【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年11月25日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞
ただし、愛称として「わたしへの贈りもの」という名称を用いる場合があります。
（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】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

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

＜基準価額の照会方法等＞
基準価額は、委託会社の毎営業日において、委託会社により計算され、公表されます。
※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位とします。

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※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11月26日から2021年5月25日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

○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】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

②当ファンドの信託金限度額は、1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

1 主として次のマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）に投資します。

マザーファンド	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式（除く日本）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券（除く日本）

上記マザーファンドを総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。

2 各資産クラスのベンチマークを次に掲げる基本配分比率で合成したものを当ファンドのベンチマーク（合成ベンチマーク）として定め、これに連動した投資成果をめざして運用を行います。

資産クラス	ベンチマーク	基本配分比率
国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	20%
国内債券	NOMURA-BPI総合	52%
先進国株式（除く日本）	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）	10%
先進国債券（除く日本）	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）	15%
短期金融資産	コール・ローン（オーバーナイト物）	3%

指数の著作権等

●東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈱東京証券取引所が有しています。
なお、本商品は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈱東京証券取引所は、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、責任を有しません。

●NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、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。

●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

3 時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

4 マザーファンドの組入比率は、原則として高位を維持します。

5 実質組入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。

運用プロセス

ポートフォリオ構築	ベンチマークの基本配分比率に基づき、各マザーファンドへ資金を配分します。
リバランス	時価変動等により、各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合はリバランスを行います。

■分配方針

年1回の決算時(毎年2月25日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

＜商品分類＞

・商品分類表

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

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

＜属性区分＞

・属性区分表

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

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

（注2）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（債券、株式）資産配分固定型））	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（債券、株式）を実質的な投資対象とし、組入比率については、固定的とする旨の記載があるものをいう。
年１回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。
その他（合成ベンチマーク）	日経２２５またはＴＯＰＩＸにあてはまらない全てのものをいう。（対象インデックスは、合成ベンチマークとする。（注1））

（注1）対象インデックスについては、上記　1ファンドの性格　(1)ファンドの目的及び基本的性格　＜ファンドの特色＞をご参照ください。

（注2）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

（注3）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

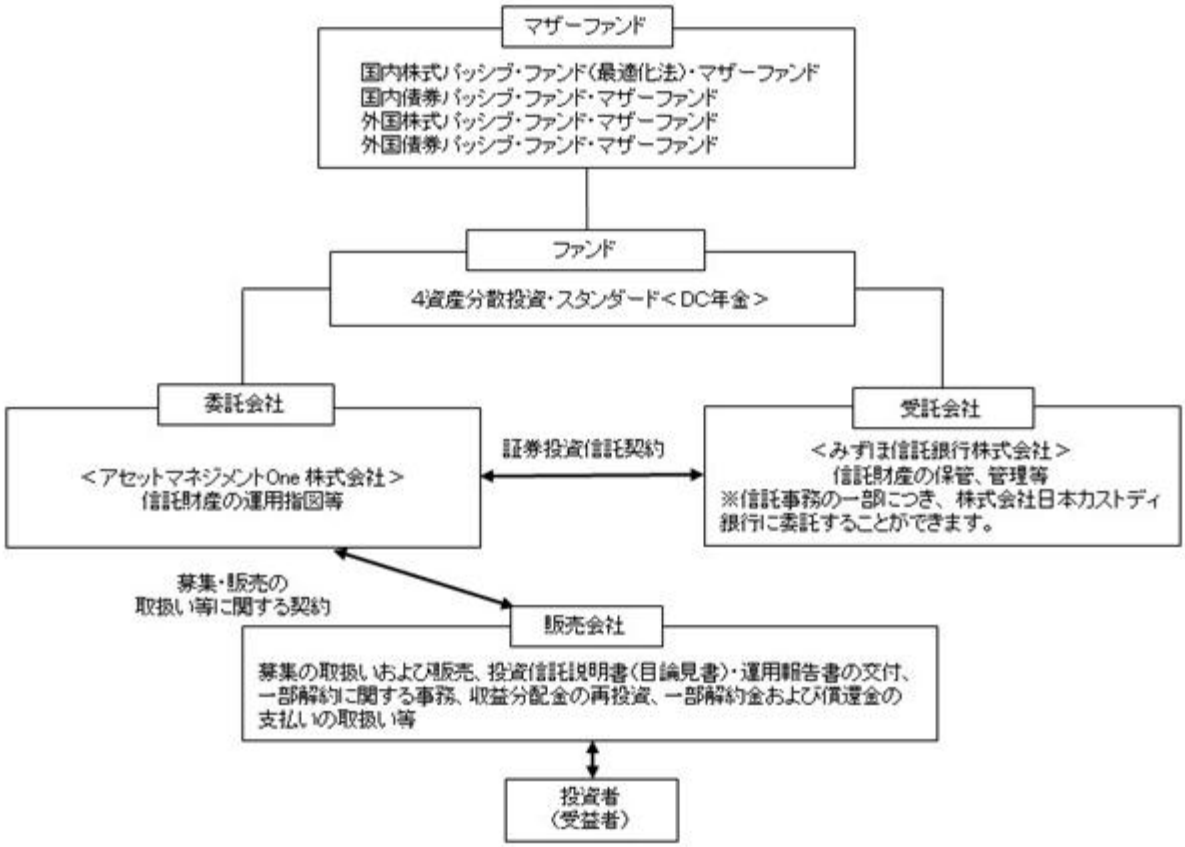
（注4）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2018年2月28日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

2019年5月25日　　信託報酬率（税抜）を「年率0.16%」から「年率0.14%」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

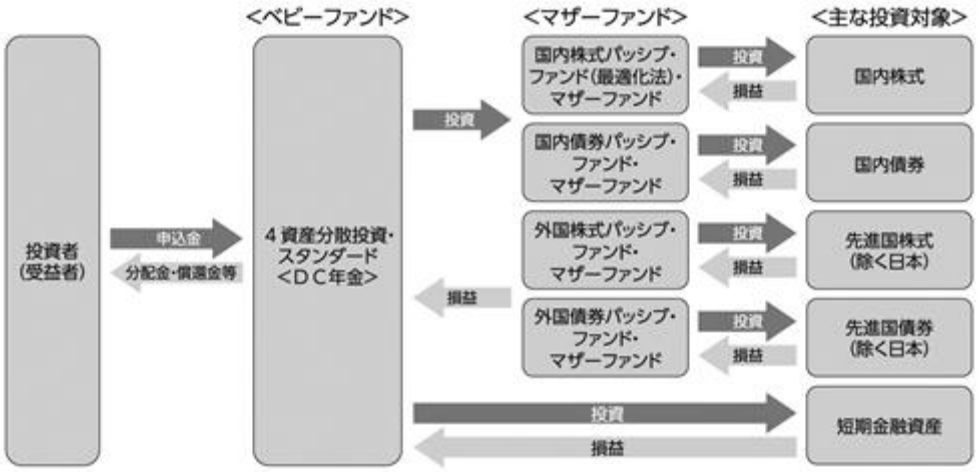
委託会社と受託会社との間においては、当ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。
当該契約の内容は、当ファンドの運用の基本方針、投資対象、投資制限、受益者の権利等を規定したものです。

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

●ファミリーファンド方式とは●

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



○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8月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2020年8月31日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・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」受益証券および短期金融資産を主要投資対象とします。

＜投資態度＞

①この投資信託は、主として次のマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内株式、国内債券、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）に投資します。

マザーファンド	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国株式（除く日本）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	先進国債券（除く日本）

上記マザーファンドを総称して「マザーファンド」ということがあります。

②各資産クラスのベンチマークを次に掲げる基本配分比率で合成したものを当ファンドのベンチマークとして定め、これに連動した投資成果をめざして運用を行います。

資産クラス	ベンチマーク	基本配分比率
国内株式	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	20%
国内債券	NOMURA-BPI総合	52%
先進国株式（除く日本）	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）	10%
先進国債券（除く日本）	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）	15%
短期金融資産	コール・ローン（オーバーナイト物）	3%

③時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

④マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。

⑤実質組入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。

⑥ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

■対象指数の変動を基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項

ファンドは合成ベンチマークに連動させるため、時価変動等により各資産クラスへの組入比率が基本配分比率から一定以上乖離した場合にはリバランスすることとします。

なお、投資対象とする各マザーファンドにおける対象指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法に関する事項については、下記2投資方針 (2)投資対象 （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をご参照ください。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

10.コマーシャル・ペーパー

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

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

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

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

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

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

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

18.預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

20.指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

21.抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)

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

23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

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

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1．預金

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

3．コール・ローン

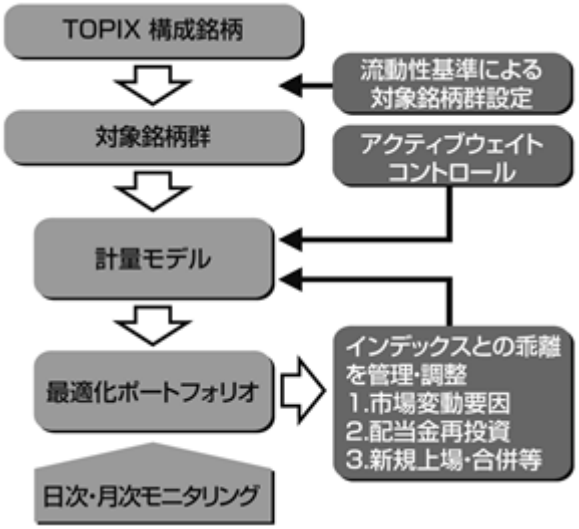
4．手形割引市場において売買される手形

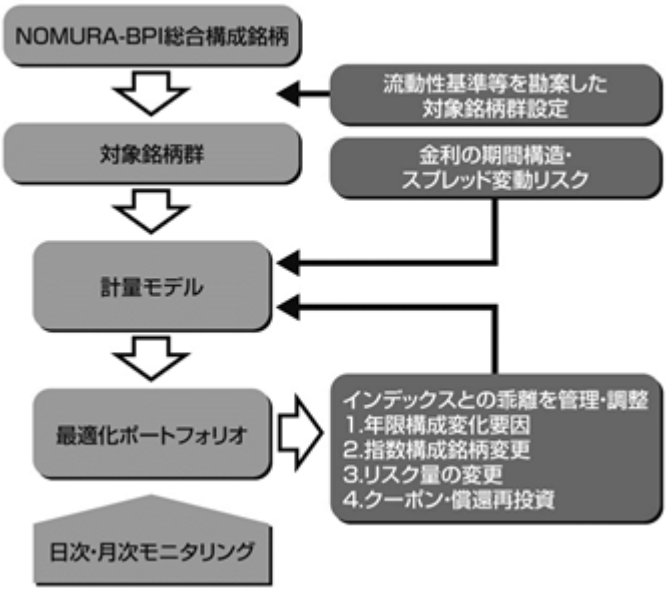
5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

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

運用プロセス	1.流動性基準による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、ＴＯＰＩＸ採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄を除外して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因　・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更　・クーポン、償還再投資 

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

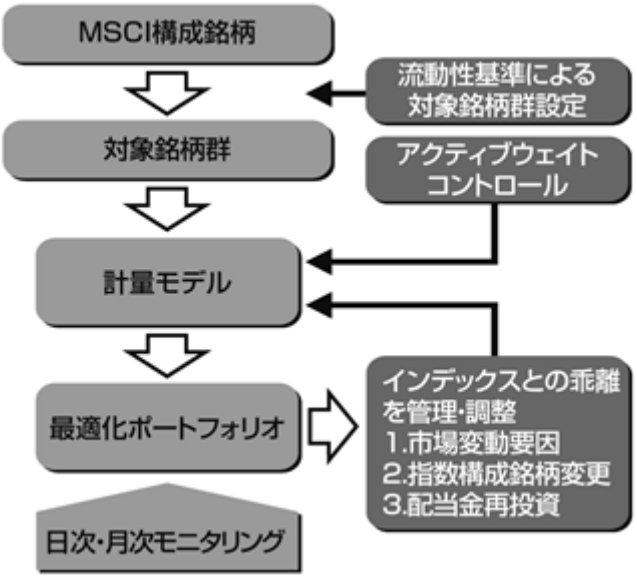
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

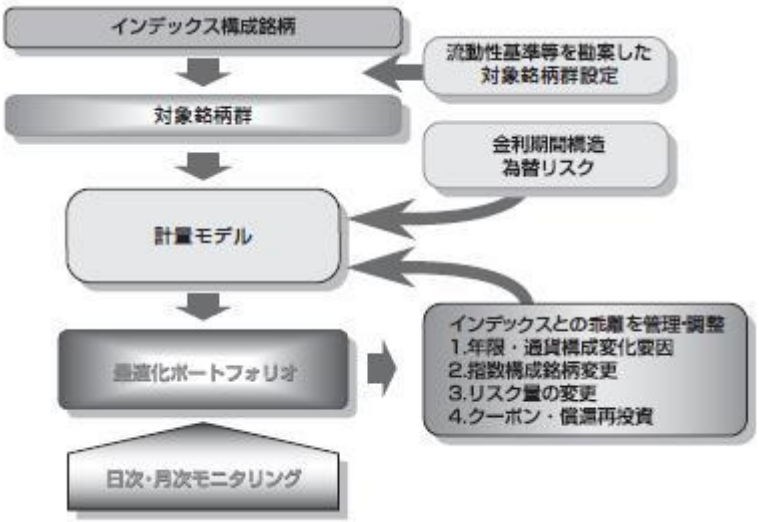
投資態度	**1.主に海外の株式に投資を行い、「ＭＳＣＩコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.株式への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.組入外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。**

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

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

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

運用プロセス	1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

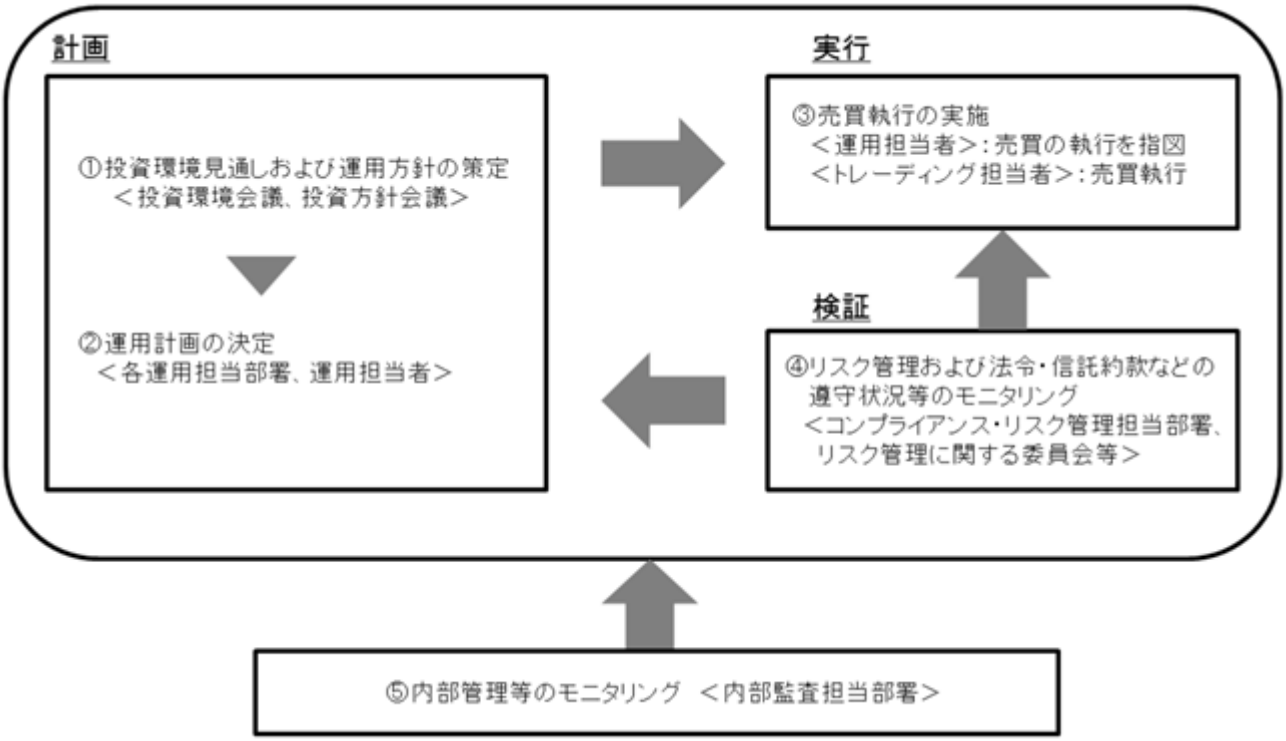
ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。 このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
運用プロセス	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	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2.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。 3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



① 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

② 運用計画の決定

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

③ 売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。
※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年2月25日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

(1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

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

(3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

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

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の再投資

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。

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

（５）【投資制限】

①株式への実質投資割合には、制限を設けません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

②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)

③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)

④デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

⑤一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限)

⑥投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑦信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑧先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

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

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑧で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑧で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑧で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑨スワップ取引の運用指図（約款第24条）

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

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

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

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

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

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

⑩金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

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

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

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

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

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

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

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

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

⑪デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

⑫有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

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

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

⑬公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

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

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

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

⑭公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

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

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑮特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

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

⑯外国為替予約取引の指図（約款第31条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑰資金の借入れ（約款第37条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的とし

て、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

⑱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。

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、公社債および株式等に資産配分を行いますが、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には、基準価額が下落する要因となります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

株式の価格は、国内外の政治・経済・社会情勢の変化、発行企業の業績・経営状況の変化、市場の需給関係等の影響を受け変動します。株式市場や当ファンドが実質的に投資する企業の株価が下落した場合には、その影響を受け、基準価額が下落する要因となります。

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。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、保有外貨建資産が現地通貨ベースで値上がりした場合でも基準価額が下落する可能性があります。

○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。

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。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、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

○流動性リスク

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

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から

期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※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、各マザーファンドへの投資を通じて合成ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いますが、各マザーファンドがベンチマーク採用全銘柄を組入れない場合があること、資金流出入から組入銘柄の売買執行までのタイミングにずれが生じること、売買時のコストや信託報酬等の費用を負担すること等により、基準価額と合成ベンチマークが乖離する場合があります。

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

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

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

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

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

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

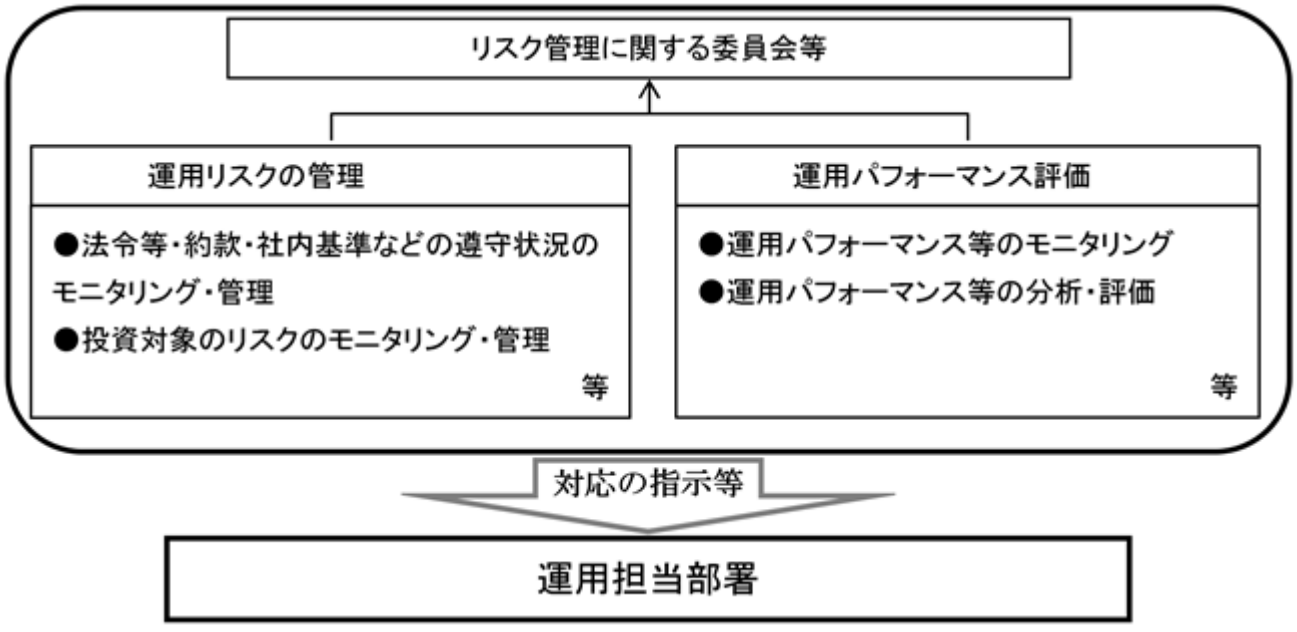
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

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

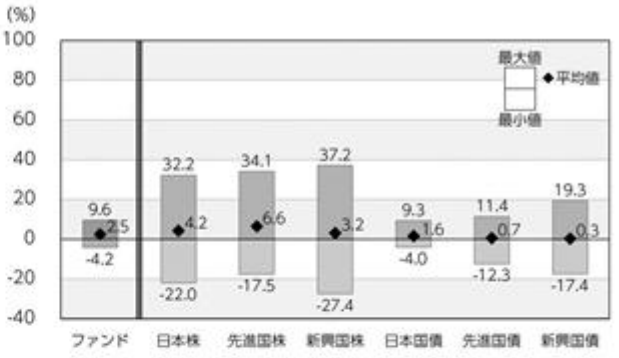


※リスク管理体制は2020年8月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2015年9月～2020年8月(2015年9月～2019年1月は対象インデックスのデータ)
代表的な資産クラス:2015年9月～2020年8月

*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。
*ファンドの年間騰落率がない期間については、連動する投資成果を目指す対象インデックスの年間騰落率を表示しており、ファンドの実績ではありません。
*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
*ファンドの対象インデックスは当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本配分比率で委託会社が合成したものです。対象インデックス(合成ベンチマーク)については、ファンドの特色をご参照ください。

*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。
*ファンドの年間騰落率がない期間については、ファンドの年間騰落率に代えて対象インデックスの年間騰落率を用いて算出・表示していますので、ファンドの実績ではありません。
*対象インデックス算出の月末時点はファンドの騰落率算出の月末時点とは異なる場合があります。
*全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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0.154%（税抜0.14%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.06%	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0.06%	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0.02%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

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

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

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

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的に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、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。
※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

②解約時および償還時

解約時および償還時の差益（譲渡益）※については、譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率での申告分離課税が適用されます。
原則として確定申告が必要ですが、特定口座（源泉徴収口座）を利用する場合、20.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。）および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。
※解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料および当該手数料にかかる消費税等に相当する金額を含みます。）を控除した利益。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

○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8月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、個別元本の算出が行われる場合があります。

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。
（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

令和2年8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		1,121,102,402	97.00
	内　日本	1,121,102,402	97.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		34,661,285	3.00
純資産総額		1,155,763,687	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8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		230,936,310,500	97.84
	内　日本	230,936,310,500	97.84
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,106,334,776	2.16
純資産総額		236,042,645,276	100.00

その他資産の投資状況

令和2年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		5,639,840,000	2.39
	内　日本	5,639,840,000	2.39

（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8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		181,055,898,200	81.49
	内　日本	181,055,898,200	81.49
地方債証券		16,290,934,000	7.33
	内　日本	16,290,934,000	7.33
特殊債券		15,288,407,042	6.88
	内　日本	15,288,407,042	6.88
社債券		9,565,199,270	4.31
	内　日本	9,162,629,270	4.12
	内　フランス	402,570,000	0.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		△19,548,812	△0.01
純資産総額		222,180,889,700	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		343,400,665,343	90.75
	内　アメリカ	237,168,516,437	62.68
	内　イギリス	15,749,906,129	4.16
	内　スイス	12,559,010,640	3.32
	内　カナダ	12,047,643,508	3.18
	内　フランス	11,539,828,742	3.05
	内　ドイツ	10,837,759,321	2.86
	内　オーストラリア	7,213,341,976	1.91
	内　オランダ	6,478,278,103	1.71
	内　アイルランド	6,334,211,602	1.67
	内　スウェーデン	3,571,297,111	0.94
	内　香港	2,879,252,847	0.76
	内　デンマーク	2,786,459,697	0.74
	内　スペイン	2,694,429,670	0.71
	内　イタリア	2,179,144,363	0.58
	内　フィンランド	1,426,664,430	0.38
	内　バミューダ	1,125,424,546	0.30
	内　ジャージィー	1,116,171,895	0.29
	内　ベルギー	1,067,302,059	0.28
	内　シンガポール	1,036,351,086	0.27
	内　イスラエル	758,280,689	0.20
	内　ケイマン諸島	670,272,365	0.18
	内　ノルウェー	660,601,162	0.17
	内　ニュージーランド	383,402,927	0.10
	内　ルクセンブルグ	268,691,923	0.07
	内　オランダ領キュラソー	207,639,381	0.05
	内　オーストリア	190,032,781	0.05
	内　ポルトガル	187,562,550	0.05
	内　リベリア	103,983,893	0.03
	内　マン島	56,115,300	0.01
	内　パナマ	54,930,462	0.01
	内　パプアニューギニア	48,157,748	0.01
新株予約権証券		2,968,414	0.00
	内　アメリカ	2,968,414	0.00
投資信託受益証券		678,375,437	0.18
	内　オーストラリア	504,507,188	0.13
	内　シンガポール	173,868,249	0.05
投資証券		7,458,367,619	1.97
	内　アメリカ	6,866,332,439	1.81
	内　イギリス	198,210,371	0.05
	内　フランス	137,442,457	0.04
	内　香港	124,104,420	0.03
	内　カナダ	66,575,868	0.02
	内　オランダ	65,702,064	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		26,868,023,985	7.10
純資産総額		378,408,400,798	100.00

その他資産の投資状況

令和2年8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）		29,845,025,410	7.89
	内　アメリカ	22,043,276,964	5.83
	内　ドイツ	4,821,912,476	1.27
	内　イギリス	1,333,001,534	0.35
	内　カナダ	1,014,480,936	0.27
	内　オーストラリア	632,353,500	0.17

（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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		127,691,394,583	99.35
	内　アメリカ	56,318,439,900	43.82
	内　フランス	13,428,137,218	10.45
	内　イタリア	12,227,338,451	9.51
	内　ドイツ	9,770,693,037	7.60
	内　イギリス	8,386,399,512	6.53
	内　スペイン	7,805,341,950	6.07
	内　ベルギー	3,348,654,576	2.61
	内　オーストラリア	3,004,934,206	2.34
	内　オランダ	2,476,672,604	1.93
	内　カナダ	2,429,789,086	1.89
	内　オーストリア	2,029,586,985	1.58
	内　アイルランド	1,047,265,355	0.81
	内　メキシコ	946,356,786	0.74
	内　フィンランド	778,232,578	0.61
	内　ポーランド	756,810,952	0.59
	内　デンマーク	664,314,688	0.52
	内　マレーシア	624,909,261	0.49
	内　シンガポール	531,078,150	0.41
	内　イスラエル	465,087,208	0.36
	内　スウェーデン	376,246,662	0.29
	内　ノルウェー	275,105,418	0.21
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		830,845,908	0.65
純資産総額		128,522,240,491	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

令和2年8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	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	458,556,286	1.3191 604,883,012	1.3044 598,140,819	－ －	51.75
2	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	90,324,255	2.4439 220,744,376	2.5983 234,689,511	－ －	20.31
3	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	85,346,339	1.9420 165,747,377	1.9819 169,147,909	－ －	14.64
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	28,976,931	3.6465 105,665,030	4.1110 119,124,163	－ －	10.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年8月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	97.00
合計	97.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）
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8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	1,136,300	7,615.83 8,653,872,330	7,006.00 7,960,917,800	－ －	3.37
2	ソニー 日本	株式 電気機器	638,000	7,636.94 4,872,371,754	8,309.00 5,301,142,000	－ －	2.25
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	793,000	4,964.00 3,936,458,200	6,598.00 5,232,214,000	－ －	2.22
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	92,300	37,990.15 3,506,491,686	43,680.00 4,031,664,000	－ －	1.71
5	任天堂 日本	株式 その他製品	62,400	41,142.24 2,567,276,196	56,740.00 3,540,576,000	－ －	1.50

6	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	847,400	4,305.03 3,648,087,165	3,959.00 3,354,856,600	－ －	1.42
7	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,336,000	2,789.41 3,726,662,955	2,411.50 3,221,764,000	－ －	1.36
8	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	6,871,600	548.62 3,769,938,262	442.50 3,040,683,000	－ －	1.29
9	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	697,300	4,207.97 2,934,223,080	4,026.00 2,807,329,800	－ －	1.19
10	第一三共 日本	株式 医薬品	291,500	8,072.04 2,353,001,724	9,447.00 2,753,800,500	－ －	1.17
11	ダイキン工業 日本	株式 機械	129,800	15,989.50 2,075,438,071	19,965.00 2,591,457,000	－ －	1.10
12	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	728,600	3,361.37 2,449,096,010	3,078.00 2,242,630,800	－ －	0.95
13	信越化学工業 日本	株式 化学	171,300	13,179.99 2,257,733,166	12,885.00 2,207,200,500	－ －	0.94
14	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	801,700	2,783.37 2,231,431,873	2,729.00 2,187,839,300	－ －	0.93
15	日本電産 日本	株式 電気機器	245,200	7,184.71 1,761,691,392	8,911.00 2,184,977,200	－ －	0.93
16	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	694,700	3,731.23 2,592,092,129	3,118.00 2,166,074,600	－ －	0.92
17	ＮＴＴドコモ 日本	株式 情報・通信業	714,700	3,150.24 2,251,479,240	2,959.00 2,114,797,300	－ －	0.90
18	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	202,000	10,046.70 2,029,433,652	10,415.00 2,103,830,000	－ －	0.89
19	花王 日本	株式 化学	243,800	8,648.14 2,108,418,553	8,069.00 1,967,222,200	－ －	0.83
20	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	13,648,000	157.54 2,150,120,378	143.80 1,962,582,400	－ －	0.83
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	701,600	2,600.19 1,824,294,356	2,723.50 1,910,807,600	－ －	0.81
22	村田製作所 日本	株式 電気機器	299,200	6,450.24 1,929,914,185	6,280.00 1,878,976,000	－ －	0.80
23	ＳＭＣ 日本	株式 機械	31,900	50,309.04 1,604,858,642	58,250.00 1,858,175,000	－ －	0.79
24	ファナック 日本	株式 電気機器	95,700	19,872.32 1,901,781,746	18,605.00 1,780,498,500	－ －	0.75
25	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	64,600	24,061.78 1,554,391,532	27,150.00 1,753,890,000	－ －	0.74
26	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	355,200	5,967.84 2,119,777,219	4,890.00 1,736,928,000	－ －	0.74

27	日立製作所 日本	株式 電気機器	489,300	4,051.16 1,982,236,641	3,530.00 1,727,229,000	－ －	0.73
28	三井物産 日本	株式 卸売業	868,600	1,896.55 1,647,347,116	1,914.00 1,662,500,400	－ －	0.70
29	三菱商事 日本	株式 卸売業	657,700	2,795.25 1,838,436,934	2,512.50 1,652,471,250	－ －	0.70
30	中外製薬 日本	株式 医薬品	318,600	4,155.79 1,324,034,711	4,721.00 1,504,110,600	－ －	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8月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.84
合計	97.84

