(標準型)	463,389,849円
たわらノーロード バランス(積極型)	54,936,684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)	18,893,399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)	539,447,357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)	515,615,534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)	125,356,407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)	9,367,935円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	8,352,493円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	6,411,552円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	11,048,608円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,637,902円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	761,148円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,986,813,063円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	7,090,015,816円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	9,313,872,662円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,650,402,740円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,825,688,011円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,939,607,409円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	308,751,808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>	2,238,625,325円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,343,546円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,523,149,588円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,011,014,146円

DIAM DC 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	7,718,472,827円
クルーズコントロール	1,125,972,520円
投資のソムリエ<DC年金>	714,982,545円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,097,186,147円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	384,803,504円
クルーズコントロール<DC年金>	1,088,427円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,217,794円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	8,452,373円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,279,020,170円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	11,814,726,005円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,117,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,966,890円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	12,161,087円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	13,844,159円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	442,871,655円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	950,399,505円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,614,058,920円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,172,877円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	860,187円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	895,992円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	7,403,858円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,401,009円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,860,811,325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)	663,689,320円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	323,753,360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)	3,259,960,022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)	3,250,860,114円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,237,091,282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)	3,226,120,948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)	3,230,659,249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
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	199,810,907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)	141,385,750円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	53,504,597円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	124,626,466円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	60,871,166円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,519,927円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	74,379,322円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	160,738,977円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,318,265,330円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,465,004,585円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,620,556,035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)	490,291,264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)	222,109,341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)	2,599,964,681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)	222,975,138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)	12,831,163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)	52,648,893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)	2,361,515,201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)	62,394,331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)	478,274,167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)	835,864,772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)	1,239,342,867円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	334,186,362円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	106,339,314円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	48,376,429円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	726,521円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	395,889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)	1,034,577,783円
計	160,662,227,289円
2. 受益権の総数	160,662,227,289口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

## (1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	1,3063円
(1万口当たり純資産額)	(13,063円)

## 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7月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,245,646,634
株式	216,088,212,610
派生商品評価勘定	10,739,920
未収配当金	338,101,463
流動資産合計	219,682,700,627
資産合計	219,682,700,627
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,972,390
前受金	11,025,000
未払金	281,320
未払解約金	1,026,229,000
流動負債合計	1,047,507,710
負債合計	1,047,507,710
純資産の部	
元本等	
元本	87,004,526,418
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	131,630,666,499
元本等合計	218,635,192,917
純資産合計	218,635,192,917
負債純資産合計	219,682,700,627



## 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2年1月15日 至 令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,962,453,569円
同期中追加設定元本額	27,495,349,798円
同期中一部解約元本額	37,453,276,949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	15,065,593,761円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,090,580,497円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,120,128円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,821,766円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,739,111円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	34,449,643円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,897,440円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,302,652円
たわらノーロード TOPIX	711,882,648円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	472,520,771円
たわらノーロード バランス(堅実型)	17,232,605円
たわらノーロード バランス(標準型)	103,644,887円
たわらノーロード バランス(積極型)	152,864,238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)	631,941円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	42,490,684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)	130,453,810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)	84,657,144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)	157,230,360円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	353,928円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,280,624円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,843,640円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,173,787円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,300,182円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	36,178,186,416円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,093,375,687円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,573,116,747円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,554,404,496円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	368,128,460円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,251,487,994円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,134,841,512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>	1,138,688,254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)	331,030,179円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	263,393,479円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	424,373,758円
投資のソムリエ	3,167,430,752円
クルーズコントロール	606,852,697円
投資のソムリエ<DC年金>	293,471,669円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	304,923,106円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	366,650,929円
クルーズコントロール<DC年金>	587,464円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,130,773円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,659,966円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	122,596,617円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,132,951,435円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	8,764,431円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,881,928円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,165,676円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	11,363,689円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	89,401,868円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	495,877,499円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	252,177,142円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,289,656円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,060,807円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,090,717円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,103,215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)	59,462,332円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	72,273,333円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	51,392,405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)	126,877,220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)	92,783,549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)	86,864,930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)	184,781,207円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,962,362円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	43,340,425円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,700,256円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	9,204,903円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,866,895円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,899,593円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	844,576,231円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	857,306,760円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,410,882,128円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	170,487,551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)	46,372,672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)	451,344,233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)	116,339,343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)	2,229,883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)	33,240,956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)	461,786,280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)	32,554,336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)	124,726,708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)	327,046,674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)	387,821,716円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	53,016,365円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	23,834,958円
D I A Mバランス2 0 V A (適格機関投資家限定)	2,372,174円
D I A Mバランス4 0 V A (適格機関投資家限定)	108,403円
D I A Mバランス6 0 V A (適格機関投資家限定)	124,308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)	404,410,942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)	1,274,945,305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)	1,685,747,142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)	67,341,342円
計	87,004,526,418円
2. 受益権の総数	87,004,526,418口
3. 差入代用有価証券 株式	1,686,000,000円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （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7月14日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	2,485,145,000	-	2,485,965,000	820,000	
合計	2,485,145,000	-	2,485,965,000	820,000	

