

**【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>	マネックス資産設計ファンド<育成型>
<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>	3,000億円を上限とします。
<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】

マネックス資産設計ファンド<育成型>

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

3,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、収益分配金の再投資については、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

#### <基準価額の照会方法等>

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

### （５）【申込手数料】

ありません。

( 6 ) 【申込単位】

販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

( 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

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

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っております。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

( 9 ) 【払込期日】

取得申込者は、お申込みをされた販売会社が定める所定の日までに買付代金を販売会社に支払うものとします。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。

( 1 0 ) 【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、販売会社を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

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)

( 1 1 ) 【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

( 1 2 ) 【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。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「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」に従って分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、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。

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

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

ただし、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取得申込みの受付を取り消すことができるものとします。

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

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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、マザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式、債券および不動産投資信託証券に投資を行い、信託財産の成長と安定した収益の確保をめざします。

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

<ファンドの特色>

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

\*2020年7月末時点

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

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

## 4 「育成型」(自動けいぞく投資専用)のファンドです。

信託財産の成長を重視します。分配金は、決算ごとに原則として経費控除後の利子・配当等収益の範囲内から支払われ、税引後、自動的に無手数料で全額再投資されます。

※決算は原則として毎年1月11日(休業日の場合は翌営業日)です。

●将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

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

## 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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



## 属性区分表

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

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分定義

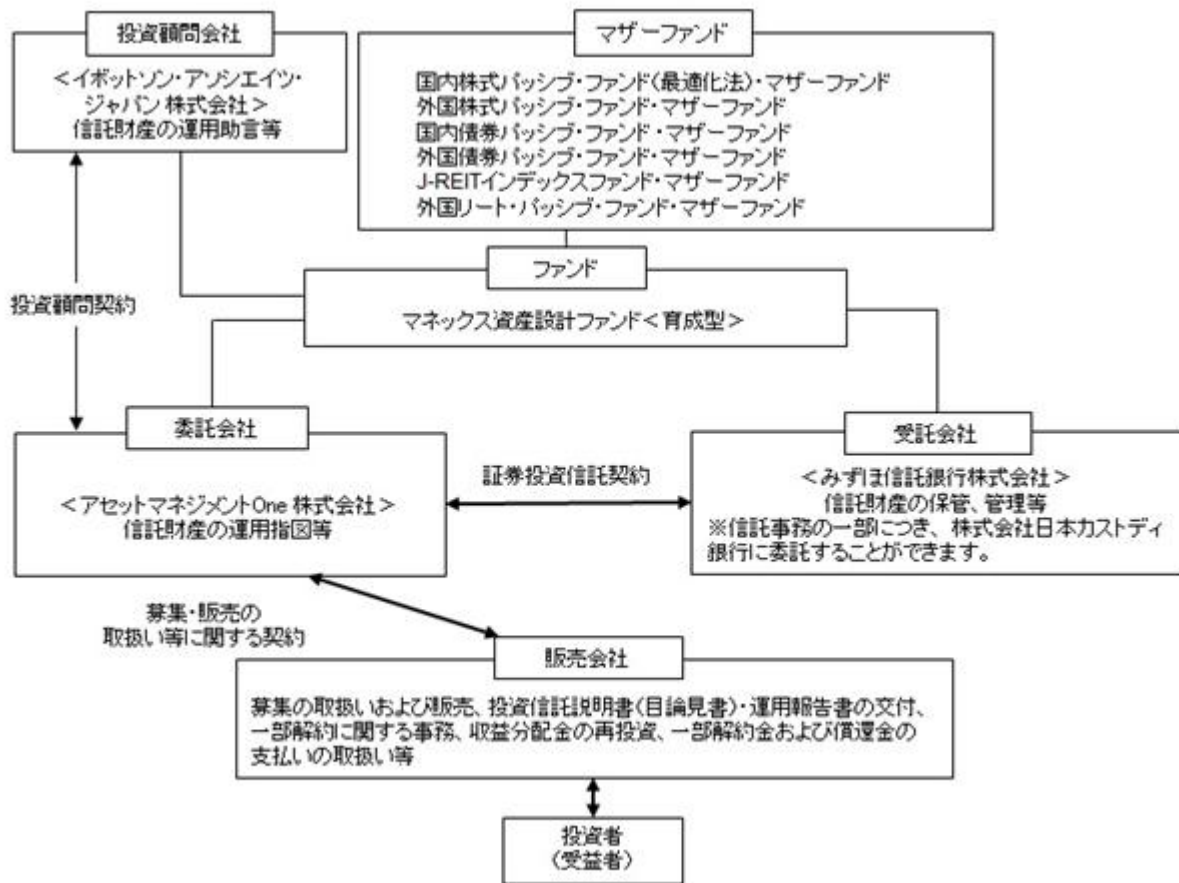
その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株 式、債券、不動 産投信)資産配 分変更型))	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産(株式、債券、不動産投信)を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信)資産配分変更型))に分類されます。
年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリー ファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

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】

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

## (3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、当ファンドの設定時に証券投資信託契約を締結しております。

当該契約の内容は、運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。

当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、収益分配金の再投資、一部解約に関する事務、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

- ・「投資顧問契約」の概要

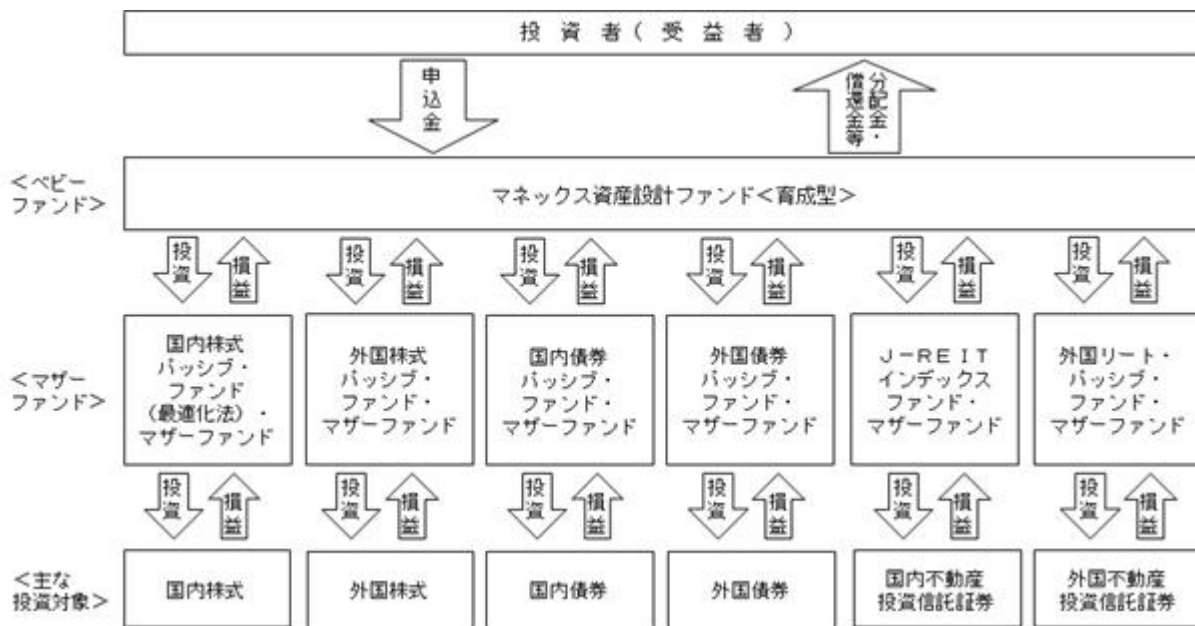
委託会社と投資顧問会社（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）の間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



#### 委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

#### 資本金の額

20億円（2020年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リュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

## 大株主の状況

(2020年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】

## &lt;基本方針&gt;

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

## &lt;投資対象&gt;

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

## &lt;投資態度&gt;

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

基本資産配分は原則として年1回見直すこととします。また、この期間において時価変動による基本資産配分からの乖離分については、原則として見直しを行いません。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった時等、やむを得ない事情が発生した場合には、随時基本資産配分を見直すこととします。

基本資産配分比率の決定については、イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社の投資助言を受けます。

基本資産配分比率については、分散投資の観点から、各資産への配分は一定の範囲内に制限します。

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

リート(REIT)とは

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

投資対象の詳細は、約款をご覧ください。

#### <運用プロセス>

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

#### (2)【投資対象】

##### 1. 投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

(2)次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

##### 2. 有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

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

- (1) 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
- (2) 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (3) 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (4) 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (5) J-REITインデックスファンド・マザーファンド
- (6) 外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- (7) 株券または新株引受権証券
- (8) 国債証券
- (9) 地方債証券
- (10) 特別の法律により法人の発行する債券
- (11) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
- (12) 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
- (13) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
- (14) 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
- (15) 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
- (16) コマーシャル・ペーパー
- (17) 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ)および新株予約権証券
- (18) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、(7)から(17)までの証券または証書の性質を有するもの
- (19) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替投資信託受益権を含みます。)
- (20) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- (21) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- (22) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。)
- (23) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- (24) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
- (25) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
- (26) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

(27)貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

(28)外国の者に対する権利で上記(27)の有価証券の性質を有するもの

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

### 3. 金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

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

(1) 預金

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

(3) コール・ローン

(4) 手形割引市場において売買される手形

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

(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は信託金を上記3.の(1)から(4)までの金融商品により運用することの指図ができます。(約款第16条第3項)

### (参考)当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド
基本方針	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	<ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>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。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 10px;"> <p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p> <p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p> </div>
------	---

運用プロセス	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にし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>

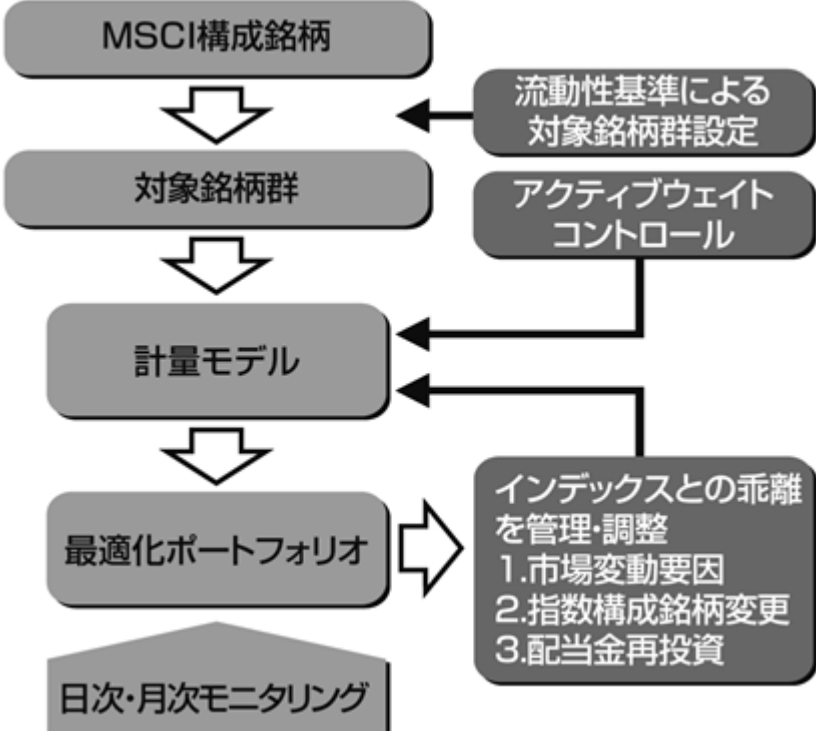
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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、

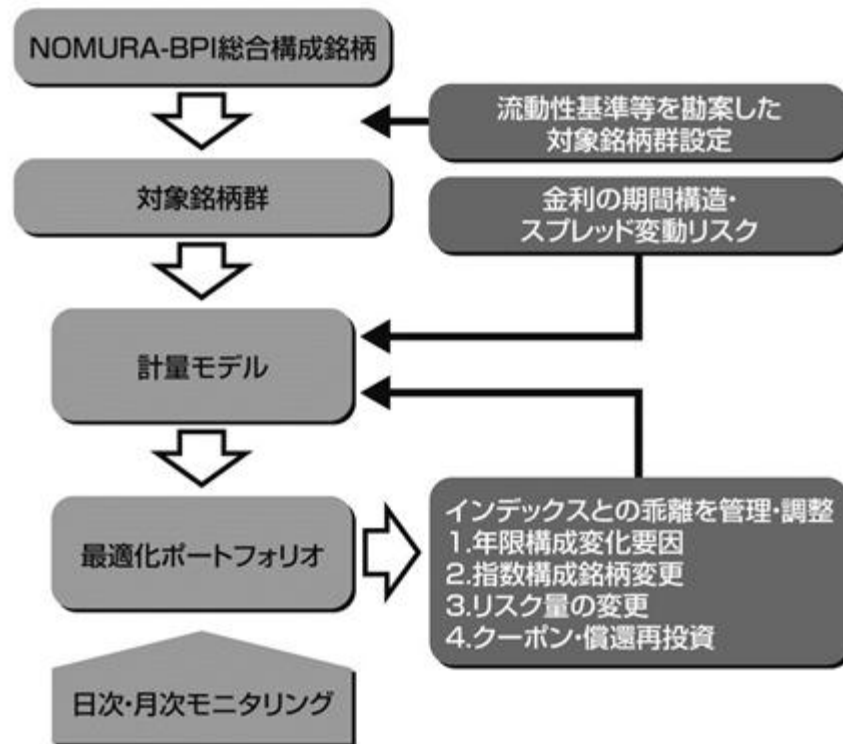
	<p>事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
<p>運用プロセス</p>	<p>1)流動性基準による対象銘柄群設定        取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2)最適化法によるポートフォリオの構築        インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3)インデックスとの乖離を管理        日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、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。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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</li> <li>・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</li> <li>・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</li> </ul>  <pre>       graph TD         A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]         C[流動性基準による対象銘柄群設定] --&gt; B         B --&gt; D[計量モデル]         E[アクティブウェイトコントロール] --&gt; D         D --&gt; F[最適化ポートフォリオ]         F --&gt; G[日次・月次モニタリング]         F --&gt; H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資]       </pre>

主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
--------	---

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>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>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>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> <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>

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



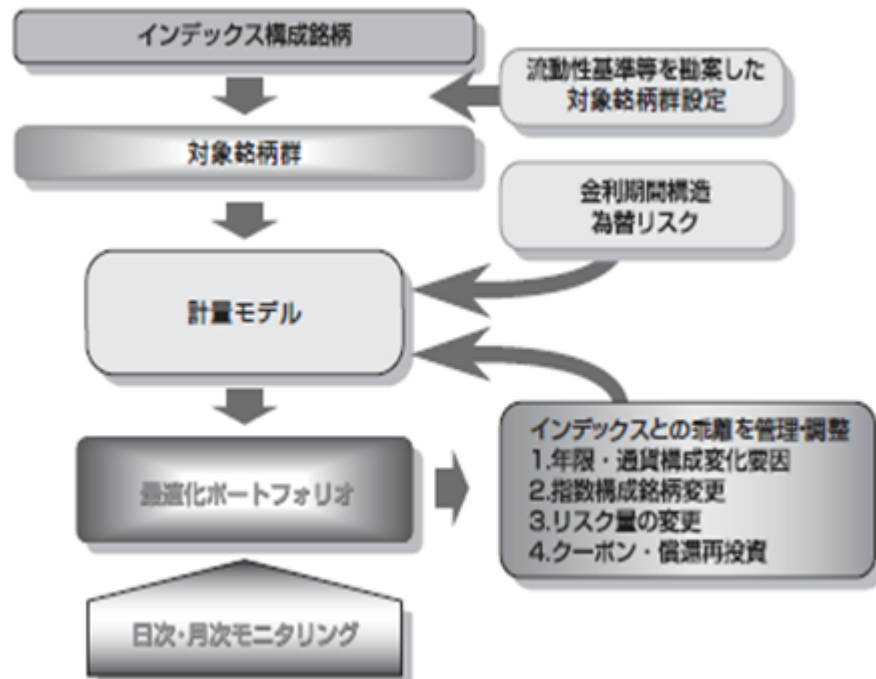


主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にし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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>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、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。</p>
	<p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>