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

令和2年8月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	14.72
情報・通信業		9.95
輸送用機器		7.15
化学		7.01
医薬品		6.42
サービス業		5.38
機械		5.33
小売業		4.88
銀行業		4.87
卸売業		4.67
陸運業		3.76
食料品		3.69
その他製品		2.64
精密機器		2.56
建設業		2.48
不動産業		1.95
保険業		1.95
電気・ガス業		1.40
その他金融業		1.10
証券、商品先物取引業		0.81
ガラス・土石製品		0.75
非鉄金属		0.67
鉄鋼		0.57
ゴム製品		0.55
金属製品		0.54
繊維製品		0.48
石油・石炭製品		0.42
空運業		0.35
パルプ・紙		0.21
倉庫・運輸関連業		0.19
鉱業		0.17

海運業	0.14
水産・農林業	0.09
合計	97.84

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8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	101.05 2,223,298,000	0.1 2028/3/20	1.00
2	３４１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	2,110,000,000	102.46 2,161,912,000	101.99 2,152,094,500	0.3 2025/12/20	0.97
3	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	101.01 2,101,195,200	0.1 2026/6/20	0.95
4	３３４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,980,000,000	103.00 2,039,458,500	102.68 2,033,242,200	0.6 2024/6/20	0.92
5	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	101.04 2,030,984,400	0.1 2026/12/20	0.91
6	３４８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,980,000,000	101.60 2,011,863,000	101.09 2,001,720,600	0.1 2027/9/20	0.90
7	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	101.03 2,000,453,400	0.1 2026/9/20	0.90
8	３４２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,980,000,000	101.47 2,009,145,600	100.97 1,999,285,200	0.1 2026/3/20	0.90
9	３３５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,940,000,000	102.90 1,996,282,900	102.44 1,987,355,400	0.5 2024/9/20	0.89
10	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,940,000,000	103.08 1,999,933,500	102.28 1,984,387,200	0.4 2025/6/20	0.89
11	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	101.09 1,930,857,200	0.1 2027/6/20	0.87
12	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	102.33 1,903,431,000	0.6 2023/12/20	0.86
13	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,850,000,000	102.99 1,905,479,000	102.40 1,894,548,000	0.4 2025/9/20	0.85
14	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,870,000,000	101.60 1,900,073,000	101.08 1,890,289,500	0.1 2027/3/20	0.85

15	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,860,000,000	101.55 1,888,890,000	101.01 1,878,897,600	0.1 2028/6/20	0.85
16	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	102.21 1,870,516,200	0.4 2025/3/20	0.84
17	１３５回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	1,840,000,000	100.69 1,852,704,000	100.54 1,850,101,600	0.1 2023/3/20	0.83
18	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	102.55 1,815,223,500	0.8 2023/6/20	0.82
19	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	100.29 1,785,322,200	0.1 2021/12/20	0.80
20	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	101.06 1,778,691,200	0.1 2027/12/20	0.80
21	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	100.96 1,736,632,400	0.1 2028/9/20	0.78
22	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	100.85 1,684,261,800	0.1 2029/3/20	0.76
23	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	100.84 1,633,640,400	0.1 2024/12/20	0.74
24	３２８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,590,000,000	102.28 1,626,261,600	101.82 1,619,049,300	0.6 2023/3/20	0.73
25	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	100.91 1,554,060,200	0.1 2028/12/20	0.70
26	３５８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,500,000,000	100.90 1,513,620,000	100.61 1,509,270,000	0.1 2030/3/20	0.68
27	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	100.40 1,506,075,000	0.1 2022/6/20	0.68
28	３５６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,480,000,000	101.27 1,498,810,500	100.72 1,490,685,600	0.1 2029/9/20	0.67
29	３５７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	1,460,000,000	101.36 1,479,866,000	100.64 1,469,475,400	0.1 2029/12/20	0.66
30	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	100.67 1,459,845,500	0.1 2023/12/20	0.66

（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8月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	81.49
地方債証券	7.33
特殊債券	6.88
社債券	4.31
合計	100.01

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8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	337,144	33,550.59 11,311,382,883	52,598.87 17,733,394,371	－ －	4.69
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	556,756	19,276.19 10,732,138,793	24,117.95 13,427,817,601	－ －	3.55
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	32,597	224,594.97 7,321,122,400	358,413.64 11,683,209,683	－ －	3.09
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	185,251	22,074.04 4,089,238,182	30,940.01 5,731,669,200	－ －	1.51
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	23,701	156,551.02 3,710,415,954	173,255.03 4,106,317,646	－ －	1.09
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	23,046	156,086.44 3,597,168,111	172,730.34 3,980,743,526	－ －	1.05

7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	202,933	15,649.55 3,175,810,293	16,187.51 3,284,980,048	－ －	0.87
8	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	131,560	21,648.42 2,848,066,480	22,727.20 2,989,991,168	－ －	0.79
9	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	229,471	12,456.64 2,858,438,510	12,693.07 2,912,692,842	－ －	0.77
10	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	190,305	13,159.31 2,504,282,530	14,620.80 2,782,412,714	－ －	0.74
11	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	69,001	34,940.03 2,410,897,242	38,574.40 2,661,672,395	－ －	0.70
12	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	11,352	82,193.12 933,056,403	233,203.82 2,647,329,810	－ －	0.70
13	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	47,121	30,742.98 1,448,639,971	55,409.87 2,610,968,842	－ －	0.69
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	236,771	13,964.50 3,306,390,134	10,827.84 2,563,720,209	－ －	0.68
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	84,057	25,284.75 2,125,361,069	30,163.51 2,535,454,529	－ －	0.67
16	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	106,854	23,180.87 2,476,969,068	23,026.42 2,460,465,937	－ －	0.65
17	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	73,031	30,917.78 2,257,957,115	33,122.02 2,418,934,476	－ －	0.64
18	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	37,070	39,370.87 1,459,478,245	54,412.11 2,017,057,229	－ －	0.53
19	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	318,807	6,125.93 1,952,990,395	6,243.63 1,990,514,097	－ －	0.53
20	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	138,889	14,234.92 1,977,073,899	14,280.49 1,983,403,586	－ －	0.52
21	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	54,066	39,349.02 2,127,444,296	36,554.09 1,976,333,970	－ －	0.52
22	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	33,740	40,163.72 1,355,124,186	55,197.05 1,862,348,480	－ －	0.49

23	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	64,766	19,550.63 1,266,216,706	28,563.09 1,849,917,475	－ －	0.49
24	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	85,699	12,760.89 1,093,596,018	21,544.01 1,846,300,352	－ －	0.49
25	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	195,321	8,655.00 1,690,504,861	9,024.08 1,762,593,110	－ －	0.47
26	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	329,314	6,970.25 2,295,403,108	5,313.30 1,749,745,656	－ －	0.46
27	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	552,615	3,934.82 2,174,441,933	3,165.01 1,749,034,432	－ －	0.46
28	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	426,125	3,817.99 1,626,942,813	3,994.19 1,702,027,452	－ －	0.45
29	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	604,885	3,525.98 2,132,816,113	2,770.96 1,676,116,978	－ －	0.44
30	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	314,260	6,129.75 1,926,338,200	5,250.08 1,649,892,906	－ －	0.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

令和2年8月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	90.75
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.18
投資証券	1.97
合計	92.90

（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8月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	7.15
医薬品		4.92
コンピュータ・周辺機器		4.91
銀行		4.85
情報技術サービス		4.51
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.95
インターネット販売・通信販売		3.77
半導体・半導体製造装置		3.63
ヘルスケア機器・用品		2.89
保険		2.87
資本市場		2.75
石油・ガス・消耗燃料		2.69
化学		2.02
バイオテクノロジー		1.86
電力		1.81
食品		1.80
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		1.79
専門小売り		1.65
各種電気通信サービス		1.63
飲料		1.62
機械		1.52
金属・鉱業		1.45
ホテル・レストラン・レジャー		1.43
娯楽		1.43
食品・生活必需品小売り		1.42
航空宇宙・防衛		1.39
家庭用品		1.36
繊維・アパレル・贅沢品		1.27
自動車		1.20
コングロマリット		1.04
メディア		1.03
陸運・鉄道		1.02
ライフサイエンス・ツール／サービス		0.93
総合公益事業		0.88
各種金融サービス		0.87
電気設備		0.71
専門サービス		0.70

タバコ	0.68
パーソナル用品	0.65
通信機器	0.64
航空貨物・物流サービス	0.60
建設関連製品	0.50
電子装置・機器・部品	0.49
複合小売り	0.46
不動産管理・開発	0.42
商業サービス・用品	0.41
家庭用耐久財	0.34
消費者金融	0.31
商社・流通業	0.29
無線通信サービス	0.27
容器・包装	0.25
建設・土木	0.25
自動車部品	0.22
建設資材	0.22
ヘルスケア・テクノロジー	0.16
ガス	0.15
運送インフラ	0.14
エネルギー設備・サービス	0.12
水道	0.11
紙製品・林産品	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
海運業	0.06
販売	0.05
旅客航空輸送業	0.04
レジャー用品	0.03
合計	90.75

（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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8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	1,095,744,000	101.00 1,106,744,239	102.23 1,120,269,829	2 2021/11/15	0.87
2	US T N/B 2.125 12/31/21 アメリカ	国債証券	965,097,600	101.30 977,689,101	102.64 990,582,208	2.125 2021/12/31	0.77
3	US T N/B 2.0 02/15/22 アメリカ	国債証券	892,399,200	101.19 903,031,296	102.71 916,626,436	2 2022/2/15	0.71
4	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証券	736,466,400	100.75 742,047,429	102.56 755,338,351	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	676,411,200	108.30 732,598,378	108.51 734,011,839	2.375 2024/8/15	0.57
6	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証券	694,322,400	101.70 706,147,577	104.17 723,342,902	2 2022/11/30	0.56
7	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証券	688,000,800	101.72 699,879,559	103.65 713,155,828	2.125 2022/6/30	0.55

8	US T N/B 8.0 11/15/21 アメリカ	国債証券	632,160,000	111.23 703,154,525	109.44 691,894,175	8 2021/11/15	0.54
9	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	634,267,200	105.04 666,277,872	108.21 686,396,035	2.75 2023/11/15	0.53
10	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	509,942,400	113.25 577,549,601	120.17 612,847,176	3.125 2028/11/15	0.48
11	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証券	592,123,200	100.67 596,124,655	103.27 611,529,107	1.625 2022/11/15	0.48
12	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	560,515,200	105.35 590,555,311	108.86 610,217,130	2.75 2024/2/15	0.47
13	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証券	581,587,200	102.11 593,900,488	104.62 608,485,608	2.125 2022/12/31	0.47
14	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	558,408,000	102.98 575,072,988	107.78 601,859,122	2 2025/2/15	0.47
15	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	546,818,400	104.62 572,108,751	110.04 601,756,560	2.25 2025/11/15	0.47
16	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	545,764,800	103.17 563,118,411	108.48 592,069,531	2 2025/8/15	0.46
17	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	542,604,000	103.71 562,739,692	108.69 589,785,109	2.125 2025/5/15	0.46
18	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証券	568,944,000	100.82 573,611,115	102.76 584,656,627	1.75 2022/5/15	0.45
19	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証券	553,140,000	100.96 558,498,543	103.33 571,592,401	1.75 2022/9/30	0.44
20	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	321,203,200	173.16 556,202,309	170.79 548,595,341	5.75 2032/10/25	0.43
21	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	466,744,800	110.75 516,956,326	117.46 548,279,281	2.875 2028/5/15	0.43
22	US T N/B 1.5 09/30/21 アメリカ	国債証券	539,443,200	100.10 540,012,139	101.48 547,429,483	1.5 2021/9/30	0.43
23	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証券	524,692,800	101.10 530,472,615	103.86 544,983,651	1.75 2023/1/31	0.42
24	US T N/B 1.625 12/31/21 アメリカ	国債証券	526,800,000	102.42 539,558,358	102.00 537,336,000	1.625 2021/12/31	0.42
25	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証券	502,567,200	102.59 515,602,536	106.67 536,137,114	2 2024/5/31	0.42
26	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	494,138,400	104.01 513,981,143	108.46 535,985,745	2.25 2024/11/15	0.42
27	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	460,423,200	109.60 504,631,016	116.19 534,990,171	2.75 2028/2/15	0.42
28	US T N/B 2.875 11/15/21 アメリカ	国債証券	514,156,800	102.47 526,870,128	103.33 531,288,663	2.875 2021/11/15	0.41
29	DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23 ドイツ	国債証券	498,115,900	106.19 528,966,039	105.45 525,293,402	1.5 2023/2/15	0.41
30	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	286,071,600	184.69 528,354,521	183.57 525,144,496	4.5 2041/4/25	0.41

（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8月31日現在

種類	投資比率（%）

国債証券	99.35
合計	99.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

②【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。

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。

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。

③【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8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	349	5,495,585,170	5,639,840,000	2.39

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8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	1,194	21,660,116,886	22,043,276,964	5.83
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep20	買建	1,160	4,854,450,611	4,821,912,476	1.27
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep20	買建	159	1,350,971,939	1,333,001,534	0.35
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep20	買建	63	1,013,703,789	1,014,480,936	0.27
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep20	買建	54	634,482,812	632,353,500	0.17

（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。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（令和2年8月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末(平成31年2月25日)	196	196	1.0087	1.0087
第2計算期間末(令和2年2月25日)	499	499	1.0477	1.0477
令和1年8月末日	301	－	1.0166	－
9月末日	326	－	1.0271	－
10月末日	334	－	1.0408	－
11月末日	396	－	1.0468	－
12月末日	427	－	1.0520	－
令和2年1月末日	474	－	1.0511	－
2月末日	485	－	1.0270	－
3月末日	495	－	0.9922	－
4月末日	818	－	1.0095	－
5月末日	868	－	1.0275	－
6月末日	1,094	－	1.0301	－
7月末日	1,107	－	1.0286	－
8月末日	1,155	－	1.0499	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
令和2年2月26日～令和2年8月25日	－

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	0.9
第2計算期間	3.9
令和2年2月26日～令和2年8月25日	0.4

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

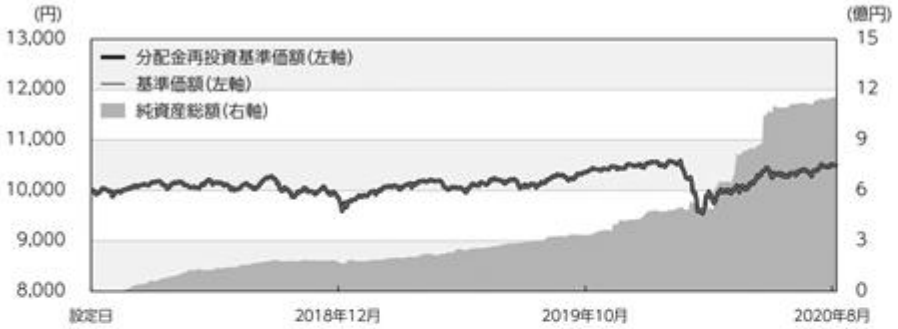
	設定口数	解約口数
第1計算期間	359,187,202	164,566,177
第2計算期間	459,829,471	178,063,350
令和2年2月26日～ 令和2年8月25日	779,864,133	161,669,332

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2020年8月31日

基準価額・純資産の推移 《2018年2月28日～2020年8月31日》



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2018年2月28日)

分配の推移(税引前)

2019年 2月	0円
2020年 2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	51.75
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.31
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.64
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.31

■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	3.37
2	ソニー	株式	日本	電気機器	2.25
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.22
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.71
5	任天堂	株式	日本	その他製品	1.50

■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	1.00
2	341回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.3	2025/12/20	0.97
3	343回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/6/20	0.95
4	334回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	0.92
5	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.91

○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。
○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
○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8月31日

■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	4.69
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.55
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	3.09
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	1.51
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	1.09

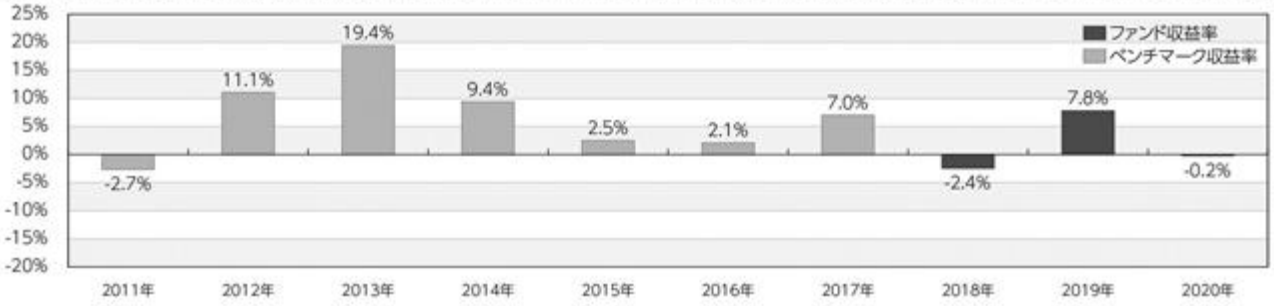
■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

※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	0.87
2	US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	アメリカ	2.125	2021/12/31	0.77
3	US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	アメリカ	2	2022/2/15	0.71
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	0.57

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。
※2018年は設定日から年末までの収益率、および2020年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※2017年以前は、ベンチマークの収益率を表示しています。当ファンドのベンチマークは、合成ベンチマークであり、当ファンドが投資する各マザーファンドのベンチマークを基本配分比率で委託会社が合成したものです。合成ベンチマークについては、ファンドの特色をご参照ください。

○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。
○ベンチマークの情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

当ファンドは、収益の分配が行われた場合、収益分配金を無手数料で再投資する「累積投資（自動けいぞく投資）」専用ファンドです。このためお申込みの際、受益権の取得申込者は販売会社との間で、「自動けいぞく投資約款」にしたがって分配金累積投資に関する契約を締結します。

なお、販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

なお、収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

1円以上1円単位とします。

※収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

・解約単位
1口単位とします。

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。
・販売会社へのお問い合わせ
・委託会社への照会
ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/
コールセンター：0120-104-694（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

（2）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2018年2月28日から原則として無期限です。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年2月26日から翌年2月25日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

- **委託会社は、毎年2月25日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。**
- **運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。**

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

４【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

（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2期計算期間（平成31年2月26日から令和2年2月25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】

【４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 平成31年2月25日現在	第2期 令和2年2月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,990,708	17,498,573
親投資信託受益証券	190,442,582	484,035,341
流動資産合計	198,433,290	501,533,914
資産合計	198,433,290	501,533,914
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,958,626	2,100,532
未払受託者報酬	19,215	43,041
未払委託者報酬	134,710	258,377
その他未払費用	3,607	7,949
流動負債合計	2,116,158	2,409,899
負債合計	2,116,158	2,409,899
純資産の部		
元本等		
元本	194,621,025	476,387,146
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,696,107	22,736,869
（分配準備積立金）	1,572,020	9,407,683
元本等合計	196,317,132	499,124,015
純資産合計	196,317,132	499,124,015
負債純資産合計	198,433,290	501,533,914

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　平成30年2月28日 至　平成31年2月25日	第2期 自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	△48,418	12,264,759
営業収益合計	△48,418	12,264,759
営業費用		
支払利息	4,216	6,331
受託者報酬	27,207	69,190
委託者報酬	191,032	426,652
その他費用	5,143	12,840
営業費用合計	227,598	515,013
営業利益又は営業損失（△）	△276,016	11,749,746
経常利益又は経常損失（△）	△276,016	11,749,746
当期純利益又は当期純損失（△）	△276,016	11,749,746
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（△）	△1,318,193	2,923,065
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－	1,696,107
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,210,746	15,106,918
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	2,210,746	15,106,918
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,556,816	2,892,837
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,556,816	2,892,837
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（△）	1,696,107	22,736,869

（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2期 自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 平成31年2月25日現在	第2期 令和2年2月25日現在
１．　期首元本額	1,000,000円	194,621,025円
期中追加設定元本額	358,187,202円	459,829,471円
期中一部解約元本額	164,566,177円	178,063,350円
２．　受益権の総数	194,621,025口	476,387,146口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　平成30年2月28日 至　平成31年2月25日	第2期 自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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（1,572,020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（167,514円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は1,739,534円（1万口当たり89.38円）でありますが、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（4,347,234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（4,184,072円）、信託約款に規定される収益調整金（13,329,186円）及び分配準備積立金（876,377円）より分配対象収益は22,736,869円（1万口当たり477.27円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第1期 自　平成30年2月28日 至　平成31年2月25日	第2期 自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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1期 平成31年2月25日現在	第2期 令和2年2月25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1期 平成31年2月25日現在	第2期 令和2年2月25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	624,300	10,225,805
合計	624,300	10,225,805

（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1期 平成31年2月25日現在	第2期 令和2年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0087円 (10,087円)	1.0477円 (10,477円)

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

令和2年2月25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	37,918,714	97,159,120	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	197,794,405	262,631,410	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,927,518	48,216,991	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	38,912,796	76,027,820	
親投資信託受益証券　合計		286,553,433	484,035,341	
合計			484,035,341	

（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、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・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2月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,476,403,430
株式	245,829,299,910
未収配当金	419,211,946
前払金	86,114,000
流動資産合計	252,811,029,286
資産合計	252,811,029,286
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	273,734,680
未払金	1,671,320
未払解約金	201,011,000
流動負債合計	476,417,000
負債合計	476,417,000
純資産の部	
元本等	
元本	98,480,866,315
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	153,853,745,971
元本等合計	252,334,612,286
純資産合計	252,334,612,286
負債純資産合計	252,811,029,286

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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	114,657,645,379円
同期中追加設定元本額	40,379,627,015円
同期中一部解約元本額	56,556,406,079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	13,753,237,108円

ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	2,295,825,238円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,872,943円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	4,943,656円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	7,620,410円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,957,587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）	10,586,919円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	553,828,385円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	349,198,420円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	11,426,487円
たわらノーロード　バランス（標準型）	71,300,022円
たわらノーロード　バランス（積極型）	110,005,731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）	458,409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）	32,932,692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）	104,459,071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）	69,905,403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）	144,883,086円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	196,809円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	855,511円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,848,975円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,235,538円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,103,762円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	36,067,222,721円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	993,369,179円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,260,180,890円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,391,828,693円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	348,768,052円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,181,694,171円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,120,913,992円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	38,596,173円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,118,218,857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）	307,430,970円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	239,633,149円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	422,956,944円
投資のソムリエ	8,744,672,163円
クルーズコントロール	579,839,889円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	829,749,325円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	261,682,155円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	317,148,733円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	586,737円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,507,282円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	10,392,737円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	474,307,956円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,017,761,432円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	6,092,982円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,868,170円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,432,236円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	13,656,070円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	37,918,714円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,373,225,234円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	217,750,260円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	953,346円

	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	800,488円
	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	896,698円
	４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	197,398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）	106,706,919円
	ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,488,956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）	874,781,533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）	87,104,494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）	90,787,326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）	204,882,608円
	ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,081,740円
	ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,099,169円
	ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,085,281円
	ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,090,446円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,577,334円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,241,538円
	ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	851,350,276円
	ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	851,774,975円
	ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,428,703,718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）	174,311,622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）	48,033,765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）	465,903,601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）	125,302,358円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,220,284円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,583,091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）	485,222,339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）	37,120,804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）	134,171,540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）	347,374,438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）	569,241,310円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,062,894円
	ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,530,419円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,993,766円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,317円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	121,717円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１２１２）（適格機関投資家限定）	380,720,505円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,210,952,937円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,605,155,025円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	65,047,821円
	計	98,480,866,315円
２．	受益権の総数	98,480,866,315口

３．　差入代用有価証券 　　株式	1,893,500,000円

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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2月25日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△17,300,380,340
合計	△17,300,380,340

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和2年2月8日から令和2年2月25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2月25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	6,698,704,000	－	6,425,100,000	△273,604,000
合計	6,698,704,000	－	6,425,100,000	△273,604,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5623円 (25,623円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年2月25日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	5,100	2,719.00	13,866,900	
日本水産	146,500	570.00	83,505,000	
マルハニチロ	21,200	2,438.00	51,685,600	
ホウスイ	900	795.00	715,500	
カネコ種苗	4,500	1,201.00	5,404,500	
サカタのタネ	17,400	3,200.00	55,680,000	
ホクト	11,200	1,930.00	21,616,000	
ホクリヨウ	2,300	756.00	1,738,800	
ヒノキヤグループ	3,700	1,941.00	7,181,700	
ショーボンドホールディングス	22,700	4,125.00	93,637,500	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,481.00	64,571,600	
タマホーム	6,900	1,371.00	9,459,900	
サンヨーホームズ	1,200	711.00	853,200	
日本アクア	5,800	575.00	3,335,000	
ファーストコーポレーション	4,500	559.00	2,515,500	
ベステラ	2,500	1,040.00	2,600,000	
ＴＡＴＥＲＵ	30,300	182.00	5,514,600	
スペースバリューホールディングス	17,800	515.00	9,167,000	
住石ホールディングス	30,100	139.00	4,183,900	
日鉄鉱業	3,400	4,110.00	13,974,000	
三井松島ホールディングス	5,700	1,081.00	6,161,700	
国際石油開発帝石	587,500	1,020.00	599,250,000	
石油資源開発	19,200	2,605.00	50,016,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	7,100	1,622.00	11,516,200	
ダイセキ環境ソリューション	2,900	933.00	2,705,700	
第一カッター興業	1,800	1,794.00	3,229,200	
安藤・間	87,200	836.00	72,899,200	
東急建設	42,900	721.00	30,930,900	
コムシスホールディングス	51,900	2,768.00	143,659,200	
ビーアールホールディングス	16,000	473.00	7,568,000	
高松コンストラクショングループ	9,100	2,479.00	22,558,900	
東建コーポレーション	4,500	8,140.00	36,630,000	
ソネック	1,500	722.00	1,083,000	
ヤマウラ	6,400	920.00	5,888,000	
大成建設	112,800	3,850.00	434,280,000	
大林組	338,100	1,167.00	394,562,700	
清水建設	343,200	1,041.00	357,271,200	
飛島建設	9,700	1,283.00	12,445,100	
長谷工コーポレーション	130,900	1,347.00	176,322,300	
松井建設	13,400	695.00	9,313,000	
錢高組	1,400	3,660.00	5,124,000	
鹿島建設	265,500	1,220.00	323,910,000	
不動テトラ	8,900	1,544.00	13,741,600	
大末建設	4,000	915.00	3,660,000	

鉄建建設	7,300	2,528.00	18,454,400	
西松建設	26,000	2,322.00	60,372,000	
三井住友建設	81,700	574.00	46,895,800	
大豊建設	7,600	2,488.00	18,908,800	
前田建設工業	84,700	1,010.00	85,547,000	
佐田建設	7,400	373.00	2,760,200	
ナカノフドー建設	9,300	436.00	4,054,800	
奥村組	18,400	2,757.00	50,728,800	
東鉄工業	14,500	2,907.00	42,151,500	
イチケン	2,400	1,630.00	3,912,000	
富士ピー・エス	5,000	482.00	2,410,000	
淺沼組	3,800	4,795.00	18,221,000	
戸田建設	140,300	678.00	95,123,400	
熊谷組	15,700	3,085.00	48,434,500	
北野建設	2,000	2,498.00	4,996,000	
植木組	1,500	2,450.00	3,675,000	
矢作建設工業	14,900	812.00	12,098,800	
ピーエス三菱	11,100	627.00	6,959,700	
日本ハウスホールディングス	23,200	433.00	10,045,600	
大東建託	40,500	11,895.00	481,747,500	
新日本建設	14,400	803.00	11,563,200	
ＮＩＰＰＯ	27,900	2,589.00	72,233,100	
東亜道路工業	2,100	3,245.00	6,814,500	
前田道路	35,800	3,330.00	119,214,000	
日本道路	3,300	6,950.00	22,935,000	
東亜建設工業	10,500	1,684.00	17,682,000	
日本国土開発	19,800	573.00	11,345,400	
若築建設	6,100	1,525.00	9,302,500	
東洋建設	37,900	487.00	18,457,300	
五洋建設	134,000	623.00	83,482,000	
世紀東急工業	16,200	847.00	13,721,400	
福田組	3,900	4,125.00	16,087,500	
日本ドライケミカル	2,700	1,678.00	4,530,600	
住友林業	85,700	1,700.00	145,690,000	
日本基礎技術	11,400	351.00	4,001,400	
巴コーポレーション	15,200	353.00	5,365,600	
大和ハウス工業	334,500	3,248.00	1,086,456,000	
ライト工業	19,400	1,395.00	27,063,000	
積水ハウス	369,900	2,290.00	847,071,000	
日特建設	8,900	801.00	7,128,900	
北陸電気工事	5,800	1,011.00	5,863,800	
ユアテック	19,400	607.00	11,775,800	
四電工	1,700	2,474.00	4,205,800	
中電工	13,700	2,366.00	32,414,200	
関電工	48,100	966.00	46,464,600	
きんでん	80,400	1,717.00	138,046,800	
東京エネシス	11,200	801.00	8,971,200	
トーエネック	3,400	3,600.00	12,240,000	
住友電設	9,600	2,334.00	22,406,400	
日本電設工業	18,600	2,091.00	38,892,600	

協和エクシオ	51,300	2,526.00	129,583,800	
新日本空調	9,000	1,879.00	16,911,000	
日本工営	6,900	3,155.00	21,769,500	
九電工	23,800	3,030.00	72,114,000	
三機工業	24,400	1,300.00	31,720,000	
日揮ホールディングス	104,100	1,500.00	156,150,000	
中外炉工業	3,700	1,643.00	6,079,100	
ヤマト	10,800	680.00	7,344,000	
太平電業	8,200	2,386.00	19,565,200	
高砂熱学工業	29,400	1,789.00	52,596,600	
三晃金属工業	1,400	2,513.00	3,518,200	
ＮＥＣネッツエスアイ	10,000	4,140.00	41,400,000	
朝日工業社	2,200	2,972.00	6,538,400	
明星工業	21,800	746.00	16,262,800	
大氣社	16,400	3,265.00	53,546,000	
ダイダン	8,100	2,608.00	21,124,800	
日比谷総合設備	10,900	1,874.00	20,426,600	
日本製粉	31,600	1,606.00	50,749,600	
日清製粉グループ本社	122,300	1,854.00	226,744,200	
日東富士製粉	700	6,050.00	4,235,000	
昭和産業	10,000	2,996.00	29,960,000	
鳥越製粉	9,700	775.00	7,517,500	
中部飼料	13,300	1,509.00	20,069,700	
フィード・ワン	72,900	171.00	12,465,900	
東洋精糖	1,700	1,170.00	1,989,000	
日本甜菜製糖	5,700	1,770.00	10,089,000	
三井製糖	9,500	1,998.00	18,981,000	
塩水港精糖	11,300	220.00	2,486,000	
日新製糖	5,100	1,966.00	10,026,600	
ＬＩＦＵＬＬ	36,000	466.00	16,776,000	
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,535.00	10,591,500	
日本M&Aセンター	77,800	3,600.00	280,080,000	
メンバーズ	3,100	1,515.00	4,696,500	
中広	1,100	526.00	578,600	
ＵＴグループ	12,100	2,404.00	29,088,400	
アイティメディア	3,100	1,070.00	3,317,000	
タケエイ	9,900	964.00	9,543,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,200	1,549.00	1,858,800	
ビーネックスグループ	11,300	918.00	10,373,400	
コシダカホールディングス	24,800	1,447.00	35,885,600	
アルトナー	2,500	810.00	2,025,000	
パソナグループ	11,100	1,212.00	13,453,200	
ＣＤＳ	2,500	1,331.00	3,327,500	
リンクアンドモチベーション	22,700	515.00	11,690,500	
ＧＣＡ	12,400	769.00	9,535,600	
エス・エム・エス	32,000	2,225.00	71,200,000	
サニーサイドアップグループ	2,300	830.00	1,909,000	
パーソルホールディングス	103,000	1,633.00	168,199,000	
リニカル	5,000	946.00	4,730,000	
クックパッド	36,100	302.00	10,902,200	