## （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はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	2,5129円
(1万口当たり純資産額)	(25,129円)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,310,842,895
コール・ローン	999,583,373
国債証券	360,155,519,461
派生商品評価勘定	994,372,866
未収入金	5,640,561
未収利息	1,926,663,888
前払費用	380,880,477
流動資産合計	365,773,503,521
資産合計	365,773,503,521
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	935,939,326
未払金	18,760
未払解約金	10,771,000
流動負債合計	946,729,086
負債合計	946,729,086
純資産の部	
元本等	
元本	247,705,352,210
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	117,121,422,225
元本等合計	364,826,774,435
純資産合計	364,826,774,435
負債純資産合計	365,773,503,521

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	341,232,781,383円
同期中追加設定元本額	192,348,253,178円
同期中一部解約元本額	285,875,682,351円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	5,104,742,023円
たわらノーロード バランス(堅実型)	238,918,674円
たわらノーロード バランス(標準型)	573,598,715円
たわらノーロード バランス(積極型)	258,981,901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)	11,885,670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)	487,282,380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)	498,687,042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)	117,687,444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)	16,654,220円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	3,131,737円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,499,173円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	14,842,380円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,939,204円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,052,124円
投資のソムリエ	88,375,585,134円
投資のソムリエ<DC年金>	8,190,359,631円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,610,113,834円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	61,060,887,519円
ワールドアセットバランス(基本コース)	3,323,348,254円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,756,892,516円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	68,858,477円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	38,378,161円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	62,864,043円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	146,255,483円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	30,299,163,589円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,201,813,056円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,903,099円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,330,381円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,653,526円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,975,175,686円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	5,943,085,380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)	523,388,123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)	55,362,483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)	424,050,242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)	926,431,777円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,099,770,543円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	12,860,808円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,045,914,615円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,183,735,880円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,887,293,805円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	115,973,478円
計	247,705,352,210円
2. 受益権の総数	247,705,352,210口



## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(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7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	363,335,927,953	-	363,277,494,413	58,433,540
アメリカ・ドル	165,809,893,572	-	164,881,114,704	928,778,868
イギリス・ポンド	23,217,545,255	-	23,442,172,873	224,627,618
イスラエル・シェケル	1,413,384,807	-	1,410,230,808	3,153,999
オーストラリア・ドル	7,978,499,437	-	7,989,186,348	10,686,911
カナダ・ドル	6,767,988,558	-	6,730,356,618	37,631,940
シンガポール・ドル	1,635,095,798	-	1,629,730,780	5,365,018
スウェーデン・クローナ	1,014,430,064	-	1,022,334,012	7,903,948
デンマーク・クローネ	1,879,565,786	-	1,889,961,900	10,396,114
ノルウェー・クローネ	768,503,841	-	779,762,025	11,258,184
ポーランド・ズロチ	2,217,818,489	-	2,204,120,961	13,697,528
マレーシア・リンギット	1,443,836,163	-	1,442,277,100	1,559,063
メキシコ・ペソ	2,718,630,343	-	2,743,617,950	24,987,607
ユーロ	146,470,735,840	-	147,112,628,334	641,892,494
合計	363,335,927,953	-	363,277,494,413	58,433,540

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	1.4728円
(1万口当たり純資産額)	(14,728円)