運用プロセス

- 1)流動性基準等による対象銘柄群設定  
 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。
- 2)最適化法によるポートフォリオの構築  
 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。
- 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、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。  
 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
  - ・年限・通貨構成変化要因
  - ・指数構成銘柄変更
  - ・リスク量の変更
  - ・クーポン・償還再投資



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

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

## 投資態度

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

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

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

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

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

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

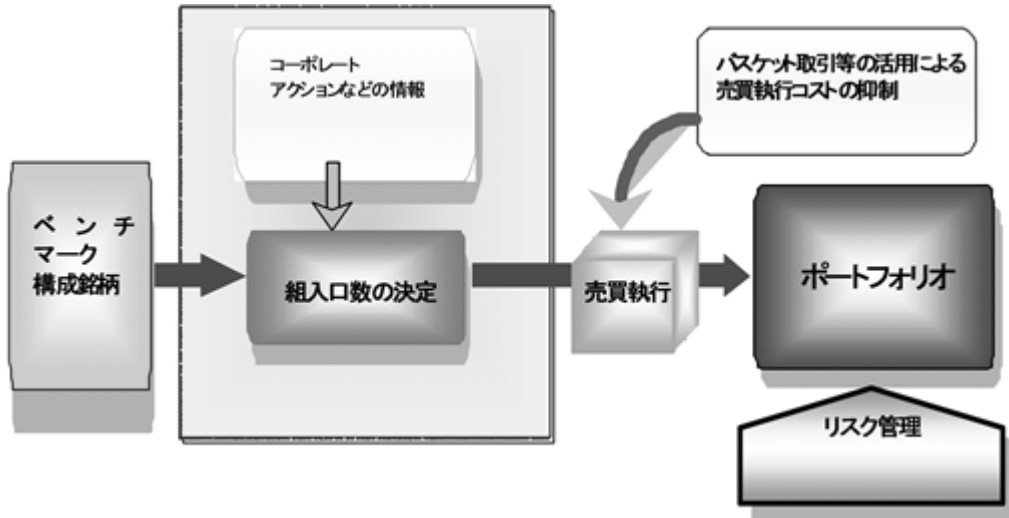
株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

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

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

運用プロセス

- ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。
- ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。
- ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。



主な投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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。

株式への投資は行いません。

外貨建資産への投資は行いません。

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。

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

ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REIT インデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託の受益証券(振替投資信託受益権を含みます。))および不動産投資法人の投資証券。以下同じ。)とします。



投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>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 &amp; 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。</li><li>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。</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。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。</li></ol>
------	---

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

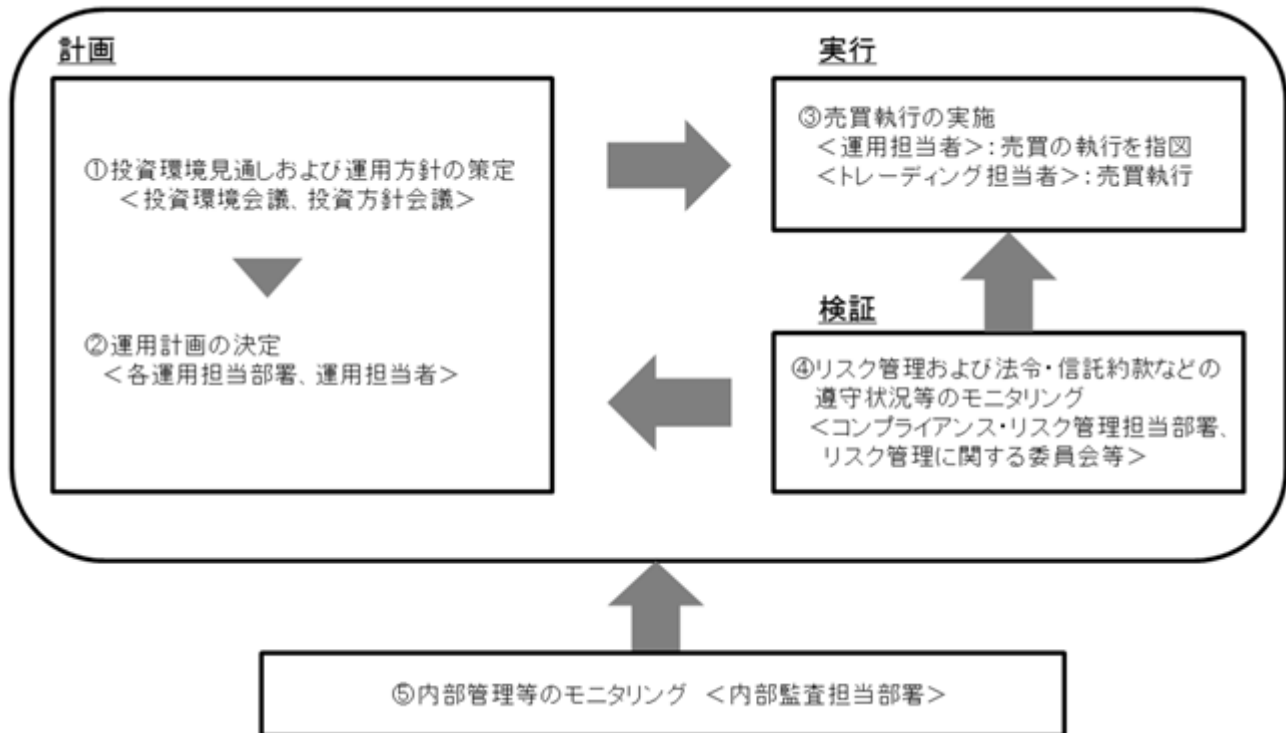
S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 REIT インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信(電子通信も含む)を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indicesは、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 REIT インデックスを使用することによっ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

	<p>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&amp;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&amp;P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&amp;P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&amp;P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD     A[インデックス構成銘柄] --&gt; B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定]     B --&gt; C[ポートフォリオ]     C --&gt; D[日々・月次モニタリング]     C --&gt; E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約]     E --&gt; B   </pre>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <p>株式への直接投資は行いません。</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%以内とします。ただし、S &amp; 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 &amp; P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。</p> <p>デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

## (3) 【運用体制】

## a. ファンドの運用体制



## 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

#### モニタリング

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

定期的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（毎年1月11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

##### 1)分配対象額の範囲

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

##### 2)分配対象額についての分配方針

原則として、経費控除後の利子配当等収益の範囲内で、基準価額水準および市況動向等を勘案し委託会社の判断により決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。

##### 3)留保益の運用方針

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

##### 収益の分配方式

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

1) 信託財産に属する配当等収益（利子およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）と各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額、監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

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

c. 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

##### 収益分配金の再投資

収益分配金は、税引後自動的に全額無手数料で再投資されます。

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

(5)【投資制限】

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

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

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

投資する株式等の範囲(約款第19条)

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

信用取引の指図および範囲(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.から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.から6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - 1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
  - 2.株式分割により取得する株券
  - 3.有償増資により取得する株券
  - 4.売出しにより取得する株券

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

#### 先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第23条)

- 1) 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を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。)
- 2) 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- 3) 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第24条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図・目的・範囲(約款第25条)

- 1) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 4) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条の2)

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

#### 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)



- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.2.の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)1.2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 公社債の空売りの指図および範囲(約款第27条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、公社債(信託財産により借り入れた公社債を含みます。)の引き渡しまたは買い戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2) 上記1)の売り付けの指図は、当該売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の売り付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売り付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 公社債の借入れ(約款第28条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- 2) 上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3) 信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4) 上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第29条)

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

#### 外国為替予約の指図および範囲(約款第30条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産に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が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に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37条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、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、資金借入れ額は借入指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
- 3)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、資金借入れ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。

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

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

### 3【投資リスク】

#### < 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

#### 資産配分リスク

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

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

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

#### 株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### 金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

#### リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

#### 為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

また、外貨建資産への投資は、その国の政治経済情勢、通貨規制、資本規制等の要因による影響を受けて損失を被る可能性もあります。

## 信用リスク

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

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

## 流動性リスク

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

当ファンドにおいて有価証券等を実質的に売却または取得する際に、市場規模、取引量、取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## <その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

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

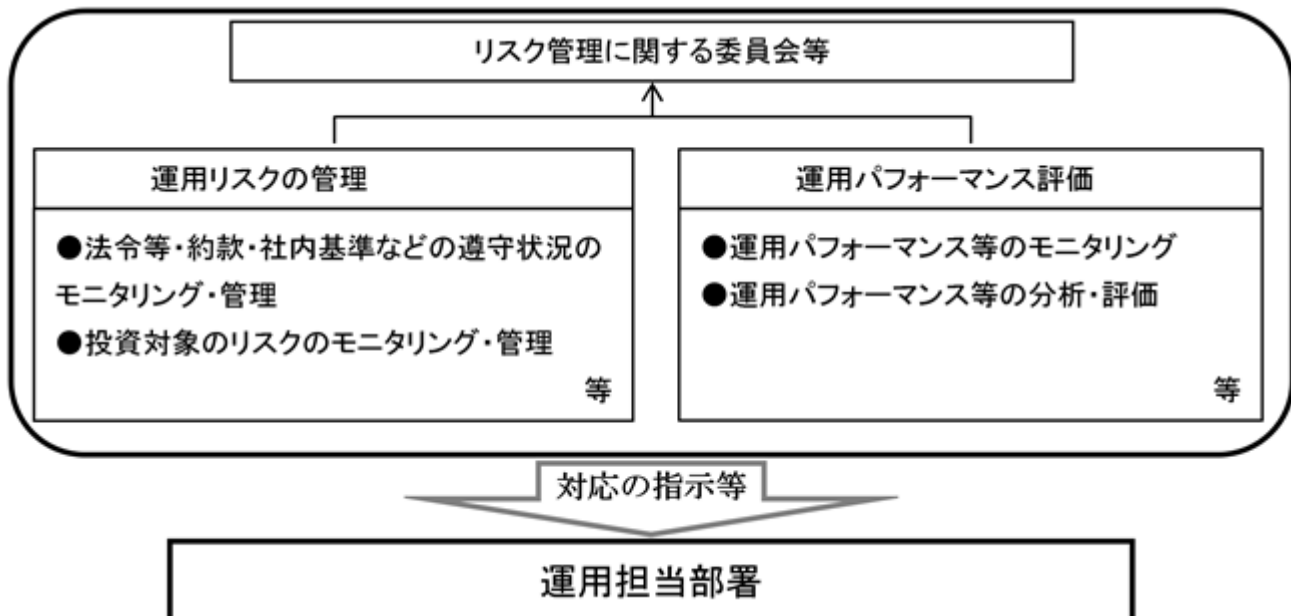
#### 注意事項

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

#### <リスク管理体制>

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

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



リスク管理体制は2020年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>

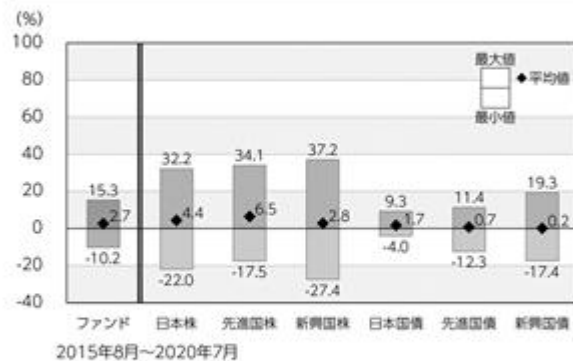
### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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

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

### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

\*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

### 各資産クラスの指数

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金（解約）手数料】

ありません。

## (3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.26%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.20%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬は、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年7月11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（イボットソン・アソシエイツ・ジャパン株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

## (4)【その他の手数料等】

## 1. 信託財産留保額

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

## 2. その他の費用

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

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

監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎年7月11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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### 損益通算について

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

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

NISAおよびジュニアNISAは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡



損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご注意ください。

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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	11,253,234,987	98.98
内 日本	11,253,234,987	98.98
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	115,591,526	1.02
純資産総額	11,368,826,513	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

令和2年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。

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 パミューダ	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。

## 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。

## 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	125,545,829,598	99.01
内 アメリカ	55,563,032,540	43.82
内 フランス	13,044,673,208	10.29
内 イタリア	11,838,944,055	9.34
内 ドイツ	9,679,110,849	7.63
内 イギリス	8,300,202,763	6.55
内 スペイン	7,762,524,804	6.12
内 ベルギー	3,261,159,037	2.57
内 オーストラリア	2,782,154,863	2.19
内 オランダ	2,550,348,048	2.01
内 カナダ	2,303,100,992	1.82
内 オーストリア	1,991,918,136	1.57
内 アイルランド	1,051,866,323	0.83
内 メキシコ	939,129,020	0.74
内 フィンランド	790,878,258	0.62
内 ポーランド	782,073,040	0.62
内 デンマーク	665,838,880	0.53
内 マレーシア	609,896,152	0.48
内 シンガポール	531,074,050	0.42
内 イスラエル	457,170,884	0.36
内 スウェーデン	372,789,338	0.29
内 ノルウェー	267,944,358	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,253,313,496	0.99
純資産総額	126,799,143,094	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年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。

## (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	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	834,497,929	4.0497 3,379,474,126	3.8177 3,185,862,743	- -	28.02
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	2,238,625,325	1.3138 2,941,321,309	1.3104 2,933,494,625	- -	25.80
3	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,138,688,254	2.7443 3,124,952,193	2.4020 2,735,129,186	- -	24.06
4	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	530,144,248	1.9082 1,011,622,978	1.9841 1,051,859,202	- -	9.25
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	623,478,643	1.3285 828,351,124	1.1008 686,325,290	- -	6.04
6	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	350,338,871	2.3333 817,449,030	1.8855 660,563,941	- -	5.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.98
合計	98.98

(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。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年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	S M C 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。

## 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

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。

#### 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
特殊債券	7.14
社債券	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。

## 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 2.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	1,087,840,000	101.00 1,098,760,890	102.39 1,113,888,665	2 2021/11/15	0.88
2	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	958,136,000	101.30 970,636,674	102.78 984,859,006	2.125 2021/12/31	0.78
3	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	885,962,000	101.19 896,517,403	102.85 911,260,360	2 2022/2/15	0.72
4	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	731,154,000	100.75 736,694,771	102.66 750,632,395	1.75 2022/3/31	0.59
5	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	671,532,000	108.30 727,313,879	108.80 730,658,289	2.375 2024/8/15	0.58
6	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	689,314,000	101.70 701,053,878	104.37 719,471,487	2 2022/11/30	0.57
7	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	683,038,000	101.72 694,831,073	103.82 709,185,548	2.125 2022/6/30	0.56
8	US T N/B 8.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	627,600,000	111.23 698,082,416	110.15 691,316,102	8 2021/11/15	0.55
9	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	629,692,000	105.04 661,471,767	108.53 683,461,790	2.75 2023/11/15	0.54
10	US T N/B 2.125 09/30/21 アメリカ	国債証券	610,864,000	101.08 617,491,874	102.32 625,061,810	2.125 2021/9/30	0.49
11	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	506,264,000	113.25 573,383,526	121.62 615,743,590	3.125 2028/11/15	0.49
12	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	587,852,000	100.67 591,824,591	103.42 607,990,521	1.625 2022/11/15	0.48
13	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	556,472,000	105.35 586,295,421	109.11 607,206,591	2.75 2024/2/15	0.48
14	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	577,392,000	102.11 589,616,468	104.82 605,224,095	2.125 2022/12/31	0.48
15	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	542,874,000	104.62 567,981,922	110.39 599,324,410	2.25 2025/11/15	0.47
16	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	554,380,000	102.98 570,924,777	108.03 598,903,643	2 2025/2/15	0.47
17	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	541,828,000	103.17 559,056,433	108.78 589,407,271	2 2025/8/15	0.46
18	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	538,690,000	103.71 558,680,445	109.04 587,424,610	2.125 2025/5/15	0.46
19	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	564,840,000	100.82 569,473,449	102.87 581,101,211	1.75 2022/5/15	0.46
20	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	549,150,000	100.96 554,469,890	103.50 568,413,149	1.75 2022/9/30	0.45
21	FRANCE OAT 0.25 11/25/26 フランス	国債証券	527,552,500	104.08 549,091,054	104.81 552,970,030	0.25 2026/11/25	0.44