エスクリ	3,300	691.00	2,280,300	
アイ・ケイ・ケイ	5,100	711.00	3,626,100	
森永製菓	25,400	4,440.00	112,776,000	
中村屋	2,800	3,905.00	10,934,000	
江崎グリコ	32,100	4,535.00	145,573,500	
名糖産業	5,200	1,381.00	7,181,200	
井村屋グループ	4,600	1,852.00	8,519,200	
不二家	6,000	2,160.00	12,960,000	
山崎製パン	81,200	1,942.00	157,690,400	
第一屋製パン	1,800	921.00	1,657,800	
モロゾフ	1,800	4,825.00	8,685,000	
亀田製菓	6,200	4,560.00	28,272,000	
寿スピリッツ	10,400	5,800.00	60,320,000	
カルビー	49,400	2,923.00	144,396,200	
森永乳業	20,000	3,860.00	77,200,000	
六甲バター	7,100	1,427.00	10,131,700	
ヤクルト本社	74,500	5,210.00	388,145,000	
明治ホールディングス	71,600	6,770.00	484,732,000	
雪印メグミルク	26,100	2,320.00	60,552,000	
プリマハム	16,900	2,348.00	39,681,200	
日本ハム	41,400	4,415.00	182,781,000	
林兼産業	3,700	648.00	2,397,600	
丸大食品	11,600	1,891.00	21,935,600	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8,700	2,498.00	21,732,600	
柿安本店	3,800	3,030.00	11,514,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	69,800	636.00	44,392,800	
学情	3,700	1,896.00	7,015,200	
スタジオアリス	5,200	1,784.00	9,276,800	
クロスキャット	2,800	1,126.00	3,152,800	
シミックホールディングス	5,700	1,523.00	8,681,100	
エプコ	1,600	1,052.00	1,683,200	
システナ	37,700	1,599.00	60,282,300	
ＮＪＳ	2,200	1,686.00	3,709,200	
デジタルアーツ	5,200	5,450.00	28,340,000	
日鉄ソリューションズ	15,900	3,245.00	51,595,500	
綜合警備保障	41,000	5,310.00	217,710,000	
キューブシステム	5,600	677.00	3,791,200	
いちご	135,300	373.00	50,466,900	
エイジア	1,900	1,461.00	2,775,900	
日本駐車場開発	117,200	140.00	16,408,000	
コア	4,500	1,263.00	5,683,500	
カカクコム	77,100	2,675.00	206,242,500	
アイロムグループ	3,700	1,397.00	5,168,900	
セントケア・ホールディング	6,700	460.00	3,082,000	
サイネックス	1,700	661.00	1,123,700	
ルネサンス	5,700	1,593.00	9,080,100	
ディップ	14,500	2,930.00	42,485,000	
ＳＢＳホールディングス	9,300	1,729.00	16,079,700	
オプトホールディング	5,600	1,886.00	10,561,600	
新日本科学	11,200	667.00	7,470,400	

ツクイ	24,300	581.00	14,118,300	
キャリアデザインセンター	2,700	1,174.00	3,169,800	
ベネフィット・ワン	28,200	1,781.00	50,224,200	
エムスリー	227,100	2,945.00	668,809,500	
ツカダ・グローバルホールディング	6,700	516.00	3,457,200	
ブラス	800	697.00	557,600	
アウトソーシング	59,000	894.00	52,746,000	
ウェルネット	9,800	635.00	6,223,000	
ワールドホールディングス	3,500	1,819.00	6,366,500	
ディー・エヌ・エー	50,500	1,527.00	77,113,500	
博報堂ＤＹホールディングス	143,300	1,341.00	192,165,300	
ぐるなび	18,000	804.00	14,472,000	
タカミヤ	11,000	566.00	6,226,000	
ジャパンベストレスキューシステム	6,900	820.00	5,658,000	
ファンコミュニケーションズ	28,400	443.00	12,581,200	
ライク	4,100	1,753.00	7,187,300	
ビジネス・ブレークスルー	4,400	401.00	1,764,400	
エスプール	19,900	738.00	14,686,200	
ＷＤＢホールディングス	4,700	2,455.00	11,538,500	
ティア	6,100	590.00	3,599,000	
ＣＤＧ	1,100	1,382.00	1,520,200	
バリューコマース	5,800	2,260.00	13,108,000	
インフォマート	112,900	697.00	78,691,300	
サッポロホールディングス	36,900	2,321.00	85,644,900	
アサヒグループホールディングス	226,600	4,496.00	1,018,793,600	
キリンホールディングス	459,000	2,120.50	973,309,500	
宝ホールディングス	81,000	869.00	70,389,000	
オエノンホールディングス	28,700	361.00	10,360,700	
養命酒製造	3,400	1,906.00	6,480,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	76,000	2,762.00	209,912,000	
サントリー食品インターナショナル	72,400	4,415.00	319,646,000	
ダイドーグループホールディングス	5,600	3,790.00	21,224,000	
伊藤園	32,800	5,150.00	168,920,000	
キーコーヒー	10,700	2,169.00	23,208,300	
ユニカフェ	2,900	930.00	2,697,000	
ジャパンフーズ	1,500	1,185.00	1,777,500	
日清オイリオグループ	14,000	3,520.00	49,280,000	
不二製油グループ本社	26,400	2,604.00	68,745,600	
かどや製油	1,100	3,710.00	4,081,000	
Ｊ－オイルミルズ	5,600	4,070.00	22,792,000	
ローソン	26,800	6,070.00	162,676,000	
サンエー	8,900	4,320.00	38,448,000	
カワチ薬品	8,300	2,027.00	16,824,100	
エービーシー・マート	16,600	6,460.00	107,236,000	
ハードオフコーポレーション	4,200	778.00	3,267,600	
高千穂交易	4,100	1,086.00	4,452,600	
アスクル	11,100	3,210.00	35,631,000	
ゲオホールディングス	19,100	1,191.00	22,748,100	
アダストリア	14,700	1,986.00	29,194,200	

ジーフット	6,400	591.00	3,782,400	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,500	631.00	946,500	
伊藤忠食品	2,400	4,750.00	11,400,000	
くら寿司	5,500	5,080.00	27,940,000	
キャンドゥ	5,100	1,607.00	8,195,700	
エレマテック	9,900	976.00	9,662,400	
パルグループホールディングス	5,400	3,320.00	17,928,000	
ＪＡＬＵＸ	3,100	2,107.00	6,531,700	
エディオン	48,800	976.00	47,628,800	
あらた	8,500	4,295.00	36,507,500	
サーラコーポレーション	21,600	573.00	12,376,800	
ワッツ	4,800	595.00	2,856,000	
トーメンデバイス	1,600	3,685.00	5,896,000	
ハローズ	4,000	2,698.00	10,792,000	
ＪＰホールディングス	32,400	296.00	9,590,400	
フジオフードシステム	9,000	1,597.00	14,373,000	
あみやき亭	2,200	3,325.00	7,315,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,900	2,666.00	10,397,400	
ひらまつ	19,600	233.00	4,566,800	
フィールズ	8,200	452.00	3,706,400	
双日	586,600	331.00	194,164,600	
アルフレッサ　ホールディングス	118,000	2,036.00	240,248,000	
大黒天物産	2,500	3,180.00	7,950,000	
ハニーズホールディングス	9,400	1,268.00	11,919,200	
ファーマライズホールディングス	2,500	621.00	1,552,500	
キッコーマン	77,900	5,500.00	428,450,000	
味の素	239,000	1,904.50	455,175,500	
キユーピー	60,300	2,057.00	124,037,100	
ハウス食品グループ本社	40,500	3,310.00	134,055,000	
カゴメ	41,100	2,485.00	102,133,500	
焼津水産化学工業	5,300	990.00	5,247,000	
アリアケジャパン	9,900	7,420.00	73,458,000	
ピエトロ	1,400	1,630.00	2,282,000	
エバラ食品工業	2,500	2,100.00	5,250,000	
やまみ	500	2,156.00	1,078,000	
ニチレイ	51,500	2,786.00	143,479,000	
横浜冷凍	29,900	899.00	26,880,100	
東洋水産	55,700	4,400.00	245,080,000	
イートアンド	3,800	1,780.00	6,764,000	
大冷	1,400	1,923.00	2,692,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	5,900	1,051.00	6,200,900	
日清食品ホールディングス	46,000	8,640.00	397,440,000	
永谷園ホールディングス	5,300	2,035.00	10,785,500	
一正蒲鉾	4,000	926.00	3,704,000	
フジッコ	11,700	1,810.00	21,177,000	
ロック・フィールド	11,700	1,359.00	15,900,300	
日本たばこ産業	624,900	2,217.50	1,385,715,750	
ケンコーマヨネーズ	6,100	2,079.00	12,681,900	
わらべや日洋ホールディングス	7,100	1,768.00	12,552,800	
なとり	6,100	1,650.00	10,065,000	

イフジ産業	1,900	825.00	1,567,500	
ピックルスコーポレーション	2,300	2,370.00	5,451,000	
北の達人コーポレーション	37,700	618.00	23,298,600	
ユーグレナ	46,200	803.00	37,098,600	
スター・マイカ・ホールディングス	5,500	1,518.00	8,349,000	
片倉工業	15,400	1,283.00	19,758,200	
グンゼ	7,800	3,990.00	31,122,000	
ヒューリック	227,100	1,291.00	293,186,100	
神栄	1,500	700.00	1,050,000	
ラサ商事	5,600	900.00	5,040,000	
アルペン	8,200	1,811.00	14,850,200	
ハブ	3,100	979.00	3,034,900	
ラクーンホールディングス	5,100	800.00	4,080,000	
クオールホールディングス	15,600	1,320.00	20,592,000	
アルコニックス	11,200	1,177.00	13,182,400	
神戸物産	36,600	4,335.00	158,661,000	
ソリトンシステムズ	4,600	1,117.00	5,138,200	
ジンズホールディングス	5,600	7,190.00	40,264,000	
ビックカメラ	62,900	1,036.00	65,164,400	
ＤＣＭホールディングス	57,300	1,025.00	58,732,500	
ペッパーフードサービス	8,500	818.00	6,953,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	75,500	2,579.00	194,714,500	
東京一番フーズ	2,700	575.00	1,552,500	
ＤＤホールディングス	4,200	1,560.00	6,552,000	
あい　ホールディングス	15,200	1,630.00	24,776,000	
ディーブイエックス	3,800	880.00	3,344,000	
きちりホールディングス	2,900	682.00	1,977,800	
アークランドサービスホールディングス	7,800	1,907.00	14,874,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	126,800	1,235.00	156,598,000	
ドトール・日レスホールディングス	16,900	2,006.00	33,901,400	
マツモトキヨシホールディングス	43,900	3,635.00	159,576,500	
ブロンコビリー	5,500	2,391.00	13,150,500	
ＺＯＺＯ	73,000	1,650.00	120,450,000	
トレジャー・ファクトリー	3,200	805.00	2,576,000	
物語コーポレーション	2,700	8,050.00	21,735,000	
ココカラファイン	11,100	4,975.00	55,222,500	
三越伊勢丹ホールディングス	185,600	756.00	140,313,600	
東洋紡	41,700	1,451.00	60,506,700	
ユニチカ	31,200	336.00	10,483,200	
富士紡ホールディングス	5,100	3,200.00	16,320,000	
日清紡ホールディングス	71,800	1,009.00	72,446,200	
倉敷紡績	10,900	2,138.00	23,304,200	
ダイワボウホールディングス	9,100	6,070.00	55,237,000	
シキボウ	5,600	1,250.00	7,000,000	
日東紡績	16,000	4,800.00	76,800,000	
トヨタ紡織	31,400	1,555.00	48,827,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	25,300	1,620.00	40,986,000	
Ｈａｍｅｅ	3,300	1,559.00	5,144,700	
ラクト・ジャパン	4,000	3,705.00	14,820,000	

ウエルシアホールディングス	31,600	6,320.00	199,712,000	
クリエイトＳＤホールディングス	17,800	2,570.00	45,746,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,000	1,030.00	20,600,000	
八洲電機	8,300	856.00	7,104,800	
メディアスホールディングス	6,000	739.00	4,434,000	
レスターホールディングス	11,100	1,755.00	19,480,500	
ジューテックホールディングス	2,300	1,079.00	2,481,700	
丸善ＣＨＩホールディングス	12,400	357.00	4,426,800	
大光	4,600	624.00	2,870,400	
ＯＣＨＩホールディングス	3,100	1,369.00	4,243,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	56,200	956.00	53,727,200	
黒谷	1,900	470.00	893,000	
ミサワ	2,100	652.00	1,369,200	
ティーライフ	1,400	808.00	1,131,200	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1,800	779.00	1,402,200	
エー・ピーカンパニー	2,000	557.00	1,114,000	
三洋貿易	10,600	1,128.00	11,956,800	
チムニー	3,300	2,106.00	6,949,800	
シュッピン	7,200	918.00	6,609,600	
ビューティガレージ	1,700	1,845.00	3,136,500	
ウイン・パートナーズ	7,600	981.00	7,455,600	
ネクステージ	15,200	955.00	14,516,000	
ジョイフル本田	31,100	1,166.00	36,262,600	
鳥貴族	3,500	2,522.00	8,827,000	
キリン堂ホールディングス	4,200	1,632.00	6,854,400	
ホットランド	7,100	1,201.00	8,527,100	
すかいらーくホールディングス	119,000	1,780.00	211,820,000	
ＳＦＰホールディングス	4,500	2,019.00	9,085,500	
綿半ホールディングス	4,000	1,750.00	7,000,000	
日本毛織	34,800	951.00	33,094,800	
ダイトウボウ	17,800	218.00	3,880,400	
トーア紡コーポレーション	4,100	498.00	2,041,800	
ダイドーリミテッド	14,100	252.00	3,553,200	
ヨシックス	1,700	2,521.00	4,285,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,900	933.00	28,829,700	
三栄建築設計	4,300	1,459.00	6,273,700	
野村不動産ホールディングス	64,500	2,616.00	168,732,000	
三重交通グループホールディングス	21,500	552.00	11,868,000	
サムティ	15,100	1,718.00	25,941,800	
ディア・ライフ	13,700	556.00	7,617,200	
コーセーアールイー	3,200	575.00	1,840,000	
エー・ディー・ワークス	201,800	28.00	5,650,400	
日本商業開発	6,700	1,722.00	11,537,400	
プレサンスコーポレーション	17,400	1,232.00	21,436,800	
ユニゾホールディングス	16,000	6,010.00	96,160,000	
フィル・カンパニー	1,400	3,690.00	5,166,000	
ＴＨＥグローバル社	5,500	416.00	2,288,000	
ハウスコム	1,400	1,432.00	2,004,800	

日本管理センター	7,000	1,288.00	9,016,000	
サンセイランディック	3,200	785.00	2,512,000	
エストラスト	1,400	759.00	1,062,600	
フージャースホールディングス	21,200	666.00	14,119,200	
オープンハウス	30,900	3,105.00	95,944,500	
東急不動産ホールディングス	289,300	750.00	216,975,000	
飯田グループホールディングス	88,700	1,566.00	138,904,200	
イーグランド	1,700	776.00	1,319,200	
ムゲンエステート	7,300	568.00	4,146,400	
帝国繊維	11,800	2,039.00	24,060,200	
日本コークス工業	92,100	72.00	6,631,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,900	640.00	3,136,000	
ミタチ産業	3,200	673.00	2,153,600	
ＢＥＥＮＯＳ	4,000	1,071.00	4,284,000	
あさひ	8,000	1,201.00	9,608,000	
日本調剤	3,300	3,735.00	12,325,500	
コスモス薬品	4,700	23,610.00	110,967,000	
シップヘルスケアホールディングス	17,000	4,515.00	76,755,000	
トーエル	5,200	726.00	3,775,200	
ソフトクリエイトホールディングス	4,600	1,689.00	7,769,400	
オンリー	1,800	761.00	1,369,800	
セブン＆アイ・ホールディングス	415,400	3,889.00	1,615,490,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	28,600	2,072.00	59,259,200	
明治電機工業	3,400	1,362.00	4,630,800	
ツルハホールディングス	23,100	12,350.00	285,285,000	
デリカフーズホールディングス	3,900	673.00	2,624,700	
スターティアホールディングス	2,400	646.00	1,550,400	
サンマルクホールディングス	8,400	2,079.00	17,463,600	
フェリシモ	2,300	925.00	2,127,500	
トリドールホールディングス	13,200	2,667.00	35,204,400	
帝人	86,200	1,915.00	165,073,000	
東レ	764,700	681.60	521,219,520	
クラレ	166,400	1,214.00	202,009,600	
旭化成	700,000	986.00	690,200,000	
サカイオーベックス	2,900	1,892.00	5,486,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	9,600	431.00	4,137,600	
稲葉製作所	6,000	1,282.00	7,692,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,300	1,940.00	6,402,000	
トーカロ	29,600	1,049.00	31,050,400	
アルファ	3,800	1,126.00	4,278,800	
ＳＵＭＣＯ	127,700	1,883.00	240,459,100	
川田テクノロジーズ	2,100	5,920.00	12,432,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	3,100	2,657.00	8,236,700	
信和	4,600	1,007.00	4,632,200	
ビーロット	2,400	1,763.00	4,231,200	
ファーストブラザーズ	2,400	1,058.00	2,539,200	
ハウスドゥ	5,900	1,112.00	6,560,800	
シーアールイー	2,700	993.00	2,681,100	
プロパティエージェント	1,600	998.00	1,596,800	

ケイアイスター不動産	3,400	1,561.00	5,307,400	
アグレ都市デザイン	1,500	496.00	744,000	
グッドコムアセット	2,400	1,769.00	4,245,600	
ジェイ・エス・ビー	1,100	4,855.00	5,340,500	
テンポイノベーション	2,400	888.00	2,131,200	
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	691.00	1,174,700	
住江織物	2,300	2,218.00	5,101,400	
日本フエルト	5,700	466.00	2,656,200	
イチカワ	1,500	1,381.00	2,071,500	
エコナックホールディングス	18,800	129.00	2,425,200	
日東製網	1,200	1,585.00	1,902,000	
芦森工業	2,200	1,220.00	2,684,000	
アツギ	8,800	754.00	6,635,200	
ウイルプラスホールディングス	1,600	715.00	1,144,000	
ＪＭホールディングス	5,400	2,124.00	11,469,600	
コメダホールディングス	23,200	2,107.00	48,882,400	
サツドラホールディングス	1,500	1,760.00	2,640,000	
アレンザホールディングス	5,300	946.00	5,013,800	
串カツ田中ホールディングス	1,600	1,999.00	3,198,400	
バロックジャパンリミテッド	7,300	931.00	6,796,300	
クスリのアオキホールディングス	9,500	6,370.00	60,515,000	
ダイニック	3,900	788.00	3,073,200	
共和レザー	5,800	751.00	4,355,800	
力の源ホールディングス	4,800	850.00	4,080,000	
スシローグローバルホールディングス	11,600	8,640.00	100,224,000	
ＬＩＸＩＬビバ	10,500	2,271.00	23,845,500	
アセンテック	800	3,120.00	2,496,000	
セーレン	26,000	1,508.00	39,208,000	
ソトー	3,800	963.00	3,659,400	
東海染工	1,400	1,106.00	1,548,400	
小松マテーレ	17,300	763.00	13,199,900	
ワコールホールディングス	27,500	2,643.00	72,682,500	
ホギメディカル	12,000	3,205.00	38,460,000	
レナウン	28,200	99.00	2,791,800	
クラウディアホールディングス	2,900	454.00	1,316,600	
ＴＳＩホールディングス	35,500	462.00	16,401,000	
マツオカコーポレーション	3,100	1,921.00	5,955,100	
ワールド	15,000	2,161.00	32,415,000	
ＴＩＳ	35,300	6,980.00	246,394,000	
ネオス	4,300	634.00	2,726,200	
電算システム	4,100	2,426.00	9,946,600	
グリー	64,900	445.00	28,880,500	
コーエーテクモホールディングス	21,600	2,939.00	63,482,400	
三菱総合研究所	4,600	4,065.00	18,699,000	
ボルテージ	1,900	484.00	919,600	
電算	1,200	2,182.00	2,618,400	
ＡＧＳ	5,900	753.00	4,442,700	
ファインデックス	9,000	822.00	7,398,000	
ブレインパッド	2,100	4,900.00	10,290,000	
ＫＬａｂ	20,400	724.00	14,769,600	

ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,700	940.00	11,938,000	
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	1,561.00	2,341,500	
ネクソン	301,200	1,837.00	553,304,400	
アイスタイル	27,300	330.00	9,009,000	
エムアップ	3,100	2,623.00	8,131,300	
エイチーム	7,200	864.00	6,220,800	
エニグモ	7,500	804.00	6,030,000	
テクノスジャパン	8,300	462.00	3,834,600	
ｅｎｉｓｈ	4,700	492.00	2,312,400	
コロプラ	34,700	892.00	30,952,400	
オルトプラス	7,900	891.00	7,038,900	
ブロードリーフ	52,500	493.00	25,882,500	
クロス・マーケティンググループ	4,900	419.00	2,053,100	
デジタルハーツホールディングス	5,600	912.00	5,107,200	
システム情報	5,400	809.00	4,368,600	
メディアドゥホールディングス	3,400	3,070.00	10,438,000	
じげん	26,200	420.00	11,004,000	
ブイキューブ	6,500	916.00	5,954,000	
エンカレッジ・テクノロジ	1,700	846.00	1,438,200	
サイバーリンクス	1,600	951.00	1,521,600	
ディー・エル・イー	7,900	167.00	1,319,300	
フィックスターズ	11,200	1,284.00	14,380,800	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,100	1,062.00	5,416,200	
オプティム	2,800	4,355.00	12,194,000	
セレス	3,500	1,209.00	4,231,500	
ＳＨＩＦＴ	2,800	7,040.00	19,712,000	
特種東海製紙	6,700	3,890.00	26,063,000	
ティーガイア	9,400	2,217.00	20,839,800	
セック	1,500	3,495.00	5,242,500	
日本アジアグループ	11,100	341.00	3,785,100	
豆蔵ホールディングス	7,200	1,880.00	13,536,000	
テクマトリックス	7,400	2,767.00	20,475,800	
プロシップ	3,100	1,370.00	4,247,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,500	1,826.00	46,563,000	
GMOペイメントゲートウェイ	17,400	7,300.00	127,020,000	
ザッパラス	5,600	345.00	1,932,000	
システムリサーチ	2,900	1,913.00	5,547,700	
インターネットイニシアティブ	15,600	3,285.00	51,246,000	
さくらインターネット	11,300	582.00	6,576,600	
ヴィンクス	3,000	919.00	2,757,000	
GMOクラウド	1,900	2,380.00	4,522,000	
ＳＲＡホールディングス	5,600	2,481.00	13,893,600	
システムインテグレータ	3,400	847.00	2,879,800	
朝日ネット	7,500	700.00	5,250,000	
ｅＢＡＳＥ	6,300	1,585.00	9,985,500	
アバント	7,500	924.00	6,930,000	
アドソル日進	3,800	2,510.00	9,538,000	
フリービット	6,300	767.00	4,832,100	

コムチュア	11,800	2,152.00	25,393,600	
サイバーコム	1,800	1,792.00	3,225,600	
アステリア	6,400	497.00	3,180,800	
アイル	3,800	1,754.00	6,665,200	
王子ホールディングス	441,300	545.00	240,508,500	
日本製紙	46,700	1,645.00	76,821,500	
三菱製紙	12,000	423.00	5,076,000	
北越コーポレーション	70,000	476.00	33,320,000	
中越パルプ工業	4,500	1,394.00	6,273,000	
巴川製紙所	3,200	775.00	2,480,000	
大王製紙	46,300	1,431.00	66,255,300	
阿波製紙	2,800	491.00	1,374,800	
マークラインズ	5,300	1,985.00	10,520,500	
メディカル・データ・ビジョン	8,100	866.00	7,014,600	
ｇｕｍｉ	13,600	689.00	9,370,400	
ショーケース	2,400	630.00	1,512,000	
モバイルファクトリー	2,300	1,837.00	4,225,100	
テラスカイ	3,800	3,410.00	12,958,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,700	1,581.00	7,430,700	
ＰＣＩホールディングス	2,100	2,155.00	4,525,500	
パイプドHD	1,300	1,584.00	2,059,200	
アイビーシー	1,900	1,025.00	1,947,500	
ネオジャパン	1,900	1,329.00	2,525,100	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	900	2,381.00	2,142,900	
ランドコンピュータ	1,600	1,162.00	1,859,200	
ダブルスタンダード	1,300	3,875.00	5,037,500	
オープンドア	5,200	1,139.00	5,922,800	
マイネット	3,500	550.00	1,925,000	
アカツキ	3,800	4,530.00	17,214,000	
ベネフィットジャパン	800	1,501.00	1,200,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	1,244.00	2,861,200	
ＬＩＮＥ	24,200	5,350.00	129,470,000	
カナミックネットワーク	6,400	649.00	4,153,600	
ノムラシステムコーポレーション	2,300	440.00	1,012,000	
レンゴー	99,900	793.00	79,220,700	
トーモク	6,500	1,638.00	10,647,000	
ザ・パック	8,000	4,025.00	32,200,000	
チェンジ	2,100	3,975.00	8,347,500	
シンクロ・フード	4,600	397.00	1,826,200	
オークネット	6,500	1,153.00	7,494,500	
セグエグループ	1,700	1,045.00	1,776,500	
エイトレッド	1,300	1,382.00	1,796,600	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,700	729.00	7,800,300	
マクロミル	18,900	959.00	18,125,100	
ビーグリー	2,000	1,411.00	2,822,000	
オロ	2,800	3,080.00	8,624,000	
テモナ	1,300	827.00	1,075,100	
ニーズウェル	1,200	673.00	807,600	
サインポスト	1,600	1,944.00	3,110,400	

昭和電工	75,200	2,572.00	193,414,400	
住友化学	776,000	430.00	333,680,000	
住友精化	4,700	3,005.00	14,123,500	
日産化学	59,100	4,780.00	282,498,000	
ラサ工業	3,800	1,356.00	5,152,800	
クレハ	9,100	5,750.00	52,325,000	
多木化学	3,100	4,320.00	13,392,000	
テイカ	7,800	1,551.00	12,097,800	
石原産業	19,000	773.00	14,687,000	
片倉コープアグリ	3,000	1,126.00	3,378,000	
日本曹達	15,600	2,999.00	46,784,400	
東ソー	163,300	1,578.00	257,687,400	
トクヤマ	30,500	2,586.00	78,873,000	
セントラル硝子	21,600	2,183.00	47,152,800	
東亞合成	66,400	1,161.00	77,090,400	
大阪ソーダ	10,800	2,645.00	28,566,000	
関東電化工業	25,100	996.00	24,999,600	
デンカ	38,600	2,847.00	109,894,200	
イビデン	66,000	2,620.00	172,920,000	
信越化学工業	181,300	13,495.00	2,446,643,500	
日本カーバイド工業	3,700	1,211.00	4,480,700	
堺化学工業	6,800	2,076.00	14,116,800	
第一稀元素化学工業	11,500	823.00	9,464,500	
エア・ウォーター	90,200	1,493.00	134,668,600	
大陽日酸	101,500	2,043.00	207,364,500	
日本化学工業	3,300	2,563.00	8,457,900	
東邦アセチレン	1,500	1,289.00	1,933,500	
日本パーカライジング	53,300	1,053.00	56,124,900	
高圧ガス工業	16,900	710.00	11,999,000	
チタン工業	1,300	2,074.00	2,696,200	
四国化成工業	16,300	1,136.00	18,516,800	
戸田工業	2,400	1,980.00	4,752,000	
ステラ　ケミファ	5,800	3,045.00	17,661,000	
保土谷化学工業	4,000	4,095.00	16,380,000	
日本触媒	16,400	5,800.00	95,120,000	
大日精化工業	9,400	2,455.00	23,077,000	
カネカ	27,300	3,160.00	86,268,000	
協和キリン	108,400	2,654.00	287,693,600	
三菱瓦斯化学	99,700	1,769.00	176,369,300	
三井化学	96,000	2,450.00	235,200,000	
ＪＳＲ	98,400	2,087.00	205,360,800	
東京応化工業	18,200	4,240.00	77,168,000	
大阪有機化学工業	9,800	1,671.00	16,375,800	
三菱ケミカルホールディングス	706,200	773.50	546,245,700	
ＫＨネオケム	18,600	2,387.00	44,398,200	
ダイセル	144,500	956.00	138,142,000	
住友ベークライト	16,600	3,510.00	58,266,000	
積水化学工業	227,100	1,732.00	393,337,200	
日本ゼオン	95,300	1,144.00	109,023,200	
アイカ工業	31,700	3,290.00	104,293,000	

宇部興産	53,300	2,080.00	110,864,000	
積水樹脂	19,000	2,225.00	42,275,000	
タキロンシーアイ	22,800	630.00	14,364,000	
旭有機材	6,000	1,537.00	9,222,000	
日立化成	48,900	4,605.00	225,184,500	
ニチバン	5,600	1,648.00	9,228,800	
リケンテクノス	26,700	463.00	12,362,100	
大倉工業	5,000	1,592.00	7,960,000	
積水化成品工業	14,200	653.00	9,272,600	
群栄化学工業	2,400	2,351.00	5,642,400	
タイガースポリマー	5,600	535.00	2,996,000	
ミライアル	3,800	1,104.00	4,195,200	
ダイキアクシス	3,800	779.00	2,960,200	
ダイキョーニシカワ	22,200	675.00	14,985,000	
竹本容器	3,800	809.00	3,074,200	
森六ホールディングス	5,700	2,057.00	11,724,900	
日本化薬	65,400	1,227.00	80,245,800	
カーリットホールディングス	11,300	528.00	5,966,400	
ＥＰＳホールディングス	15,500	1,208.00	18,724,000	
ソルクシーズ	4,500	815.00	3,667,500	
レッグス	2,500	1,233.00	3,082,500	
プレステージ・インターナショナル	38,600	927.00	35,782,200	
フェイス	3,800	770.00	2,926,000	
プロトコーポレーション	9,500	1,263.00	11,998,500	
ハイマックス	1,200	1,911.00	2,293,200	
アミューズ	5,600	2,469.00	13,826,400	
野村総合研究所	149,900	2,621.00	392,887,900	
ドリームインキュベータ	3,200	1,426.00	4,563,200	
サイバネットシステム	7,500	739.00	5,542,500	
クイック	6,400	1,346.00	8,614,400	
ＴＡＣ	6,700	192.00	1,286,400	
ＣＥホールディングス	6,100	450.00	2,745,000	
ケネディクス	98,000	655.00	64,190,000	
日本システム技術	1,700	1,214.00	2,063,800	
電通グループ	106,200	3,060.00	324,972,000	
インテージホールディングス	13,300	819.00	10,892,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,000	944.00	3,776,000	
東邦システムサイエンス	2,900	875.00	2,537,500	
ぴあ	2,900	3,550.00	10,295,000	
イオンファンタジー	4,000	2,111.00	8,444,000	
ソースネクスト	50,200	383.00	19,226,600	
シーティーエス	11,600	663.00	7,690,800	
ネクシィーズグループ	3,600	1,520.00	5,472,000	
インフォコム	11,500	2,710.00	31,165,000	
メディカルシステムネットワーク	10,300	457.00	4,707,100	
日本精化	8,600	1,340.00	11,524,000	
扶桑化学工業	10,700	3,245.00	34,721,500	
トリケミカル研究所	2,300	9,000.00	20,700,000	
ＨＥＲＯＺ	500	4,775.00	2,387,500	
ラクスル	5,600	3,270.00	18,312,000	