## 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7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,379,893,184
コール・ローン	200,445,350
株式	343,730,732,298
投資信託受益証券	683,454,471
投資証券	7,770,048,203
派生商品評価勘定	181,871,030
未収入金	9,455,361
未収配当金	376,125,377
差入委託証拠金	2,483,699,715
流動資産合計	358,815,724,989
資産合計	358,815,724,989
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,197,551
未払解約金	544,392,400
流動負債合計	547,589,951
負債合計	547,589,951
純資産の部	
元本等	
元本	94,016,620,065
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	264,251,514,973
元本等合計	358,268,135,038
純資産合計	358,268,135,038
負債純資産合計	358,815,724,989

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14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7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	88,107,131,248円
同期中追加設定元本額	20,358,174,810円
同期中一部解約元本額	14,448,685,993円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,942,724,920円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,268,674円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,896,321円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,565,894円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	36,089,252円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	34,985,273円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	16,013,642円
たわらノーロード 先進国株式	15,255,308,177円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	97,848,667円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,006,113,113円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	312,578,722円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,266,935円
たわらノーロード バランス(標準型)	263,116,415円
たわらノーロード バランス(積極型)	311,430,997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)	989,527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)	119,030,228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)	293,681,978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)	188,212,938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)	319,271,529円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	385,656円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,893,757円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,570,826円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,308,917円
たわらノーロード 全世界株式	63,363,194円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	44,990,482,975円
One DC 先進国株式インデックスファンド	281,358,009円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	195,276,515円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	971,200,821円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,150,165,395円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	124,115,251円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	365,574,704円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	308,740,983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>	834,497,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	174,689,647円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	220,653,972円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	179,422,441円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	288,800,808円
投資のソムリエ	1,191,275,386円
クルーズコントロール	195,318,521円
投資のソムリエ<DC年金>	110,575,912円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	207,306,102円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	116,610,198円
クルーズコントロール<DC年金>	189,087円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,113,687円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,947,625円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	80,752,036円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	746,428,570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)	368,873,613円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	1,111,680円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	633,519円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	770,594円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	2,167,416円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	29,265,534円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	335,861,496円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	166,913,124円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	305,324円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	133,311円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	137,468円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,050,368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)	73,876,051円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	89,790,365円
MSCIコクサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり>(適格機関投資家限定)	259,611,247円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	85,814,153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)	1,761,296,608円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	9,074,383,700円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	205,874,409円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	14,908,067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)	116,747,445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)	58,890,342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)	125,196,985円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,101,766円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	44,069,079円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,299,927円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,163,386円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,532,547円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	56,839,120円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	381,294,978円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	508,117,665円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,633,135,207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)	575,725,817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)	93,601,998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)	612,393,599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)	26,235,047円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,783,514円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	8,920,478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)	208,651,242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)	22,052,824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)	84,491,056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)	147,711,851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)	262,884,139円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	5,107,187円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	222,659円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	255,561円
計	94,016,620,065円
2. 受益権の総数	94,016,620,065口

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(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7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	432,958,917	-	434,580,390	1,621,473
アメリカ・ドル	313,254,880	-	314,486,320	1,231,440
イギリス・ポンド	29,428,256	-	29,344,980	83,276
オーストラリア・ドル	9,874,319	-	9,891,210	16,891
カナダ・ドル	18,874,560	-	18,902,400	27,840
ユーロ	61,526,902	-	61,955,480	428,578
買建	66,541,523	-	66,537,810	3,713
アメリカ・ドル	49,449,626	-	49,446,860	2,766
イギリス・ポンド	2,423,160	-	2,422,980	180
オーストラリア・ドル	4,537,119	-	4,536,570	549
カナダ・ドル	1,732,918	-	1,732,720	198
ユーロ	8,398,700	-	8,398,680	20
合計	499,500,440	-	501,118,200	1,625,186

(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7月14日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	5,911,078,602	-	6,091,377,267	180,298,665
合計	5,911,078,602	-	6,091,377,267	180,298,665

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	3.8107円
(1万口当たり純資産額)	(38,107円)