22	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	317,772,800	173.16 550,262,155	173.22 550,458,943	5.75 2032/10/25	0.43
23	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	463,378,000	110.75 513,227,332	118.64 549,790,753	2.875 2028/5/15	0.43
24	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証券	535,552,000	100.10 536,116,835	101.60 544,129,196	1.5 2021/9/30	0.43
25	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	520,908,000	101.10 526,646,123	104.05 542,029,188	1.75 2023/1/31	0.43
26	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	457,102,000	109.60 500,990,929	117.25 535,987,801	2.75 2028/2/15	0.42
27	US T N/B 1.625 12/31/21 アメリカ	国債証券	523,000,000	102.42 535,666,327	102.11 534,083,102	1.625 2021/12/31	0.42
28	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	498,942,000	102.59 511,883,307	106.94 533,595,078	2 2024/5/31	0.42
29	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	490,574,000	104.01 510,273,610	108.72 533,384,243	2.25 2024/11/15	0.42
30	US T N/B 2.875 11/15/21 アメリカ	国債証券	510,448,000	102.47 523,069,622	103.50 528,333,617	2.875 2021/11/15	0.42

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

令和2年7月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	99.01
合計	99.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年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。

**【投資不動産物件】**

該当事項はありません。

(参考)

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
該当事項はありません。

**【その他投資資産の主要なもの】**

該当事項はありません。

(参考)

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年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。

## 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
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep20	買建	337	1,355,228,375	1,335,271,375	0.37
	ICE-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。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

## J-REITインデックスファンド・マザーファンド

令和2年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	TREIT 先物 0209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。

## (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4計算期間末 (平成23年1月11日)	7,727	7,727	0.7224	0.7224
第5計算期間末 (平成24年1月11日)	7,492	7,492	0.6688	0.6688
第6計算期間末 (平成25年1月11日)	8,892	8,892	0.8003	0.8003
第7計算期間末 (平成26年1月14日)	9,193	9,193	0.9817	0.9817
第8計算期間末 (平成27年1月13日)	9,794	9,794	1.1261	1.1261
第9計算期間末 (平成28年1月12日)	10,062	10,062	1.0954	1.0954
第10計算期間末 (平成29年1月11日)	11,012	11,012	1.1844	1.1844
第11計算期間末 (平成30年1月11日)	11,528	11,528	1.3017	1.3017
第12計算期間末 (平成31年1月11日)	10,725	10,725	1.2039	1.2039
第13計算期間末 (令和2年1月14日)	12,252	12,252	1.3699	1.3699
令和1年7月末日	11,534	-	1.2880	-
8月末日	11,411	-	1.2687	-
9月末日	11,668	-	1.3000	-
10月末日	11,941	-	1.3334	-
11月末日	12,076	-	1.3496	-
12月末日	12,160	-	1.3604	-
令和2年1月末日	12,182	-	1.3600	-
2月末日	11,497	-	1.2886	-
3月末日	10,458	-	1.1790	-
4月末日	10,886	-	1.2226	-
5月末日	11,333	-	1.2628	-
6月末日	11,341	-	1.2684	-
7月末日	11,368	-	1.2704	-



## 【分配の推移】

	1口当たりの分配金（円）
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
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4計算期間	1.9
第5計算期間	7.4
第6計算期間	19.7
第7計算期間	22.7
第8計算期間	14.7
第9計算期間	2.7
第10計算期間	8.1
第11計算期間	9.9
第12計算期間	7.5
第13計算期間	13.8
令和2年1月15日～令和2年7月14日	6.5

（注）収益率は期間騰落率です。

## （４）【設定及び解約の実績】

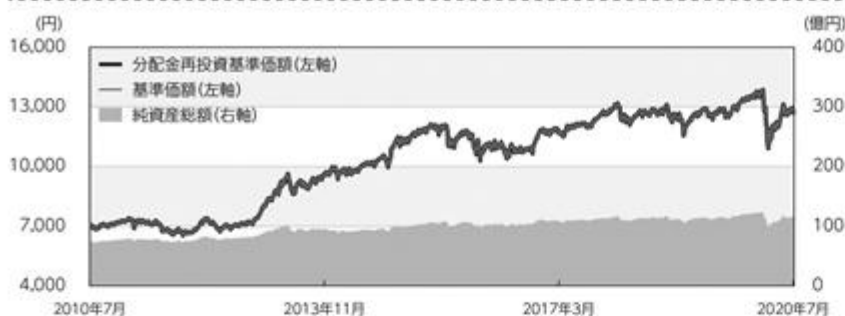
	設定口数	解約口数
第4計算期間	1,561,559,539	1,016,414,248
第5計算期間	1,553,939,256	1,049,226,063
第6計算期間	1,341,335,454	1,433,126,499
第7計算期間	1,753,311,968	3,498,697,249
第8計算期間	1,496,503,368	2,163,948,960
第9計算期間	1,823,323,622	1,334,995,256
第10計算期間	1,257,703,399	1,145,956,042
第11計算期間	1,031,255,707	1,472,513,113
第12計算期間	914,554,043	862,640,600
第13計算期間	954,093,952	918,248,197
令和2年1月15日～ 令和2年7月14日	650,905,042	643,403,276

（注）本邦外における設定及び解約はありません。

## &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 (2010年7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、グラフの起点における基準価額に合わせて指数化しています。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2007年1月26日)

## 分配の推移 (税引前)

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	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.02
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.80
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	24.06
4	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.25
5	外国リートパッシブ・ファンド・マザーファンド	6.04
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.81

## ■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

## ■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

○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

## ■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

## ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	アメリカ	2	2021/11/15	0.88
2	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/12/31	0.78
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2	2022/2/15	0.72
4	US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	アメリカ	1.75	2022/3/31	0.59
5	US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	アメリカ	2.375	2024/8/15	0.58

## ■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

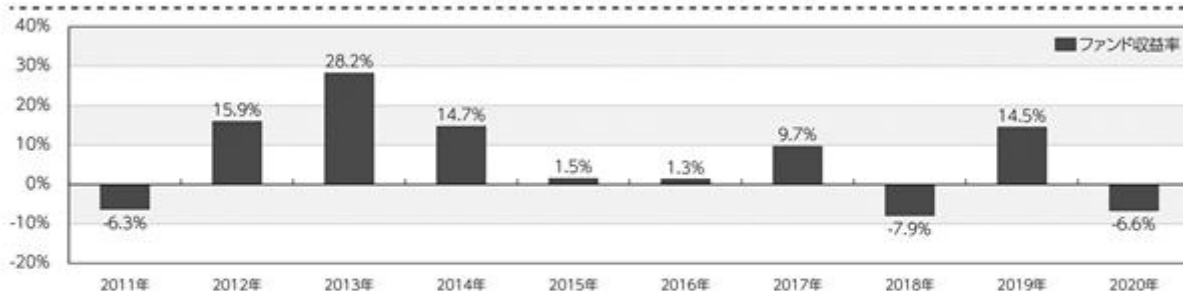
## ■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### ・お申込みの方法

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合、取扱いが一部異なる場合があります。

当ファンドは、収益の分配がなされた場合に、収益分配金を無手数料で再投資する「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、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再投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、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。

また、受益者と販売会社との間であらかじめ決められた一定の金額を一定期間毎に定額購入（積立）することができる場合があります。販売会社までお問い合わせください。当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。

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

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

#### ・お申込価額（発行価格）

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、収益分配金を再投資する場合には、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

- ・お申込手数料  
ありません。

- ・お申込単位

販売会社が定める単位とします。

お申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金の再投資については、1口単位となります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

- ・払込期日

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に販売会社の定める単位をもって解約を請求することができます。委託会社は、解約の請求を受付けた場合には、この信託契約の一部を解約します。

解約のお申込みの受付は、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、解約の請求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、解約の請求の受付を行いません。

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

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

・解約価額

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

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 <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>
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、委託会社にて計算されます。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社への問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は2007年1月26日から無期限です。ただし、下記(5)イ.の場合には信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は原則として毎年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、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなった場合には、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- b. 委託会社は、信託期間中においてこの信託契約を解約することが受益者のために有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
- c. 委託会社は、上記a.およびb.の事項について、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- d. 委託会社は上記c.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- e. 上記d.に定める一定期間内に異議を述べた受益者の受益権口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは信託契約の解約をしません。
- f. 委託会社は、上記e.の規定により、信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの内容を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- g. 上記d.からf.の規定は信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記d.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- i. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記

「ロ.信託約款の変更d.」に該当する場合を除き、その投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

#### ロ.信託約款の変更

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



## 八. 関係法人との契約の更改

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

### 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てします。)に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付けを行います。当該売付けにより増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

いては原則として取得申込者とします。)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。

#### 一部解約請求権

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

#### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13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】

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 平成31年1月11日現在	第13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	183,423,275	171,145,930
親投資信託受益証券	10,612,615,306	12,130,018,870
流動資産合計	10,796,038,581	12,301,164,800
資産合計	10,796,038,581	12,301,164,800
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	26,069,902	15,255,491
未払受託者報酬	3,380,731	2,628,706
未払委託者報酬	41,217,634	30,230,538
その他未払費用	237,547	249,079
流動負債合計	70,905,814	48,363,814
負債合計	70,905,814	48,363,814
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,908,596,761	8,944,442,516
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,816,536,006	3,308,358,470
(分配準備積立金)	2,681,696,894	2,953,167,127
元本等合計	10,725,132,767	12,252,800,986
純資産合計	10,725,132,767	12,252,800,986
負債純資産合計	10,796,038,581	12,301,164,800

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期		第13期	
	自 至	平成30年1月12日 平成31年1月11日	自 至	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		770,172,272		1,548,327,564
その他収益		94,211		70,650
営業収益合計		770,078,061		1,548,398,214
<b>営業費用</b>				
支払利息		143,214		103,255
受託者報酬		7,577,245		5,041,081
委託者報酬		93,974,022		57,973,331
その他費用		477,449		478,161
営業費用合計		102,171,930		63,595,828
営業利益又は営業損失( )		872,249,991		1,484,802,386
経常利益又は経常損失( )		872,249,991		1,484,802,386
当期純利益又は当期純損失( )		872,249,991		1,484,802,386
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( )		38,331,007		76,202,003
期首剰余金又は期首欠損金( )		2,671,819,463		1,816,536,006
剰余金増加額又は欠損金減少額		237,272,086		273,612,004
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		237,272,086		273,612,004
剰余金減少額又は欠損金増加額		258,636,559		190,389,923
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		258,636,559		190,389,923
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		1,816,536,006		3,308,358,470

## (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13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. 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12期	第13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	8,856,683,318円	8,908,596,761円
期中追加設定元本額	914,554,043円	954,093,952円
期中一部解約元本額	862,640,600円	918,248,197円
2. 受益権の総数	8,908,596,761口	8,944,442,516口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13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(136,206,368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(1,643,323,164円)及び分配準備積立金(2,545,490,526円)より分配対象収益は4,325,020,058円(1万口当たり4,854.88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(231,105,081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(302,028,925円)、信託約款に規定される収益調整金(1,923,437,391円)及び分配準備積立金(2,420,033,121円)より分配対象収益は4,876,604,518円(1万口当たり5,452.10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12期 自 平成30年1月12日 至 平成31年1月11日	第13期 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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、主要投資対象である親投資信託受益証券が保有する金融商品に係る、価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスク等のリスクに晒されております。	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 平成31年1月11日現在	第13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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 平成31年1月11日現在	第13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	727,621,845	1,513,825,662
合計	727,621,845	1,513,825,662

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。



(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 平成31年1月11日現在	第13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)	1,2039円 (12,039円)	1,3699円 (13,699円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

令和2年1月14日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	1,120,067,435	3,086,121,803	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,373,109,117	3,118,028,068	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	328,184,484	779,339,694	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	792,953,460	3,255,311,839	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	608,711,291	1,161,421,143	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	520,836,657	729,796,323	
親投資信託受益証券 合計		5,743,862,444	12,130,018,870	
合計			12,130,018,870	

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

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

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

リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,361,214,519円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	5,602,955円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,636,868円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,311,705円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	10,798,340円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	34,196,244円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,235,209,579円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	204,093,997円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	834,994円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	709,579円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	713,959円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	189,185円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	78,739,020円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	60,924,956円
日米資産配分戦略ファンド(インカム重視型)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	619,149,099円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	89,946,801円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	206,404,283円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,789,652円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	48,075,805円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	14,232,103円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	10,898,566円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,025,819円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	54,091,785円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	847,524,247円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	842,970,799円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,416,784,905円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	170,583,328円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	47,266,489円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	462,442,535円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	123,979,136円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	2,256,332円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	35,787,888円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	479,569,491円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	36,811,782円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	131,239,904円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	339,216,777円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,627,526,351円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	57,780,766円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	23,343,327円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	16,767,270円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	101,694円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	119,842円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	380,720,505円

	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)	1,210,952,937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)	1,605,155,025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)	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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 株式関連

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

(注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年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	
TATERU	30,100	214.00	6,441,400	
スペースバリューホールディングス	18,000	584.00	10,512,000	
住石ホールディングス	29,500	147.00	4,336,500	



日鉄鉱業	3,300	4,775.00	15,757,500
三井松島ホールディングス	5,700	1,208.00	6,885,600
国際石油開発帝石	585,000	1,155.00	675,675,000
石油資源開発	19,100	3,045.00	58,159,500
K&Oエナジーグループ	7,100	1,505.00	10,685,500
ダイセキ環境ソリューション	2,800	1,145.00	3,206,000
第一カッター興業	1,800	1,843.00	3,317,400
安藤・間	86,800	966.00	83,848,800
東急建設	42,800	758.00	32,442,400
コムシスホールディングス	51,700	3,195.00	165,181,500
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
UTグループ	12,100	3,300.00	39,930,000
アイティメディア	3,100	909.00	2,817,900
タケエイ	9,800	1,233.00	12,083,400
E・Jホールディングス	1,200	1,840.00	2,208,000
ビーネックスグループ	11,300	1,313.00	14,836,900
コシダカホールディングス	24,700	1,565.00	38,655,500
アルトナー	2,500	840.00	2,100,000
パソナグループ	12,500	1,565.00	19,562,500
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
エブコ	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
S B S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D Y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
W D B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
C D G	1,100	1,427.00	1,569,700
バリューコマース	5,700	2,544.00	14,500,800
インフォマート	112,400	1,018.00	114,423,200
サッポロホールディングス	36,800	2,652.00	97,593,600
アサヒグループホールディングス	225,800	4,973.00	1,122,903,400