ＦＩＧ	11,600	275.00	3,190,000	
システムサポート	900	3,330.00	2,997,000	
ＡＤＥＫＡ	48,700	1,491.00	72,611,700	
日油	39,800	3,585.00	142,683,000	
ミヨシ油脂	4,400	1,044.00	4,593,600	
新日本理化	18,000	187.00	3,366,000	
ハリマ化成グループ	8,800	986.00	8,676,800	
イーソル	3,800	1,761.00	6,691,800	
アルテリア・ネットワークス	11,700	1,938.00	22,674,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,400	1,415.00	3,396,000	
花王	258,100	8,126.00	2,097,320,600	
第一工業製薬	4,000	4,020.00	16,080,000	
石原ケミカル	3,000	1,787.00	5,361,000	
日華化学	3,700	747.00	2,763,900	
ニイタカ	1,600	2,730.00	4,368,000	
三洋化成工業	6,300	4,650.00	29,295,000	
武田薬品工業	897,100	4,067.00	3,648,505,700	
アステラス製薬	948,400	1,824.00	1,729,881,600	
大日本住友製薬	79,900	1,641.00	131,115,900	
塩野義製薬	137,900	6,237.00	860,082,300	
わかもと製薬	13,000	246.00	3,198,000	
あすか製薬	12,300	1,071.00	13,173,300	
日本新薬	28,300	8,640.00	244,512,000	
ビオフェルミン製薬	1,700	2,357.00	4,006,900	
中外製薬	112,400	11,995.00	1,348,238,000	
科研製薬	18,500	5,600.00	103,600,000	
エーザイ	129,000	8,723.00	1,125,267,000	
理研ビタミン	5,100	3,810.00	19,431,000	
ロート製薬	55,300	3,230.00	178,619,000	
小野薬品工業	247,600	2,457.00	608,353,200	
久光製薬	28,500	5,230.00	149,055,000	
有機合成薬品工業	8,500	370.00	3,145,000	
持田製薬	15,000	4,065.00	60,975,000	
参天製薬	200,800	1,896.00	380,716,800	
扶桑薬品工業	3,800	1,911.00	7,261,800	
日本ケミファ	1,400	2,542.00	3,558,800	
ツムラ	33,500	2,656.00	88,976,000	
日医工	30,600	1,277.00	39,076,200	
テルモ	305,100	3,631.00	1,107,818,100	
みらかホールディングス	28,900	2,724.00	78,723,600	
キッセイ薬品工業	19,100	2,763.00	52,773,300	
生化学工業	20,800	1,154.00	24,003,200	
栄研化学	19,000	2,246.00	42,674,000	
日水製薬	4,600	1,261.00	5,800,600	
鳥居薬品	6,700	3,525.00	23,617,500	
ＪＣＲファーマ	7,600	10,610.00	80,636,000	
東和薬品	13,800	2,305.00	31,809,000	
富士製薬工業	7,300	1,180.00	8,614,000	
沢井製薬	22,100	6,740.00	148,954,000	

ゼリア新薬工業	19,600	1,867.00	36,593,200	
第一三共	308,500	7,270.00	2,242,795,000	
キョーリン製薬ホールディングス	23,800	2,067.00	49,194,600	
大幸薬品	4,400	5,270.00	23,188,000	
ダイト	6,300	3,180.00	20,034,000	
大塚ホールディングス	205,400	4,288.00	880,755,200	
大正製薬ホールディングス	22,700	6,930.00	157,311,000	
ペプチドリーム	54,600	4,810.00	262,626,000	
大日本塗料	12,000	1,007.00	12,084,000	
日本ペイントホールディングス	87,200	4,950.00	431,640,000	
関西ペイント	118,700	2,493.00	295,919,100	
神東塗料	8,800	187.00	1,645,600	
中国塗料	30,100	908.00	27,330,800	
日本特殊塗料	8,000	1,108.00	8,864,000	
藤倉化成	14,500	500.00	7,250,000	
太陽ホールディングス	7,800	4,565.00	35,607,000	
ＤＩＣ	44,700	2,819.00	126,009,300	
サカタインクス	23,200	1,059.00	24,568,800	
東洋インキＳＣホールディングス	22,400	2,274.00	50,937,600	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	8,400	874.00	7,341,600	
アルプス技研	9,100	1,804.00	16,416,400	
サニックス	18,100	420.00	7,602,000	
ダイオーズ	2,000	1,294.00	2,588,000	
日本空調サービス	10,800	742.00	8,013,600	
オリエンタルランド	109,500	12,920.00	1,414,740,000	
フォーカスシステムズ	6,500	857.00	5,570,500	
ダスキン	26,400	2,898.00	76,507,200	
パーク２４	57,100	2,431.00	138,810,100	
明光ネットワークジャパン	12,100	880.00	10,648,000	
ファルコホールディングス	5,700	1,830.00	10,431,000	
クレスコ	6,500	1,784.00	11,596,000	
フジ・メディア・ホールディングス	101,900	1,365.00	139,093,500	
秀英予備校	2,300	427.00	982,100	
田谷	2,000	607.00	1,214,000	
ラウンドワン	28,800	903.00	26,006,400	
リゾートトラスト	47,200	1,554.00	73,348,800	
オービック	36,700	14,320.00	525,544,000	
ジャストシステム	17,200	5,330.00	91,676,000	
ＴＤＣソフト	9,300	863.00	8,025,900	
Ｚホールディングス	1,452,900	434.00	630,558,600	
ビー・エム・エル	13,300	3,170.00	42,161,000	
ワタベウェディング	1,600	470.00	752,000	
トレンドマイクロ	47,000	5,750.00	270,250,000	
りらいあコミュニケーションズ	18,700	1,342.00	25,095,400	
ＩＤホールディングス	4,100	1,614.00	6,617,400	
リソー教育	47,100	365.00	17,191,500	
日本オラクル	21,400	9,150.00	195,810,000	
早稲田アカデミー	3,400	986.00	3,352,400	
アルファシステムズ	3,300	2,700.00	8,910,000	
フューチャー	12,700	1,739.00	22,085,300	

ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	6,800	1,211.00	8,234,800	
ＳＢテクノロジー	3,800	2,291.00	8,705,800	
トーセ	2,900	871.00	2,525,900	
ユー・エス・エス	115,400	1,792.00	206,796,800	
オービックビジネスコンサルタント	10,800	3,975.00	42,930,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	48,200	3,265.00	157,373,000	
アイティフォー	12,900	717.00	9,249,300	
東京個別指導学院	3,700	638.00	2,360,600	
東計電算	1,500	4,430.00	6,645,000	
サイバーエージェント	59,300	4,330.00	256,769,000	
楽天	480,200	980.00	470,596,000	
エックスネット	1,600	947.00	1,515,200	
クリーク・アンド・リバー社	5,300	970.00	5,141,000	
テー・オー・ダブリュー	9,000	818.00	7,362,000	
大塚商会	57,200	4,775.00	273,130,000	
サイボウズ	12,300	2,116.00	26,026,800	
ソフトブレーン	6,200	480.00	2,976,000	
山田コンサルティンググループ	5,000	1,459.00	7,295,000	
セントラルスポーツ	3,900	2,823.00	11,009,700	
パラカ	2,800	1,900.00	5,320,000	
電通国際情報サービス	6,500	4,870.00	31,655,000	
デジタルガレージ	19,100	3,795.00	72,484,500	
イーエムシステムズ	14,900	885.00	13,186,500	
ウェザーニューズ	3,600	3,765.00	13,554,000	
ＣＩＪ	7,900	803.00	6,343,700	
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,015.00	3,618,000	
日本エンタープライズ	10,800	255.00	2,754,000	
WOWOW	5,100	2,571.00	13,112,100	
スカラ	7,500	706.00	5,295,000	
インテリジェント　ウェイブ	4,000	711.00	2,844,000	
フルキャストホールディングス	10,300	2,119.00	21,825,700	
エン・ジャパン	18,400	3,350.00	61,640,000	
富士フイルムホールディングス	206,700	5,567.00	1,150,698,900	
コニカミノルタ	235,600	625.00	147,250,000	
資生堂	214,300	6,828.00	1,463,240,400	
ライオン	140,200	1,909.00	267,641,800	
高砂香料工業	6,800	2,202.00	14,973,600	
マンダム	24,300	2,422.00	58,854,600	
ミルボン	14,400	5,610.00	80,784,000	
ファンケル	43,700	2,959.00	129,308,300	
コーセー	20,300	13,860.00	281,358,000	
コタ	5,700	1,419.00	8,088,300	
シーボン	1,200	2,420.00	2,904,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,000	2,146.00	98,716,000	
ノエビアホールディングス	10,300	5,000.00	51,500,000	
アジュバンコスメジャパン	2,300	971.00	2,233,300	
エステー	6,900	1,542.00	10,639,800	
アグロ　カネショウ	3,400	1,327.00	4,511,800	
コニシ	17,700	1,469.00	26,001,300	
長谷川香料	14,400	2,075.00	29,880,000	

星光ＰＭＣ	6,300	814.00	5,128,200	
小林製薬	30,200	8,330.00	251,566,000	
荒川化学工業	9,700	1,404.00	13,618,800	
メック	7,400	1,447.00	10,707,800	
日本高純度化学	3,100	2,633.00	8,162,300	
タカラバイオ	28,200	2,184.00	61,588,800	
ＪＣＵ	13,100	2,807.00	36,771,700	
新田ゼラチン	6,700	603.00	4,040,100	
ＯＡＴアグリオ	1,800	1,301.00	2,341,800	
デクセリアルズ	27,800	871.00	24,213,800	
アース製薬	8,200	5,740.00	47,068,000	
北興化学工業	11,100	572.00	6,349,200	
大成ラミック	3,300	2,747.00	9,065,100	
クミアイ化学工業	44,700	790.00	35,313,000	
日本農薬	19,400	531.00	10,301,400	
富士興産	3,300	643.00	2,121,900	
ニチレキ	12,700	1,338.00	16,992,600	
ユシロ化学工業	6,000	1,301.00	7,806,000	
ビーピー・カストロール	3,900	1,321.00	5,151,900	
富士石油	29,000	222.00	6,438,000	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,000	1,307.00	5,228,000	
出光興産	121,300	2,851.00	345,826,300	
ＪＸＴＧホールディングス	1,621,800	464.70	753,650,460	
コスモエネルギーホールディングス	31,200	1,951.00	60,871,200	
横浜ゴム	62,400	1,920.00	119,808,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	61,900	1,614.00	99,906,600	
ブリヂストン	331,400	3,836.00	1,271,250,400	
住友ゴム工業	96,900	1,208.00	117,055,200	
藤倉コンポジット	9,500	434.00	4,123,000	
オカモト	6,500	3,475.00	22,587,500	
アキレス	7,400	1,833.00	13,564,200	
フコク	4,700	658.00	3,092,600	
ニッタ	12,100	2,656.00	32,137,600	
クリエートメディック	3,600	1,101.00	3,963,600	
住友理工	20,900	780.00	16,302,000	
三ツ星ベルト	14,200	1,645.00	23,359,000	
バンドー化学	19,000	770.00	14,630,000	
ＡＧＣ	106,600	3,325.00	354,445,000	
日本板硝子	51,500	536.00	27,604,000	
石塚硝子	1,900	2,410.00	4,579,000	
有沢製作所	17,000	883.00	15,011,000	
日本山村硝子	4,500	1,110.00	4,995,000	
日本電気硝子	43,300	1,984.00	85,907,200	
オハラ	4,300	1,215.00	5,224,500	
住友大阪セメント	20,400	3,985.00	81,294,000	
太平洋セメント	68,100	2,781.00	189,386,100	
リソルホールディングス	1,000	4,010.00	4,010,000	
日本ヒューム	10,800	718.00	7,754,400	
日本コンクリート工業	23,400	270.00	6,318,000	
三谷セキサン	5,000	3,575.00	17,875,000	

アジアパイルホールディングス	15,300	504.00	7,711,200	
東海カーボン	112,900	1,001.00	113,012,900	
日本カーボン	5,500	3,955.00	21,752,500	
東洋炭素	6,300	1,877.00	11,825,100	
ノリタケカンパニーリミテド	5,900	4,000.00	23,600,000	
ＴＯＴＯ	77,000	4,370.00	336,490,000	
日本碍子	131,600	1,826.00	240,301,600	
日本特殊陶業	83,900	1,859.00	155,970,100	
ダントーホールディングス	8,000	107.00	856,000	
ＭＡＲＵＷＡ	4,200	7,360.00	30,912,000	
品川リフラクトリーズ	2,900	2,770.00	8,033,000	
黒崎播磨	2,100	6,230.00	13,083,000	
ヨータイ	8,600	648.00	5,572,800	
イソライト工業	5,500	520.00	2,860,000	
東京窯業	13,800	296.00	4,084,800	
ニッカトー	4,900	624.00	3,057,600	
フジミインコーポレーテッド	9,600	2,936.00	28,185,600	
クニミネ工業	4,400	1,146.00	5,042,400	
エーアンドエーマテリアル	1,800	1,294.00	2,329,200	
ニチアス	29,500	2,457.00	72,481,500	
日本製鉄	477,300	1,270.50	606,409,650	
神戸製鋼所	195,100	427.00	83,307,700	
中山製鋼所	14,900	431.00	6,421,900	
合同製鐵	5,700	2,640.00	15,048,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	287,900	1,050.00	302,295,000	
東京製鐵	52,000	746.00	38,792,000	
共英製鋼	12,000	1,748.00	20,976,000	
大和工業	22,600	2,395.00	54,127,000	
東京鐵鋼	4,400	1,290.00	5,676,000	
大阪製鐵	5,700	1,536.00	8,755,200	
淀川製鋼所	14,400	1,935.00	27,864,000	
丸一鋼管	34,600	2,753.00	95,253,800	
モリ工業	3,200	2,435.00	7,792,000	
大同特殊鋼	17,400	4,035.00	70,209,000	
日本高周波鋼業	4,200	388.00	1,629,600	
日本冶金工業	8,900	1,898.00	16,892,200	
山陽特殊製鋼	7,600	1,338.00	10,168,800	
愛知製鋼	6,000	3,260.00	19,560,000	
日立金属	114,800	1,652.00	189,649,600	
日本金属	2,400	783.00	1,879,200	
大平洋金属	7,200	2,185.00	15,732,000	
新日本電工	69,200	164.00	11,348,800	
栗本鐵工所	5,300	2,008.00	10,642,400	
虹　技	1,600	1,256.00	2,009,600	
日本鋳鉄管	1,100	1,494.00	1,643,400	
日本製鋼所	32,300	1,670.00	53,941,000	
三菱製鋼	8,000	918.00	7,344,000	
日亜鋼業	15,700	292.00	4,584,400	
日本精線	1,700	3,355.00	5,703,500	

エンビプロ・ホールディングス	4,100	669.00	2,742,900	
大紀アルミニウム工業所	17,500	634.00	11,095,000	
日本軽金属ホールディングス	270,000	205.00	55,350,000	
三井金属鉱業	28,800	2,873.00	82,742,400	
東邦亜鉛	5,500	1,708.00	9,394,000	
三菱マテリアル	70,500	2,653.00	187,036,500	
住友金属鉱山	136,300	2,922.50	398,336,750	
ＤＯＷＡホールディングス	27,000	3,735.00	100,845,000	
古河機械金属	19,000	1,285.00	24,415,000	
エス・サイエンス	47,600	44.00	2,094,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	1,232.00	13,675,200	
東邦チタニウム	19,100	814.00	15,547,400	
ＵＡＣＪ	16,200	2,000.00	32,400,000	
ＣＫサンエツ	1,900	3,255.00	6,184,500	
古河電気工業	33,100	2,492.00	82,485,200	
住友電気工業	398,600	1,389.50	553,854,700	
フジクラ	128,700	369.00	47,490,300	
昭和電線ホールディングス	12,300	1,231.00	15,141,300	
東京特殊電線	1,600	2,470.00	3,952,000	
タツタ電線	21,100	543.00	11,457,300	
カナレ電気	1,700	1,721.00	2,925,700	
平河ヒューテック	4,000	1,265.00	5,060,000	
リョービ	13,200	1,551.00	20,473,200	
アーレスティ	14,000	480.00	6,720,000	
アサヒホールディングス	18,700	2,677.00	50,059,900	
東洋製罐グループホールディングス	67,900	1,812.00	123,034,800	
ホッカンホールディングス	5,900	1,714.00	10,112,600	
コロナ	5,900	981.00	5,787,900	
横河ブリッジホールディングス	19,900	2,061.00	41,013,900	
ＯＳＪＢホールディングス	53,100	253.00	13,434,300	
駒井ハルテック	1,900	1,624.00	3,085,600	
高田機工	900	2,701.00	2,430,900	
三和ホールディングス	102,300	1,058.00	108,233,400	
文化シヤッター	31,500	815.00	25,672,500	
三協立山	14,800	1,231.00	18,218,800	
アルインコ	7,800	1,034.00	8,065,200	
東洋シヤッター	2,500	636.00	1,590,000	
ＬＩＸＩＬグループ	157,400	1,777.00	279,699,800	
日本フイルコン	8,300	497.00	4,125,100	
ノーリツ	22,100	1,221.00	26,984,100	
長府製作所	10,800	2,110.00	22,788,000	
リンナイ	20,700	7,950.00	164,565,000	
ユニプレス	20,900	1,222.00	25,539,800	
ダイニチ工業	5,700	634.00	3,613,800	
日東精工	14,700	500.00	7,350,000	
三洋工業	1,400	1,946.00	2,724,400	
岡部	21,600	817.00	17,647,200	
ジーテクト	13,300	1,400.00	18,620,000	
東プレ	19,900	1,506.00	29,969,400	
高周波熱錬	20,500	758.00	15,539,000	

東京製綱	7,600	911.00	6,923,600	
サンコール	6,100	530.00	3,233,000	
モリテックスチール	8,400	314.00	2,637,600	
パイオラックス	15,700	1,685.00	26,454,500	
エイチワン	10,500	650.00	6,825,000	
日本発条	114,300	859.00	98,183,700	
中央発條	1,200	2,729.00	3,274,800	
アドバネクス	1,300	1,420.00	1,846,000	
三浦工業	46,100	3,675.00	169,417,500	
タクマ	36,100	1,227.00	44,294,700	
テクノプロ・ホールディングス	20,700	7,300.00	151,110,000	
アトラ	2,300	286.00	657,800	
インターワークス	1,900	528.00	1,003,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,200	7,500.00	31,500,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	3,900	1,150.00	4,485,000	
ファーストロジック	2,300	544.00	1,251,200	
三機サービス	2,100	969.00	2,034,900	
Ｇｕｎｏｓｙ	7,100	1,113.00	7,902,300	
デザインワン・ジャパン	2,000	264.00	528,000	
イー・ガーディアン	5,200	1,830.00	9,516,000	
リブセンス	6,700	269.00	1,802,300	
ジャパンマテリアル	31,700	1,408.00	44,633,600	
ベクトル	12,900	1,057.00	13,635,300	
ウチヤマホールディングス	5,200	428.00	2,225,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	7,500	893.00	6,697,500	
ライクキッズ	2,400	811.00	1,946,400	
キャリアリンク	3,400	532.00	1,808,800	
ＩＢＪ	7,000	1,071.00	7,497,000	
アサンテ	4,200	1,828.00	7,677,600	
Ｎ・フィールド	7,100	534.00	3,791,400	
バリューＨＲ	2,000	3,295.00	6,590,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	7,300	3,575.00	26,097,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,564.00	6,099,600	
ＥＲＩホールディングス	3,000	750.00	2,250,000	
アビスト	1,600	2,401.00	3,841,600	
シグマクシス	7,000	1,614.00	11,298,000	
ウィルグループ	6,700	942.00	6,311,400	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,500	202.00	2,929,000	
リクルートホールディングス	738,000	4,287.00	3,163,806,000	
エラン	6,100	1,546.00	9,430,600	
ツガミ	22,000	940.00	20,680,000	
オークマ	12,400	4,830.00	59,892,000	
東芝機械	12,000	3,095.00	37,140,000	
アマダホールディングス	135,500	1,039.00	140,784,500	
アイダエンジニアリング	27,900	843.00	23,519,700	
滝澤鉄工所	3,300	1,268.00	4,184,400	
ＦＵＪＩ	45,800	1,810.00	82,898,000	
牧野フライス製作所	12,400	3,935.00	48,794,000	

オーエスジー	49,300	1,698.00	83,711,400	
ダイジェット工業	1,200	1,243.00	1,491,600	
旭ダイヤモンド工業	27,900	555.00	15,484,500	
ＤＭＧ森精機	67,400	1,479.00	99,684,600	
ソディック	25,100	790.00	19,829,000	
ディスコ	14,500	23,660.00	343,070,000	
日東工器	5,800	2,337.00	13,554,600	
日進工具	3,200	2,653.00	8,489,600	
パンチ工業	9,800	399.00	3,910,200	
冨士ダイス	4,600	579.00	2,663,400	
土木管理総合試験所	4,500	398.00	1,791,000	
ネットマーケティング	3,800	751.00	2,853,800	
日本郵政	844,500	985.90	832,592,550	
ベルシステム２４ホールディングス	17,200	1,424.00	24,492,800	
鎌倉新書	7,600	1,592.00	12,099,200	
ＳＭＮ	1,600	757.00	1,211,200	
一蔵	1,100	584.00	642,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	3,600	2,338.00	8,416,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,500	698.00	1,047,000	
エアトリ	4,600	1,276.00	5,869,600	
アトラエ	2,700	2,705.00	7,303,500	
ストライク	3,900	4,510.00	17,589,000	
ソラスト	28,400	1,035.00	29,394,000	
セラク	3,300	1,183.00	3,903,900	
インソース	5,000	2,909.00	14,545,000	
豊田自動織機	87,300	6,020.00	525,546,000	
豊和工業	5,900	744.00	4,389,600	
ＯＫＫ	4,400	563.00	2,477,200	
石川製作所	2,500	1,420.00	3,550,000	
東洋機械金属	7,500	483.00	3,622,500	
津田駒工業	2,000	980.00	1,960,000	
エンシュウ	2,500	1,025.00	2,562,500	
島精機製作所	17,100	1,822.00	31,156,200	
オプトラン	11,900	3,225.00	38,377,500	
ＮＣホールディングス	3,300	597.00	1,970,100	
イワキ	5,100	1,001.00	5,105,100	
フリュー	10,400	1,095.00	11,388,000	
ヤマシンフィルタ	23,200	706.00	16,379,200	
日阪製作所	13,200	890.00	11,748,000	
やまびこ	20,700	952.00	19,706,400	
平田機工	5,000	5,500.00	27,500,000	
ペガサスミシン製造	10,700	437.00	4,675,900	
マルマエ	4,400	840.00	3,696,000	
タツモ	5,000	1,298.00	6,490,000	
ナブテスコ	62,800	3,070.00	192,796,000	
三井海洋開発	11,300	1,883.00	21,277,900	
レオン自動機	10,500	1,252.00	13,146,000	
ＳＭＣ	33,900	47,390.00	1,606,521,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9,300	748.00	6,956,400	

ホソカワミクロン	3,800	5,200.00	19,760,000	
ユニオンツール	4,000	2,821.00	11,284,000	
オイレス工業	13,800	1,465.00	20,217,000	
日精エー・エス・ビー機械	3,600	3,860.00	13,896,000	
サトーホールディングス	15,200	2,664.00	40,492,800	
技研製作所	9,400	4,040.00	37,976,000	
日本エアーテック	3,400	1,209.00	4,110,600	
カワタ	3,200	940.00	3,008,000	
日精樹脂工業	9,000	923.00	8,307,000	
オカダアイヨン	3,400	1,007.00	3,423,800	
ワイエイシイホールディングス	4,600	572.00	2,631,200	
小松製作所	488,300	2,241.50	1,094,524,450	
住友重機械工業	61,700	2,500.00	154,250,000	
日立建機	43,100	2,873.00	123,826,300	
日工	14,800	730.00	10,804,000	
巴工業	4,600	2,000.00	9,200,000	
井関農機	10,800	1,291.00	13,942,800	
ＴＯＷＡ	10,900	1,041.00	11,346,900	
丸山製作所	2,200	1,605.00	3,531,000	
北川鉄工所	4,800	1,900.00	9,120,000	
シンニッタン	16,600	359.00	5,959,400	
ローツェ	4,700	3,735.00	17,554,500	
タカキタ	3,700	490.00	1,813,000	
クボタ	572,100	1,532.50	876,743,250	
荏原実業	2,700	2,054.00	5,545,800	
東洋エンジニアリング	14,200	546.00	7,753,200	
三菱化工機	3,800	1,787.00	6,790,600	
月島機械	19,900	1,307.00	26,009,300	
帝国電機製作所	8,900	1,399.00	12,451,100	
東京機械製作所	4,700	306.00	1,438,200	
新東工業	25,500	833.00	21,241,500	
澁谷工業	9,400	2,603.00	24,468,200	
アイチコーポレーション	18,700	650.00	12,155,000	
小森コーポレーション	27,300	869.00	23,723,700	
鶴見製作所	8,400	1,878.00	15,775,200	
住友精密工業	1,600	2,874.00	4,598,400	
日本ギア工業	3,500	374.00	1,309,000	
酒井重工業	2,000	2,446.00	4,892,000	
荏原製作所	44,600	2,723.00	121,445,800	
石井鐵工所	1,400	2,802.00	3,922,800	
酉島製作所	10,900	792.00	8,632,800	
北越工業	11,100	1,243.00	13,797,300	
ダイキン工業	137,400	15,300.00	2,102,220,000	
オルガノ	3,900	6,740.00	26,286,000	
トーヨーカネツ	4,700	2,375.00	11,162,500	
栗田工業	58,300	3,055.00	178,106,500	
椿本チエイン	15,400	3,070.00	47,278,000	
大同工業	5,200	761.00	3,957,200	
日機装	32,300	1,051.00	33,947,300	
木村化工機	9,000	533.00	4,797,000	

レイズネクスト	18,200	1,220.00	22,204,000	
アネスト岩田	16,700	1,000.00	16,700,000	
ダイフク	55,100	6,720.00	370,272,000	
サムコ	3,000	1,788.00	5,364,000	
加藤製作所	5,900	1,405.00	8,289,500	
油研工業	1,700	1,601.00	2,721,700	
タダノ	52,000	1,000.00	52,000,000	
フジテック	39,200	1,608.00	63,033,600	
ＣＫＤ	30,000	1,830.00	54,900,000	
キトー	8,200	1,525.00	12,505,000	
平和	30,100	2,207.00	66,430,700	
理想科学工業	9,500	1,802.00	17,119,000	
ＳＡＮＫＹＯ	24,000	3,860.00	92,640,000	
日本金銭機械	11,900	736.00	8,758,400	
マースグループホールディングス	6,800	1,880.00	12,784,000	
フクシマガリレイ	6,600	3,875.00	25,575,000	
オーイズミ	4,600	491.00	2,258,600	
ダイコク電機	5,000	1,338.00	6,690,000	
竹内製作所	18,100	1,862.00	33,702,200	
アマノ	28,300	2,760.00	78,108,000	
ＪＵＫＩ	15,000	777.00	11,655,000	
サンデンホールディングス	14,200	590.00	8,378,000	
蛇の目ミシン工業	10,100	372.00	3,757,200	
ブラザー工業	131,600	2,040.00	268,464,000	
マックス	16,400	1,917.00	31,438,800	
モリタホールディングス	18,900	1,781.00	33,660,900	
グローリー	27,600	3,085.00	85,146,000	
新晃工業	10,000	1,590.00	15,900,000	
大和冷機工業	15,600	1,026.00	16,005,600	
セガサミーホールディングス	107,000	1,613.00	172,591,000	
日本ピストンリング	4,000	1,421.00	5,684,000	
リケン	5,000	3,200.00	16,000,000	
ＴＰＲ	14,500	1,579.00	22,895,500	
ツバキ・ナカシマ	22,000	1,149.00	25,278,000	
ホシザキ	31,500	9,990.00	314,685,000	
大豊工業	8,900	630.00	5,607,000	
日本精工	203,000	870.00	176,610,000	
ＮＴＮ	249,600	281.00	70,137,600	
ジェイテクト	103,400	1,105.00	114,257,000	
不二越	10,000	3,790.00	37,900,000	
ミネベアミツミ	200,100	2,130.00	426,213,000	
日本トムソン	31,900	411.00	13,110,900	
ＴＨＫ	62,700	2,640.00	165,528,000	
ユーシン精機	8,400	865.00	7,266,000	
前澤給装工業	3,900	2,103.00	8,201,700	
イーグル工業	13,300	891.00	11,850,300	
前澤工業	7,100	365.00	2,591,500	
日本ピラー工業	10,900	1,397.00	15,227,300	
キッツ	43,800	668.00	29,258,400	
日立製作所	518,100	4,020.00	2,082,762,000	

三菱電機	1,078,200	1,477.50	1,593,040,500	
富士電機	65,000	3,200.00	208,000,000	
東洋電機製造	4,300	1,309.00	5,628,700	
安川電機	116,100	3,615.00	419,701,500	
シンフォニア　テクノロジー	14,000	1,114.00	15,596,000	
明電舎	19,800	1,881.00	37,243,800	
オリジン	3,000	1,398.00	4,194,000	
山洋電気	5,200	4,685.00	24,362,000	
デンヨー	9,200	1,944.00	17,884,800	
ベイカレント・コンサルティング	6,200	7,460.00	46,252,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,000	963.00	1,926,000	
アイモバイル	3,300	653.00	2,154,900	
キャリアインデックス	4,200	313.00	1,314,600	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,400	1,188.00	4,039,200	
船場	1,700	1,030.00	1,751,000	
グレイステクノロジー	4,700	2,993.00	14,067,100	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10,800	2,147.00	23,187,600	
フルテック	1,200	1,091.00	1,309,200	
グリーンズ	3,900	800.00	3,120,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,200	532.00	638,400	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	2,200	693.00	1,524,600	
ソウルドアウト	1,600	1,931.00	3,089,600	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,400	1,010.00	1,414,000	
日総工産	6,800	761.00	5,174,800	
キュービーネットホールディングス	4,300	2,120.00	9,116,000	
ＲＰＡホールディングス	5,800	1,109.00	6,432,200	
三櫻工業	13,700	976.00	13,371,200	
マキタ	140,600	3,900.00	548,340,000	
東芝テック	13,500	4,035.00	54,472,500	
芝浦メカトロニクス	1,900	3,095.00	5,880,500	
マブチモーター	29,900	3,995.00	119,450,500	
日本電産	129,700	13,525.00	1,754,192,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,500	357.00	2,320,500	
トレックス・セミコンダクター	6,200	1,420.00	8,804,000	
東光高岳	6,000	1,096.00	6,576,000	
ダブル・スコープ	16,700	753.00	12,575,100	
宮越ホールディングス	4,000	777.00	3,108,000	
ダイヘン	11,800	3,040.00	35,872,000	
ヤーマン	15,600	580.00	9,048,000	
ＪＶＣケンウッド	88,000	243.00	21,384,000	
ミマキエンジニアリング	9,600	476.00	4,569,600	
第一精工	4,000	2,267.00	9,068,000	
日新電機	25,300	1,066.00	26,969,800	
大崎電気工業	21,400	579.00	12,390,600	
オムロン	96,700	6,320.00	611,144,000	
日東工業	15,800	2,025.00	31,995,000	
ＩＤＥＣ	15,600	1,748.00	27,268,800	
正興電機製作所	2,500	1,222.00	3,055,000	