## 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7月14日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	636,034,024
投資証券	40,699,970,000
未収入金	97,223,006
未収配当金	299,174,591
前払金	38,828,400
差入委託証拠金	111,874,000
流動資産合計	41,883,104,021
資産合計	41,883,104,021
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	40,458,040
未払金	28,681,200
未払解約金	103,206,000
流動負債合計	172,345,240
負債合計	172,345,240
純資産の部	
元本等	
元本	22,174,286,756
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	19,536,472,025
元本等合計	41,710,758,781
純資産合計	41,710,758,781
負債純資産合計	41,883,104,021

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,388,243,328円
同期中追加設定元本額	17,357,473,219円
同期中一部解約元本額	12,571,429,791円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	373,212円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,009,699円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,091,484円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	4,116,199円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	3,968,750円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,827,112円
たわらノーロード 国内リート	4,044,937,602円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,087,840,294円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	620,209,701円
たわらノーロード バランス(堅実型)	11,228,944円
たわらノーロード バランス(標準型)	194,820,550円
たわらノーロード バランス(積極型)	200,629,804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)	98,978,444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)	195,354,760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)	102,440,338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)	130,795,384円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,136,825円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,186,049円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,314,603円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,938,707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>	350,338,871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)	121,912,674円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	131,994,633円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	250,698,560円
投資のソムリエ	4,159,292,479円
投資のソムリエ<DC年金>	387,564,139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	80,694,275円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	742,892,334円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	4,919,857円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,741,770円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	763,157円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	8,516,955円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	329,859,392円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	97,804,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,348,029円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	594,976円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	614,023円
Jリートインデックスファンド(DC)	30,636,904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)	85,802,270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)	770,651,758円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	78,912,154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)	272,570,473円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	96,673,199円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	5,138,807,386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)	393,572,589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)	123,135,452円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,666,841,804円
計	22,174,286,756円
2. 受益権の総数	22,174,286,756口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （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7月14日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	905,000,400	-	864,600,000	40,400,400	
合計	905,000,400	-	864,600,000	40,400,400	

## （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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	1.8810円
(1万口当たり純資産額)	(18,810円)

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7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	148,069,397
コール・ローン	100,393,627
投資信託受益証券	4,194,124,024
投資証券	33,747,000,025
未収配当金	136,327,094
流動資産合計	38,325,914,167
資産合計	38,325,914,167
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,247
未払金	114,824,082
未払解約金	12,250,000
流動負債合計	127,083,329
負債合計	127,083,329
純資産の部	
元本等	
元本	35,564,794,130
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,634,036,708
元本等合計	38,198,830,838
純資産合計	38,198,830,838
負債純資産合計	38,325,914,167

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14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7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	29,640,253,704円
同期中追加設定元本額	35,851,944,047円
同期中一部解約元本額	29,927,403,621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)	65,995,162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)	28,503,443円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,032,257円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	16,380,961円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	17,586,179円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	66,567,083円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	64,408,021円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,442,500円
たわらノーロード 先進国リート	6,680,518,449円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	882,822,135円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	305,700,993円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,086,743,685円
たわらノーロード バランス(堅実型)	9,689,110円



たわらノーロード バランス(標準型)	169,796,685円
たわらノーロード バランス(積極型)	324,189,246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)	73,794,932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)	264,312,991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)	178,233,109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)	295,800,990円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,317,913円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	6,473,044円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,026,778円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,818,729円
One DC 先進国リートインデックスファンド	87,209,177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>	623,478,643円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	54,446,524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)	238,890,973円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	440,162,846円
投資のソムリエ	4,112,034,505円
投資のソムリエ<DC年金>	381,030,321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	278,683,494円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,575,429,338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)	834,776,955円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	3,817,650円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	2,168,199円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,652,870円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	7,440,570円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,263,558,370円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,223,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,047,363円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	460,840円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	479,731円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	664,483,683円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	97,522,040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)	384,722,019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)	1,097,495,508円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	467,607,215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)	608,047,101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)	179,501,830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)	356,352,501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)	3,800,527,901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)	556,293,354円
計	35,564,794,130円
2. 受益権の総数	35,564,794,130口

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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。