キリンホールディングス	457,100	2,446.50	1,118,295,150	
宝ホールディングス	80,700	1,004.00	81,022,800	
オエノンホールディングス	28,500	400.00	11,400,000	
養命酒製造	3,300	1,988.00	6,560,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	75,700	2,881.00	218,091,700	
サントリー食品インターナショナル	72,100	4,620.00	333,102,000	
ダイドーグループホールディングス	5,500	4,545.00	24,997,500	
伊藤園	32,700	5,580.00	182,466,000	
キーコーヒー	10,700	2,285.00	24,449,500	
ユニカフェ	2,900	979.00	2,839,100	
ジャパンフーズ	1,500	1,293.00	1,939,500	
日清オイリオグループ	13,900	3,815.00	53,028,500	
不二製油グループ本社	26,300	2,986.00	78,531,800	
かどや製油	1,100	3,845.00	4,229,500	
J・オイルミルズ	5,600	4,300.00	24,080,000	
ローソン	26,800	6,330.00	169,644,000	
サンエー	8,800	4,620.00	40,656,000	
カワチ薬品	8,200	2,161.00	17,720,200	
エービーシー・マート	16,500	7,010.00	115,665,000	
ハードオフコーポレーション	4,200	828.00	3,477,600	
高千穂交易	4,100	1,217.00	4,989,700	
アスクル	11,100	3,410.00	37,851,000	
ゲオホールディングス	19,000	1,300.00	24,700,000	
アダストリア	14,600	2,328.00	33,988,800	
ジーフット	6,600	620.00	4,092,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1,500	689.00	1,033,500	
伊藤忠食品	2,400	5,170.00	12,408,000	
くら寿司	5,500	5,370.00	29,535,000	
キャンドウ	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
イートアンド	3,800	1,840.00	6,992,000
大冷	1,400	1,964.00	2,749,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,900	1,221.00	7,203,900
日清食品ホールディングス	45,800	8,160.00	373,728,000
永谷園ホールディングス	5,300	2,170.00	11,501,000
一正蒲鉾	3,900	1,005.00	3,919,500
フジッコ	11,700	1,992.00	23,306,400
ロック・フィールド	11,600	1,554.00	18,026,400
日本たばこ産業	622,300	2,429.00	1,511,566,700
ケンコーマヨネーズ	6,100	2,457.00	14,987,700
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,912.00	13,575,200
なとり	6,100	1,710.00	10,431,000
イフジ産業	1,900	761.00	1,445,900
ピク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
ゲンゼ	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
ブロンコビリー	5,500	2,787.00	15,328,500
ZOZO	72,700	1,985.00	144,309,500
トレジャー・ファクトリー	3,100	965.00	2,991,500
物語コーポレーション	2,600	8,940.00	23,244,000
ココカラファイン	11,000	6,610.00	72,710,000
三越伊勢丹ホールディングス	184,800	1,003.00	185,354,400
東洋紡	41,500	1,578.00	65,487,000
ユニチカ	31,000	351.00	10,881,000
富士紡ホールディングス	5,100	3,505.00	17,875,500
日清紡ホールディングス	71,500	1,047.00	74,860,500
倉敷紡績	10,800	2,431.00	26,254,800
ダイワボウホールディングス	9,000	6,470.00	58,230,000
シキボウ	5,600	1,076.00	6,025,600
日東紡績	16,000	5,120.00	81,920,000
トヨタ紡織	31,300	1,714.00	53,648,200
マクニカ・富士エレホールディングス	25,200	1,853.00	46,695,600
Hamee	3,200	1,586.00	5,075,200
ラクト・ジャパン	3,900	3,790.00	14,781,000
ウエルシアホールディングス	31,500	6,830.00	215,145,000
クリエイトSDホールディングス	15,600	2,822.00	44,023,200
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,000	1,034.00	20,680,000
八洲電機	8,300	915.00	7,594,500
メディアスホールディングス	6,000	880.00	5,280,000
レスターホールディングス	11,000	2,071.00	22,781,000
ジューテックホールディングス	2,300	1,170.00	2,691,000
丸善CHIホールディングス	12,200	367.00	4,477,400
大光	4,600	666.00	3,063,600
OCHIホールディングス	3,000	1,474.00	4,422,000
TOKAIホールディングス	55,900	1,073.00	59,980,700
黒谷	1,900	521.00	989,900
ミサワ	2,200	747.00	1,643,400
ティーライフ	1,400	887.00	1,241,800
Cominix	1,800	829.00	1,492,200
エー・ピーカンパニー	2,100	675.00	1,417,500
三洋貿易	5,300	2,530.00	13,409,000
チムニー	3,200	2,345.00	7,504,000
シュッピン	7,200	1,304.00	9,388,800
ビューティガレージ	1,700	2,452.00	4,168,400
ウイン・パートナーズ	7,600	1,285.00	9,766,000
ネクステージ	15,100	1,211.00	18,286,100
ジョイフル本田	31,000	1,341.00	41,571,000
鳥貴族	3,500	2,380.00	8,330,000

キリン堂ホールディングス	4,200	1,993.00	8,370,600	
ホットランド	7,100	1,284.00	9,116,400	
すかいらーくホールディングス	118,500	2,174.00	257,619,000	
SFPホールディングス	4,500	2,517.00	11,326,500	
綿半ホールディングス	4,000	1,803.00	7,212,000	
日本毛織	34,600	1,120.00	38,752,000	
ダイトウボウ	18,400	86.00	1,582,400	
トーア紡コーポレーション	4,000	530.00	2,120,000	
ダイドーリミテッド	14,200	279.00	3,961,800	
ヨシックス	1,700	2,802.00	4,763,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,800	971.00	29,906,800	
三栄建築設計	4,300	1,599.00	6,875,700	
野村不動産ホールディングス	64,200	2,738.00	175,779,600	
三重交通グループホールディングス	21,500	608.00	13,072,000	
サムティ	15,000	1,823.00	27,345,000	
ディア・ライフ	13,600	607.00	8,255,200	
コーセーアールイー	3,100	929.00	2,879,900	
エー・ディー・ワークス	197,900	29.00	5,739,100	
日本商業開発	6,700	1,703.00	11,410,100	
プレサンスコーポレーション	17,300	1,356.00	23,458,800	
ユニゾホールディングス	16,000	5,160.00	82,560,000	
THEグローバル社	5,600	464.00	2,598,400	
ハウスコム	1,400	1,570.00	2,198,000	
日本管理センター	7,000	1,277.00	8,939,000	
サンセイランディック	3,100	919.00	2,848,900	
エストラスト	1,400	839.00	1,174,600	
フージャースホールディングス	21,100	706.00	14,896,600	
オープンハウス	30,700	3,030.00	93,021,000	
東急不動産ホールディングス	288,000	738.00	212,544,000	
飯田グループホールディングス	88,400	1,956.00	172,910,400	
イーグランド	1,700	879.00	1,494,300	
ムゲンエステート	7,300	764.00	5,577,200	
帝国繊維	11,800	2,272.00	26,809,600	
日本コークス工業	91,800	79.00	7,252,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	663.00	3,248,700	
ミタチ産業	3,200	766.00	2,451,200	
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	
ソフトクリエイイトホールディングス	4,600	1,703.00	7,833,800	
オンリー	1,900	811.00	1,540,900	
セブン&アイ・ホールディングス	413,800	4,285.00	1,773,133,000	
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	28,500	2,044.00	58,254,000	
明治電機工業	3,300	1,608.00	5,306,400	
ツルハホールディングス	23,000	13,900.00	319,700,000	



デリカフーズホールディングス	3,900	729.00	2,843,100	
スターティアホールディングス	2,400	815.00	1,956,000	
サンマルクホールディングス	8,400	2,324.00	19,521,600	
フェリシモ	2,300	1,045.00	2,403,500	
トリドールホールディングス	13,100	2,863.00	37,505,300	
帝人	85,800	2,036.00	174,688,800	
東レ	761,700	748.20	569,903,940	
クラレ	165,700	1,313.00	217,564,100	
旭化成	697,200	1,200.50	836,988,600	
サカイオーベックス	2,800	1,891.00	5,294,800	
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	
S U M C O	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	
R S T e c h n o l o g i e s	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	
ハウズドゥ	5,900	1,443.00	8,513,700	
シーアールイー	2,600	1,192.00	3,099,200	
プロパティエージェント	1,700	1,185.00	2,014,500	
ケイアイスター不動産	3,300	2,032.00	6,705,600	
アグレ都市デザイン	1,500	592.00	888,000	
グッドコムアセット	2,500	2,000.00	5,000,000	
ジェイ・エス・ビー	1,100	5,840.00	6,424,000	
テンポイノベーション	2,400	977.00	2,344,800	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	636.00	1,081,200	
住江織物	3,000	2,693.00	8,079,000	
日本フェルト	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	
L I X I L ビバ	10,400	1,980.00	20,592,000	

アセンテック	800	2,339.00	1,871,200	
セーレン	25,900	1,508.00	39,057,200	
ソトー	3,700	973.00	3,600,100	
東海染工	1,400	1,131.00	1,583,400	
小松マテーレ	17,200	788.00	13,553,600	
ワコールホールディングス	27,400	2,994.00	82,035,600	
ホギメディカル	12,000	3,605.00	43,260,000	
レナウン	27,600	113.00	3,118,800	
クラウ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	
バイキューブ	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	
GMOペイメントゲートウェイ	17,300	8,030.00	138,919,000	
ザッパラス	5,500	405.00	2,227,500	
システムリサーチ	2,800	1,845.00	5,166,000	
インターネットイニシアティブ	15,600	2,961.00	46,191,600	
さくらインターネット	11,300	739.00	8,350,700	
ヴィンクス	3,000	1,262.00	3,786,000	
GMOクラウド	2,000	2,635.00	5,270,000	
SRAホールディングス	5,600	2,600.00	14,560,000	
システムインテグレータ	3,300	911.00	3,006,300	
朝日ネット	7,500	642.00	4,815,000	
e B A S E	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نز	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	
g u m i	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	
P C I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	
P R T I M E S	900	2,668.00	2,401,200	
ランドコンピュータ	1,600	1,144.00	1,830,400	

ダブルスタンダード	1,300	4,900.00	6,370,000
オープンドア	5,200	1,489.00	7,742,800
マイネット	3,400	702.00	2,386,800
アカツキ	3,700	5,900.00	21,830,000
ベネフィットジャパン	800	1,874.00	1,499,200
Ubicomホールディングス	2,300	1,371.00	3,153,300
LINE	24,100	5,390.00	129,899,000
カナミックネットワーク	6,500	846.00	5,499,000
ノムラシステムコーポレーション	2,300	543.00	1,248,900
レンゴー	99,400	828.00	82,303,200
トモク	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	
ビオフェルミン製薬	1,700	2,385.00	4,054,500	
中外製薬	112,000	10,450.00	1,170,400,000	

科研製薬	18,400	5,980.00	110,032,000
エーザイ	128,500	8,106.00	1,041,621,000
理研ビタミン	5,100	3,980.00	20,298,000
ロート製薬	55,100	3,445.00	189,819,500
小野薬品工業	246,600	2,599.50	641,036,700
久光製薬	28,400	5,940.00	168,696,000
有機合成薬品工業	8,300	289.00	2,398,700
持田製薬	14,900	4,375.00	65,187,500
参天製薬	200,000	2,161.00	432,200,000
扶桑薬品工業	3,800	2,025.00	7,695,000
日本ケミファ	1,400	2,903.00	4,064,200
ツムラ	33,300	3,175.00	105,727,500
日医工	30,400	1,325.00	40,280,000
テルモ	303,900	3,932.00	1,194,934,800
みらかホールディングス	28,700	2,671.00	76,657,700
キッセイ薬品工業	19,000	3,075.00	58,425,000
生化学工業	20,800	1,233.00	25,646,400
栄研化学	18,900	2,143.00	40,502,700
日水製薬	4,600	1,277.00	5,874,200
鳥居薬品	6,700	3,195.00	21,406,500
JCRファーマ	7,600	9,330.00	70,908,000
東和薬品	13,700	2,810.00	38,497,000
富士製薬工業	7,300	1,281.00	9,351,300
沢井製薬	22,000	7,090.00	155,980,000
ゼリア新薬工業	19,500	2,078.00	40,521,000
第一三共	307,300	7,200.00	2,212,560,000
キョーリン製薬ホールディングス	23,700	1,934.00	45,835,800
大幸薬品	4,300	3,535.00	15,200,500
ダイト	6,300	3,170.00	19,971,000
大塚ホールディングス	204,600	4,948.00	1,012,360,800
大正製薬ホールディングス	22,700	8,130.00	184,551,000
ペプチドリーム	54,300	5,740.00	311,682,000
大日本塗料	12,000	1,169.00	14,028,000
日本ペイントホールディングス	86,800	5,760.00	499,968,000
関西ペイント	118,200	2,742.00	324,104,400
神東塗料	8,600	221.00	1,900,600
中国塗料	30,000	1,029.00	30,870,000
日本特殊塗料	7,900	1,399.00	11,052,100
藤倉化成	14,500	576.00	8,352,000
太陽ホールディングス	7,800	4,585.00	35,763,000
D I C	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S Cホールディングス	22,300	2,546.00	56,775,800
T & K T O K A	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
ビーピー・カストロール	3,800	1,460.00	5,548,000
富士石油	28,900	238.00	6,878,200
MORESCO	4,000	1,415.00	5,660,000
出光興産	120,800	2,958.00	357,326,400
JXTGホールディングス	1,615,300	492.90	796,181,370
コスモエネルギーホールディングス	31,100	2,470.00	76,817,000
横浜ゴム	62,200	2,049.00	127,447,800
TOYO TIRE	61,700	1,458.00	89,958,600

ブリヂストン	330,100	3,990.00	1,317,099,000	
住友ゴム工業	96,500	1,284.00	123,906,000	
藤倉コンポジット	9,600	474.00	4,550,400	
オカモト	6,500	4,000.00	26,000,000	
アキレス	7,400	1,803.00	13,342,200	
フコク	4,700	739.00	3,473,300	
ニッタ	12,100	3,100.00	37,510,000	
クリエートメディック	3,600	1,052.00	3,787,200	
住友理工	20,900	911.00	19,039,900	
三ツ星ベルト	14,100	2,010.00	28,341,000	
バンドー化学	18,900	887.00	16,764,300	
A G C	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	
T O T O	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	
M A R U W A	4,100	8,770.00	35,957,000	
品川リフラクトリーズ	2,800	3,240.00	9,072,000	
黒崎播磨	2,100	6,410.00	13,461,000	
ヨータイ	8,500	720.00	6,120,000	
イソライト工業	5,500	645.00	3,547,500	
東京窯業	13,800	340.00	4,692,000	
ニッカトー	4,900	752.00	3,684,800	
フジインコーポレーテッド	9,600	3,075.00	29,520,000	
クニミネ工業	4,400	1,316.00	5,790,400	
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,510.00	2,718,000	
ニチアス	29,400	2,758.00	81,085,200	
日本製鉄	475,300	1,680.50	798,741,650	
神戸製鋼所	194,300	579.00	112,499,700	
中山製鋼所	14,800	530.00	7,844,000	
合同製鐵	5,700	2,738.00	15,606,600	
ジェイ エフ イー ホールディング ス	286,800	1,485.00	425,898,000	