不二電機工業	1,200	1,173.00	1,407,600	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	36,000	2,031.00	73,116,000	
サクサホールディングス	2,500	1,750.00	4,375,000	
メルコホールディングス	3,800	2,373.00	9,017,400	
テクノメディカ	2,400	2,020.00	4,848,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	1,700	819.00	1,392,300	
日本電気	130,900	4,630.00	606,067,000	
富士通	103,900	12,250.00	1,272,775,000	
沖電気工業	43,900	1,276.00	56,016,400	
岩崎通信機	4,800	811.00	3,892,800	
電気興業	5,200	3,085.00	16,042,000	
サンケン電気	11,700	2,821.00	33,005,700	
ナカヨ	1,900	1,563.00	2,969,700	
アイホン	6,100	1,620.00	9,882,000	
ルネサスエレクトロニクス	514,900	736.00	378,966,400	
セイコーエプソン	133,800	1,646.00	220,234,800	
ワコム	72,400	364.00	26,353,600	
アルバック	19,800	3,485.00	69,003,000	
アクセル	4,500	833.00	3,748,500	
ＥＩＺＯ	8,400	3,630.00	30,492,000	
ジャパンディスプレイ	312,000	70.00	21,840,000	
日本信号	27,400	1,278.00	35,017,200	
京三製作所	25,200	507.00	12,776,400	
能美防災	14,300	2,217.00	31,703,100	
ホーチキ	7,900	1,305.00	10,309,500	
星和電機	5,400	598.00	3,229,200	
エレコム	11,700	3,675.00	42,997,500	
パナソニック	1,231,900	1,137.50	1,401,286,250	
シャープ	124,700	1,399.00	174,455,300	
アンリツ	69,500	1,936.00	134,552,000	
富士通ゼネラル	29,300	2,346.00	68,737,800	
ソニー	681,600	7,269.00	4,954,550,400	
ＴＤＫ	52,000	10,970.00	570,440,000	
帝国通信工業	4,700	1,153.00	5,419,100	
タムラ製作所	36,000	535.00	19,260,000	
アルプスアルパイン	95,500	1,786.00	170,563,000	
池上通信機	3,500	981.00	3,433,500	
日本電波工業	9,800	454.00	4,449,200	
鈴木	5,800	854.00	4,953,200	
日本トリム	1,400	3,590.00	5,026,000	
ローランド　ディー．ジー．	5,900	1,771.00	10,448,900	
フォスター電機	11,300	1,543.00	17,435,900	
ＳＭＫ	2,800	2,650.00	7,420,000	
ヨコオ	6,900	2,780.00	19,182,000	
ティアック	8,000	170.00	1,360,000	
ホシデン	29,500	1,031.00	30,414,500	
ヒロセ電機	16,700	12,370.00	206,579,000	
日本航空電子工業	24,700	1,854.00	45,793,800	
ＴＯＡ	11,500	978.00	11,247,000	

マクセルホールディングス	23,300	1,380.00	32,154,000	
古野電気	13,900	997.00	13,858,300	
ユニデンホールディングス	3,000	1,988.00	5,964,000	
スミダコーポレーション	8,300	1,074.00	8,914,200	
アイコム	6,000	2,466.00	14,796,000	
リオン	4,500	2,643.00	11,893,500	
本多通信工業	9,400	492.00	4,624,800	
船井電機	10,900	666.00	7,259,400	
横河電機	98,900	1,870.00	184,943,000	
新電元工業	3,800	3,230.00	12,274,000	
アズビル	68,000	2,861.00	194,548,000	
東亜ディーケーケー	5,300	935.00	4,955,500	
日本光電工業	44,600	3,450.00	153,870,000	
チノー	3,700	1,190.00	4,403,000	
共和電業	11,300	410.00	4,633,000	
日本電子材料	4,300	942.00	4,050,600	
堀場製作所	21,300	6,240.00	132,912,000	
アドバンテスト	80,200	5,300.00	425,060,000	
小野測器	4,200	539.00	2,263,800	
エスペック	9,500	2,066.00	19,627,000	
キーエンス	97,700	37,280.00	3,642,256,000	
日置電機	5,600	3,415.00	19,124,000	
シスメックス	77,000	7,313.00	563,101,000	
日本マイクロニクス	18,800	1,026.00	19,288,800	
メガチップス	10,000	1,654.00	16,540,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	5,600	2,945.00	16,492,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	9,000	450.00	4,050,000	
澤藤電機	1,300	1,813.00	2,356,900	
デンソー	237,400	4,328.00	1,027,467,200	
原田工業	5,100	913.00	4,656,300	
コーセル	13,200	1,068.00	14,097,600	
イリソ電子工業	9,100	3,955.00	35,990,500	
オプテックスグループ	17,600	1,383.00	24,340,800	
千代田インテグレ	5,000	1,975.00	9,875,000	
アイ・オー・データ機器	4,000	872.00	3,488,000	
レーザーテック	47,300	5,360.00	253,528,000	
スタンレー電気	75,800	2,784.00	211,027,200	
岩崎電気	4,200	1,577.00	6,623,400	
ウシオ電機	62,600	1,411.00	88,328,600	
岡谷電機産業	8,500	343.00	2,915,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9,900	372.00	3,682,800	
エノモト	3,300	1,144.00	3,775,200	
日本セラミック	10,900	2,429.00	26,476,100	
遠藤照明	5,400	666.00	3,596,400	
古河電池	7,600	667.00	5,069,200	
双信電機	5,400	381.00	2,057,400	
山一電機	7,900	1,764.00	13,935,600	
図研	7,000	2,279.00	15,953,000	
日本電子	21,200	3,105.00	65,826,000	
カシオ計算機	95,400	2,032.00	193,852,800	

ファナック	102,400	19,505.00	1,997,312,000	
日本シイエムケイ	25,400	520.00	13,208,000	
エンプラス	5,500	2,852.00	15,686,000	
大真空	4,000	1,781.00	7,124,000	
ローム	47,800	7,900.00	377,620,000	
浜松ホトニクス	77,300	4,500.00	347,850,000	
三井ハイテック	11,900	1,551.00	18,456,900	
新光電気工業	36,200	1,329.00	48,109,800	
京セラ	151,700	7,179.00	1,089,054,300	
協栄産業	1,200	1,305.00	1,566,000	
太陽誘電	47,900	3,425.00	164,057,500	
村田製作所	316,700	6,138.00	1,943,904,600	
双葉電子工業	17,000	1,088.00	18,496,000	
日東電工	74,500	5,710.00	425,395,000	
北陸電気工業	4,300	996.00	4,282,800	
東海理化電機製作所	28,400	1,717.00	48,762,800	
ニチコン	36,600	843.00	30,853,800	
日本ケミコン	8,200	1,732.00	14,202,400	
ＫＯＡ	16,200	1,148.00	18,597,600	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	39,000	833.00	32,487,000	
日立造船	85,600	409.00	35,010,400	
三菱重工業	180,700	3,650.00	659,555,000	
川崎重工業	83,900	2,097.00	175,938,300	
ＩＨＩ	77,600	2,565.00	199,044,000	
名村造船所	34,700	228.00	7,911,600	
サノヤスホールディングス	13,200	171.00	2,257,200	
スプリックス	3,500	927.00	3,244,500	
マネジメントソリューションズ	1,100	3,245.00	3,569,500	
日本車輌製造	4,000	2,718.00	10,872,000	
三菱ロジスネクスト	14,300	1,617.00	23,123,100	
近畿車輌	1,600	1,299.00	2,078,400	
ＦＰＧ	32,800	928.00	30,438,400	
島根銀行	2,100	615.00	1,291,500	
じもとホールディングス	72,200	99.00	7,147,800	
全国保証	30,000	4,425.00	132,750,000	
めぶきフィナンシャルグループ	552,600	219.00	121,019,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,400	1,178.00	16,963,200	
九州フィナンシャルグループ	174,500	393.00	68,578,500	
かんぽ生命保険	37,600	1,783.00	67,040,800	
ゆうちょ銀行	301,300	991.00	298,588,300	
富山第一銀行	25,400	294.00	7,467,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	625,300	404.00	252,621,200	
ジェイリース	3,000	322.00	966,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,500	651.00	47,197,500	
マーキュリアインベストメント	4,700	658.00	3,092,600	
イントラスト	3,800	715.00	2,717,000	
日本モーゲージサービス	2,100	2,129.00	4,470,900	
ＣＡＳＡ	3,700	1,400.00	5,180,000	

アルヒ	16,900	1,736.00	29,338,400	
プレミアグループ	5,800	1,940.00	11,252,000	
日産自動車	1,271,600	481.40	612,148,240	
いすゞ自動車	312,400	1,084.00	338,641,600	
トヨタ自動車	1,203,100	7,574.00	9,112,279,400	代用有価証券 250,000株
日野自動車	134,600	974.00	131,100,400	
三菱自動車工業	399,000	386.00	154,014,000	
エフテック	7,500	696.00	5,220,000	
レシップホールディングス	4,400	572.00	2,516,800	
ＧＭＢ	2,000	769.00	1,538,000	
ファルテック	1,900	913.00	1,734,700	
武蔵精密工業	24,000	1,288.00	30,912,000	
日産車体	21,100	1,013.00	21,374,300	
新明和工業	29,100	1,271.00	36,986,100	
極東開発工業	20,000	1,312.00	26,240,000	
日信工業	21,900	2,240.00	49,056,000	
トピー工業	8,900	1,632.00	14,524,800	
ティラド	3,900	1,702.00	6,637,800	
曙ブレーキ工業	59,300	220.00	13,046,000	
タチエス	17,600	1,163.00	20,468,800	
ＮＯＫ	57,900	1,490.00	86,271,000	
フタバ産業	30,100	596.00	17,939,600	
ＫＹＢ	12,000	2,604.00	31,248,000	
市光工業	16,100	699.00	11,253,900	
大同メタル工業	20,700	640.00	13,248,000	
プレス工業	53,500	338.00	18,083,000	
ミクニ	13,700	305.00	4,178,500	
太平洋工業	22,500	1,229.00	27,652,500	
ケーヒン	24,800	2,582.00	64,033,600	
河西工業	14,500	707.00	10,251,500	
アイシン精機	88,700	3,725.00	330,407,500	
マツダ	317,200	836.00	265,179,200	
今仙電機製作所	10,000	823.00	8,230,000	
本田技研工業	849,000	2,935.00	2,491,815,000	
スズキ	213,700	4,718.00	1,008,236,600	
ＳＵＢＡＲＵ	334,700	2,845.00	952,221,500	
安永	5,200	1,101.00	5,725,200	
ヤマハ発動機	140,600	1,856.00	260,953,600	
ショーワ	25,400	2,282.00	57,962,800	
小糸製作所	64,600	4,445.00	287,147,000	
ＴＢＫ	12,900	435.00	5,611,500	
エクセディ	14,700	2,099.00	30,855,300	
ミツバ	19,900	664.00	13,213,600	
豊田合成	34,800	2,429.00	84,529,200	
愛三工業	16,900	663.00	11,204,700	
盟和産業	1,600	1,013.00	1,620,800	
日本プラスト	8,400	630.00	5,292,000	
ヨロズ	10,100	1,390.00	14,039,000	
エフ・シー・シー	17,600	2,027.00	35,675,200	

新家工業	2,400	1,369.00	3,285,600	
シマノ	40,400	15,150.00	612,060,000	
テイ・エス　テック	25,000	3,000.00	75,000,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	62,400	543.00	33,883,200	
三十三フィナンシャルグループ	9,900	1,492.00	14,770,800	
第四北越フィナンシャルグループ	18,500	2,453.00	45,380,500	
ジャムコ	5,400	1,217.00	6,571,800	
小野建	9,600	1,222.00	11,731,200	
はるやまホールディングス	4,500	802.00	3,609,000	
南陽	2,100	1,700.00	3,570,000	
ノジマ	18,900	2,040.00	38,556,000	
佐鳥電機	7,900	802.00	6,335,800	
カッパ・クリエイト	14,900	1,408.00	20,979,200	
エコートレーディング	2,300	561.00	1,290,300	
伯東	6,500	1,156.00	7,514,000	
コンドーテック	8,300	1,138.00	9,445,400	
中山福	6,200	499.00	3,093,800	
ライトオン	8,000	563.00	4,504,000	
ナガイレーベン	15,400	2,294.00	35,327,600	
ジーンズメイト	3,400	261.00	887,400	
三菱食品	11,600	2,795.00	32,422,000	
良品計画	141,000	1,643.00	231,663,000	
三城ホールディングス	11,500	287.00	3,300,500	
松田産業	7,800	1,460.00	11,388,000	
第一興商	15,800	4,620.00	72,996,000	
メディパルホールディングス	114,600	2,102.00	240,889,200	
アドヴァン	16,200	1,144.00	18,532,800	
ＳＰＫ	2,200	2,500.00	5,500,000	
萩原電気ホールディングス	4,000	2,453.00	9,812,000	
アルビス	4,000	2,082.00	8,328,000	
アズワン	6,900	8,530.00	58,857,000	
スズデン	3,700	1,356.00	5,017,200	
尾家産業	3,100	1,387.00	4,299,700	
シモジマ	6,500	1,045.00	6,792,500	
ドウシシャ	10,100	1,492.00	15,069,200	
小津産業	2,300	1,642.00	3,776,600	
コナカ	12,500	384.00	4,800,000	
高速	6,300	1,170.00	7,371,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,300	1,671.00	2,172,300	
Ｇ－７ホールディングス	6,200	2,405.00	14,911,000	
たけびし	3,500	1,382.00	4,837,000	
イオン北海道	10,700	819.00	8,763,300	
コジマ	18,300	463.00	8,472,900	
ヒマラヤ	3,500	816.00	2,856,000	
コーナン商事	15,100	2,335.00	35,258,500	
ネットワンシステムズ	40,300	2,412.00	97,203,600	
エコス	3,900	1,630.00	6,357,000	
ワタミ	12,500	1,095.00	13,687,500	
マルシェ	2,900	759.00	2,201,100	
リックス	2,300	1,671.00	3,843,300	

システムソフト	26,300	89.00	2,340,700	
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	233,400	1,910.00	445,794,000	
丸文	9,400	573.00	5,386,200	
西松屋チェーン	23,300	857.00	19,968,100	
ゼンショーホールディングス	50,900	2,300.00	117,070,000	
ハピネット	8,900	1,230.00	10,947,000	
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,741.00	11,664,700	
ハークスレイ	2,000	1,060.00	2,120,000	
橋本総業ホールディングス	2,100	1,626.00	3,414,600	
日本ライフライン	31,400	1,378.00	43,269,200	
サイゼリヤ	17,500	2,168.00	37,940,000	
タカショー	5,400	439.00	2,370,600	
ＶＴホールディングス	44,100	400.00	17,640,000	
マルカ	3,800	1,992.00	7,569,600	
アルゴグラフィックス	9,000	3,495.00	31,455,000	
魚力	3,000	1,593.00	4,779,000	
ＩＤＯＭ	28,700	587.00	16,846,900	
日本エム・ディ・エム	6,200	1,810.00	11,222,000	
ポプラ	2,800	458.00	1,282,400	
フジ・コーポレーション	2,900	1,998.00	5,794,200	
ユナイテッドアローズ	11,100	2,655.00	29,470,500	
進和	6,300	2,092.00	13,179,600	
エスケイジャパン	2,200	402.00	884,400	
ダイトロン	4,500	1,861.00	8,374,500	
ハイデイ日高	15,300	1,850.00	28,305,000	
シークス	13,500	1,300.00	17,550,000	
京都きもの友禅	7,000	311.00	2,177,000	
コロワイド	35,300	2,107.00	74,377,100	
ピーシーデポコーポレーション	14,100	557.00	7,853,700	
田中商事	3,400	688.00	2,339,200	
オーハシテクニカ	5,900	1,381.00	8,147,900	
壱番屋	7,400	5,230.00	38,702,000	
白銅	3,900	1,340.00	5,226,000	
トップカルチャー	3,900	316.00	1,232,400	
ＰＬＡＮＴ	2,800	521.00	1,458,800	
スギホールディングス	21,200	5,260.00	111,512,000	
薬王堂ホールディングス	4,600	2,167.00	9,968,200	
島津製作所	128,800	2,789.00	359,223,200	
ＪＭＳ	9,200	801.00	7,369,200	
クボテック	2,800	375.00	1,050,000	
長野計器	7,800	904.00	7,051,200	
ブイ・テクノロジー	5,000	4,290.00	21,450,000	
スター精密	16,600	1,282.00	21,281,200	
東京計器	6,900	861.00	5,940,900	
愛知時計電機	1,300	4,200.00	5,460,000	
インターアクション	5,800	2,637.00	15,294,600	
オーバル	9,800	227.00	2,224,600	
東京精密	19,500	3,715.00	72,442,500	
マニー	42,900	2,450.00	105,105,000	

ニコン	174,400	1,157.00	201,780,800	
トプコン	54,300	1,170.00	63,531,000	
オリンパス	596,700	2,025.00	1,208,317,500	
理研計器	9,500	2,126.00	20,197,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	18,700	5,860.00	109,582,000	
キヤノン電子	11,300	1,937.00	21,888,100	
タムロン	8,700	2,595.00	22,576,500	
ＨＯＹＡ	215,300	10,070.00	2,168,071,000	
シード	4,600	890.00	4,094,000	
ノーリツ鋼機	7,200	1,435.00	10,332,000	
エー・アンド・デイ	9,800	910.00	8,918,000	
朝日インテック	91,600	2,640.00	241,824,000	
キヤノン	580,400	2,724.00	1,581,009,600	
リコー	274,300	1,061.00	291,032,300	
シチズン時計	126,300	459.00	57,971,700	
リズム時計工業	3,400	850.00	2,890,000	
大研医器	7,500	637.00	4,777,500	
メニコン	14,800	4,775.00	70,670,000	
シンシア	1,100	523.00	575,300	
中本パックス	2,800	1,561.00	4,370,800	
スノーピーク	5,100	781.00	3,983,100	
パラマウントベッドホールディングス	11,400	4,365.00	49,761,000	
トランザクション	6,900	1,003.00	6,920,700	
粧美堂	3,200	373.00	1,193,600	
ニホンフラッシュ	5,000	2,414.00	12,070,000	
前田工繊	11,800	2,068.00	24,402,400	
永大産業	14,300	312.00	4,461,600	
アートネイチャー	11,500	709.00	8,153,500	
バンダイナムコホールディングス	111,500	5,765.00	642,797,500	
アイフィスジャパン	2,800	679.00	1,901,200	
共立印刷	18,400	164.00	3,017,600	
ＳＨＯＥＩ	5,200	5,350.00	27,820,000	
フランスベッドホールディングス	15,300	895.00	13,693,500	
マーベラス	16,100	658.00	10,593,800	
パイロットコーポレーション	17,500	3,845.00	67,287,500	
萩原工業	6,000	1,575.00	9,450,000	
エイベックス	18,200	1,151.00	20,948,200	
トッパン・フォームズ	23,200	1,106.00	25,659,200	
フジシールインターナショナル	24,200	2,037.00	49,295,400	
タカラトミー	48,300	1,001.00	48,348,300	
廣済堂	7,500	909.00	6,817,500	
エステールホールディングス	2,800	672.00	1,881,600	
アーク	41,500	86.00	3,569,000	
レック	11,500	1,092.00	12,558,000	
タカノ	4,200	703.00	2,952,600	
三光合成	12,400	321.00	3,980,400	
プロネクサス	9,300	1,073.00	9,978,900	
ホクシン	7,200	138.00	993,600	
ウッドワン	3,500	1,015.00	3,552,500	
大建工業	7,200	1,786.00	12,859,200	

きもと	18,500	151.00	2,793,500	
凸版印刷	152,200	1,961.00	298,464,200	
大日本印刷	141,100	2,773.00	391,270,300	
共同印刷	3,400	2,724.00	9,261,600	
ＮＩＳＳＨＡ	22,100	913.00	20,177,300	
光村印刷	900	1,609.00	1,448,100	
藤森工業	9,700	3,155.00	30,603,500	
ヴィア・ホールディングス	13,100	640.00	8,384,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	5,200	1,611.00	8,377,200	
前澤化成工業	6,900	1,090.00	7,521,000	
未来工業	5,800	1,936.00	11,228,800	
アシックス	89,000	1,267.00	112,763,000	
ツツミ	3,400	1,902.00	6,466,800	
ウェーブロックホールディングス	3,900	665.00	2,593,500	
ＪＳＰ	6,300	1,724.00	10,861,200	
ニチハ	15,000	2,430.00	36,450,000	
エフピコ	11,800	6,760.00	79,768,000	
小松ウオール工業	3,400	1,980.00	6,732,000	
ヤマハ	64,200	5,450.00	349,890,000	
河合楽器製作所	3,400	2,844.00	9,669,600	
クリナップ	10,100	568.00	5,736,800	
ピジョン	65,200	3,820.00	249,064,000	
天馬	7,100	1,801.00	12,787,100	
オリバー	2,200	3,475.00	7,645,000	
兼松サステック	700	1,748.00	1,223,600	
キングジム	9,000	792.00	7,128,000	
象印マホービン	31,600	1,847.00	58,365,200	
リンテック	25,600	2,429.00	62,182,400	
信越ポリマー	19,400	933.00	18,100,200	
東リ	27,100	281.00	7,615,100	
イトーキ	22,900	399.00	9,137,100	
任天堂	66,100	39,230.00	2,593,103,000	
三菱鉛筆	17,700	1,540.00	27,258,000	
松風	4,900	1,857.00	9,099,300	
タカラスタンダード	22,200	1,657.00	36,785,400	
コクヨ	51,700	1,548.00	80,031,600	
ナカバヤシ	10,700	581.00	6,216,700	
ニフコ	39,600	2,782.00	110,167,200	
立川ブラインド工業	4,700	1,150.00	5,405,000	
グローブライド	4,800	2,099.00	10,075,200	
オカムラ	37,600	950.00	35,720,000	
バルカー	8,800	2,184.00	19,219,200	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,400	1,650.00	2,310,000	
伊藤忠商事	742,800	2,578.50	1,915,309,800	
丸紅	1,105,300	757.50	837,264,750	
スクロール	16,300	333.00	5,427,900	
高島	1,600	1,809.00	2,894,400	
ヨンドシーホールディングス	10,800	2,212.00	23,889,600	
三陽商会	5,500	1,496.00	8,228,000	
長瀬産業	59,800	1,391.00	83,181,800	

ナイガイ	4,000	387.00	1,548,000	
蝶理	6,800	1,952.00	13,273,600	
豊田通商	118,500	3,440.00	407,640,000	
オンワードホールディングス	63,500	581.00	36,893,500	
三共生興	16,000	525.00	8,400,000	
兼松	39,600	1,268.00	50,212,800	
美津濃	9,800	2,373.00	23,255,400	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,107.00	1,992,600	
ファミリーマート	84,900	2,417.00	205,203,300	
ルックホールディングス	3,600	948.00	3,412,800	
三井物産	933,400	1,869.00	1,744,524,600	
日本紙パルプ商事	6,000	3,750.00	22,500,000	
東京エレクトロン	71,900	24,285.00	1,746,091,500	
日立ハイテク	36,900	8,000.00	295,200,000	
カメイ	13,900	1,045.00	14,525,500	
東都水産	1,300	2,804.00	3,645,200	
ＯＵＧホールディングス	1,600	2,580.00	4,128,000	
スターゼン	3,900	4,335.00	16,906,500	
セイコーホールディングス	15,200	2,125.00	32,300,000	
山善	41,400	952.00	39,412,800	
椿本興業	1,900	3,820.00	7,258,000	
住友商事	670,000	1,601.50	1,073,005,000	
日本ユニシス	33,000	3,660.00	120,780,000	
内田洋行	4,500	5,590.00	25,155,000	
三菱商事	745,200	2,798.50	2,085,442,200	
第一実業	5,200	3,490.00	18,148,000	
キヤノンマーケティングジャパン	30,400	2,649.00	80,529,600	
西華産業	6,000	1,236.00	7,416,000	
佐藤商事	8,800	874.00	7,691,200	
菱洋エレクトロ	10,800	1,851.00	19,990,800	
東京産業	9,600	556.00	5,337,600	
ユアサ商事	10,100	3,170.00	32,017,000	
神鋼商事	2,700	2,285.00	6,169,500	
小林産業	6,300	271.00	1,707,300	
阪和興業	19,900	2,425.00	48,257,500	
正栄食品工業	6,800	3,585.00	24,378,000	
カナデン	8,600	1,232.00	10,595,200	
菱電商事	7,600	1,601.00	12,167,600	
ニプロ	74,700	1,205.00	90,013,500	
フルサト工業	5,900	1,553.00	9,162,700	
岩谷産業	23,600	3,635.00	85,786,000	
すてきナイスグループ	4,600	1,085.00	4,991,000	
昭光通商	3,500	639.00	2,236,500	
ニチモウ	1,700	1,827.00	3,105,900	
極東貿易	3,100	1,802.00	5,586,200	
イワキ	14,000	499.00	6,986,000	
兼松エレクトロニクス	5,700	3,260.00	18,582,000	
三愛石油	26,100	996.00	25,995,600	
稲畑産業	23,400	1,388.00	32,479,200	
ＧＳＩクレオス	2,500	1,174.00	2,935,000	

明和産業	9,800	551.00	5,399,800	
クワザワ	3,800	595.00	2,261,000	
キムラタン	57,900	26.00	1,505,400	
ゴールドウイン	19,200	6,920.00	132,864,000	
ユニ・チャーム	207,900	3,742.00	777,961,800	
デサント	20,600	1,569.00	32,321,400	
キング	5,000	530.00	2,650,000	
ワキタ	22,600	975.00	22,035,000	
ヤマトインターナショナル	6,300	400.00	2,520,000	
東邦ホールディングス	34,100	2,193.00	74,781,300	
サンゲツ	29,200	1,701.00	49,669,200	
ミツウロコグループホールディングス	15,700	1,063.00	16,689,100	
シナネンホールディングス	4,400	2,099.00	9,235,600	
伊藤忠エネクス	23,500	887.00	20,844,500	
サンリオ	29,800	1,805.00	53,789,000	
サンワ　テクノス	7,500	899.00	6,742,500	
リョーサン	11,700	2,332.00	27,284,400	
新光商事	16,700	759.00	12,675,300	
トーホー	4,800	1,706.00	8,188,800	
三信電気	5,700	1,561.00	8,897,700	
東陽テクニカ	12,200	992.00	12,102,400	
モスフードサービス	14,000	2,902.00	40,628,000	
加賀電子	10,600	2,161.00	22,906,600	
三益半導体工業	8,400	2,130.00	17,892,000	
ソーダニッカ	10,800	557.00	6,015,600	
立花エレテック	7,900	1,668.00	13,177,200	
木曽路	13,900	2,760.00	38,364,000	
ＳＲＳホールディングス	12,500	1,006.00	12,575,000	
千趣会	19,200	476.00	9,139,200	
タカキュー	8,600	177.00	1,522,200	
ケーヨー	21,800	529.00	11,532,200	
上新電機	12,500	1,896.00	23,700,000	
日本瓦斯	16,800	3,745.00	62,916,000	
ロイヤルホールディングス	18,600	2,009.00	37,367,400	
東天紅	800	1,222.00	977,600	
いなげや	13,200	1,307.00	17,252,400	
島忠	20,000	2,870.00	57,400,000	
チヨダ	11,100	1,362.00	15,118,200	
ライフコーポレーション	8,100	2,541.00	20,582,100	
リンガーハット	13,100	2,365.00	30,981,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	14,600	461.00	6,730,600	
テンアライド	9,800	414.00	4,057,200	
ＡＯＫＩホールディングス	21,200	986.00	20,903,200	
オークワ	16,600	1,421.00	23,588,600	
コメリ	16,400	2,106.00	34,538,400	
青山商事	21,900	1,253.00	27,440,700	
しまむら	12,300	7,480.00	92,004,000	
はせがわ	5,300	390.00	2,067,000	
高島屋	77,400	1,070.00	82,818,000	
松屋	21,400	755.00	16,157,000	

エイチ・ツー・オー　リテイリング	50,300	896.00	45,068,800	
近鉄百貨店	4,000	3,165.00	12,660,000	
丸井グループ	97,300	2,257.00	219,606,100	
クレディセゾン	74,500	1,716.00	127,842,000	
アクシアル　リテイリング	8,800	3,575.00	31,460,000	
井筒屋	5,800	231.00	1,339,800	
イオン	408,700	2,227.00	910,174,900	
イズミ	21,600	3,150.00	68,040,000	
フォーバル	4,700	1,120.00	5,264,000	
平和堂	21,500	1,801.00	38,721,500	
フジ	12,900	1,767.00	22,794,300	
ヤオコー	12,000	5,810.00	69,720,000	
ゼビオホールディングス	12,900	1,049.00	13,532,100	
ケーズホールディングス	102,500	1,256.00	128,740,000	
ＰＡＬＴＡＣ	17,000	4,665.00	79,305,000	
三谷産業	14,200	340.00	4,828,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,500	546.00	3,003,000	
日産東京販売ホールディングス	15,900	246.00	3,911,400	
新生銀行	78,000	1,618.00	126,204,000	
あおぞら銀行	63,300	2,956.00	187,114,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,320,800	556.30	4,072,561,040	
りそなホールディングス	1,167,000	430.00	501,810,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	201,000	3,887.00	781,287,000	
三井住友フィナンシャルグループ	735,500	3,640.00	2,677,220,000	
千葉銀行	365,700	600.00	219,420,000	
群馬銀行	209,000	346.00	72,314,000	
武蔵野銀行	15,800	1,586.00	25,058,800	
千葉興業銀行	29,200	316.00	9,227,200	
筑波銀行	44,400	190.00	8,436,000	
七十七銀行	35,900	1,492.00	53,562,800	
青森銀行	8,300	2,443.00	20,276,900	
秋田銀行	6,800	1,793.00	12,192,400	
山形銀行	11,900	1,269.00	15,101,100	
岩手銀行	6,900	2,420.00	16,698,000	
東邦銀行	95,100	237.00	22,538,700	
東北銀行	5,100	981.00	5,003,100	
みちのく銀行	6,800	1,254.00	8,527,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	89,500	1,786.00	159,847,000	
静岡銀行	263,300	728.00	191,682,400	
十六銀行	13,400	1,998.00	26,773,200	
スルガ銀行	108,800	435.00	47,328,000	
八十二銀行	256,700	388.00	99,599,600	
山梨中央銀行	12,300	879.00	10,811,700	
大垣共立銀行	21,000	2,125.00	44,625,000	
福井銀行	9,100	1,490.00	13,559,000	
北國銀行	10,900	2,958.00	32,242,200	
清水銀行	4,400	1,883.00	8,285,200	
富山銀行	2,000	1,866.00	3,732,000	
滋賀銀行	21,300	2,546.00	54,229,800	
南都銀行	17,600	2,327.00	40,955,200	