(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7月14日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	6,085,920	-	6,086,000	80
ユーロ	6,085,920	-	6,086,000	80
買建	69,680,467	-	69,671,300	9,167
アメリカ・ドル	34,326,016	-	34,323,200	2,816
イギリス・ポンド	4,038,648	-	4,038,300	348
イスラエル・シケル	1,557,530	-	1,556,000	1,530
オーストラリア・ドル	4,462,740	-	4,462,200	540
カナダ・ドル	787,703	-	787,600	103
シンガポール・ドル	23,123,790	-	23,121,000	2,790
香港・ドル	1,384,040	-	1,383,000	1,040
合計	75,766,387	-	75,757,300	9,247

(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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	1.0741円
(1万口当たり純資産額)	(10,741円)

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

令和2年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,611,231,506
コール・ローン	101,998,063
国債証券	111,890,373,652
派生商品評価勘定	7,272
未収利息	919,788,502
前払費用	587,287,713
流動資産合計	115,110,686,708
資産合計	115,110,686,708
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,661,845
未払金	119,874,225
未払解約金	420,948,000
流動負債合計	542,484,070
負債合計	542,484,070
純資産の部	
元本等	
元本	55,760,921,044
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	58,807,281,594
元本等合計	114,568,202,638
純資産合計	114,568,202,638
負債純資産合計	115,110,686,708

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	65,968,862,023円
同期中追加設定元本額	58,156,782,232円
同期中一部解約元本額	68,364,723,211円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	127,631,116円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	570,744,237円
たわらノーロード バランス（堅実型）	41,673,148円
たわらノーロード バランス（標準型）	106,867,835円
たわらノーロード バランス（積極型）	42,143,691円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	433,638円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,397,059円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,428,297円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	710,879円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	974,782円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	196,333,833円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	205,234,186円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	390,060,660円
投資のソムリエ	14,730,660,998円
クルーズコントロール	359,925,689円
投資のソムリエ<DC年金>	1,365,537,152円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	171,006,640円
クルーズコントロール<DC年金>	347,944円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	2,053,438円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	5,434,692円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	480,601,368円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,441,445,854円
ワールドアセットバランス（基本コース）	843,793,149円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	661,346,596円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	13,619,101円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,572,784円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,570,407円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	26,427,979円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,216,906,979円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	152,088,521円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	3,742,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,644,812円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,706,562円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	15,503,078,087円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,619,219,446円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	367,691,412円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	74,578,342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)	188,359,051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)	133,309,860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)	5,865,056,518円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,787,321,725円
計	55,760,921,044円
2. 受益権の総数	55,760,921,044口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （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7月14日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	540,000,000	-	541,654,573	1,654,573
合計	540,000,000	-	541,654,573	1,654,573

## （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。

(1口当たり情報に関する注記)

	令和2年7月14日現在
1口当たり純資産額	2,0546円
(1万口当たり純資産額)	(20,546円)



## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

令和2年7月14日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,848,427,502
コール・ローン	107,231,916
株式	35,993,795,572
新株予約権証券	32,275
投資信託受益証券	189,047,645
投資証券	34,589,354
派生商品評価勘定	270,730,242
未収入金	12,248,182
未収配当金	177,614,832
差入委託証拠金	2,265,952,498
流動資産合計	41,899,670,018
資産合計	41,899,670,018
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,027,447
未払金	33,331,919
未払解約金	410,853,800
流動負債合計	446,213,166
負債合計	446,213,166
純資産の部	
元本等	
元本	35,913,856,377
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,539,600,475
元本等合計	41,453,456,852
純資産合計	41,453,456,852
負債純資産合計	41,899,670,018