東京製鐵	51,800	770.00	39,886,000
共英製鋼	12,000	2,096.00	25,152,000
大和工業	22,600	2,676.00	60,477,600
東京鐵鋼	4,400	1,482.00	6,520,800
大阪製鐵	5,700	1,526.00	8,698,200
淀川製鋼所	14,400	1,956.00	28,166,400
丸一鋼管	34,500	3,095.00	106,777,500
モリ工業	3,100	2,592.00	8,035,200
大同特殊鋼	17,400	4,705.00	81,867,000
日本高周波鋼業	4,300	424.00	1,823,200
日本冶金工業	8,800	2,302.00	20,257,600
山陽特殊製鋼	7,700	1,540.00	11,858,000
愛知製鋼	6,000	3,760.00	22,560,000
日立金属	114,400	1,662.00	190,132,800
日本金属	2,500	919.00	2,297,500
大平洋金属	7,200	2,582.00	18,590,400
新日本電工	68,700	167.00	11,472,900
栗本鐵工所	5,200	2,107.00	10,956,400
虹 技	1,600	1,454.00	2,326,400
日本鑄鉄管	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
DOWAホールディングス	26,900	4,195.00	112,845,500
古河機械金属	18,900	1,415.00	26,743,500
エス・サイエンス	48,900	47.00	2,298,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	1,512.00	16,783,200
東邦チタニウム	19,000	937.00	17,803,000
UACJ	16,100	2,418.00	38,929,800
CKサンエツ	1,900	3,445.00	6,545,500
古河電気工業	33,000	2,752.00	90,816,000
住友電気工業	396,900	1,637.00	649,725,300
フジクラ	128,200	446.00	57,177,200
昭和電線ホールディングス	12,300	1,463.00	17,994,900
東京特殊電線	1,600	2,371.00	3,793,600
タツタ電線	21,100	629.00	13,271,900
カナレ電気	1,700	1,822.00	3,097,400
平河ヒューテック	4,000	1,700.00	6,800,000
リョービ	13,100	1,937.00	25,374,700
アールスティ	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

ホッカホールディングス	5,900	2,046.00	12,071,400
コロナ	6,000	1,051.00	6,306,000
横河ブリッジホールディングス	19,800	1,880.00	37,224,000
OSJBホールディングス	53,000	266.00	14,098,000
駒井ハルテック	1,900	1,908.00	3,625,200
高田機工	900	2,666.00	2,399,400
三和ホールディングス	101,900	1,230.00	125,337,000
文化シャッター	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
LIXILグループ	156,700	1,919.00	300,707,300
日本フィルコン	8,300	560.00	4,648,000
ノーリツ	22,000	1,436.00	31,592,000
長府製作所	10,800	2,337.00	25,239,600
リンナイ	20,700	8,460.00	175,122,000
ユニプレス	20,800	1,506.00	31,324,800
ダイニチ工業	5,600	695.00	3,892,000
日東精工	14,700	637.00	9,363,900
三洋工業	1,400	2,010.00	2,814,000
岡部	21,500	902.00	19,393,000
ジーテクト	13,200	1,714.00	22,624,800
東プレ	19,800	1,737.00	34,392,600
高周波熱錬	20,500	884.00	18,122,000
東京製綱	7,600	1,227.00	9,325,200
サンコール	6,000	573.00	3,438,000
モリテックスチール	8,400	397.00	3,334,800
パイオラックス	15,700	2,089.00	32,797,300
エイチワン	10,400	808.00	8,403,200
日本発条	113,900	983.00	111,963,700
中央発條	1,200	3,005.00	3,606,000
アドバネクス	1,300	1,710.00	2,223,000
三浦工業	46,000	3,840.00	176,640,000
タクマ	36,000	1,244.00	44,784,000
テクノプロ・ホールディングス	20,600	7,550.00	155,530,000
アトラ	2,300	335.00	770,500
インターワークス	1,900	534.00	1,014,600
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	5,320.00	22,344,000
Keeper 技研	3,800	1,365.00	5,187,000
ファーストロジック	2,300	602.00	1,384,600
三機サービス	2,200	1,088.00	2,393,600
Gunosy	7,200	1,478.00	10,641,600
デザインワン・ジャパン	2,000	302.00	604,000
イー・ガーディアン	5,200	2,019.00	10,498,800
リブセンス	6,600	292.00	1,927,200
ジャパンマテリアル	31,600	1,923.00	60,766,800
ベクトル	12,800	1,256.00	16,076,800
ウチヤマホールディングス	5,300	544.00	2,883,200
チャーム・ケア・コーポレーション	7,600	988.00	7,508,800

ライクキッズ	2,500	815.00	2,037,500
キャリアリンク	3,300	616.00	2,032,800
I B J	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
E R I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
OKK	4,400	659.00	2,899,600
石川製作所	2,600	1,776.00	4,617,600
東洋機械金属	7,600	548.00	4,164,800
津田駒工業	2,100	1,260.00	2,646,000
エンシュウ	2,600	1,344.00	3,494,400
島精機製作所	17,100	2,390.00	40,869,000
オプトラ	11,800	3,205.00	37,819,000
NCホールディングス	3,300	695.00	2,293,500
イワキ	5,100	1,277.00	6,512,700
フリー	10,400	1,183.00	12,303,200
ヤマシンフィルタ	23,100	861.00	19,889,100
日阪製作所	13,100	959.00	12,562,900
やまびこ	20,600	1,131.00	23,298,600
平田機工	5,000	7,260.00	36,300,000
ペガサスミシン製造	10,700	501.00	5,360,700
マルマエ	4,400	970.00	4,268,000
タツモ	5,000	1,408.00	7,040,000
ナブテスコ	62,600	3,465.00	216,909,000
三井海洋開発	11,300	2,658.00	30,035,400
レオン自動機	10,400	1,583.00	16,463,200
SMC	33,700	53,950.00	1,818,115,000
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	622.00	5,784,600
ホソカワミクロン	3,700	4,765.00	17,630,500
ユニオンツール	4,000	3,320.00	13,280,000
オイレス工業	13,800	1,648.00	22,742,400
日精エー・エス・ビー機械	3,600	4,410.00	15,876,000
サトーホールディングス	15,100	3,340.00	50,434,000
技研製作所	9,300	4,680.00	43,524,000
日本エアテック	3,400	805.00	2,737,000
カワタ	3,100	1,107.00	3,431,700
日精樹脂工業	8,900	1,008.00	8,971,200
オカダアイヨン	3,400	1,281.00	4,355,400
ワイエイシイホールディングス	4,600	738.00	3,394,800
小松製作所	486,400	2,642.00	1,285,068,800
住友重機械工業	61,500	3,140.00	193,110,000
日立建機	43,000	3,360.00	144,480,000
日工	14,700	807.00	11,862,900
巴工業	4,600	2,217.00	10,198,200
井関農機	10,800	1,614.00	17,431,200
TOWA	10,800	1,175.00	12,690,000
丸山製作所	2,200	1,186.00	2,609,200
北川鉄工所	4,800	2,338.00	11,222,400
シンニッタン	16,600	463.00	7,685,800
ローツェ	4,700	4,660.00	21,902,000
タカキタ	3,600	620.00	2,232,000
クボタ	569,700	1,722.00	981,023,400
荏原実業	2,700	2,304.00	6,220,800
東洋エンジニアリング	14,100	663.00	9,348,300

三菱化工機	3,700	1,913.00	7,078,100
月島機械	19,800	1,627.00	32,214,600
帝国電機製作所	8,800	1,467.00	12,909,600
東京機械製作所	4,600	365.00	1,679,000
新東工業	25,400	999.00	25,374,600
澁谷工業	9,400	3,050.00	28,670,000
アイチコーポレーション	18,600	757.00	14,080,200
小森コーポレーション	27,200	1,105.00	30,056,000
鶴見製作所	8,400	1,933.00	16,237,200
住友精密工業	1,600	3,315.00	5,304,000
日本ギア工業	3,600	407.00	1,465,200
酒井重工業	2,000	2,806.00	5,612,000
荏原製作所	44,400	3,385.00	150,294,000
石井鐵工所	1,400	2,688.00	3,763,200
西島製作所	10,900	913.00	9,951,700
北越工業	11,100	1,327.00	14,729,700
ダイキン工業	136,800	15,580.00	2,131,344,000
オルガノ	3,900	7,670.00	29,913,000
トヨーカネツ	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
SANKYO	23,900	3,770.00	90,103,000
日本金銭機械	11,800	894.00	10,549,200
マースグループホールディングス	6,800	2,028.00	13,790,400
フクシマガリレイ	6,600	4,085.00	26,961,000
オーイズミ	4,500	603.00	2,713,500
ダイコク電機	4,900	1,655.00	8,109,500
竹内製作所	17,900	1,895.00	33,920,500
アマノ	28,100	3,285.00	92,308,500
JUKI	14,900	855.00	12,739,500
サンデンホールディングス	14,100	774.00	10,913,400
蛇の目マシン工業	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
T H K	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
ベイカレント・コンサルティング	6,200	5,810.00	36,022,000
Orchestra Holdings	2,000	1,205.00	2,410,000
アイモバイル	3,200	776.00	2,483,200
キャリアインデックス	4,300	423.00	1,818,900
MS - J a p a n	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
G A M E W I T H	2,200	775.00	1,705,000
ソウルドアウト	1,600	1,958.00	3,132,800
MS & C o n s u l t i n g	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	
S M K	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	
ヒコセ電機	16,600	14,260.00	236,716,000	
日本航空電子工業	24,600	2,292.00	56,383,200	
T O A	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	
O B A R A G R O U P	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	
かんぼ生命保険	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	
C A S A	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	
G M B	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	
トビー工業	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	
N O K	57,700	1,615.00	93,185,500	
フタバ産業	29,900	718.00	21,468,200	
K Y B	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
S U B A R U	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
カップ・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
J M S	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	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
S C R E E N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
H O Y A	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
廣済堂	7,500	805.00	6,037,500
エステールホールディングス	2,700	687.00	1,854,900
アーク	40,700	94.00	3,825,800
レック	11,500	1,294.00	14,881,000
タカノ	4,100	800.00	3,280,000
三光合成	12,500	377.00	4,712,500
プロネクサス	9,200	1,247.00	11,472,400
ホクシン	7,100	159.00	1,128,900
ウッドワン	3,400	1,262.00	4,290,800
大建工業	7,200	1,924.00	13,852,800
きもと	18,600	179.00	3,329,400
凸版印刷	151,500	2,228.00	337,542,000
大日本印刷	140,500	2,977.00	418,268,500
共同印刷	3,300	3,000.00	9,900,000
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
M r M a x H D	14,600	473.00	6,905,800
テンアライド	9,600	444.00	4,262,400
A O K I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
フォーパル	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
P A L T A C	17,000	5,540.00	94,180,000
三谷産業	14,200	341.00	4,842,200
O l y m p i cグループ	5,500	643.00	3,536,500
日産東京販売ホールディングス	16,100	285.00	4,588,500
新生銀行	77,800	1,632.00	126,969,600
あおぞら銀行	63,100	2,930.00	184,883,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,291,100	579.00	4,221,546,900
りそなホールディングス	1,162,300	468.30	544,305,090
三井住友トラスト・ホールディングス	200,200	4,219.00	844,643,800
三井住友フィナンシャルグループ	732,500	3,998.00	2,928,535,000

千葉銀行	364,200	633.00	230,538,600	
群馬銀行	208,000	371.00	77,168,000	
武蔵野銀行	15,800	1,782.00	28,155,600	
千葉興業銀行	29,000	375.00	10,875,000	
筑波銀行	44,100	225.00	9,922,500	
七十七銀行	35,700	1,721.00	61,439,700	
青森銀行	8,200	2,781.00	22,804,200	
秋田銀行	6,800	2,118.00	14,402,400	
山形銀行	11,900	1,520.00	18,088,000	
岩手銀行	7,000	2,716.00	19,012,000	
東邦銀行	94,800	255.00	24,174,000	
東北銀行	5,100	1,033.00	5,268,300	
みちのく銀行	6,900	1,479.00	10,205,100	
ふくおかフィナンシャルグループ	89,200	2,040.00	181,968,000	
静岡銀行	262,200	794.00	208,186,800	
十六銀行	13,300	2,418.00	32,159,400	
スルガ銀行	108,400	457.00	49,538,800	
八十二銀行	255,500	447.00	114,208,500	
山梨中央銀行	12,300	1,113.00	13,689,900	
大垣共立銀行	21,000	2,286.00	48,006,000	
福井銀行	9,000	1,805.00	16,245,000	
北國銀行	10,900	3,250.00	35,425,000	
清水銀行	4,400	2,170.00	9,548,000	
富山銀行	2,000	2,287.00	4,574,000	
滋賀銀行	21,200	2,689.00	57,006,800	
南都銀行	17,600	2,673.00	47,044,800	
百五銀行	95,400	332.00	31,672,800	
京都銀行	37,900	4,575.00	173,392,500	
紀陽銀行	37,500	1,591.00	59,662,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	70,400	1,100.00	77,440,000	
広島銀行	156,400	510.00	79,764,000	
山陰合同銀行	62,800	633.00	39,752,400	
中国銀行	91,100	1,037.00	94,470,700	
鳥取銀行	3,700	1,362.00	5,039,400	
伊予銀行	151,000	597.00	90,147,000	
百十四銀行	11,300	2,046.00	23,119,800	
四国銀行	16,100	986.00	15,874,600	
阿波銀行	17,300	2,338.00	40,447,400	
大分銀行	6,100	2,676.00	16,323,600	
宮崎銀行	7,000	2,563.00	17,941,000	
佐賀銀行	6,400	1,648.00	10,547,200	
沖縄銀行	9,700	3,490.00	33,853,000	
琉球銀行	24,400	1,120.00	27,328,000	
セブン銀行	353,800	337.00	119,230,600	
みずほフィナンシャルグループ	14,393,200	166.60	2,397,907,120	
高知銀行	3,900	877.00	3,420,300	
山口フィナンシャルグループ	132,200	697.00	92,143,400	
芙蓉総合リース	11,100	7,220.00	80,142,000	
みずほリース	16,300	3,380.00	55,094,000	
東京センチュリー	21,300	5,740.00	122,262,000	

SBIホールディングス	118,300	2,417.00	285,931,100	
日本証券金融	46,700	520.00	24,284,000	
アイフル	161,700	300.00	48,510,000	
日本アジア投資	9,100	276.00	2,511,600	
長野銀行	3,500	1,619.00	5,666,500	
名古屋銀行	8,600	3,180.00	27,348,000	
北洋銀行	159,500	226.00	36,047,000	
愛知銀行	3,800	3,645.00	13,851,000	
中京銀行	4,400	2,210.00	9,724,000	
大光銀行	3,700	1,688.00	6,245,600	
愛媛銀行	14,800	1,126.00	16,664,800	
トマト銀行	4,100	1,064.00	4,362,400	
京葉銀行	45,100	598.00	26,969,800	
栃木銀行	51,000	223.00	11,373,000	
北日本銀行	3,300	2,230.00	7,359,000	
東和銀行	18,600	840.00	15,624,000	
福島銀行	10,200	264.00	2,692,800	
大東銀行	5,500	636.00	3,498,000	
リコーリース	8,300	4,220.00	35,026,000	
イオンフィナンシャルサービス	64,800	1,717.00	111,261,600	
アコム	212,800	514.00	109,379,200	
ジャックス	11,700	2,761.00	32,303,700	
オリエントコーポレーション	286,700	171.00	49,025,700	
日立キャピタル	24,900	3,035.00	75,571,500	
アプラスフィナンシャル	51,700	97.00	5,014,900	
オリックス	662,500	1,853.00	1,227,612,500	
三菱UFJリース	268,800	697.00	187,353,600	
ジャフコ	16,300	4,230.00	68,949,000	
九州リースサービス	4,900	601.00	2,944,900	
トモニホールディングス	81,900	400.00	32,760,000	
大和証券グループ本社	849,700	577.70	490,871,690	
野村ホールディングス	1,863,600	580.70	1,082,192,520	
岡三証券グループ	90,200	391.00	35,268,200	
丸三証券	31,400	489.00	15,354,600	
東洋証券	38,200	148.00	5,653,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	121,500	346.00	42,039,000	
光世証券	2,500	655.00	1,637,500	
水戸証券	31,000	219.00	6,789,000	
いちよし証券	19,800	648.00	12,830,400	
松井証券	60,500	888.00	53,724,000	
SOMPOホールディングス	199,200	4,213.00	839,229,600	
だいこう証券ビジネス	5,100	672.00	3,427,200	
日本取引所グループ	304,000	2,017.00	613,168,000	
マネックスグループ	80,000	284.00	22,720,000	
極東証券	14,300	762.00	10,896,600	
岩井コスモホールディングス	9,900	1,300.00	12,870,000	
藍澤證券	19,000	730.00	13,870,000	
フィデアホールディングス	103,000	131.00	13,493,000	
池田泉州ホールディングス	122,200	201.00	24,562,200	