百五銀行	95,700	303.00	28,997,100	
京都銀行	38,000	4,025.00	152,950,000	
紀陽銀行	37,600	1,531.00	57,565,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	70,700	971.00	68,649,700	
広島銀行	157,100	499.00	78,392,900	
山陰合同銀行	63,000	581.00	36,603,000	
中国銀行	91,500	903.00	82,624,500	
鳥取銀行	3,700	1,283.00	4,747,100	
伊予銀行	151,700	514.00	77,973,800	
百十四銀行	11,300	1,920.00	21,696,000	
四国銀行	16,100	865.00	13,926,500	
阿波銀行	17,300	2,307.00	39,911,100	
大分銀行	6,100	2,177.00	13,279,700	
宮崎銀行	7,000	2,239.00	15,673,000	
佐賀銀行	6,400	1,451.00	9,286,400	
沖縄銀行	9,700	3,110.00	30,167,000	
琉球銀行	24,600	1,015.00	24,969,000	
セブン銀行	355,300	307.00	109,077,100	
みずほフィナンシャルグループ	14,451,200	155.10	2,241,381,120	
高知銀行	4,000	758.00	3,032,000	
山口フィナンシャルグループ	132,800	619.00	82,203,200	
芙蓉総合リース	11,100	6,630.00	73,593,000	
みずほリース	16,400	3,115.00	51,086,000	
東京センチュリー	21,400	4,840.00	103,576,000	
ＳＢＩホールディングス	118,800	2,345.00	278,586,000	
日本証券金融	46,800	480.00	22,464,000	
アイフル	162,300	294.00	47,716,200	
日本アジア投資	9,300	241.00	2,241,300	
長野銀行	3,500	1,365.00	4,777,500	
名古屋銀行	8,600	3,280.00	28,208,000	
北洋銀行	160,200	216.00	34,603,200	
愛知銀行	3,900	3,330.00	12,987,000	
中京銀行	4,400	2,168.00	9,539,200	
大光銀行	3,700	1,530.00	5,661,000	
愛媛銀行	14,900	1,055.00	15,719,500	
トマト銀行	4,100	1,001.00	4,104,100	
京葉銀行	45,300	555.00	25,141,500	
栃木銀行	51,400	187.00	9,611,800	
北日本銀行	3,400	1,972.00	6,704,800	
東和銀行	18,700	737.00	13,781,900	
福島銀行	10,400	203.00	2,111,200	
大東銀行	5,600	592.00	3,315,200	
リコーリース	8,400	4,050.00	34,020,000	
イオンフィナンシャルサービス	65,100	1,723.00	112,167,300	
アコム	213,700	494.00	105,567,800	
ジャックス	11,700	2,323.00	27,179,100	
オリエントコーポレーション	287,800	153.00	44,033,400	
日立キャピタル	25,100	2,947.00	73,969,700	
アプラスフィナンシャル	51,200	76.00	3,891,200	
オリックス	665,200	1,859.00	1,236,606,800	

三菱ＵＦＪリース	269,900	663.00	178,943,700	
ジャフコ	16,300	4,420.00	72,046,000	
九州リースサービス	5,000	582.00	2,910,000	
トモニホールディングス	82,300	318.00	26,171,400	
大和証券グループ本社	853,200	501.50	427,879,800	
野村ホールディングス	1,871,300	532.60	996,654,380	
岡三証券グループ	90,600	377.00	34,156,200	
丸三証券	31,500	489.00	15,403,500	
東洋証券	38,200	144.00	5,500,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	122,000	314.00	38,308,000	
光世証券	2,500	571.00	1,427,500	
水戸証券	30,800	210.00	6,468,000	
いちよし証券	19,800	586.00	11,602,800	
松井証券	60,700	877.00	53,233,900	
ＳＯＭＰＯホールディングス	200,000	4,218.00	843,600,000	
だいこう証券ビジネス	5,200	621.00	3,229,200	
日本取引所グループ	305,300	1,905.00	581,596,500	
マネックスグループ	80,300	235.00	18,870,500	
極東証券	14,300	720.00	10,296,000	
岩井コスモホールディングス	10,000	1,223.00	12,230,000	
藍澤證券	19,100	658.00	12,567,800	
フィデアホールディングス	103,600	116.00	12,017,600	
池田泉州ホールディングス	122,800	179.00	21,981,200	
アニコム　ホールディングス	8,800	3,700.00	32,560,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	278,000	3,644.00	1,013,032,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	87,400	2,335.00	204,079,000	
マネーパートナーズグループ	11,500	214.00	2,461,000	
スパークス・グループ	36,800	249.00	9,163,200	
小林洋行	3,200	257.00	822,400	
第一生命ホールディングス	601,800	1,593.50	958,968,300	
東京海上ホールディングス	380,300	6,121.00	2,327,816,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	819.00	4,258,800	
イー・ギャランティ	11,400	1,260.00	14,364,000	
アサックス	5,500	681.00	3,745,500	
ＮＥＣキャピタルソリューション	4,300	2,306.00	9,915,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	317,800	1,166.00	370,554,800	
アドバンスクリエイト	2,400	1,651.00	3,962,400	
三井不動産	524,500	2,821.50	1,479,876,750	
三菱地所	745,200	2,088.00	1,555,977,600	
平和不動産	19,500	3,325.00	64,837,500	
東京建物	116,300	1,637.00	190,383,100	
ダイビル	27,400	1,318.00	36,113,200	
京阪神ビルディング	17,200	1,422.00	24,458,400	
住友不動産	239,100	3,813.00	911,688,300	
太平洋興発	4,100	733.00	3,005,300	
テーオーシー	20,900	797.00	16,657,300	
東京楽天地	1,400	5,450.00	7,630,000	

レオパレス２１	139,400	390.00	54,366,000	
スターツコーポレーション	14,500	2,462.00	35,699,000	
フジ住宅	12,400	635.00	7,874,000	
空港施設	10,800	500.00	5,400,000	
明和地所	5,900	605.00	3,569,500	
ゴールドクレスト	8,400	1,797.00	15,094,800	
リログループ	56,300	2,586.00	145,591,800	
エスリード	4,200	1,790.00	7,518,000	
日神グループホールディングス	15,700	506.00	7,944,200	
日本エスコン	19,200	838.00	16,089,600	
タカラレーベン	48,700	473.00	23,035,100	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,000	910.00	5,460,000	
イオンモール	53,300	1,761.00	93,861,300	
毎日コムネット	2,200	879.00	1,933,800	
ファースト住建	4,600	1,160.00	5,336,000	
ランド	589,500	10.00	5,895,000	
カチタス	13,200	3,795.00	50,094,000	
東祥	6,400	1,801.00	11,526,400	
トーセイ	14,700	1,310.00	19,257,000	
穴吹興産	2,200	1,566.00	3,445,200	
サンフロンティア不動産	14,700	1,207.00	17,742,900	
エフ・ジェー・ネクスト	9,300	1,047.00	9,737,100	
インテリックス	3,100	622.00	1,928,200	
ランドビジネス	4,300	725.00	3,117,500	
日本社宅サービス	2,800	976.00	2,732,800	
グランディハウス	8,300	427.00	3,544,100	
東武鉄道	113,700	3,405.00	387,148,500	
相鉄ホールディングス	34,500	2,607.00	89,941,500	
東急	271,900	1,760.00	478,544,000	
京浜急行電鉄	138,500	1,734.00	240,159,000	
小田急電鉄	160,300	2,189.00	350,896,700	
京王電鉄	56,000	5,490.00	307,440,000	
京成電鉄	75,100	3,635.00	272,988,500	
富士急行	14,700	3,050.00	44,835,000	
新京成電鉄	2,800	2,377.00	6,655,600	
東日本旅客鉄道	189,800	8,824.00	1,674,795,200	
西日本旅客鉄道	96,100	8,309.00	798,494,900	
東海旅客鉄道	89,700	19,385.00	1,738,834,500	
西武ホールディングス	144,700	1,639.00	237,163,300	
鴻池運輸	17,100	1,392.00	23,803,200	
西日本鉄道	29,900	2,500.00	74,750,000	
ハマキョウレックス	8,300	3,000.00	24,900,000	
サカイ引越センター	5,700	5,730.00	32,661,000	
近鉄グループホールディングス	102,100	4,975.00	507,947,500	
阪急阪神ホールディングス	136,200	3,830.00	521,646,000	
南海電気鉄道	48,400	2,566.00	124,194,400	
京阪ホールディングス	45,500	4,590.00	208,845,000	
神戸電鉄	2,400	3,925.00	9,420,000	
名古屋鉄道	83,900	2,952.00	247,672,800	
山陽電気鉄道	7,300	2,016.00	14,716,800	

トランコム	2,900	7,630.00	22,127,000	
日本通運	36,100	5,580.00	201,438,000	
ヤマトホールディングス	179,000	1,874.00	335,446,000	
山九	28,400	4,855.00	137,882,000	
日新	8,800	1,593.00	14,018,400	
丸運	5,900	280.00	1,652,000	
丸全昭和運輸	8,300	2,611.00	21,671,300	
センコーグループホールディングス	56,300	827.00	46,560,100	
トナミホールディングス	2,400	4,800.00	11,520,000	
ニッコンホールディングス	36,500	2,251.00	82,161,500	
日本石油輸送	1,100	2,998.00	3,297,800	
福山通運	13,100	3,460.00	45,326,000	
セイノーホールディングス	76,500	1,270.00	97,155,000	
エスライン	3,100	917.00	2,842,700	
神奈川中央交通	2,500	3,750.00	9,375,000	
日立物流	18,800	3,030.00	56,964,000	
丸和運輸機関	10,800	1,858.00	20,066,400	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	10,300	1,191.00	12,267,300	
日本郵船	85,400	1,650.00	140,910,000	
商船三井	64,600	2,408.00	155,556,800	
川崎汽船	31,400	1,366.00	42,892,400	
ＮＳユナイテッド海運	5,600	1,764.00	9,878,400	
明治海運	10,200	330.00	3,366,000	
飯野海運	48,100	340.00	16,354,000	
共栄タンカー	1,800	911.00	1,639,800	
九州旅客鉄道	91,100	3,570.00	325,227,000	
ＳＧホールディングス	107,200	2,154.00	230,908,800	
日本航空	183,800	2,877.50	528,884,500	
ＡＮＡホールディングス	186,600	3,109.00	580,139,400	
パスコ	1,900	1,821.00	3,459,900	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,900	3,040.00	5,776,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	2,049.00	1,639,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	5,200	1,876.00	9,755,200	
国際紙パルプ商事	25,200	277.00	6,980,400	
ナルミヤ・インターナショナル	1,800	1,107.00	1,992,600	
総合メディカルホールディングス	9,300	2,548.00	23,696,400	
ブックオフグループホールディングス	6,200	893.00	5,536,600	
三菱倉庫	32,400	2,737.00	88,678,800	
三井倉庫ホールディングス	11,600	1,658.00	19,232,800	
住友倉庫	37,500	1,379.00	51,712,500	
澁澤倉庫	5,600	1,938.00	10,852,800	
ヤマタネ	5,300	1,401.00	7,425,300	
東陽倉庫	18,500	299.00	5,531,500	
乾汽船	5,900	1,135.00	6,696,500	
日本トランスシティ	22,500	436.00	9,810,000	
ケイヒン	1,800	1,295.00	2,331,000	
中央倉庫	6,200	1,068.00	6,621,600	
川西倉庫	1,800	1,007.00	1,812,600	
安田倉庫	8,400	964.00	8,097,600	

ファイズホールディングス	2,200	699.00	1,537,800	
東洋埠頭	3,100	1,321.00	4,095,100	
宇徳	8,700	486.00	4,228,200	
上組	58,500	2,182.00	127,647,000	
サンリツ	2,300	663.00	1,524,900	
キムラユニティー	2,800	1,074.00	3,007,200	
キユーソー流通システム	2,500	1,815.00	4,537,500	
近鉄エクスプレス	21,600	1,785.00	38,556,000	
東海運	5,800	271.00	1,571,800	
エーアイテイー	7,200	906.00	6,523,200	
内外トランスライン	3,600	1,130.00	4,068,000	
ショーエイコーポレーション	1,200	832.00	998,400	
日本コンセプト	3,300	1,367.00	4,511,100	
東京放送ホールディングス	64,400	1,825.00	117,530,000	
日本テレビホールディングス	88,300	1,405.00	124,061,500	
朝日放送グループホールディングス	10,500	715.00	7,507,500	
テレビ朝日ホールディングス	29,100	1,938.00	56,395,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	69,600	466.00	32,433,600	
テレビ東京ホールディングス	8,700	2,272.00	19,766,400	
日本ＢＳ放送	3,600	1,212.00	4,363,200	
ビジョン	9,900	1,106.00	10,949,400	
スマートバリュー	3,100	899.00	2,786,900	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,000	1,685.00	6,740,000	
ワイヤレスゲート	5,000	550.00	2,750,000	
コネクシオ	6,000	1,488.00	8,928,000	
日本通信	81,800	202.00	16,523,600	
クロップス	1,900	658.00	1,250,200	
日本電信電話	1,414,300	2,734.50	3,867,403,350	
ＫＤＤＩ	788,500	3,394.00	2,676,169,000	
ソフトバンク	961,600	1,480.50	1,423,648,800	
光通信	10,900	22,070.00	240,563,000	
ＮＴＴドコモ	781,600	3,094.00	2,418,270,400	
エムティーアイ	10,200	618.00	6,303,600	
ＧＭＯインターネット	41,700	1,946.00	81,148,200	
ファイバーゲート	2,000	1,189.00	2,378,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,200	529.00	1,692,800	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	28,500	1,553.00	44,260,500	
学研ホールディングス	3,600	7,090.00	25,524,000	
ゼンリン	21,100	1,402.00	29,582,200	
昭文社	5,000	352.00	1,760,000	
インプレスホールディングス	8,800	159.00	1,399,200	
東京電力ホールディングス	860,800	428.00	368,422,400	
中部電力	330,000	1,482.50	489,225,000	
関西電力	408,600	1,239.00	506,255,400	
中国電力	149,100	1,462.00	217,984,200	
北陸電力	98,600	796.00	78,485,600	
東北電力	269,600	995.00	268,252,000	
四国電力	97,200	864.00	83,980,800	

九州電力	222,300	826.00	183,619,800	
北海道電力	101,000	500.00	50,500,000	
沖縄電力	20,000	1,942.00	38,840,000	
電源開発	85,900	2,432.00	208,908,800	
エフオン	5,100	626.00	3,192,600	
イーレックス	15,300	1,423.00	21,771,900	
レノバ	17,800	1,072.00	19,081,600	
東京瓦斯	207,500	2,336.50	484,823,750	
大阪瓦斯	209,300	1,842.00	385,530,600	
東邦瓦斯	53,000	3,885.00	205,905,000	
北海道瓦斯	5,800	1,535.00	8,903,000	
広島ガス	22,400	335.00	7,504,000	
西部瓦斯	12,100	2,261.00	27,358,100	
静岡ガス	30,600	901.00	27,570,600	
メタウォーター	5,200	3,970.00	20,644,000	
アイネット	5,400	1,363.00	7,360,200	
松竹	7,000	13,220.00	92,540,000	
東宝	63,200	3,645.00	230,364,000	
エイチ・アイ・エス	16,000	2,329.00	37,264,000	
東映	4,000	13,110.00	52,440,000	
ラックランド	2,100	2,077.00	4,361,700	
エヌ・ティ・ティ・データ	281,700	1,401.00	394,661,700	
共立メンテナンス	17,000	3,800.00	64,600,000	
イチネンホールディングス	11,500	1,273.00	14,639,500	
建設技術研究所	7,100	2,012.00	14,285,200	
スペース	6,700	1,106.00	7,410,200	
長　大	3,800	1,031.00	3,917,800	
アインホールディングス	13,100	6,690.00	87,639,000	
燦ホールディングス	4,500	1,426.00	6,417,000	
ピー・シー・エー	1,300	3,950.00	5,135,000	
スバル興業	600	8,140.00	4,884,000	
東京テアトル	4,100	1,296.00	5,313,600	
タナベ経営	1,900	1,273.00	2,418,700	
ビジネスブレイン太田昭和	1,800	2,712.00	4,881,600	
ナガワ	3,300	6,140.00	20,262,000	
よみうりランド	2,200	3,910.00	8,602,000	
東京都競馬	6,700	3,465.00	23,215,500	
常磐興産	4,200	1,570.00	6,594,000	
カナモト	16,800	2,551.00	42,856,800	
東京ドーム	41,800	889.00	37,160,200	
ＤＴＳ	23,700	2,120.00	50,244,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,100	4,725.00	213,097,500	
シーイーシー	11,300	1,889.00	21,345,700	
カプコン	49,900	3,345.00	166,915,500	
西尾レントオール	10,500	2,798.00	29,379,000	
アイ・エス・ビー	2,000	2,232.00	4,464,000	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	69,000	28.00	1,932,000	
日本空港ビルデング	34,000	4,760.00	161,840,000	

トランス・コスモス	9,800	2,525.00	24,745,000	
乃村工藝社	44,200	1,096.00	48,443,200	
ジャステック	6,700	986.00	6,606,200	
ＳＣＳＫ	24,400	6,100.00	148,840,000	
藤田観光	4,500	2,290.00	10,305,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,400	1,085.00	6,944,000	
日本管財	11,000	1,875.00	20,625,000	
トーカイ	10,000	2,354.00	23,540,000	
白洋舎	1,100	2,751.00	3,026,100	
セコム	109,300	9,094.00	993,974,200	
日本システムウエア	3,500	2,150.00	7,525,000	
セントラル警備保障	5,000	4,970.00	24,850,000	
アイネス	10,400	1,657.00	17,232,800	
丹青社	19,500	1,088.00	21,216,000	
メイテック	12,700	5,330.00	67,691,000	
ＴＫＣ	9,000	5,050.00	45,450,000	
富士ソフト	13,600	3,875.00	52,700,000	
応用地質	11,100	1,345.00	14,929,500	
船井総研ホールディングス	21,300	2,813.00	59,916,900	
ＮＳＤ	34,800	1,848.00	64,310,400	
進学会ホールディングス	4,100	482.00	1,976,200	
丸紅建材リース	1,000	1,740.00	1,740,000	
オオバ	8,100	675.00	5,467,500	
コナミホールディングス	38,500	4,165.00	160,352,500	
いであ	1,900	1,869.00	3,551,100	
学究社	3,100	1,286.00	3,986,600	
ベネッセホールディングス	34,300	2,904.00	99,607,200	
イオンディライト	12,700	3,540.00	44,958,000	
ナック	5,700	988.00	5,631,600	
福井コンピュータホールディングス	4,200	2,930.00	12,306,000	
ニチイ学館	14,700	1,223.00	17,978,100	
ダイセキ	17,200	2,811.00	48,349,200	
ステップ	3,800	1,574.00	5,981,200	
日鉄物産	7,500	4,460.00	33,450,000	
泉州電業	3,300	2,850.00	9,405,000	
元気寿司	2,700	2,771.00	7,481,700	
トラスコ中山	22,100	2,265.00	50,056,500	
ヤマダ電機	323,600	570.00	184,452,000	
オートバックスセブン	39,400	1,481.00	58,351,400	
モリト	7,800	749.00	5,842,200	
アークランドサカモト	16,600	1,145.00	19,007,000	
ニトリホールディングス	46,000	16,110.00	741,060,000	
グルメ杵屋	7,500	1,120.00	8,400,000	
愛眼	8,300	238.00	1,975,400	
ケーユーホールディングス	5,500	824.00	4,532,000	
吉野家ホールディングス	34,900	2,450.00	85,505,000	
加藤産業	16,600	3,300.00	54,780,000	
北恵	2,000	880.00	1,760,000	
イノテック	6,300	1,102.00	6,942,600	
イエローハット	20,100	1,580.00	31,758,000	

松屋フーズホールディングス	5,100	4,260.00	21,726,000	
ＪＢＣＣホールディングス	7,100	1,861.00	13,213,100	
ＪＫホールディングス	9,600	705.00	6,768,000	
サガミホールディングス	14,200	1,291.00	18,332,200	
日伝	9,600	1,836.00	17,625,600	
関西スーパーマーケット	8,900	969.00	8,624,100	
ミロク情報サービス	9,300	2,575.00	23,947,500	
北沢産業	7,800	236.00	1,840,800	
杉本商事	5,700	1,820.00	10,374,000	
因幡電機産業	30,200	2,513.00	75,892,600	
王将フードサービス	7,800	6,250.00	48,750,000	
プレナス	11,900	1,863.00	22,169,700	
ミニストップ	7,900	1,495.00	11,810,500	
アークス	21,700	1,850.00	40,145,000	
バローホールディングス	23,500	1,724.00	40,514,000	
東テク	3,500	2,300.00	8,050,000	
ミスミグループ本社	133,000	2,503.00	332,899,000	
藤久	900	670.00	603,000	
アルテック	8,600	230.00	1,978,000	
ベルク	5,200	5,210.00	27,092,000	
大　庄	5,700	1,575.00	8,977,500	
タキヒヨー	3,100	1,707.00	5,291,700	
ファーストリテイリング	14,200	56,420.00	801,164,000	
ソフトバンクグループ	839,500	5,460.00	4,583,670,000	
蔵王産業	2,100	1,441.00	3,026,100	
スズケン	45,000	3,765.00	169,425,000	
サンドラッグ	40,000	3,235.00	129,400,000	
サックスバー　ホールディングス	9,000	771.00	6,939,000	
ジェコス	7,300	986.00	7,197,800	
ヤマザワ	2,000	1,593.00	3,186,000	
やまや	2,100	2,180.00	4,578,000	
グローセル	9,400	427.00	4,013,800	
ベルーナ	22,700	581.00	13,188,700	
合計	127,649,400		245,829,299,910	

（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。

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2月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,465,477,249
国債証券	177,736,652,500
地方債証券	18,092,951,500
特殊債券	16,623,727,253
社債券	10,568,838,520
未収利息	536,232,146
前払費用	26,444,824
流動資産合計	225,050,323,992
資産合計	225,050,323,992
負債の部	
流動負債	
未払解約金	312,003,000
流動負債合計	312,003,000
負債合計	312,003,000
純資産の部	
元本等	
元本	169,257,068,344
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	55,481,252,648
元本等合計	224,738,320,992
純資産合計	224,738,320,992
負債純資産合計	225,050,323,992

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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	223,957,984,513円
同期中追加設定元本額	120,846,054,601円
同期中一部解約元本額	175,546,970,770円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	21,180,874,133円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	69,986,260円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	67,617,354円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	18,495,774円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	970,303,047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）	25,260,802円
たわらノーロード　国内債券	10,216,544,496円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	671,731,296円

たわらノーロード　バランス（堅実型）	203,296,488円
たわらノーロード　バランス（標準型）	336,916,196円
たわらノーロード　バランス（積極型）	42,408,884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）	14,363,297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）	437,375,899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）	432,095,433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）	108,140,598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）	9,031,893円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	5,613,145円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	8,802,354円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,898,737円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,755,393円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	243,237円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,087,638,755円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	6,949,626,291円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	9,558,018,369円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,799,837,596円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,841,604,708円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,047,028,967円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	317,181,619円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	81,601,971円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,369,253,248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）	3,565,908,407円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,012,677,096円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	214,761,880円
投資のソムリエ	7,149,156,656円
クルーズコントロール	1,214,453,782円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	663,342,952円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	3,041,555,247円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	354,763,281円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,228,781円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,760,959円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,262,628円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	522,448,330円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	5,526,677,877円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	4,979,556円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	3,975,223円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,975,395円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	9,963,190円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	197,794,405円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,896,466,735円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,308,351,355円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	760,994円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	656,181円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	731,422円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	498,022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）	1,046,358,268円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	10,108,889,564円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	340,971,896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

ＯｎｅＩＩ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	5,050,603,156円
ＯｎｅＩＩＩ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	5,102,756,119円
ＯｎｅＩＶ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	5,076,506,178円
ＯｎｅＶ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	5,113,422,319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）	852,699,721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）	219,633,689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）	165,050,839円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	61,558,322円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	148,494,901円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	70,976,271円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,810,777円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	80,376,845円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	167,069,557円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,577,509,082円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,575,679,673円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,894,991,701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）	526,468,402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）	242,472,128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）	2,823,431,665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）	252,552,460円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,361,173円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,261,134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）	2,609,658,452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）	74,826,164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）	541,115,349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）	933,900,682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）	1,902,807,090円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	351,894,308円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	110,662,909円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	200,733,021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）	410,778円
計	169,257,068,344円
２．　受益権の総数	169,257,068,344口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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2月25日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,186,912,500
地方債証券	38,045,500
特殊債券	64,061,998
社債券	23,703,890
合計	1,312,723,888

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和2年2月15日から令和2年2月25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2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3278円 (13,278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2月25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	1,003,230,000	
	４０８　利付国庫債券（２年）	800,000,000	804,520,000	
	１２８回　利付国庫債券（５年）	2,200,000,000	2,208,536,000	
	１２９回　利付国庫債券（５年）	2,120,000,000	2,129,964,000	
	１３０回　利付国庫債券（５年）	1,780,000,000	1,789,879,000	
	１３１回　利付国庫債券（５年）	1,420,000,000	1,429,102,200	
	１３２回　利付国庫債券（５年）	1,200,000,000	1,208,640,000	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,189,581,600	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	1,180,000,000	1,190,513,800	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	1,040,000,000	1,050,088,000	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	1,250,000,000	1,263,337,500	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	1,400,000,000	1,415,834,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	1,450,000,000	1,467,559,500	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,316,770,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	1,300,000,000	1,317,823,000	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	1,410,000,000	1,430,473,200	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	500,000,000	507,660,000	
	２回　利付国庫債券（４０年）	280,000,000	425,614,000	
	３回　利付国庫債券（４０年）	290,000,000	444,996,300	
	４回　利付国庫債券（４０年）	430,000,000	666,865,500	
	５回　利付国庫債券（４０年）	480,000,000	722,884,800	
	６回　利付国庫債券（４０年）	450,000,000	669,573,000	
	７回　利付国庫債券（４０年）	480,000,000	689,793,600	
	８回　利付国庫債券（４０年）	520,000,000	701,454,000	
	９回　利付国庫債券（４０年）	780,000,000	793,751,400	

１０回　利付国庫債券（４０年）	770,000,000	917,963,200	
１１回　利付国庫債券（４０年）	580,000,000	672,173,600	
１２回　利付国庫債券（４０年）	380,000,000	399,585,200	
３１３回　利付国庫債券（１０年）	1,180,000,000	1,198,667,600	
３１４回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	810,960,000	
３１５回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,527,420,000	
３１６回　利付国庫債券（１０年）	1,000,000,000	1,016,970,000	
３１７回　利付国庫債券（１０年）	600,000,000	612,192,000	
３１８回　利付国庫債券（１０年）	1,400,000,000	1,426,250,000	
３１９回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	818,928,000	
３２０回　利付国庫債券（１０年）	900,000,000	919,656,000	
３２１回　利付国庫債券（１０年）	800,000,000	819,944,000	
３２２回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	511,430,000	
３２３回　利付国庫債券（１０年）	750,000,000	769,252,500	
３２４回　利付国庫債券（１０年）	1,050,000,000	1,074,507,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	1,300,000,000	1,333,852,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	500,000,000	512,950,000	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,200,000,000	1,234,476,000	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	1,090,000,000	1,117,359,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	1,770,000,000	1,829,932,200	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	450,000,000	466,402,500	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	650,000,000	669,025,500	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	1,410,000,000	1,454,175,300	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	1,650,000,000	1,705,423,500	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	1,770,000,000	1,833,171,300	

３３５回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,963,061,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	700,000,000	724,871,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,090,000,000	1,117,838,600	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	1,730,000,000	1,785,342,700	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	1,790,000,000	1,850,144,000	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,966,899,000	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	1,910,000,000	1,969,057,200	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	1,980,000,000	2,019,520,800	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	1,780,000,000	1,817,041,800	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	1,930,000,000	1,971,784,500	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	1,710,000,000	1,748,440,800	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	1,920,000,000	1,964,755,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	1,560,000,000	1,597,096,800	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	1,630,000,000	1,669,478,600	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	1,760,000,000	1,802,609,600	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	2,250,000,000	2,304,337,500	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	1,860,000,000	1,904,751,600	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	1,720,000,000	1,760,351,200	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	1,500,000,000	1,534,860,000	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	1,470,000,000	1,503,060,300	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,481,436,000	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	1,330,000,000	1,357,650,700	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	400,000,000	408,128,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	128,004,000	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	125,084,000	
３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	249,084,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	263,942,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	257,064,000	

８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	245,696,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	244,610,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	256,100,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	127,013,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	385,688,400	
１５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	269,822,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	202,989,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	268,716,000	
１８回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	426,348,800	
１９回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	267,366,000	
２０回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	274,404,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	268,914,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	320,000,000	441,740,800	
２３回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	277,042,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	190,000,000	264,086,700	
２５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	272,082,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	552,468,000	
２７回　利付国庫債券（３０年）	420,000,000	590,931,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	679,540,800	
２９回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	787,572,800	
３０回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	794,876,400	
３１回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	829,836,000	
３２回　利付国庫債券（３０年）	760,000,000	1,071,942,000	
３３回　利付国庫債券（３０年）	740,000,000	1,005,075,400	
３４回　利付国庫債券（３０年）	670,000,000	941,752,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	820,000,000	1,125,130,200	

３６回　利付国庫債券（３０年）	800,000,000	1,103,072,000	
３７回　利付国庫債券（３０年）	890,000,000	1,214,031,200	
３８回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	768,491,100	
３９回　利付国庫債券（３０年）	480,000,000	659,548,800	
４０回　利付国庫債券（３０年）	450,000,000	609,282,000	
４１回　利付国庫債券（３０年）	460,000,000	613,354,800	
４２回　利付国庫債券（３０年）	510,000,000	681,696,600	
４３回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	669,230,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	490,000,000	657,472,200	
４５回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	648,295,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	630,000,000	817,639,200	
４７回　利付国庫債券（３０年）	540,000,000	715,246,200	
４８回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	753,937,400	
４９回　利付国庫債券（３０年）	560,000,000	717,029,600	
５０回　利付国庫債券（３０年）	540,000,000	610,421,400	
５１回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	572,091,900	
５２回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	611,546,200	
５３回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	647,886,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	600,000,000	679,332,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	590,000,000	667,838,700	
５６回　利付国庫債券（３０年）	550,000,000	623,183,000	
５７回　利付国庫債券（３０年）	650,000,000	736,261,500	
５８回　利付国庫債券（３０年）	710,000,000	803,954,300	
５９回　利付国庫債券（３０年）	580,000,000	641,375,600	
６０回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	579,690,000	

６１回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	552,305,000	
６２回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	524,625,000	
６３回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	582,215,100	
６４回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	510,110,000	
６５回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	203,800,000	
７２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	387,436,000	
７３回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	376,720,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	156,620,800	
７８回　利付国庫債券（２０年）	190,000,000	211,650,500	
８１回　利付国庫債券（２０年）	240,000,000	270,014,400	
８５回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	502,541,600	
８８回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	406,325,500	
９０回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	812,553,000	
９２回　利付国庫債券（２０年）	870,000,000	1,009,269,600	
９３回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	289,697,500	
９４回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	524,682,000	
９５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	415,240,000	
９７回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	592,390,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	531,940,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	717,084,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	438,192,000	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	478,496,000	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	421,722,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	480,384,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	473,240,000	