## 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2年1月15日 至 令和2年7月14日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	令和2年7月14日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	47,688,669,927円
同期中追加設定元本額	28,083,093,535円
同期中一部解約元本額	39,857,907,085円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	6,465,200,303円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし> (ファン ドラップ)	263,880,382円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,795,138円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	8,052,307円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	8,212,717円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,832,352円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	31,692,864円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,781,386円
たわらノーロード 新興国株式	6,422,233,135円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	3,181,717,071円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,072,684,712円
たわらノーロード バランス(堅実型)	9,259,236円
たわらノーロード バランス(標準型)	31,900,117円
たわらノーロード バランス(積極型)	53,539,247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)	511,527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)	77,048,057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)	151,975,746円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	131,767,256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)	182,785,076円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	330,930円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	812,932円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,011,763円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,848,434円
たわらノーロード 全世界株式	32,954,621円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	37,349,896円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	452,026,003円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	387,184,080円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	407,441,110円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	754,129,906円
投資のソムリエ	6,164,734,624円
クルーズコントロール	628,184,942円
投資のソムリエ< D C 年金>	570,890,325円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	363,111,843円
クルーズコントロール< D C 年金>	604,600円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	8,870,108円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	23,577,290円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制型	281,072,361円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,663,010,754円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,464,721,356円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,303,884,988円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	7,569,668円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,218,720円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	2,693,815円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	14,730,647円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,154,011,753円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	278,730,046円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,080,141円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	915,177円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	906,744円
エマージング株式パッシブファンドV A (適格機関投資家専用)	146,441,437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)	359,917,064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)	254,019,670円
計	35,913,856,377円
2. 受益権の総数	35,913,856,377口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	令和2年7月14日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （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7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	414,184,372	-	415,739,760	1,555,388
合計	414,184,372	-	415,739,760	1,555,388

## （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7月14日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,913,945,375	-	5,184,203,558	270,258,183
合計	4,913,945,375	-	5,184,203,558	270,258,183

## （注）時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## （1口当たり情報に関する注記）

令和2年7月14日現在	
1口当たり純資産額	1.1542円
（1万口当たり純資産額）	（11,542円）

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

令和2年7月31日現在

資産総額	15,874,725,241円
負債総額	74,232,922円
純資産総額（ - ）	15,800,492,319円
発行済数量	13,854,194,759口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1405円

（参考）

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	215,787,206,081円
負債総額	694,670,500円
純資産総額（ - ）	215,092,535,581円
発行済数量	164,142,704,059口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3104円

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	210,808,939,362円
負債総額	760,776,805円
純資産総額（ - ）	210,048,162,557円
発行済数量	87,447,163,142口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4020円

## 為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	395,016,761,491円
負債総額	9,812,522,100円
純資産総額（ - ）	385,204,239,391円
発行済数量	259,039,083,448口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4871円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	361,127,340,202円
負債総額	418,656,237円
純資産総額（ - ）	360,708,683,965円
発行済数量	94,484,282,214口
1口当たり純資産額（ / ）	3.8177円

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	44,883,115,251円
負債総額	647,360,092円
純資産総額( - )	44,235,755,159円
発行済数量	23,461,469,977口
1口当たり純資産額( / )	1.8855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7月31日現在

資産総額	37,981,836,899円
負債総額	251,846,466円
純資産総額( - )	37,729,990,433円
発行済数量	34,274,991,207口
1口当たり純資産額( / )	1.1008円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	115,907,644,368円
負債総額	603,200,000円
純資産総額( - )	115,304,444,368円
発行済数量	55,860,054,728口
1口当たり純資産額( / )	2.0642円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

令和2年7月31日現在

資産総額	41,310,895,959円
負債総額	143,571,076円
純資産総額( - )	41,167,324,883円
発行済数量	36,032,366,695口
1口当たり純資産額( / )	1.1425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7月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

##### (2) 会社の機構（2020年7月31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7月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,216,222,423,902
追加型株式投資信託	861	13,687,667,821,911
単位型公社債投資信託	36	92,342,483,722
単位型株式投資信託	188	1,257,025,532,490
合計	1,111	16,253,258,262,025

### 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		その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	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、記載していません。

## 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

2020年3月末日現在 247,369百万円

##### c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

#### (2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北越銀行	24,538	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十六銀行	36,839	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

#### (3)投資顧問会社

##### a. 名称

アセットマネジメントOne U.S.A.・インク

##### b. 資本金の額

2019年12月末日現在 400万米ドル

##### c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1)募集の取扱い

- (2)追加設定の申込事務
- (3)信託契約の一部解約事務
- (4)受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5)受益者に対する収益分配金の再投資
- (6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

### 3【資本関係】

委託会社はアセットマネジメントOne U.S.A.・インクの株式を100%保有しています。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

## 独立監査人の監査報告書

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2月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型の平成31年1月12日から令和2年1月14日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型の令和2年1月14日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の中間監査報告書

令和2年8月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型の令和2年1月15日から令和2年7月14日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ＜DC年金＞リスク抑制型の令和2年7月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（令和2年1月15日から令和2年7月14日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。