アニコム ホールディングス	8,800	3,685.00	32,428,000	
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	277,000	3,670.00	1,016,590,000	
ソニーフィナンシャルホールディング ス	87,000	2,639.00	229,593,000	
マネーパートナーズグループ	11,600	246.00	2,853,600	
スパークス・グループ	36,600	275.00	10,065,000	
小林洋行	3,100	268.00	830,800	
第一生命ホールディングス	599,300	1,747.00	1,046,977,100	
東京海上ホールディングス	378,700	6,147.00	2,327,868,900	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	1,015.00	5,278,000	
イー・ギャランティ	11,400	1,276.00	14,546,400	
アサックス	5,600	748.00	4,188,800	
NECキャピタルソリューション	4,300	2,504.00	10,767,200	
T&Dホールディングス	316,500	1,321.00	418,096,500	
アドバンスクリエイト	2,400	1,833.00	4,399,200	
三井不動産	522,400	2,767.00	1,445,480,800	
三菱地所	742,200	2,097.50	1,556,764,500	
平和不動産	19,400	3,065.00	59,461,000	
東京建物	115,700	1,723.00	199,351,100	
ダイビル	27,300	1,295.00	35,353,500	
京阪神ビルディング	17,200	1,385.00	23,822,000	
住友不動産	238,100	3,830.00	911,923,000	
太平洋興発	4,000	810.00	3,240,000	
テーオーシー	20,800	909.00	18,907,200	
東京楽天地	1,400	6,180.00	8,652,000	
レオパレス21	138,800	388.00	53,854,400	
スターツコーポレーション	14,400	2,722.00	39,196,800	
フジ住宅	12,400	694.00	8,605,600	
空港施設	10,900	552.00	6,016,800	
明和地所	5,900	634.00	3,740,600	
ゴールドクレスト	8,400	2,108.00	17,707,200	
リログループ	56,100	3,015.00	169,141,500	
エスリード	4,100	2,068.00	8,478,800	
日神グループホールディングス	15,600	547.00	8,533,200	
日本エスコン	19,100	933.00	17,820,300	
タカラレーベン	48,500	490.00	23,765,000	
A V A N T I A	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	
S G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	
A N A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W i s m e t t a c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	
G e n k y D r u g S t o r e s	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B S放送	3,600	1,165.00	4,194,000	
ビジョン	9,800	1,850.00	18,130,000	
スマートバリュー	3,100	806.00	2,498,600	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	4,000	1,782.00	7,128,000	



ワイヤレスゲート	5,000	720.00	3,600,000
コネクシオ	6,000	1,710.00	10,260,000
日本通信	81,400	239.00	19,454,600
クロップス	1,900	726.00	1,379,400
日本電信電話	1,408,600	2,792.00	3,932,811,200
KDDI	785,300	3,283.00	2,578,139,900
ソフトバンク	957,800	1,485.50	1,422,811,900
光通信	10,900	27,820.00	303,238,000
NTTドコモ	778,400	3,110.00	2,420,824,000
エムティーアイ	10,200	736.00	7,507,200
GMOインターネット	41,500	2,239.00	92,918,500
ファイバーゲート	2,000	1,403.00	2,806,000
アイドママーケティングコミュニケーション	3,100	711.00	2,204,100
KADOKAWA	28,400	2,073.00	58,873,200
学研ホールディングス	3,500	7,370.00	25,795,000
ゼンリン	21,000	1,731.00	36,351,000
昭文社	5,100	392.00	1,999,200
インプレスホールディングス	8,600	187.00	1,608,200
東京電力ホールディングス	857,200	435.00	372,882,000
中部電力	328,700	1,449.00	476,286,300
関西電力	407,000	1,229.50	500,406,500
中国電力	148,600	1,411.00	209,674,600
北陸電力	98,300	763.00	75,002,900
東北電力	268,500	1,020.00	273,870,000
四国電力	96,800	1,014.00	98,155,200
九州電力	221,400	895.00	198,153,000
北海道電力	100,600	508.00	51,104,800
沖縄電力	19,900	1,986.00	39,521,400
電源開発	85,500	2,572.00	219,906,000
エフオン	5,100	760.00	3,876,000
イーレックス	15,300	1,815.00	27,769,500
レノバ	17,800	1,136.00	20,220,800
東京瓦斯	206,600	2,582.00	533,441,200
大阪瓦斯	208,400	1,981.00	412,840,400
東邦瓦斯	52,800	4,360.00	230,208,000
北海道瓦斯	5,800	1,622.00	9,407,600
広島ガス	22,600	357.00	8,068,200
西部瓦斯	12,100	2,491.00	30,141,100
静岡ガス	30,500	934.00	28,487,000
メタウォーター	5,200	4,285.00	22,282,000
アイネット	5,400	1,645.00	8,883,000
松竹	7,000	16,650.00	116,550,000
東宝	63,000	4,550.00	286,650,000
エイチ・アイ・エス	16,000	3,020.00	48,320,000
東映	3,900	16,390.00	63,921,000
ラックランド	2,100	2,219.00	4,659,900
エヌ・ティ・ティ・データ	280,600	1,546.00	433,807,600
共立メンテナンス	17,000	5,020.00	85,340,000
イチネンホールディングス	11,500	1,571.00	18,066,500

建設技術研究所	7,100	2,320.00	16,472,000
スペース	6,700	1,258.00	8,428,600
長 大	3,800	1,312.00	4,985,600
アインホールディングス	14,200	6,590.00	93,578,000
燦ホールディングス	4,500	1,433.00	6,448,500
ピー・シー・エー	1,400	5,250.00	7,350,000
スバル興業	600	10,120.00	6,072,000
東京テアトル	4,100	1,386.00	5,682,600
タナベ経営	1,900	1,284.00	2,439,600
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,533.00	4,559,400
ナガワ	3,300	7,880.00	26,004,000
よみうりランド	2,200	4,510.00	9,922,000
東京都競馬	6,700	3,310.00	22,177,000
常磐興産	4,200	1,682.00	7,064,400
カナモト	16,800	2,789.00	46,855,200
東京ドーム	41,600	1,082.00	45,011,200
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・ビー	2,000	2,168.00	4,336,000
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	67,700	33.00	2,234,100
日本空港ビルデング	33,800	5,760.00	194,688,000
トランス・コスモス	9,800	2,820.00	27,636,000
乃村工藝社	44,000	1,321.00	58,124,000
ジャステック	6,700	1,181.00	7,912,700
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
日本システムウエア	3,500	2,602.00	9,107,000
セントラル警備保障	4,900	6,120.00	29,988,000
アイネス	10,400	1,415.00	14,716,000
丹青社	19,400	1,318.00	25,569,200
メイテック	12,700	6,310.00	80,137,000
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ホールディングス	7,100	1,924.00	13,660,400	
JKホールディングス	9,600	726.00	6,969,600	
サガミホールディングス	14,100	1,372.00	19,345,200	
日伝	9,600	2,051.00	19,689,600	
関西スーパーマーケット	8,800	1,045.00	9,196,000	
ミロク情報サービス	9,300	3,325.00	30,922,500	
北沢産業	7,600	277.00	2,105,200	
杉本商事	5,700	2,039.00	11,622,300	
因幡電機産業	30,100	2,692.00	81,029,200	
王将フードサービス	7,800	6,650.00	51,870,000	
プレナス	11,900	1,921.00	22,859,900	
ミニストップ	7,800	1,538.00	11,996,400	
アークス	21,600	2,081.00	44,949,600	
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。

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

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

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

## 通貨関連

種類	令和2年1月14日現在				
	契約額等（円）	うち		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 HOLIDINGS INC	4,508	86.890	391,700.120	
TRANSDIGM GROUP INC	3,681	604.570	2,225,422.170	
MASTERCARD INC	69,914	315.210	22,037,591.940	
HANESBRANDS INC	27,619	14.140	390,532.660	
WESTERN UNION CO	35,222	26.500	933,383.000	
OWENS CORNING	7,756	65.070	504,682.920	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	101.150	1,124,079.950	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	61.290	539,781.030	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,067	67.760	478,859.920	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	23.840	413,624.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	128.490	1,179,024.240	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,545	16.425	485,276.620	
DELTA AIR LINES INC	11,158	59.490	663,789.420	
INSULET CORP	4,781	184.450	881,855.450	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	33.400	201,669.200	
DISCOVER FINANCIAL	23,978	82.880	1,987,296.640	
TE CONNECTIVITY LTD	25,641	97.920	2,510,766.720	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	88.800	1,418,136.000	
WABCO HOLDING INC	4,076	135.520	552,379.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,255	245.180	2,023,960.900	
VMWARE INC	6,532	152.000	992,864.000	
MERCADOLIBRE INC	3,500	691.100	2,418,850.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	275.700	1,261,878.900	
INVESCO LTD	33,443	18.060	603,980.580	
MSCI INC	6,714	271.990	1,826,140.860	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	120,348	87.820	10,568,961.360	
VISA INC	133,771	195.330	26,129,489.430	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	123.740	1,798,684.640	
DISCOVERY INC-C	30,421	29.810	906,850.010	

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

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



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

	ROKU INC	6,674	133.930	893,848.820	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	11,986	510.150	6,114,657.900	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	22.530	675,900.000	
アメリカ・ドル	小計	23,278,667		2,171,093,076.830 (239,167,613,342)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	9.708	308,694.980	
	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	
WHEELLOCK & 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。

## 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
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	394,177,784円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	112,665,586円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	346,002,770円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	739,037円
DIAMバランス60VA(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。

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	1,199,294,217
コール・ローン	400,579,000
国債証券	128,216,590,918
派生商品評価勘定	34,668
未収入金	3,315,959,003
未収利息	1,047,593,008
前払費用	12,692,535
流動資産合計	134,192,743,349
資産合計	
134,192,743,349	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,375,964
未払解約金	556,526,000
流動負債合計	559,901,964
負債合計	
559,901,964	
純資産の部	
元本等	
元本	70,038,452,021
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	63,594,389,364
元本等合計	133,632,841,385
純資産合計	133,632,841,385
負債純資産合計	134,192,743,349

## 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	104,514,418,065円
同期中追加設定元本額	18,806,946,515円
同期中一部解約元本額	53,282,912,559円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国債券パッシブ・ファンド	8,836,039,433円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,872,361円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	22,416,555円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	26,511,635円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	81,315,037円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	83,655,608円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	33,523,720円
たわらノーロード 先進国債券	6,058,693,744円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	124,683,347円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	424,707,162円
たわらノーロード バランス(堅実型)	10,350,554円
たわらノーロード バランス(標準型)	49,409,007円
たわらノーロード バランス(積極型)	10,302,144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)	1,151,498円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	91,918,236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)	111,644,511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)	23,856,642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)	11,391,288円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	66,762円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,495,886円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,888,076円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,767,609円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,148,742円
DIAM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,788,497,719円
One DC 先進国債券インデックスファンド	633,483円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	563,311,477円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,776,508,113円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,893,291,927円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	367,533,477円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	794,341,497円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	636,723,681円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	21,865,647円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	608,711,291円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,544,595円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,271,635円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	89,318,673円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	144,218,255円
クルーズコントロール	2,935,622,952円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	103,965,584円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	173,545,305円
クルーズコントロール<DC年金>	2,777,045円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	9,644,950円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	18,243,490円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	36,894,601円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	117,892,129円

4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	136,519円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,202,435,275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)	4,923,227円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	6,606,736,425円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	3,343,537,776円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,200,165,612円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	6,074,330,363円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	87,304,942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)	619,059,995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)	473,292,498円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	42,779,519円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	68,890,264円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	20,395,865円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	5,201,925円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	55,949,832円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	77,529,667円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,835,000,838円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,963,359,418円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,463,304,445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)	611,493,537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)	237,341,311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)	2,667,283,483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)	659,602,364円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,851,575円
DIAM世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	92,698,962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)	458,040,103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)	648,201,249円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	3,110,132,802円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	82,817,841円
DIAMバランス20VA(適格機関投資家限定)	71,950,728円
DIAMバランス40VA(適格機関投資家限定)	365,642円
DIAMバランス60VA(適格機関投資家限定)	170,936円
計	70,038,452,021円
2. 受益権の総数	70,038,452,021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	5,131,850,016
合計	5,131,850,016

(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22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	2,679,770,000	-	-	2,683,111,296	3,341,296
アメリカ・ドル	1,501,540,000	-	-	1,501,540,000	-
イギリス・ポンド	79,490,000	-	-	79,497,218	7,218
オーストラリア・ドル	47,990,000	-	-	48,223,609	233,609
カナダ・ドル	56,290,000	-	-	56,292,001	2,001
シンガポール・ドル	16,510,000	-	-	16,666,792	156,792
デンマーク・クローネ	13,520,000	-	-	13,523,294	3,294
ポーランド・ズロチ	15,630,000	-	-	15,626,224	3,776
ユーロ	923,080,000	-	-	926,049,027	2,969,027
南アフリカ・ランド	25,720,000	-	-	25,693,131	26,869
合計	2,679,770,000	-	-	2,683,111,296	3,341,296

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年1月14日現在	
1口当たり純資産額	1.9080円
(1万口当たり純資産額)	(19,080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	3,680,000.000	3,659,731.220	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,396,918.750	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	11,177,596.030	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,432,428.120	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,074,132.800	
		US T N/B 1.375 09/30/23	3,100,000.000	3,073,601.540	
		US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,207,400.380	
		US T N/B 1.5 08/15/26	4,290,000.000	4,222,633.570	
		US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	748,212.880	
		US T N/B 1.5 09/30/21	5,120,000.000	5,110,199.960	
		US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,154,201.540	
		US T N/B 1.625 05/15/26	4,290,000.000	4,258,160.130	
		US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,902,492.170	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	3,984,508.580	
		US T N/B 1.625 08/15/29	4,380,000.000	4,296,506.240	
		US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,329,437.500	
		US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,624,610.140	
		US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,002,176.530	
		US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,014,574.180	
		US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,419,195.260	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,990,000.000	6,017,610.120	
		US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	833,339.440	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,345,862.500	
		US T N/B 1.75 07/31/24	5,050,000.000	5,072,488.250	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,272,148.430	
		US T N/B 1.75 11/15/29	1,280,000.000	1,269,099.990	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,689,712.500	
		US T N/B 1.875 06/30/26	720,000.000	725,793.740	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,388,885.930	
		US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,707,025.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,151,443.730	
		US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,540,473.020	
		US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,421,552.320	
		US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,386,125.000	
		US T N/B 2.0 05/31/21	10,130,000.000	10,183,419.840	
		US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,841,550.000	
		US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,263,770.280	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,475,968.670	
		US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,203,717.160	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,664,652.310	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,325,187.500	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,159,687.500	
US T N/B 2.125 05/15/25	5,150,000.000	5,262,656.250			
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,097,726.560			
US T N/B 2.125 06/30/22	6,530,000.000	6,615,706.250			
US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,085,507.730			