１０９回　利付国庫債券（２０年）	220,000,000	261,063,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	330,000,000	397,650,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	353,359,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	664,988,500	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	934,487,400	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	669,922,000	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	245,590,000	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	450,000,000	554,616,000	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	794,514,500	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	377,046,800	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	358,644,000	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	469,872,000	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	653,216,400	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	419,657,000	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	531,093,000	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	306,052,500	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	450,086,400	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	340,000,000	417,516,600	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	304,217,500	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	671,247,500	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	290,000,000	350,636,100	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	580,000,000	703,574,800	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	300,000,000	360,435,000	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	529,927,200	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	693,251,100	

１３４回　利付国庫債券（２０年）	520,000,000	634,410,400	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	422,775,500	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	200,000,000	239,168,000	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	423,780,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	280,000,000	332,119,200	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	430,000,000	515,342,100	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	1,117,202,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	650,000,000	791,082,500	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	491,940,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	560,000,000	676,132,800	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	310,000,000	370,245,400	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	840,000,000	1,027,362,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	1,042,465,500	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	980,000,000	1,190,837,200	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	830,270,100	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,085,445,000	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,133,796,500	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	956,554,600	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	890,000,000	1,039,101,700	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	890,000,000	1,054,240,600	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	994,814,500	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	981,251,400	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	780,000,000	816,340,200	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	861,568,500	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	860,000,000	913,070,600	

	１５９回　利付国庫債券（２０年）	850,000,000	916,487,000	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	766,591,000	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	862,200,000	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	862,344,000	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	770,000,000	830,113,900	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	964,308,800	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	784,059,600	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	821,535,000	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	846,584,000	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	700,000,000	727,706,000	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	764,655,000	
	１７０回　利付国庫債券（２０年）	630,000,000	641,856,600	
	１７１回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	254,520,000	
国債証券　合計		160,040,000,000	177,736,652,500	
地方債証券	６９７回　東京都公募公債	500,000,000	507,460,000	
	７０１回　東京都公募公債	700,000,000	711,137,000	
	７０８回　東京都公募公債	500,000,000	510,710,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	309,003,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	411,684,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,839,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	231,208,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	346,497,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	300,000,000	305,322,000	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	306,990,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	307,668,000	
	３５６回　大阪府公募公債	200,000,000	204,020,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	306,411,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	309,990,000	
	２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	358,718,500	
	２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	204,862,000	
	１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	314,838,000	
	２３年度９回　静岡県公募公債	200,000,000	203,772,000	
	８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	216,282,000	

１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	112,309,000	
２３年度２０回　愛知県公募公債	500,000,000	511,660,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	308,712,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	202,188,000	
２３年度２回　埼玉県公募公債	200,000,000	203,034,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	411,540,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	357,999,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	205,876,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	356,478,000	
２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	306,570,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	206,126,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	113,025,000	
９９回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	711,158,000	
１０６回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,775,000	
１０９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,730,000	
１１１回　共同発行市場公募地方債	700,000,000	715,064,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,535,000	
１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,575,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,815,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,485,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	410,176,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	412,240,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	515,805,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,295,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	202,664,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	463,140,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	116,680,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	306,909,000	
２３年度４回　横浜市公募公債	450,000,000	458,307,000	
２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	412,492,000	
２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	205,538,000	

	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	203,424,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	118,996,000	
	２３年度１回　千葉市公募公債	200,000,000	203,220,000	
地方債証券　合計		17,450,000,000	18,092,951,500	
特殊債券	７８回　日本政策投資銀行債券	200,000,000	203,288,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	237,694,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	282,018,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	714,952,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	102,723,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	201,044,000	
	９回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,171,000	
	１８回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	310,479,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	595,995,000	
	１４９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	407,860,000	
	１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	509,705,000	
	１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	515,935,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	341,117,700	
	２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	345,516,000	
	２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	513,430,000	
	２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	250,218,000	
	３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	812,440,000	
	３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	214,832,000	
	２８回　日本道路・機構承継債	400,000,000	542,452,000	
	１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	236,142,000	
	２４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,611,000	
	１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	239,984,000	
	３６回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,504,000	
	２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	238,496,000	
	４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	410,516,000	
	５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	516,615,000	

５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	559,338,580	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,478,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	232,166,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	402,724,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	238,388,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	217,074,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	239,950,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	425,925,500	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	304,575,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	305,997,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	38,001,000	39,312,034	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	26,704,000	27,731,569	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	39,924,000	41,521,758	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	42,426,000	44,502,752	
１３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	13,092,000	13,313,123	
１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	65,775,000	66,720,844	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,127,000	14,859,767	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,016,000	56,451,581	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,311,000	42,068,156	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,765,000	69,067,057	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	142,365,000	153,796,909	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,352,000	257,731,657	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,345,000	261,535,560	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,001,000	277,277,819	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,523,000	277,611,004	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,092,000	281,943,880	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	276,636,000	281,493,728	

	１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	284,412,000	290,856,775	
	い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,577,000	
	３２５回　利附信金中金債	400,000,000	400,512,000	
	２２０号　利附商工債（３年）	300,000,000	300,486,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	119,472,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	513,530,000	
特殊債券　合計		15,498,867,000	16,623,727,253	
社債券	１回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	200,000,000	200,328,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	205,982,000	
	３３７回　東京交通債	200,000,000	204,734,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	203,900,000	
	１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	101,147,000	
	６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	103,448,000	
	１４回　ブリヂストン社債	200,000,000	202,532,000	
	２３回　ジェイ　エフ　イーホールディングス社債	100,000,000	100,029,000	
	１３回　パナソニック社債	100,000,000	101,018,000	
	１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	205,712,000	
	１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	204,992,000	
	９４回　丸紅社債	100,000,000	102,814,000	
	４５回　住友商事社債	100,000,000	102,262,000	
	４７回　住友商事社債	100,000,000	102,765,000	
	４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	103,151,000	
	５７回　東京三菱銀行社債	200,000,000	211,736,000	
	３２回　三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	300,000,000	305,967,000	
	９回　三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	100,000,000	101,871,000	
	１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	204,668,000	
	１０回　セブン銀行社債	100,000,000	102,255,000	
	４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	204,756,000	
	５６回　三菱ＵＦＪリース社債	200,000,000	203,222,000	
	７２回　三菱地所社債	100,000,000	110,114,000	
	１０８回　住友不動産社債	200,000,000	202,248,000	
	８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	108,762,000	
	４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	103,000,000	
	１９回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	104,699,000	
	２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	105,145,000	
	３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	331,437,000	
	４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	222,602,000	
	９回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	209,446,000	
	１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	321,426,000	
	６回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,694,000	
	１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	309,546,000	
	１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	215,084,000	

	１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	108,753,000	
	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	137,232,000	
	５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,848,000	
	３７７回　中国電力社債	400,000,000	414,732,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	103,370,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	105,607,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	416,452,000	
	４７３回　東北電力社債	300,000,000	301,962,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	206,130,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	208,452,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	415,236,000	
	３２０回　北海道電力社債	200,000,000	201,916,000	
	３２１回　北海道電力社債	161,000,000	166,525,520	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	305,088,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	219,702,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	310,086,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	309,594,000	
	１８回　大阪ガス社債	100,000,000	104,082,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	100,000,000	102,777,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	202,802,000	
社債券　合計		10,181,000,000	10,568,838,520	
合計			223,022,169,773	

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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	令和2年2月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,834,970,359
コール・ローン	220,013,815
株式	338,725,330,310
投資信託受益証券	806,663,913
投資証券	9,243,231,807
派生商品評価勘定	16,832,801
未収入金	1,415,052
未収配当金	512,635,260
差入委託証拠金	2,524,593,143
流動資産合計	358,885,686,460
資産合計	358,885,686,460
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	186,481,682
未払解約金	479,545,000
流動負債合計	666,026,682
負債合計	666,026,682
純資産の部	
元本等	

元本	88,613,273,386
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	269,606,386,392
元本等合計	358,219,659,778
純資産合計	358,219,659,778
負債純資産合計	358,885,686,460

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年2月25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	101,613,958,939円
同期中追加設定元本額	23,842,509,649円
同期中一部解約元本額	36,843,195,202円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,401,914,577円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,265,172円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	6,568,890円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	9,649,102円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	31,400,879円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	25,017,559円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,341,477円
たわらノーロード　先進国株式	12,560,361,348円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	182,807,208円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	1,687,279,182円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	220,556,926円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	21,417,034円
たわらノーロード　バランス（標準型）	170,820,437円
たわらノーロード　バランス（積極型）	210,689,187円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	679,207円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	87,361,862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）	221,445,241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）	148,639,917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）	272,435,133円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	64,826円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,016,319円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	2,266,521円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,420,066円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,509,389円
たわらノーロード　全世界株式	43,655,941円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	42,509,430,766円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	193,388,229円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	174,926,694円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	869,857,182円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,054,769,121円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	115,910,652円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	337,771,916円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	298,101,626円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	27,385,880円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	791,786,777円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	183,095,326円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	205,493,156円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	158,721,148円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	276,167,333円
投資のソムリエ	1,161,944,551円
クルーズコントロール	194,095,583円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	110,373,729円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	175,176,786円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	97,275,584円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	196,533円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	553,382円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,320,962円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	63,170,120円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	668,936,157円
ワールドアセットバランス（基本コース）	439,823,625円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,639,187,898円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,728,654円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	1,382,325円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	570,776円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,592,751円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	11,927,518円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	582,731,561円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	142,335,138円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	266,163円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	227,452円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	257,387円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	65,132円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,230,222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）	259,114,483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）	85,275,158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）	1,998,428,508円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	9,249,451,217円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	205,956,931円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,549,100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）	858,417円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	59,896,431円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	135,162,193円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,631,553円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	48,605,100円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,643,533円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,877,279円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,536,268円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,685,027円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	373,454,066円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	491,085,406円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,600,951,538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）	575,082,958円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	95,885,349円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	615,903,478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）	27,505,763円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,370,598円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,443,862円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	207,125,284円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,495,642円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	88,530,403円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド３ＶＡ（適格機関投資家限定）	152,767,521円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド４ＶＡ（適格機関投資家限定）	355,658,616円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,133,637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	88,613,273,386円
２．　受益権の総数	88,613,273,386口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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2月25日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△15,305,332,405
投資信託受益証券	△12,610,783
投資証券	△128,844,032
合計	△15,446,787,220

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和2年2月18日から令和2年2月25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2月25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	500,249,789	－	497,268,370	2,981,419
アメリカ・ドル	347,443,996	－	345,329,300	2,114,696
イギリス・ポンド	44,978,173	－	44,852,900	125,273
オーストラリア・ドル	28,041,552	－	27,703,620	337,932
カナダ・ドル	14,899,100	－	14,765,340	133,760
ユーロ	64,886,968	－	64,617,210	269,758
合計	500,249,789	－	497,268,370	2,981,419

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	令和2年2月25日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	9,329,196,127	－	9,156,565,827	△172,630,300
合計	9,329,196,127	－	9,156,565,827	△172,630,300

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年2月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.0425円 (40,425円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

令和2年2月25日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	32,549	2,009.290	65,400,380.210	
	ABBOTT LABORATORIES	136,553	84.630	11,556,480.390	
	AES CORP	47,598	20.250	963,859.500	
	ABIOMED INC	3,574	165.290	590,746.460	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	68,481	146.430	10,027,672.830	
	ADVANCED MICRO DEVICES	79,023	49.120	3,881,609.760	
	ADOBE INC	37,540	357.410	13,417,171.400	
	CHUBB LTD	35,214	160.490	5,651,494.860	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	17,359	245.530	4,262,155.270	
	ALLEGHANY CORP	1,094	776.000	848,944.000	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	119.570	723,637.640	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	109.610	375,085.420	
	ALLSTATE CORP	25,832	120.540	3,113,789.280	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	55,687	175.270	9,760,260.490	
	AMGEN INC	46,484	217.880	10,127,933.920	
	HESS CORP	21,367	60.220	1,286,720.740	
	AMERICAN EXPRESS CO	54,474	128.190	6,983,022.060	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	39,277	100.040	3,929,271.080	
	AFLAC INC	57,028	49.230	2,807,488.440	
	AMERICAN INTL GROUP	68,037	45.700	3,109,290.900	
	AMERCO	585	343.460	200,924.100	
	ANALOG DEVICES	29,105	117.360	3,415,762.800	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,192	99.020	1,801,371.840	
	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	60,452	41.630	2,516,616.760	
	JONES LANG LASALLE INC	4,087	154.300	630,624.100	
	VALERO ENERGY CORP	31,433	78.100	2,454,917.300	
	APACHE CORP	31,470	26.750	841,822.500	
	ANSYS INC	6,770	276.740	1,873,529.800	
	APPLE INC	349,977	298.180	104,356,141.860	
	APPLIED MATERIALS INC	71,121	61.080	4,344,070.680	
	ALBEMARLE CORP	7,634	89.610	684,082.740	

ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	42,146	42.820	1,804,691.720	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	7,813	100.940	788,644.220	
AMEREN CORP	19,487	84.820	1,652,887.340	
ARROW ELECTRONICS INC	5,795	75.050	434,914.750	
AUTOLIV INC	5,913	70.140	414,737.820	
AUTODESK INC	17,235	194.370	3,349,966.950	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	33,493	174.540	5,845,868.220	
AUTOZONE INC	1,917	1,056.640	2,025,578.880	
AVERY DENNISON CORP	6,549	127.430	834,539.070	
BALL CORP	25,262	76.370	1,929,258.940	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	102,032	221.690	22,619,474.080	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,637	43.130	2,874,053.810	
BAXTER INTERNATIONAL INC	37,097	89.530	3,321,294.410	
BECTON DICKINSON & CO	20,772	250.530	5,204,009.160	
AMETEK INC	17,821	95.360	1,699,410.560	
VERIZON COMM INC	320,311	57.990	18,574,834.890	
WR BERKLEY CORP	12,201	77.040	939,965.040	
BEST BUY CO INC	18,720	85.500	1,600,560.000	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,524	385.330	587,242.920	
YUM! BRANDS INC	23,110	100.250	2,316,777.500	
FIRSTENERGY CORP	43,584	50.630	2,206,657.920	
BOEING CO	41,369	317.900	13,151,205.100	
ROBERT HALF INTL INC	8,324	56.670	471,721.080	
BORGWARNER INC	17,210	32.160	553,473.600	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,658	41.080	4,381,510.640	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9,988	72.140	720,534.320	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	8,766	113.020	990,733.320	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,929	726.580	1,401,572.820	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	181,488	63.970	11,609,787.360	
INGREDION INC	5,305	93.500	496,017.500	
ONEOK INC	32,427	75.070	2,434,294.890	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	106.400	627,760.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	141.950	877,392.950	
SEMPRA ENERGY	21,599	154.160	3,329,701.840	
FEDEX CORP	19,368	154.850	2,999,134.800	
VERISIGN INC	8,048	200.410	1,612,899.680	
AMPHENOL CORP	22,763	97.670	2,223,262.210	
BROWN-FORMAN CORP	24,381	67.660	1,649,618.460	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	125,254	7.040	881,788.160	

CSX CORP	59,540	78.060	4,647,692.400	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	15.050	472,810.800	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	48.020	674,681.000	
SEAGATE TECHNOLOGY	20,052	52.040	1,043,506.080	
CONSTELLATION BRANDS INC	12,820	201.540	2,583,742.800	
CARDINAL HEALTH INC	22,950	58.140	1,334,313.000	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	31,962	37.760	1,206,885.120	
CATERPILLAR INC	43,258	132.170	5,717,409.860	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	111.650	1,101,427.250	
CITRIX SYSTEMS INC	9,464	111.940	1,059,400.160	
CENTURYLINK INC	80,424	13.050	1,049,533.200	
CERNER CORP	25,143	73.380	1,844,993.340	
JPMORGAN CHASE & CO	247,652	132.160	32,729,688.320	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,896	75.510	1,502,346.960	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,222	107.480	1,206,140.560	
CINTAS CORP	6,604	288.160	1,903,008.640	
CISCO SYSTEMS INC	330,940	44.000	14,561,360.000	
CLOROX COMPANY	9,876	167.190	1,651,168.440	
COCA-COLA CO/THE	314,758	58.650	18,460,556.700	
COPART INC	16,749	92.770	1,553,804.730	
COGNEX CORP	12,284	48.840	599,950.560	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,779	74.420	4,672,013.180	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	22,145	134.830	2,985,810.350	
COMERICA INC	11,985	59.780	716,463.300	
NRG ENERGY, INC.	21,039	38.140	802,427.460	
COMCAST CORP-CL A	351,108	44.600	15,659,416.800	
CONAGRA BRANDS INC	35,802	29.230	1,046,492.460	
CONSOLIDATED EDISON INC	25,220	88.890	2,241,805.800	
CMS ENERGY CORP	22,937	68.250	1,565,450.250	
COOPER COS INC	3,936	347.120	1,366,264.320	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	13,220	54.200	716,524.000	
CORNING INC	58,376	27.000	1,576,152.000	
SEALED AIR CORP	13,870	33.920	470,470.400	
HEICO CORP-CL A	5,292	94.940	502,422.480	
CUMMINS INC	11,963	162.780	1,947,337.140	
DR HORTON INC	28,355	60.430	1,713,492.650	
DANAHER CORP	48,299	156.820	7,574,249.180	
MOODY'S CORP	12,922	266.260	3,440,611.720	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	42,370	67.420	2,856,585.400	
TARGET CORP	39,421	113.780	4,485,321.380	
DEERE & CO	23,824	171.860	4,094,392.640	
MORGAN STANLEY	95,198	49.680	4,729,436.640	
REPUBLIC SERVICES INC	18,081	98.930	1,788,753.330	
COSTAR GROUP INC	2,785	706.940	1,968,827.900	

THE WALT DISNEY CO	139,440	133.010	18,546,914.400	
DOLLAR TREE INC	18,697	91.040	1,702,174.880	
DOVER CORP	11,113	114.950	1,277,439.350	
OMNICOM GROUP	17,365	76.240	1,323,907.600	
DTE ENERGY CO	14,817	132.860	1,968,586.620	
DUKE ENERGY CORP	56,801	102.300	5,810,742.300	
FLOWSERVE CORP	9,882	43.570	430,558.740	
DARDEN RESTAURANTS INC	9,700	117.890	1,143,533.000	
EBAY INC	63,771	37.260	2,376,107.460	
BANK OF AMERICA CORP	684,479	32.730	22,402,997.670	
CITIGROUP INC	174,672	72.530	12,668,960.160	
EASTMAN CHEMICAL CO	9,423	71.040	669,409.920	
E*TRADE FINANCIAL CORP	17,104	50.380	861,699.520	
EATON CORP PLC	31,818	101.650	3,234,299.700	
EATON VANCE CORP	9,184	48.110	441,842.240	
CADENCE DESIGN SYS INC	22,628	71.390	1,615,412.920	
DISH NETWORK CORP	17,749	38.360	680,851.640	
ECOLAB INC	20,479	202.520	4,147,407.080	
PERKINELMER INC	8,338	88.620	738,913.560	
ELECTRONIC ARTS INC	22,491	107.030	2,407,211.730	
SALESFORCE.COM INC	64,404	185.940	11,975,279.760	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	157.750	353,833.250	
EMERSON ELECTRIC CO	46,705	69.190	3,231,518.950	
ATMOS ENERGY CORP	8,650	116.220	1,005,303.000	
ENTERGY CORP	15,031	129.740	1,950,121.940	
EOG RESOURCES INC	44,603	69.910	3,118,195.730	
EQUIFAX INC	9,161	155.700	1,426,367.700	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	17,346	198.780	3,448,037.880	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12,515	72.970	913,219.550	
EXXON MOBIL CORP	327,609	56.360	18,464,043.240	
FMC CORP	10,209	102.400	1,045,401.600	
NEXTERA ENERGY INC	37,404	273.940	10,246,451.760	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	2,875	295.060	848,297.500	
ASSURANT INC	4,594	137.240	630,480.560	
FASTENAL CO	45,891	37.760	1,732,844.160	
FIFTH THIRD BANCORP	58,144	28.310	1,646,056.640	
M&T BANK CORP	9,999	163.860	1,638,436.140	
FISERV INC	44,349	116.590	5,170,649.910	
FLIR SYSTEMS INC	11,623	56.790	660,070.170	
FORD MOTOR CO	310,836	7.570	2,353,028.520	
FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	24.190	573,617.470	
FREEPORT-MCMORAN INC	114,993	11.240	1,292,521.320	
FLEX LTD	35,127	12.740	447,517.980	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	14,270	106.210	1,515,616.700	
GAP INC/THE	18,295	16.290	298,025.550	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	54.720	1,006,081.920	
GENERAL DYNAMICS CORP	18,821	184.610	3,474,544.810	
GENERAL MILLS INC	46,141	53.720	2,478,694.520	

GENUINE PARTS CO	11,605	95.720	1,110,830.600	
GILEAD SCIENCES INC	97,831	72.900	7,131,879.900	
GARTNER INC	7,384	149.180	1,101,545.120	
MCKESSON CORP	14,558	165.560	2,410,222.480	
NVIDIA CORP	44,712	273.280	12,218,895.360	
GENERAL ELECTRIC CO	674,757	11.860	8,002,618.020	
WW GRAINGER INC	3,762	296.040	1,113,702.480	
HALLIBURTON CO	66,843	19.830	1,325,496.690	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,728	68.190	2,231,722.320	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	24,900	224.540	5,591,046.000	
HARLEY-DAVIDSON INC	12,901	34.130	440,311.130	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,586	219.060	3,852,389.160	
HASBRO INC	9,473	87.090	825,003.570	
HENRY SCHEIN INC	11,516	64.930	747,733.880	
HEICO CORP	2,278	119.000	271,082.000	
HERSHEY FOODS CORP	11,292	158.940	1,794,750.480	
HP INC	117,482	22.100	2,596,352.200	
F5 NETWORKS INC	4,874	130.260	634,887.240	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,472	77.750	814,198.000	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	23.290	650,699.310	
HOLLYFRONTIER CORP	11,855	39.860	472,540.300	
HOLOGIC INC	19,688	51.400	1,011,963.200	
UNUM GROUP	15,185	27.590	418,954.150	
HOME DEPOT INC	84,667	239.700	20,294,679.900	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	13,185	93.000	1,226,205.000	
HORMEL FOODS CORP	24,161	44.570	1,076,855.770	
CENTERPOINT ENERGY INC	37,678	25.220	950,239.160	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	247.220	720,151.860	
HUMANA INC	10,384	346.160	3,594,525.440	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,000	105.350	632,100.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	79,517	13.500	1,073,479.500	
BIOGEN INC	14,119	325.980	4,602,511.620	
IDEX CORP	6,154	169.440	1,042,733.760	
ILLINOIS TOOL WORKS	24,755	183.060	4,531,650.300	
INTUIT INC	20,054	286.430	5,744,067.220	
IDEXX LABORATORIES INC	6,791	269.810	1,832,279.710	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	57.100	625,816.000	
INGERSOLL-RAND PLC	18,244	142.080	2,592,107.520	
INTEL CORP	342,807	61.760	21,171,760.320	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,965	127.910	1,018,803.150	
INTERNATIONAL PAPER CO	29,411	41.350	1,216,144.850	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28,862	23.960	691,533.520	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,108	101.950	1,030,510.600	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,019	167.930	1,010,770.670	
INCYTE CORP	13,798	78.870	1,088,248.260	
JOHNSON & JOHNSON	204,338	145.910	29,814,957.580	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28,753	56.590	1,627,132.270	
KLA CORPORATION	12,724	153.730	1,956,060.520	
DEVON ENERGY CORP	33,312	19.180	638,924.160	
KELLOGG CO	19,181	64.500	1,237,174.500	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	43.440	502,166.400	
KEYCORP	79,497	18.980	1,508,853.060	
KIMBERLY-CLARK CORP	26,125	140.120	3,660,635.000	
BLACKROCK INC/NEW YORK	8,929	528.000	4,714,512.000	
KOHLS CORP	11,910	43.130	513,678.300	
KROGER CO	63,944	30.270	1,935,584.880	
LAM RESEARCH CORP	11,139	300.460	3,346,823.940	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,716	370.060	1,005,082.960	
PACKAGING CORP OF AMERICA	7,143	98.940	706,728.420	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,254	97.110	1,287,095.940	
LEGGETT & PLATT INC	10,928	43.150	471,543.200	
LENNAR CORP	22,753	69.160	1,573,597.480	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	20,795	22.690	471,838.550	
ELI LILLY & CO	67,242	138.150	9,289,482.300	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	55.100	845,454.400	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	53,913	98.490	5,309,891.370	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	23,662	80.500	1,904,791.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	19,676	419.350	8,251,130.600	
LOEWS CORP	21,759	52.330	1,138,648.470	
LOWE'S COS INC	59,941	122.910	7,367,348.310	
DOMINION ENERGY INC	63,796	89.800	5,728,880.800	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	29.700	1,145,618.100	
MCCORMICK & CO INC	9,935	160.990	1,599,435.650	
MCDONALD'S CORPORATION	58,712	213.520	12,536,186.240	
S&P GLOBAL INC	19,018	290.900	5,532,336.200	
EVEREST RE GROUP LTD	3,114	283.040	881,386.560	
MANPOWERGROUP INC	4,555	87.210	397,241.550	
MARKEL CORPORATION	1,065	1,320.040	1,405,842.600	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	16,561	226.290	3,747,588.690	
MARSH & MCLENNAN COS	38,872	113.330	4,405,363.760	
MASCO CORP	21,216	45.100	956,841.600	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	4,786	249.480	1,194,011.280	
METLIFE INC	61,260	49.380	3,025,018.800	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,386	58.990	1,261,560.140	
MEDTRONIC PLC	103,771	111.350	11,554,900.850	
ACTIVISION BLIZZARD INC	60,243	62.310	3,753,741.330	
CVS HEALTH CORP	100,451	67.920	6,822,631.920	
MERCK & CO.INC.	198,319	81.330	16,129,284.270	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	19.350	632,474.100	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,049	187.550	1,509,589.950	
MICROSOFT CORP	561,788	170.890	96,003,951.320	
MICRON TECH INC	84,794	55.010	4,664,517.940	
MIDDLEBY CORP	4,188	109.370	458,041.560	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	18,473	100.130	1,849,701.490	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,715	22.960	1,118,496.400	
3M CO	44,296	152.550	6,757,354.800	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	128.790	640,859.040	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,593	181.800	2,289,407.400	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,614	167.330	1,274,050.620	
MYLAN NV	43,574	20.310	884,987.940	
ILLUMINA INC	11,619	281.120	3,266,333.280	
XCEL ENERGY INC	38,963	70.370	2,741,826.310	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	6,545	96.930	634,406.850	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	27,194	21.700	590,109.800	
NETAPP INC	17,963	50.100	899,946.300	
NEWELL BRANDS INC	33,317	18.240	607,702.080	
NEWMONT CORP	63,869	50.260	3,210,055.940	
NVR INC	263	3,988.410	1,048,951.830	
NIKE INC-CL B	96,700	95.910	9,274,497.000	
NOBLE ENERGY INC	39,436	16.470	649,510.920	
NORDSTROM INC	9,487	38.970	369,708.390	
NORFOLK SOUTHERN CORP	20,260	203.000	4,112,780.000	
EVERSOURCE ENERGY	24,768	95.210	2,358,161.280	
NISOURCE INC	31,548	29.250	922,779.000	
TAPESTRY INC	21,790	25.550	556,734.500	
NORTHERN TRUST CORP	15,959	96.530	1,540,522.270	
NORTHROP GRUMMAN CORP	12,194	359.390	4,382,401.660	
WELLS FARGO & CO	323,987	46.390	15,029,756.930	
NUCOR CORP	24,042	47.290	1,136,946.180	
CHENIERE ENERGY INC	19,175	51.910	995,374.250	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35,969	98.240	3,533,594.560	

OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	69,550	39.480	2,745,834.000	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5,209	216.400	1,127,227.600	
OGE ENERGY CORP	16,028	44.500	713,246.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5,822	387.770	2,257,596.940	
ORACLE CORP	180,697	52.650	9,513,697.050	
PACCAR INC	27,394	72.730	1,992,365.620	
PTC INC	7,766	85.650	665,157.900	
EXELON CORP	73,721	48.820	3,599,059.220	
PARKER HANNIFIN CORP	10,092	203.110	2,049,786.120	
PAYCHEX INC	25,329	87.210	2,208,942.090	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,163	240.110	1,479,797.930	
PPL CORPORATION	53,724	35.120	1,886,786.880	
PEPSICO INC	108,292	142.640	15,446,770.880	
PENTAIR PLC	12,511	43.590	545,354.490	
PFIZER INC	428,075	34.670	14,841,360.250	
ESSENTIAL UTILITIES INC	15,516	51.670	801,711.720	
CONOCOPHILLIPS	85,896	56.380	4,842,816.480	
PVH CORP	5,205	81.230	422,802.150	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,908	135.970	1,755,100.760	
ALTRIA GROUP INC	144,297	43.800	6,320,208.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	34,494	148.810	5,133,052.140	
BROWN & BROWN INC	17,294	47.310	818,179.140	
POLARIS INC	4,095	86.510	354,258.450	
GARMIN LTD	10,774	95.360	1,027,408.640	
PPG INDUSTRIES INC	19,031	115.270	2,193,703.370	
IPG PHOTONICS CORP	2,608	132.170	344,699.360	
COSTCO WHOLESALE CORP	33,984	313.620	10,658,062.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,483	131.750	2,435,135.250	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	112.340	1,222,596.220	
PROCTER & GAMBLE CO	193,908	123.300	23,908,856.400	
PROGRESSIVE CORP	46,127	80.970	3,734,903.190	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	39,039	59.110	2,307,595.290	
PULTE GROUP INC	21,209	45.250	959,707.250	
GLOBAL PAYMENTS INC	23,692	200.420	4,748,350.640	
QUALCOMM INC	93,982	83.320	7,830,580.240	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,388	93.750	973,875.000	
EXACT SCIENCES CORP	11,306	95.560	1,080,401.360	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,161	192.640	608,935.040	
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,116	425.380	2,601,624.080	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	146.870	740,518.540	

RESMED INC	11,116	169.830	1,887,830.280	
US BANCORP	115,614	53.080	6,136,791.120	
SEATTLE GENETICS INC /WA	9,150	116.000	1,061,400.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31,500	45.650	1,437,975.000	
ROSS STORES INC	28,814	121.620	3,504,358.680	
ROLLINS INC	12,378	39.660	490,911.480	
ROPER TECHNOLOGIES INC	7,949	375.020	2,981,033.980	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,251	202.760	1,875,732.760	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	96.610	1,359,785.750	
RPM INTERNATIONAL INC	11,141	72.790	810,953.390	
RAYTHEON COMPANY	21,972	216.050	4,747,050.600	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,848	98.720	379,874.560	
ACCENTURE PLC-CL A	49,357	204.360	10,086,596.520	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	111,385	57.740	6,431,369.900	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,190	205.540	2,094,452.600	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	19,563	134.120	2,623,789.560	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	47,412	150.720	7,145,936.640	
BOOKING HOLDINGS INC	3,283	1,792.540	5,884,908.820	
SCHLUMBERGER LTD	106,593	30.930	3,296,921.490	
SCHWAB (CHARLES) CORP	89,867	43.800	3,936,174.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	15,590	154.330	2,406,004.700	
BUNGE LTD	10,622	53.020	563,178.440	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	66.100	704,163.300	
ANTHEM INC	19,728	277.500	5,474,520.000	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,749	94.930	1,210,262.570	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	51.730	1,147,112.750	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,367	567.100	3,610,725.700	
CENTENE CORP	46,124	59.350	2,737,459.400	
SVB FINANCIAL GROUP	4,044	243.270	983,783.880	
IAC INTERACTIVE CORP	6,252	221.570	1,385,255.640	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	42.840	486,276.840	
ACUITY BRANDS INC	3,087	112.820	348,275.340	
SNAP-ON INC	3,981	159.100	633,377.100	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,388	87.830	2,756,808.040	
ADVANCE AUTO PARTS	5,297	139.910	741,103.270	
EDISON INTERNATIONAL	26,652	76.320	2,034,080.640	
SOUTHERN CO	80,067	67.800	5,428,542.600	
TRUIST FINANCIAL CORP	103,681	53.770	5,574,927.370	
SOUTHWEST AIRLINES	11,352	54.110	614,256.720	
AT&T INC	565,686	38.050	21,524,352.300	
CHEVRON CORP	147,108	104.710	15,403,678.680	