US T N/B 2.125 09/30/21	8,840,000.000	8,915,968.750	
US T N/B 2.125 09/30/24	3,920,000.000	4,003,606.230	
US T N/B 2.125 12/31/21	9,160,000.000	9,253,031.250	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,604,525.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	358,312.500	
US T N/B 2.25 02/15/27	4,670,000.000	4,820,680.440	
US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,833,962.450	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,184,631.250	
US T N/B 2.25 04/30/21	8,170,000.000	8,236,062.040	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,382,757.790	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,779,946.870	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,720,000.000	2,687,062.480	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,370,749.990	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,818,975.000	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,345,700.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	4,040,000.000	4,176,034.350	
US T N/B 2.25 12/31/23	4,830,000.000	4,942,825.750	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,827,375.000	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,228,359.370	
US T N/B 2.375 05/15/29	5,430,000.000	5,680,713.240	
US T N/B 2.375 08/15/24	6,110,000.000	6,305,233.550	
US T N/B 2.375 11/15/49	1,860,000.000	1,887,900.000	
US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,917,826.140	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,020,983.570	
US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,089,769.910	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,840,000.000	2,943,393.750	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,043,413.260	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,664,550.760	
US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,048,448.430	
US T N/B 2.5 05/15/24	6,240,000.000	6,463,275.000	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,790,000.000	2,894,189.050	
US T N/B 2.5 08/15/23	6,240,000.000	6,431,587.460	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,293,087.500	
US T N/B 2.625 02/15/29	5,130,000.000	5,471,064.800	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,251,957.020	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,881,993.750	
US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,842,896.450	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,176,184.370	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,407,720.310	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,553,165.590	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,682,728.120	
US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,696,194.510	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,580,651.560	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,391,347.630	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	833,573.430	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,397,478.880	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	1,949,484.360	
US T N/B 2.75 08/15/47	770,000.000	840,021.870	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,255,952.330	

US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,731,993.750	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,910,000.000	7,196,656.990	
US T N/B 2.75 11/15/42	2,110,000.000	2,285,228.890	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,640,000.000	2,879,043.720	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,990,000.000	5,402,064.810	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,720,000.000	3,008,149.990	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,700,000.000	4,150,070.280	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,684,369.510	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,602,139.820	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,680,000.000	5,073,046.820	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,090,000.000	2,319,410.140	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	877,734.370	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,858,644.510	
US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	4,991,515.610	
US T N/B 2.875 11/15/46	2,220,000.000	2,474,085.910	
US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,903,053.090	
US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,706,200.000	
US T N/B 3.0 02/15/47	2,540,000.000	2,901,354.660	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,110,000.000	3,558,034.370	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,524,024.190	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,105,179.680	
US T N/B 3.0 05/15/45	2,910,000.000	3,297,166.390	
US T N/B 3.0 05/15/47	2,350,000.000	2,682,855.450	
US T N/B 3.0 08/15/48	3,210,000.000	3,678,208.560	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,509,250.770	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,056,800.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	2,290,000.000	2,591,457.010	
US T N/B 3.0 11/15/45	2,950,000.000	3,349,171.870	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,380,000.000	1,588,401.540	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,657,687.490	
US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,157,500.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,115,213.260	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,830,000.000	3,267,544.510	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,470,000.000	6,049,050.730	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	874,356.250	
US T N/B 3.375 05/15/44	2,420,000.000	2,906,457.790	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,720,000.000	4,566,009.350	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,092,937.500	
US T N/B 3.625 02/15/21	5,500,000.000	5,618,593.750	
US T N/B 3.625 02/15/44	2,790,000.000	3,478,345.300	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,078,106.250	
US T N/B 3.75 08/15/41	410,000.000	516,055.460	
US T N/B 3.75 11/15/43	2,620,000.000	3,324,534.370	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,417,678.120	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,080,021.080	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,110,000.000	1,488,700.770	
US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	740,523.430	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,300,000.000	1,768,710.920	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,420,087.500	



	US T N/B 4.375 11/15/39	1,080,000.000	1,464,918.750	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,110,000.000	1,486,359.370	
	US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	957,031.250	
	US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,086,805.450	
	US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,050,234.370	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,440,000.000	2,057,287.490	
	US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	715,351.560	
	US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	630,683.590	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,088,398.430	
	US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,351,757.810	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	841,140.620	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,048,096.870	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,186,945.300	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,004,705.460	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,160,976.560	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,690,703.070	
アメリカ・ドル	小計	536,610,000.000 (59,112,957,600)	563,182,003.130 (62,040,129,463)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	2,350,000.000	2,353,243.000	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,573,745.160	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	430,000.000	435,165.160	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	836,482.000	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,090,000.000	1,141,589.700	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	954,630.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,450,000.000	1,533,520.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,830,000.000	1,979,130.360	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	510,000.000	571,388.700	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	580,000.000	694,599.410	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	580,000.000	649,832.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,020,000.000	1,202,478.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	2,080,000.000	2,150,990.400	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,540,000.000	1,684,760.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	856,123.000	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,255,160.570	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,130,000.000	1,672,243.600	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,380,000.000	1,521,532.800		

	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,540,000.000	2,176,636.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,490,000.000	2,207,435.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,120,000.000	2,097,312.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,120,000.000	1,884,512.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	990,000.000	1,892,880.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,118,717.600	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,130,000.000	1,661,100.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,190,000.000	1,657,551.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,415,972.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	970,000.000	1,242,764.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,170,000.000	1,826,253.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,170,000.000	1,970,280.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	990,000.000	1,733,391.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,170,000.000	2,220,426.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	1,327,500.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,080,000.000	1,784,376.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,120,000.000	1,583,792.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	990,000.000	1,597,464.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,610,000.000	1,974,487.900	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,110,322.000	
	イギリス・ポンド 小計	43,690,000.000 (6,254,660,400)	57,549,785.360 (8,238,827,272)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,810,494.940	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,950,000.000	2,115,945.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	926,911.680	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,200,000.000	1,348,289.750	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,137,511.170	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	625,320.070	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,330,000.000	1,491,116.200	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,080,000.000	2,355,144.270	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,776,996.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	910,000.000	1,138,465.050	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,920,000.000	2,150,241.020	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,820,000.000	3,327,176.430	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	770,000.000	976,194.210	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	850,000.000	1,135,146.610	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,407,747.640	

	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,130,000.000	1,566,296.160	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,670,000.000	2,100,738.250	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,710,000.000	1,968,706.920	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,040,000.000	2,290,682.740	
オーストラリア・ドル 小計		29,120,000.000 (2,214,576,000)	33,649,124.110 (2,559,015,889)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	230,000.000	330,999.900	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	591,018.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	765,632.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	786,376.000	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,204,071.000	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,120,000.000	1,112,294.400	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,163,259.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,050,589.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	749,523.800	
	CANADA 2.0 12/01/51	420,000.000	451,596.600	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	543,636.900	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,549,230.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	644,007.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,659,840.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,296,380.800	
	CANADA 2.75 12/01/48	1,030,000.000	1,274,213.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	390,000.000	520,115.700	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,797,666.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,020,000.000	1,398,532.200	
	CANADA 4.0 06/01/41	950,000.000	1,336,232.000	
CANADA 5.0 06/01/37	870,000.000	1,300,737.000		
CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,490,478.000		
CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,072,094.400		
カナダ・ドル 小計		25,360,000.000 (2,140,130,400)	28,088,524.600 (2,370,390,591)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	216,930.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	210,300.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	500,000.000	521,250.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	450,000.000	511,758.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	431,300.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	220,004.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	460,000.000	509,220.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	586,058.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,668,480.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	569,409.600	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	821,250.000	
シンガポール・ドル 小計		5,760,000.000 (471,513,600)	6,265,959.600 (512,931,453)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,740,000.000	3,953,375.970	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,291,042.600	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,547,500.000	

	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	7,052,325.540	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,996,069.500	
スウェーデン・クローナ 小計		19,610,000.000 (228,456,500)	22,840,313.610 (266,089,654)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,593,521.300	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,936,150.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	6,006,016.120	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,820,000.000	16,438,807.720	
デンマーク・クローネ 小計		26,770,000.000 (439,563,400)	35,974,495.140 (590,701,210)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	4,890,000.000	4,929,597.260	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,064,247.800	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,873,910.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,161,908.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,608,766.000	
ノルウェー・クローネ 小計		20,930,000.000 (259,532,000)	21,638,429.060 (268,316,520)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,055,709.600	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,377,284.710	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,341,243.550	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,440,000.000	2,479,742.230	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,280,000.000	2,311,452.600	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	1,959,421.160	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,517,022.780	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,342,280.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,868,976.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,901,334.440	
ポーランド・ズロチ 小計		22,900,000.000 (663,642,000)	24,154,467.570 (699,996,470)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,026,684.400	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,234,483.350	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,570,000.000	2,607,884.370	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,062,072.600	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,251,176.170	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	832,503.680	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	1,968,321.560	
	MALAYSIA 4.16 07/15/21	4,000,000.000	4,067,891.200	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,532,984.120	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,274,456.160	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,972,643.220	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,329,282.400	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,830,813.910	
マレーシア・リングgit 小計		27,550,000.000 (748,258,000)	28,991,197.140 (787,400,914)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,453,419.900	

	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	27,596,000.000	31,326,151.320	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,091,384.060	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,794,743.550	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,664,300.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	18,497,000.000	19,781,246.710	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,510,650.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,518,580.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,571,060.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,109,000.000	16,837,318.510	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	12,751,252.500	
	メキシコ・ペソ 小計	149,342,000.000 (875,144,120)	162,300,106.550 (951,078,624)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	355,181.000	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	544,831.040	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	874,896.540	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	580,000.000	617,649.540	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	355,792.500	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	476,935.320	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	695,038.080	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	370,000.000	449,858.950	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	210,000.000	259,329.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	592,426.980	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	950,000.000	1,030,084.050	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	310,000.000	492,790.320	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	622,490.880	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	460,000.000	734,666.000	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	823,908.600	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,420,000.000	1,516,702.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	860,000.000	942,474.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	300,000.000	623,794.800	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	930,000.000	1,518,318.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	777,162.750	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	992,919.900	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	676,071.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	830,000.000	863,331.550	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	900,000.000	953,288.720	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	650,000.000	693,595.500	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	942,656.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	610,000.000	657,797.160	

BELGIUM 1.0 06/22/26	1,130,000.000	1,217,290.240	
BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	882,885.420	
BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	572,213.370	
BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	171,727.800	
BELGIUM 1.6 06/22/47	720,000.000	851,344.840	
BELGIUM 1.7 06/22/50	390,000.000	468,244.920	
BELGIUM 1.9 06/22/38	590,000.000	722,339.950	
BELGIUM 2.15 06/22/66	350,000.000	480,147.500	
BELGIUM 2.25 06/22/23	160,000.000	175,278.400	
BELGIUM 2.25 06/22/57	320,000.000	439,106.240	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,190,332.500	
BELGIUM 3.0 06/22/34	470,000.000	643,603.750	
BELGIUM 3.75 06/22/45	630,000.000	1,058,489.460	
BELGIUM 4.0 03/28/22	1,080,000.000	1,189,788.480	
BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	770,808.150	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,140,000.000	1,936,514.800	
BELGIUM 4.25 09/28/21	1,240,000.000	1,342,957.200	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,345,909.040	
BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,023,061.060	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,210,000.000	2,021,871.030	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,807,575.900	
BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	643,853.700	
BUNDESOBL 04/08/22	1,340,000.000	1,357,969.400	
BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,150,940.030	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,422,447.460	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,306,444.800	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,156,291.710	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	330,000.000	295,305.120	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,870,000.000	1,952,055.600	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,670,000.000	1,744,861.090	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,505,448.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,360,000.000	1,428,326.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,260,000.000	1,331,631.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,620,000.000	1,727,017.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,880,000.000	2,001,090.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,710,000.000	1,754,506.510	
DEUTSCHLAND 08/15/29	430,000.000	438,157.100	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,433,424.800	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	670,000.000	724,980.200	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,180,000.000	1,474,688.480	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	970,000.000	1,032,758.610	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	850,000.000	909,284.950	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,010,000.000	1,099,392.070	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,741,664.100	

DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,641,420.450	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,629,650.170	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	1,650,000.000	1,735,998.000	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,639,119.000	
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,120,076.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,820,000.000	2,786,110.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,730,000.000	2,701,062.840	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	1,150,000.000	1,215,147.500	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	900,000.000	1,500,075.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,500,000.000	2,490,957.000	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	990,000.000	1,771,357.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	858,294.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,370,000.000	2,317,944.100	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	920,000.000	1,770,687.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,017,901.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,100,000.000	1,627,340.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,069,756.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,172,735.400	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,077,034.500	
FINLAND 0.5 04/15/26	300,000.000	313,828.200	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	314,280.600	
FINLAND 0.5 09/15/28	360,000.000	377,107.200	
FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	282,543.390	
FINLAND 0.75 04/15/31	380,000.000	406,673.900	
FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	319,827.000	
FINLAND 04/15/22	320,000.000	324,059.200	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	234,007.980	
FINLAND 1.125 04/15/34	230,000.000	256,954.390	
FINLAND 1.375 04/15/47	130,000.000	156,924.300	
FINLAND 1.5 04/15/23	170,000.000	181,152.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	423,348.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	480,000.000	529,908.480	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	512,619.100	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	470,993.280	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	533,210.750	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,338,126.560	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,380,000.000	1,419,742.620	

FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,620,000.000	2,736,097.440	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,164,654.890	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,510,000.000	2,616,135.350	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,610,000.000	2,783,956.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,140,000.000	2,281,911.960	
FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,931,524.800	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,769,242.880	
FRANCE OAT 03/25/25	1,270,000.000	1,290,630.630	
FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,529,703.500	
FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,039,339.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,650,000.000	1,787,032.500	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,848,094.930	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	1,953,921.160	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,990,000.000	2,225,815.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	2,290,000.000	2,629,755.850	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,560,000.000	1,796,535.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	1,930,000.000	2,077,581.310	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	790,000.000	985,095.240	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,420,000.000	1,719,435.400	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,090,000.000	3,410,541.150	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,490,000.000	1,914,129.360	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,212,800.480	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,030,000.000	3,266,788.440	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,060,000.000	3,813,974.820	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,700,000.000	3,304,557.000	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,850,000.000	3,082,993.200	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,640,000.000	2,570,027.600	
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	2,980,000.000	3,184,922.680	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,800,000.000	3,457,160.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,110,000.000	2,110,110.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	790,000.000	1,568,469.160	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,770,000.000	2,860,789.050	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,500,000.000	4,131,974.000	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,270,000.000	4,008,161.700	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,930,000.000	3,177,648.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,836,728.420	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,120,000.000	3,594,746.400	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,457,270.000	
IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	380,408.390	
IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	623,442.000	
IRISH 1.0 05/15/26	680,000.000	729,606.000	
IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	371,722.570	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	380,389.960	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	235,576.110	
IRISH 1.5 05/15/50	270,000.000	310,944.960	
IRISH 1.7 05/15/37	380,000.000	451,812.400	
IRISH 10/18/22	220,000.000	222,892.120	
IRISH 2.0 02/18/45	540,000.000	690,822.000	
IRISH 2.4 05/15/30	690,000.000	847,242.030	



IRISH 3.4 03/18/24	600,000.000	695,068.680	
IRISH 3.9 03/20/23	240,000.000	273,387.960	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	1,033,886.400	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,711,928.050	
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	917,571.200	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,590,000.000	1,608,126.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	999,110.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	939,241.980	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,092,898.000	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	789,327.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,378,107.000	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,040,000.000	1,036,959.040	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,660,000.000	1,706,893.340	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,597,212.540	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,551,625.500	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,081,325.440	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,757,174.120	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,567,500.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,630,000.000	1,650,208.740	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,610,000.000	1,701,770.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,485,441.700	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,035,857.850	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,600,000.000	1,713,504.310	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	130,000.000	139,560.460	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,680,000.000	1,749,888.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	520,000.000	562,380.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,072,020.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,199,761.200	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	602,186.750	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,056,216.510	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,100,376.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	689,832.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,585,843.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,073,104.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	780,000.000	899,145.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	597,613.120	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,172,174.850	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	970,000.000	1,160,373.170	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,453,383.040	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,640,000.000	1,968,506.760	
ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,417,346.000	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,390,784.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,172,490.400	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	959,712.660	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	970,000.000	1,252,173.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,268,112.540	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,985,340.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,591,993.200	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,194,880.000	

ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,664,265.500	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	750,000.000	968,010.750	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,140,000.000	1,655,725.740	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,879,860.000	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,178,555.300	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,267,685.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	1,939,672.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,440,000.000	2,103,120.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,210,000.000	3,001,622.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,311,859.050	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,250,517.080	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,889,152.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,000,000.000	2,938,600.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,509,759.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,524,852.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,575,560.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,055,283.840	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	814,915.330	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	340,000.000	351,845.600	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	989,585.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	1,073,844.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	808,569.140	
NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	465,309.320	
NETHERLANDS 01/15/24	1,230,000.000	1,253,600.010	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,110,000.000	1,199,561.010	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	911,165.460	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	880,000.000	943,051.380	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	910,000.000	1,195,553.450	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	900,000.000	1,454,451.470	
NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	1,967,877.690	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	300,000.000	339,420.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,090,000.000	1,895,705.110	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,554,390.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	970,000.000	1,416,685.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	344,888.580	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,460,000.000	1,488,040.760	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,597,427.900	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,368,252.560	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,080,000.000	1,092,483.720	

	SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,730,892.400	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,070,000.000	1,150,631.990	
	SPAIN 1.4 04/30/28	1,560,000.000	1,695,400.200	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,540,000.000	1,677,368.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,495,382.400	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,480,000.000	1,612,181.010	
	SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,319,868.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,660,000.000	1,798,726.200	
	SPAIN 1.85 07/30/35	490,000.000	557,368.080	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,704,162.960	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,650,000.000	1,888,556.500	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,580,000.000	1,768,606.180	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,140,000.000	1,373,814.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,127,118.740	
	SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,747,060.700	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,160,000.000	1,565,748.280	
	SPAIN 3.45 07/30/66	760,000.000	1,188,298.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,482,218.270	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,340,000.000	2,031,770.980	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,430,000.000	1,677,467.220	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,760,000.000	2,206,485.600	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,070,000.000	1,797,713.420	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,355,123.120	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,993,680.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	880,000.000	1,244,584.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	980,000.000	1,794,419.390	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,712,086.520	
	SPAIN 5.5 04/30/21	3,600,000.000	3,875,202.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,971,059.690	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,810,000.000	2,041,019.350	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,170,000.000	1,605,906.900	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,830,000.000	2,740,113.900	
	ユーロ 小計	328,450,000.000 (40,297,530,500)	392,751,184.070 (48,186,642,774)	
南アフリカ・ラ ンド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	16,420,000.000	18,324,432.640	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	5,305,780.270	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	3,570,000.000	2,463,509.200	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	7,030,000.000	5,933,320.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,656,866.680	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	10,900,000.000	10,154,262.760	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,590,000.000	6,037,428.500	

	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	8,820,000.000	7,746,657.770	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,706,190.800	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,040,000.000	13,893,532.000	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	8,410,000.000	7,808,841.510	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	8,000,000.000	7,236,812.800	
	南アフリカ・ランド 小計	106,840,000.000 (818,394,400)	97,267,634.930 (745,070,084)	
国債証券 合計		114,524,358,920 (114,524,358,920)	128,216,590,918 (128,216,590,918)	
合計			128,216,590,918 (128,216,590,918)	

(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 160銘柄	46.43	48.39
イギリス・ポンド	国債証券 38銘柄	6.17	6.43
オーストラリア・ドル	国債証券 19銘柄	1.91	2.00
カナダ・ドル	国債証券 23銘柄	1.77	1.85
シンガポール・ドル	国債証券 11銘柄	0.38	0.40
スウェーデン・クローナ	国債証券 5銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 4銘柄	0.44	0.46
ノルウェー・クローネ	国債証券 5銘柄	0.20	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 10銘柄	0.52	0.55
マレーシア・リングギット	国債証券 13銘柄	0.59	0.61
メキシコ・ペソ	国債証券 11銘柄	0.71	0.74
ユーロ	国債証券 277銘柄	36.06	37.58
南アフリカ・ランド	国債証券 12銘柄	0.56	0.58

(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

<b>資産の部</b>	
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	
<b>負債の部</b>	
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	
<b>純資産の部</b>	
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	<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、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。</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		時価（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
合計	1,174,112,400	-		1,163,331,000

(注) 時価の算定方法

## 不動産投信指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
  - 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
  - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

令和2年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・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	
プレミアム投資法人	3,310	503,451,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	782	107,134,000	
マリモ地方創生リート投資法人	315	40,572,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,228	1,675,220,800	
ラサールロジポート投資法人	3,407	545,460,700	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	567	68,096,700	
阪急阪神リート投資法人	1,655	277,047,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	902	427,548,000	
三菱地所物流リート投資法人	721	251,989,500	
産業ファンド投資法人	4,720	777,856,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	860	129,602,000	
森トラスト総合リート投資法人	2,619	504,943,200	
森ヒルズリート投資法人	4,216	749,604,800	
星野リゾート・リート投資法人	558	318,618,000	
積水ハウス・リート投資法人	10,715	958,992,500	
大江戸温泉リート投資法人	623	58,375,100	

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

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド  
貸借対照表

(単位：円)

令和2年1月14日現在

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

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 平成31年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・イヤー2045)	7,867,234円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	6,495,377円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,827,884円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	12,066,338円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,766,404,334円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	121,836,794円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,172,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	995,914円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	995,529円
DIAMバッシュ資産分散ファンド	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。

- (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14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】

## 【マネックス資産設計ファンド&lt;育成型&gt;】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第13期 令和2年1月14日現在	第14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	171,145,930	132,843,458
親投資信託受益証券	12,130,018,870	11,337,630,910
流動資産合計	12,301,164,800	11,470,474,368
資産合計	12,301,164,800	11,470,474,368
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	15,255,491	10,249,101
未払受託者報酬	2,628,706	13,792
未払委託者報酬	30,230,538	158,606
その他未払費用	249,079	1,244
流動負債合計	48,363,814	10,422,743
負債合計	48,363,814	10,422,743
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	8,944,442,516	8,951,944,282
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	3,308,358,470	2,508,107,343
（分配準備積立金）	2,953,167,127	2,747,740,061
元本等合計	12,252,800,986	11,460,051,625
純資産合計	12,252,800,986	11,460,051,625
負債純資産合計	12,301,164,800	11,470,474,368

## (2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13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14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	792,277,062	772,002,960
その他収益	32,059	15,518
営業収益合計	792,309,121	771,987,442
<b>営業費用</b>		
支払利息	55,573	46,151
受託者報酬	2,412,375	2,464,188
委託者報酬	27,742,793	28,338,608
その他費用	229,082	222,305
営業費用合計	30,439,823	31,071,252
営業利益又は営業損失( )	761,869,298	803,058,694
経常利益又は経常損失( )	761,869,298	803,058,694
中間純利益又は中間純損失( )	761,869,298	803,058,694
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( )	24,972,302	74,252,193
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,816,536,006	3,308,358,470
剰余金増加額又は欠損金減少額	120,801,401	164,410,051
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	120,801,401	164,410,051
剰余金減少額又は欠損金増加額	88,066,082	235,854,677
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	88,066,082	235,854,677
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( )	2,586,168,321	2,508,107,343



## (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14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. 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13期	第14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	8,908,596,761円	8,944,442,516円
期中追加設定元本額	954,093,952円	650,905,042円
期中一部解約元本額	918,248,197円	643,403,276円
2. 受益権の総数	8,944,442,516口	8,951,944,282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13期 令和2年1月14日現在	第14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 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （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）

	第13期 令和2年1月14日現在	第14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)	1,3699円 (13,699円)	1,2802円 (12,802円)

## （参考）

当ファンドは、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、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）
		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	2,5129円
(1万口当たり純資産額)	(25,129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 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	3.8107円
(1万口当たり純資産額)	(38,107円)

## 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	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	19,417,045,498円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	76,387,550円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	62,545,953円
M I T O 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
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,986,813,063円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	7,090,015,816円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	9,313,872,662円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	3,650,402,740円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	1,825,688,011円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	1,939,607,409円
D I A M 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
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,523,149,588円
D I A M 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)

## 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	237,604,673
コール・ローン	222,961,375
国債証券	124,769,149,558
派生商品評価勘定	204,929
未収入金	1,032,278,829
未収利息	801,037,864
前払費用	52,832,977
流動資産合計	127,116,070,205
資産合計	127,116,070,205
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,384,344
未払解約金	1,171,835,300
流動負債合計	1,177,219,644
負債合計	1,177,219,644
純資産の部	
元本等	
元本	64,000,392,604
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	61,938,457,957
元本等合計	125,938,850,561
純資産合計	125,938,850,561
負債純資産合計	127,116,070,205

## 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	70,038,452,021円
同期中追加設定元本額	9,569,897,113円
同期中一部解約元本額	15,607,956,530円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,995,851,136円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,100,144円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	17,551,332円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	16,534,241円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	67,359,878円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	69,031,552円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	27,675,051円
たわらノーロード 先進国債券	7,691,030,358円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	142,399,801円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	596,642,776円
たわらノーロード バランス（堅実型）	16,147,332円
たわらノーロード バランス（標準型）	73,753,249円
たわらノーロード バランス（積極型）	14,637,071円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（保守型）	2,424,578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）	162,369,877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）	207,571,235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）	68,627,626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）	37,500,259円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	180,398円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,356,129円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	5,782,407円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,213,293円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	3,036,232円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,941,720,082円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	32,924,529円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	577,667,661円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,729,391,688円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,769,397,665円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	355,835,549円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	767,057,750円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	588,070,569円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,884,013円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	530,144,248円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	28,446,399円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,271,635円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	89,589,782円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	139,048,634円
クルーズコントロール	1,121,682,235円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	109,167,362円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	185,623,883円
クルーズコントロール<DC年金>	1,085,208円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,191,838円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	8,458,694円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	84,821,031円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	127,186,758円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,989,357円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,198,717,289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)	262,346,855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)	318,864,802円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,943,757,521円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	3,359,917,853円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,329,450,739円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,689,634,902円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	65,439,616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)	413,179,117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)	531,359,035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)	376,254,061円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	35,541,164円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	55,188,928円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	16,173,098円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,901,001円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	49,418,613円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	71,180,721円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,510,356,994円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,774,295,434円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,069,909,838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)	543,064,326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)	206,583,675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)	2,305,133,842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)	542,152,230円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,260,982円

D I A M世界バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	78,025,962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)	392,211,337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)	555,351,522円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	658,635,928円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	67,514,128円
D I A Mバランス20VA(適格機関投資家限定)	9,631,492円
D I A Mバランス40VA(適格機関投資家限定)	347,346円
D I A Mバランス60VA(適格機関投資家限定)	159,728円
計	64,000,392,604円
2. 受益権の総数	64,000,392,604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	1,100,000,000	-	1,105,179,415	5,179,415
アメリカ・ドル	544,063,000	-	546,201,772	2,138,772
イギリス・ポンド	72,418,000	-	72,213,071	204,929
カナダ・ドル	22,306,000	-	22,338,901	32,901
ユーロ	461,213,000	-	464,425,671	3,212,671
合計	1,100,000,000	-	1,105,179,415	5,179,415

(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	1.9678円
(1万口当たり純資産額)	(19,678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 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	6,085,920	-	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)

## 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	11,396,391,578円
負債総額	27,565,065円
純資産総額( - )	11,368,826,513円
発行済数量	8,948,758,834口
1口当たり純資産額( / )	1.2704円

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

令和2年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

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

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

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	127,052,156,094円
負債総額	253,013,000円
純資産総額( - )	126,799,143,094円
発行済数量	63,907,896,135口
1口当たり純資産額( / )	1.9841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

## 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あります。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第34期(2019年3月31日現在)

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

第35期(2020年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	32,932,013	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	28,548,165	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	11,487,393	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	4,674,225	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	2,988	2,988	-
資産計	77,644,787	77,644,787	-
(1) 未払手数料	4,582,140	4,582,140	-
負債計	4,582,140	4,582,140	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負債

## (1) 未払手数料

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

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第34期(2019年3月31日現在)

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

## 第35期(2020年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	32,932,013	-	-	-
(2) 金銭の信託	28,548,165	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	11,487,393	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,674,225	-	-	-
(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## （有価証券関係）

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

関係会社株式（第34期の貸借対照表計上額4,499,196千円、第35期の貸借対照表計上額5,299,196千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

## 第34期（2019年3月31日現在）

（千円）

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,764千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

## 第35期（2020年3月31日現在）

（千円）

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	2,988	3,000	11
小計	2,988	3,000	11
合計	2,988	3,000	11

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

## 3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

## 第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

## 第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
株式	1,298,377	1,169,758	-
投資信託	159,526	5,528	1

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



(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 4.42%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度104,720千円、当事業年度103,477千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第34期	第35期
	(2019年3月31日現在)	(2020年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	173,805	221,053
未払事業所税	10,915	10,778
賞与引当金	411,675	420,513
未払法定福利費	80,253	78,439
未払給与	7,961	10,410
受取負担金	138,994	47,781
運用受託報酬	102,490	331,395
資産除去債務	10,152	14,116
減価償却超過額(一括償却資産)	4,569	50,942
減価償却超過額	125,839	82,684
繰延資産償却超過額(税法上)	135,542	323,132
退職給付引当金	580,297	648,821
時効後支払損引当金	54,458	53,321
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	29,494	11,532
その他有価証券評価差額金	-	3
繰延税金資産小計	2,069,527	2,508,004
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,069,527	2,508,004
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	321,067	-
繰延税金負債合計	321,067	-
繰延税金資産の純額	1,748,459	2,508,004

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	104,326,078千円	94,605,736千円
資産合計	104,326,078千円	94,605,736千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	10,571,428千円	8,278,713千円
負債合計	10,571,428千円	8,278,713千円
純資産	93,754,650千円	86,327,023千円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	66,696,733千円	62,885,491千円
顧客関連資産	39,959,586千円	34,810,031千円

## (2) 損益計算書項目

	第34期 (自 2018年4月 1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	9,043,138千円	8,954,439千円
経常利益	9,043,138千円	8,954,439千円
税引前当期純利益	9,091,728千円	9,111,312千円
当期純利益	7,489,721千円	7,536,465千円
1株当たり当期純利益	187,243円04銭	188,411円64銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,241,252千円	5,149,555千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## (1) 親会社及び法人主要株主等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

## (2) 子会社及び関連会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当はありません。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

## (3) 兄弟会社等

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の 関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
子 会 社	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
株式会社静岡銀行	90,800	日本において銀行業務を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

(注) 確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

#### (3) 投資顧問会社

##### a. 名称

イボットソン・アソシエーツ・ジャパン株式会社

##### b. 資本金の額

2020年3月末日現在 9,557.5万円

##### c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)・運用報告書の送付

## (7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

## 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

## 第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

(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 長谷川 敬 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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>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、マネックス資産設計ファンド<育成型>の令和2年1月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注2) 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 山野 浩 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」に掲げられているマネックス資産設計ファンド<育成型>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、マネックス資産設計ファンド<育成型>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。