STANLEY BLACK & DECKER INC	11,776	151.080	1,779,118.080	
STATE STREET CORP	29,590	74.010	2,189,955.900	
STARBUCKS CORP	92,312	84.520	7,802,210.240	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	29.320	514,478.040	
STRYKER CORP	25,850	215.550	5,571,967.500	
NETFLIX INC	33,860	368.700	12,484,182.000	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	19.920	975,183.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	37.770	369,881.610	
SYNOPSYS INC	11,855	145.940	1,730,118.700	
SYSCO CORP	38,229	75.540	2,887,818.660	
INTUITIVE SURGICAL INC	8,850	580.170	5,134,504.500	
TELEFLEX INC	3,455	361.590	1,249,293.450	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	12.700	1,121,689.400	
TERADYNE INC	12,162	63.880	776,908.560	
TEXAS INSTRUMENTS INC	72,056	121.440	8,750,480.640	
TEXTRON INC	16,304	45.880	748,027.520	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	30,995	323.150	10,016,034.250	
TIFFANY & CO	8,733	133.960	1,169,872.680	
GLOBE LIFE INC	7,282	106.670	776,770.940	
DAVITA INC	8,159	82.860	676,054.740	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	96.460	923,411.580	
TRIMBLE INC	20,073	44.270	888,631.710	
TYLER TECHNOLOGIES INC	2,851	326.440	930,680.440	
TYSON FOODS INC	22,736	75.590	1,718,614.240	
UGI CORP	14,797	40.570	600,314.290	
MARATHON OIL CORP	58,418	9.460	552,634.280	
UNION PACIFIC CORP	54,482	176.800	9,632,417.600	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	63,451	146.580	9,300,647.580	
UNITEDHEALTH GROUP INC	73,307	277.790	20,363,951.530	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	141.230	868,988.190	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	135.550	979,484.300	
VF CORP	26,750	81.830	2,188,952.500	
VIACOMCBS INC	45,361	26.930	1,221,571.730	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	19,829	237.010	4,699,671.290	
VULCAN MATERIALS CO	9,794	130.220	1,275,374.680	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	60,250	49.030	2,954,057.500	
WALMART INC	110,464	116.320	12,849,172.480	
WASTE MANAGEMENT INC	32,300	123.990	4,004,877.000	
WATERS CORP	5,468	210.070	1,148,662.760	
ALLERGAN PLC	25,262	198.170	5,006,170.540	

WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	5,240	166.890	874,503.600	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	109.820	1,007,708.320	
VAIL RESORTS INC	3,109	242.210	753,030.890	
WESTERN DIGITAL CORP	22,567	63.560	1,434,358.520	
WABTEC CORP	14,964	74.290	1,111,675.560	
WHIRLPOOL CORP	4,614	140.770	649,512.780	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,902	111.190	1,545,763.380	
WYNN RESORTS LTD	7,970	120.170	957,754.900	
NASDAQ INC	9,020	114.740	1,034,954.800	
CME GROUP INC	27,673	209.300	5,791,958.900	
WILLIAMS COS INC	90,718	20.400	1,850,647.200	
LKQ CORP	22,196	32.330	717,596.680	
ALLIANT ENERGY CORP	17,221	58.835	1,013,197.530	
WEC ENERGY GROUP INC	23,839	101.820	2,427,286.980	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	21,820	45.920	1,001,974.400	
CARMAX INC	12,081	97.450	1,177,293.450	
XILINX INC	18,997	85.180	1,618,164.460	
TJX COMPANIES INC	93,010	61.750	5,743,367.500	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,128	227.400	938,707.200	
ZIONS BANCORP NA	13,142	43.760	575,093.920	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	5.050	138,370.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	76,400	5.230	399,572.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	15,700	57.190	897,883.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	30.750	525,825.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	8,178	122.290	1,000,087.620	
SIGNATURE BANK	4,171	143.560	598,788.760	
CBRE GROUP INC	23,613	60.070	1,418,432.910	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	20.730	263,934.360	
REGIONS FINANCIAL CORP	76,480	15.730	1,203,030.400	
DOMINO'S PIZZA INC	3,256	363.010	1,181,960.560	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	3,000	59.750	179,250.000	
T-MOBILE US INC	25,675	96.370	2,474,299.750	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,759	62.210	1,726,887.390	
MOSAIC CO/THE	28,249	19.410	548,313.090	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	2,892	341.910	988,803.720	
CELANESE CORP	10,326	103.950	1,073,387.700	
DEXCOM INC	7,216	294.050	2,121,864.800	
DISCOVERY INC-A	10,423	28.310	295,075.130	
EXPEDIA GROUP INC	11,527	112.310	1,294,597.370	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	38.830	717,384.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,312	164.470	1,696,014.640	

LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	19.730	671,273.790	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	44,248	93.850	4,152,674.800	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	14,696	15.480	227,494.080	
LIVE NATION	11,339	68.260	774,000.140	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,040	885.000	1,805,400.000	
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4,508	75.470	340,218.760	
TRANSDIGM GROUP INC	3,681	601.450	2,213,937.450	
MASTERCARD INC	69,914	324.670	22,698,978.380	
HANESBRANDS INC	27,619	14.080	388,875.520	
WESTERN UNION CO	35,222	25.110	884,424.420	
OWENS CORNING	7,756	61.870	479,863.720	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,113	113.830	1,264,992.790	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	57.990	510,717.930	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	7,067	62.570	442,182.190	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	19.530	338,845.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	116.440	1,068,453.440	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	29,545	15.970	471,833.650	
DELTA AIR LINES INC	11,158	54.230	605,098.340	
INSULET CORP	4,781	207.310	991,149.110	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	6,038	23.420	141,409.960	
DISCOVER FINANCIAL	23,978	73.150	1,753,990.700	
TE CONNECTIVITY LTD	25,641	88.090	2,258,715.690	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	15,970	74.590	1,191,202.300	
WABCO HOLDING INC	4,076	135.650	552,909.400	
LULULEMON ATHLETICA INC	8,255	246.210	2,032,463.550	
VMWARE INC	6,532	151.690	990,839.080	
MERCADOLIBRE INC	3,500	673.460	2,357,110.000	
ULTA BEAUTY INC	4,577	285.570	1,307,053.890	
INVESCO LTD	33,443	16.780	561,173.540	
MSCI INC	6,714	303.530	2,037,900.420	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	120,348	85.570	10,298,178.360	
VISA INC	133,771	198.790	26,592,337.090	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	14,536	136.530	1,984,600.080	
DISCOVERY INC-C	30,421	27.130	825,321.730	
MARATHON PETROLEUM CORP	51,474	55.870	2,875,852.380	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,624	69.340	806,008.160	

KINDER MORGAN INC/DELAWARE	160,064	21.770	3,484,593.280	
XYLEM INC	13,237	86.430	1,144,073.910	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	20,876	79.650	1,662,773.400	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,479	234.840	817,008.360	
SPLUNK INC	11,194	160.050	1,791,599.700	
EPAM SYSTEMS INC	4,023	226.030	909,318.690	
HCA HEALTHCARE INC	20,649	140.020	2,891,272.980	
VERISK ANALYTICS INC	12,320	167.580	2,064,585.600	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	130.860	559,164.780	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,885	298.420	2,054,621.700	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	12,453	114.340	1,423,876.020	
NXP SEMICONDUCTOR NV	21,318	124.040	2,644,284.720	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	9,833	72.170	709,647.610	
TARGA RESOURCES CORP	19,038	37.760	718,874.880	
LEAR CORP	4,681	113.060	529,233.860	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	121.990	1,051,797.780	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	17,268	62.140	1,073,033.520	
DOLLAR GENERAL CORP	20,252	164.860	3,338,744.720	
FORTINET INC	11,150	108.700	1,212,005.000	
AON PLC	18,189	223.300	4,061,603.700	
TESLA INC	10,548	833.790	8,794,816.920	
GENERAL MOTORS CO	100,695	33.090	3,331,997.550	
XPO LOGISTICS INC	7,614	91.820	699,117.480	
TRIPADVISOR INC	9,263	26.900	249,174.700	
ALLY FINANCIAL INC	31,871	27.410	873,584.110	
CAPRI HOLDINGS LTD	12,138	26.540	322,142.520	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	59.930	615,660.890	
APTIV PLC	18,920	83.980	1,588,901.600	
PHILLIPS 66	34,235	86.560	2,963,381.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	5,885	115.030	676,951.550	
FACEBOOK INC	186,156	200.720	37,365,232.320	
IQVIA HOLDINGS INC	13,453	158.080	2,126,650.240	
DIAMONDBACK ENERGY INC	11,424	71.080	812,017.920	
SERVICENOW INC	14,406	333.560	4,805,265.360	
PALO ALTO NETWORKS INC	7,272	237.330	1,725,863.760	
WORKDAY INC	12,224	177.105	2,164,931.520	
ABBVIE INC	114,434	93.140	10,658,382.760	
ZOETIS INC	36,825	138.390	5,096,211.750	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	16,899	42.580	719,559.420	
COTY INC	23,813	10.700	254,799.100	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	13.610	411,879.430	

HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	42.120	592,839.000	
CDW CORP	11,406	129.540	1,477,533.240	
SPRINT CORP	63,882	9.820	627,321.240	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,199	25.450	259,564.550	
ARCONIC INC	30,749	33.070	1,016,869.430	
TWILIO INC	9,190	117.940	1,083,868.600	
SNAP INC	57,130	16.150	922,649.500	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	14,304	45.420	649,687.680	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5,006	49.500	247,797.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	49.660	705,420.300	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	15,410	14.140	217,897.400	
OKTA INC	8,816	126.800	1,117,868.800	
BLACK KNIGHT INC	12,700	73.540	933,958.000	
BAKER HUGHES CO	51,005	19.480	993,577.400	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	10,669	95.320	1,016,969.080	
ALTICE USA INC-A	13,887	28.220	391,891.140	
TECHNIPFMC LTD	31,257	16.020	500,737.140	
BROADCOM INC	30,762	291.600	8,970,199.200	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	5,725	234.150	1,340,508.750	
MONGODB INC	3,423	153.850	526,628.550	
BURLINGTON STORES INC	5,095	238.160	1,213,425.200	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	29,578	30.010	887,635.780	
VEEVA SYSTEMS INC	9,733	154.020	1,499,076.660	
TWITTER INC	57,562	35.890	2,065,900.180	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	45.680	603,615.520	
EVERGY INC	18,388	71.990	1,323,752.120	
ALLEGION PLC	7,469	126.950	948,189.550	
STERIS PLC	6,658	167.460	1,114,948.680	
DOCUSIGN INC	7,220	86.370	623,591.400	
WIX.COM LTD	4,000	131.500	526,000.000	
DROPBOX INC	17,573	21.760	382,388.480	
KKR & CO INC	37,307	31.630	1,180,020.410	
PERRIGO CO PLC	10,553	59.210	624,843.130	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20,655	104.020	2,148,533.100	
ARAMARK	18,144	41.280	748,984.320	
CIGNA CORP	29,083	200.360	5,827,069.880	
DELL TECHNOLOGIES INC	12,960	48.310	626,097.600	
DOW INC	56,434	46.240	2,609,508.160	
AMCOR PLC	130,000	9.930	1,290,900.000	
PINTEREST INC	13,183	21.650	285,411.950	
XEROX HOLDINGS CORP	17,455	34.860	608,481.300	
FOX CORP-A	26,257	34.690	910,855.330	
FOX CORP-B	13,009	34.270	445,818.430	
UBER TECHNOLOGIES INC	13,312	38.310	509,982.720	
CORTEVA INC	59,322	30.660	1,818,812.520	

	BLACKSTONE GROUP INC	50,889	58.560	2,980,059.840	
	GRUBHUB INC	8,158	54.570	445,182.060	
	PAYCOM SOFTWARE INC	3,923	295.770	1,160,305.710	
	SABRE CORP	19,809	20.580	407,669.220	
	ARISTA NETWORKS INC	4,441	213.750	949,263.750	
	IHS MARKIT LTD	29,796	77.450	2,307,700.200	
	FNF GROUP	21,372	43.500	929,682.000	
	SYNCHRONY FINANCIAL	43,986	32.250	1,418,548.500	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	35,820	36.060	1,291,669.200	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	114.880	397,140.160	
	CDK GLOBAL INC	9,969	49.380	492,269.220	
	WAYFAIR INC	5,091	75.540	384,574.140	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13,954	90.890	1,268,279.060	
	QORVO INC	8,871	96.340	854,632.140	
	ZAYO GROUP HOLDINGS INC	16,888	34.930	589,897.840	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	136.020	1,129,918.140	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.170	479,397.060	
	GODADDY INC	12,328	75.070	925,462.960	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	21.380	560,241.520	
	TRANSUNION	15,000	97.060	1,455,900.000	
	SQUARE INC	26,487	80.210	2,124,522.270	
	DUPONT DE NEMOURS INC	58,757	50.450	2,964,290.650	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	19,321	55.780	1,077,725.380	
	WESTROCK CO	18,284	37.570	686,929.880	
	KRAFT HEINZ CO	51,163	26.630	1,362,470.690	
	FORTIVE CORP	22,500	72.550	1,632,375.000	
	MATCH GROUP INC	4,599	70.150	322,619.850	
	WASTE CONNECTIONS INC	20,417	101.970	2,081,921.490	
	ALPHABET INC-CL A	23,132	1,419.860	32,844,201.520	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	104,040	13.710	1,426,388.400	
	PAYPAL HOLDINGS INC	86,404	116.440	10,060,881.760	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,471	25.200	893,869.200	
	DXC TECHNOLOGY CO	20,848	28.150	586,871.200	
	ZILLOW GROUP INC-C	8,166	59.690	487,428.540	
	ALPHABET INC-CL C	24,252	1,421.590	34,476,400.680	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	163.960	517,949.640	
	LINDE PLC	41,798	210.550	8,800,568.900	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	48.040	569,129.880	
	ROKU INC	6,674	116.990	780,791.260	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	11,986	528.700	6,336,998.200	
	VISTRA ENERGY CORP	30,000	22.980	689,400.000	
アメリカ・ドル　小計		23,287,756		2,129,738,041.640	

				(236,209,246,195)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	8.162	259,535.270	
	ASHTEAD GROUP	36,689	26.080	956,849.120	
	SEVERN TRENT PLC	18,217	26.560	483,843.520	
	BHP GROUP PLC	161,284	15.698	2,531,836.230	
	BARCLAYS PLC	1,342,831	1.700	2,282,812.700	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	8.370	688,708.710	
	BT GROUP PLC	630,777	1.512	953,734.820	
	BUNZL PLC	27,838	20.010	557,038.380	
	EASYJET PLC	13,628	12.570	171,303.960	
	AVIVA PLC	314,691	3.895	1,225,721.440	
	CRODA INTERNATIONAL	10,391	49.200	511,237.200	
	DIAGEO PLC	182,812	30.120	5,506,297.440	
	SCHRODERS PLC	10,932	31.960	349,386.720	
	DCC PLC	7,898	59.820	472,458.360	
	NATIONAL GRID PLC	264,642	10.446	2,764,450.330	
	KINGFISHER PLC	165,680	2.079	344,448.720	
	BAE SYSTEMS PLC	248,672	6.596	1,640,240.510	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	177,272	32.365	5,737,408.280	
	HALMA PLC	27,901	21.450	598,476.450	
	NEXT PLC	10,018	67.640	677,617.520	
	IMPERIAL BRANDS PLC	71,656	17.014	1,219,155.180	
	JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	26.260	394,346.420	
	ANGLO AMERICAN PLC	78,981	19.428	1,534,442.860	
	COMPASS GROUP PLC	119,560	18.905	2,260,281.800	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,561,212	5.508	8,599,155.690	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	452,758	3.008	1,361,896.060	
	CENTRICA PLC	471,340	0.767	361,517.780	
	UNILEVER PLC	85,586	44.830	3,836,820.380	
	MEGGITT PLC	62,181	5.944	369,603.860	
	MORRISON SUPERMARKETS	168,676	1.829	308,508.400	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	10.320	562,305.840	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	5.472	442,487.800	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,547	25.430	649,660.210	
	PEARSON PLC	65,009	5.796	376,792.160	
	PERSIMMON PLC	26,085	31.840	830,546.400	
	PRUDENTIAL PLC	204,940	14.205	2,911,172.700	
	RIO TINTO PLC	87,436	39.655	3,467,274.580	
	VODAFONE GROUP PLC	2,043,718	1.506	3,077,839.300	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	54,464	62.470	3,402,366.080	
	RELX PLC	147,523	20.040	2,956,360.920	
	RENTOKIL INITIAL PLC	140,617	5.020	705,897.340	

ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	139,268	6.284	875,160.110	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	397,434	1.977	785,727.010	
ST JAMES'S PLACE PLC	37,685	11.230	423,202.550	
SSE PLC	74,684	16.555	1,236,393.620	
BP PLC	1,574,009	4.382	6,897,307.430	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	7.578	660,127.150	
SMITHS GROUP PLC	31,720	16.680	529,089.600	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	5,518	90.800	501,034.400	
STANDARD CHARTERED PLC	218,329	6.066	1,324,383.710	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,393,991	0.531	2,864,209.220	
TAYLOR WIMPLEY PLC	252,287	2.243	565,879.740	
TESCO PLC	757,316	2.493	1,887,988.780	
3I GROUP PLC	76,643	11.305	866,449.110	
SMITH & NEPHEW PLC	68,027	18.900	1,285,710.300	
GLAXOSMITHKLINE PLC	386,219	16.298	6,294,597.260	
WEIR GROUP	19,161	12.610	241,620.210	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	24,660	83.000	2,046,780.000	
WPP PLC	95,148	9.244	879,548.110	
ASTRAZENECA PLC	101,556	74.460	7,561,859.760	
WHITBREAD PLC	9,814	44.510	436,821.140	
CARNIVAL PLC	13,350	28.050	374,467.500	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	176,730	1.790	316,346.700	
INTERTEK GROUP PLC	12,083	56.700	685,106.100	
BURBERRY GROUP PLC	31,686	17.950	568,763.700	
INTERCONTINENTAL HOTELS	12,460	47.410	590,728.600	
ITV PLC	254,308	1.264	321,445.310	
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.069	283,897.830	
G4S PLC	122,250	1.946	237,898.500	
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	22.620	359,499.660	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	8,233	52.740	434,208.420	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	333,687	18.218	6,079,109.760	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	286,367	18.220	5,217,606.740	
TUI AG-DI	29,824	7.676	228,929.020	
AVEVA GROUP PLC	5,704	47.160	269,000.640	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	201,144	3.074	618,316.650	
EXPERIAN PLC	69,842	27.760	1,938,813.920	
MONDI PLC	39,767	16.360	650,588.120	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	20,927	16.755	350,631.880	
OCADO GROUP PLC	31,011	10.955	339,725.500	
INFORMA PLC	102,475	7.550	773,686.250	
GLENCORE PLC	866,421	2.115	1,832,480.410	

	GVC HOLDINGS PLC	49,618	8.346	414,111.820	
	EVRAZ PLC	48,765	3.676	179,260.140	
	NMC HEALTH PLC	8,149	8.482	69,119.810	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.248	366,030.110	
	COCA-COLA HBC AG	15,208	27.290	415,026.320	
	FERGUSON PLC	17,128	73.400	1,257,195.200	
	M&G PLC	204,940	2.314	474,231.160	
	JD SPORTS FASHION PLC	32,086	8.242	264,452.810	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	26,100	7.481	195,254.100	
	AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.486	418,845.120	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	2.262	825,030.570	
イギリス・ポンド　小計		23,261,639		133,855,535.020 (19,182,836,724)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	79,754	27.810	2,217,958.740	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	106,399	23.000	2,447,177.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	536.000	943,360.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.070	1,539,159.380	
	ISRAEL CHEMICALS LTD	49,411	12.850	634,931.350	
	NICE LTD	4,902	587.600	2,880,415.200	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	89.100	930,560.400	
	AZRIELI GROUP	2,291	264.800	606,656.800	
イスラエル・シュケル　小計		357,095		12,200,218.870 (394,799,083)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	12,432	77.480	963,231.360	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	218,180	26.830	5,853,769.400	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	265,407	25.500	6,767,878.500	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	115,662	11.000	1,272,282.000	
	TELSTRA CORP LTD	296,965	3.710	1,101,740.150	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	39,014	9.940	387,799.160	
	AMP LTD	302,414	1.965	594,243.510	
	ASX LTD	15,573	79.300	1,234,938.900	
	BHP GROUP LTD	228,136	37.090	8,461,564.240	
	CALTEX AUSTRALIA LTD	20,946	34.470	722,008.620	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	14,867	4.550	67,644.850	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	16.720	636,028.800	
	CSL LIMITED	35,166	325.460	11,445,126.360	
	REA GROUP LTD	4,119	109.400	450,618.600	
	TRANSURBAN GROUP	206,475	16.070	3,318,053.250	
	COCA-COLA AMATIL LTD	48,601	12.750	619,662.750	
	COCHLEAR LTD	4,381	224.510	983,578.310	

ORIGIN ENERGY LTD	132,860	7.530	1,000,435.800	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	137,026	87.990	12,056,917.740	
BORAL LIMITED	86,101	4.880	420,172.880	
RIO TINTO LIMITED	28,081	95.260	2,674,996.060	
APA GROUP	94,106	11.150	1,049,281.900	
ARISTOCRAT LEISU	45,323	36.580	1,657,915.340	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	180,573	6.670	1,204,421.910	
TPG TELECOM LTD	28,719	7.860	225,731.340	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3,275	37.530	122,910.750	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	33,926	29.730	1,008,619.980	
ORICA LTD	27,865	21.420	596,868.300	
CIMIC GROUP LTD	8,709	27.140	236,362.260	
LEND LEASE CORP LTD	42,974	19.050	818,654.700	
BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	12.630	466,564.830	
SYDNEY AIRPORT	85,130	8.200	698,066.000	
MACQUARIE GROUP LTD	24,765	145.690	3,608,012.850	
WORLEY LTD	27,772	13.850	384,642.200	
SUNCORP GROUP LTD	104,783	12.220	1,280,448.260	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	226,421	27.110	6,138,273.310	
NEWCREST MINING LTD	62,080	30.170	1,872,953.600	
OIL SEARCH LTD	105,470	6.150	648,640.500	
INCITEC PIVOT LTD	136,426	2.990	407,913.740	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	6.020	374,937.640	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	107,820	14.790	1,594,657.800	
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	45,707	10.070	460,269.490	
SANTOS LTD	132,862	7.660	1,017,722.920	
SONIC HEALTHCARE	34,684	30.600	1,061,330.400	
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	4,466	21.670	96,778.220	
TABCORP HOLDINGS LTD	148,535	4.040	600,081.400	
WESFARMERS LTD	86,051	44.130	3,797,430.630	
ALUMINA LIMITED	184,613	2.160	398,764.080	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	75,944	31.080	2,360,339.520	
WOOLWORTHS GROUP LTD	95,647	42.650	4,079,344.550	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	68.000	679,660.000	
SEEK LTD	25,899	22.410	580,396.590	
AUSNET SERVICES	165,066	1.710	282,262.860	
AGL ENERGY LTD	49,644	20.900	1,037,559.600	
BRAMBLES LTD	126,693	12.770	1,617,869.610	
CROWN RESORTS LTD	32,861	11.030	362,456.830	
AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	5.230	785,284.500	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	11.630	670,667.210	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.900	600,039.000	
	SOUTH32 LTD(AUD)	357,525	2.470	883,086.750	
	COLES GROUP LTD	81,608	15.650	1,277,165.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	18.830	150,640.000	
オーストラリア・ドル　小計		5,776,333		108,227,717.810 (7,933,091,715)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	16,302	70.130	1,143,259.260	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	68,496	43.740	2,996,015.040	
	BARRICK GOLD CORP	140,953	29.300	4,129,922.900	
	ATCO LTD	7,193	54.560	392,450.080	
	BANK OF MONTREAL	50,286	99.470	5,001,948.420	
	BANK OF NOVA SCOTIA	94,561	73.150	6,917,137.150	
	NATIONAL BANK OF CANADA	25,548	74.180	1,895,150.640	
	BCE INC	11,673	63.910	746,021.430	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	68,751	87.280	6,000,587.280	
	BAUSCH HEALTH COS INC	20,415	34.550	705,338.250	
	BOMBARDIER INC 'B'	151,615	1.210	183,454.150	
	SAPUTO INC	18,601	40.390	751,294.390	
	BLACKBERRY LTD	39,652	7.640	302,941.280	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	36,321	22.010	799,425.210	
	CGI INC	18,686	98.520	1,840,944.720	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	45.000	510,300.000	
	CAE INC	23,000	39.110	899,530.000	
	CAMECO CORP	32,627	11.800	384,998.600	
	ROGERS COMM-CL B	27,696	65.350	1,809,933.600	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	34,111	107.500	3,666,932.500	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,493	38.000	3,476,734.000	
	CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	144.890	704,455.180	
	CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	42.450	387,101.550	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	55,493	122.250	6,784,019.250	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	35.090	558,316.990	
	OPEN TEXT CORP	21,795	59.790	1,303,123.050	
	EMPIRE CO LTD	15,093	31.760	479,353.680	
	KINROSS GOLD CORP	99,741	7.890	786,956.490	
	FORTIS INC	32,312	58.460	1,888,959.520	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	55,296	10.920	603,832.320	
	TELUS CORP	15,945	51.410	819,732.450	
	GREAT WEST LIFECO INC	20,722	33.590	696,051.980	
	IMPERIAL OIL LTD	21,542	31.210	672,325.820	
	ENBRIDGE INC	156,599	54.220	8,490,797.780	
	IGM FINANCIAL INC	2,953	38.810	114,605.930	

MANULIFE FINANCIAL CORP	147,054	23.900	3,514,590.600	
LOBLAW CO LTD	15,354	70.000	1,074,780.000	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,909	66.060	1,579,428.540	
SUN LIFE FINANCIAL INC	44,241	63.600	2,813,727.600	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	623.750	1,292,410.000	
METRO INC	19,949	55.090	1,098,990.410	
HUSKY ENERGY INC	28,749	7.760	223,092.240	
EMERA INC	19,138	60.210	1,152,298.980	
METHANEX CORP	5,281	43.100	227,611.100	
ONEX CORP	6,646	83.930	557,798.780	
POWER CORP OF CANADA	46,551	33.400	1,554,803.400	
QUEBECOR INC-B	11,331	33.070	374,716.170	
ROYAL BANK OF CANADA	111,311	108.320	12,057,207.520	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	10,747	350.370	3,765,426.390	
SHAW COMM INC-B	35,431	25.170	891,798.270	
SUNCOR ENERGY INC	119,141	39.040	4,651,264.640	
LUNDIN MINING CORP	43,480	7.320	318,273.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	14.060	576,684.960	
THOMSON REUTERS CORP	16,394	106.600	1,747,600.400	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	140,924	74.810	10,542,524.440	
TC ENERGY CORP	71,704	75.160	5,389,272.640	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,696	59.190	337,146.240	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	109.460	676,900.640	
INTACT FINANCIAL CORP	10,989	153.120	1,682,635.680	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	34,963	44.280	1,548,161.640	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,565	1,406.180	2,200,671.700	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	14,922	159.840	2,385,132.480	
CI FINANCIAL CORP	20,695	24.720	511,580.400	
KEYERA CORP	16,668	35.420	590,380.560	
PARKLAND FUEL CORP	10,583	45.810	484,807.230	
ALTAGAS LTD	23,944	22.190	531,317.360	
PEMBINA PIPELINE CORP	42,684	52.370	2,235,361.080	
DOLLARAMA INC	23,536	39.010	918,139.360	
STARS GROUP INC	18,529	33.100	613,309.900	
CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	11.300	912,147.300	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	15,250	48.930	746,182.500	
INTER PIPELINE LTD	27,946	21.450	599,441.700	
NUTRIEN LTD	44,453	55.830	2,481,810.990	
CRONOS GROUP INC	16,000	8.490	135,840.000	
WSP GLOBAL INC	8,400	92.610	777,924.000	
IA FINANCIAL CORP INC	8,104	68.560	555,610.240	
OVINTIV INC	19,278	19.130	368,788.140	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	14,961	13.780	206,162.580	

	AIR CANADA	10,722	40.070	429,630.540	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	19,685	85.490	1,682,870.650	
	AURORA CANNABIS INC	66,562	2.080	138,448.960	
	SHOPIFY INC	7,605	652.990	4,965,988.950	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	26.980	502,745.320	
	HYDRO ONE LTD	27,340	28.870	789,305.800	
カナダ・ドル　小計		3,093,745		154,256,693.510 (12,869,635,940)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	4.200	525,000.000	
	SEMBCORP INDUSTRIES	81,400	1.950	158,730.000	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	123,700	1.970	243,689.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	141,900	24.850	3,526,215.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	10.490	381,836.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	28.660	170,355.040	
	SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	47,800	4.400	210,320.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	8.930	615,277.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	3.670	750,570.050	
	GENTING SINGAPORE LTD	416,400	0.870	362,268.000	
	KEPPEL CORP LTD	101,100	6.650	672,315.000	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	177,900	1.990	354,021.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	251,553	10.920	2,746,958.760	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	607,122	3.100	1,882,078.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	47,500	8.480	402,800.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	95,200	25.280	2,406,656.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.900	319,950.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	16.080	337,680.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	4.050	576,315.000	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	1.000	188,800.000	
シンガポール・ドル　小計		2,924,934		16,831,834.050 (1,335,774,350)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	191,483	12.710	2,433,748.930	
	NESTLE SA-REGISTERED	230,364	105.840	24,381,725.760	
	CIE FINANC RICHEMONT	40,915	70.100	2,868,141.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	54,432	334.750	18,221,112.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,896	224.600	650,441.600	
	SIKA INHABER	10,209	184.200	1,880,497.800	
	SGS SA-REG	424	2,548.000	1,080,352.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	166,222	91.290	15,174,406.380	
	BALOISE HOLDING AG -R	3,252	171.700	558,368.400	

	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,138.000	566,570.000	
	CLARIANT AG-REG	12,282	22.350	274,502.700	
	SWISSCOM AG-REG	1,960	568.600	1,114,456.000	
	ABB LTD	140,852	22.390	3,153,676.280	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	54.440	704,671.360	
	GEBERIT AG	2,901	515.000	1,494,015.000	
	LONZA GROUP AG-REG	5,793	408.500	2,366,440.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	79	8,150.000	643,850.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	89,400.000	804,600.000	
	GIVAUDAN-REG	742	3,243.000	2,406,306.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,558	413.300	4,776,921.400	
	LAFARGEHOLCIM LTD	37,997	46.510	1,767,240.470	
	TEMENOS GROUP	4,730	154.850	732,440.500	
	SONOVA HOLDING AG	4,584	249.900	1,145,541.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,018	149.600	601,092.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	794	976.200	775,102.800	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,134	235.400	502,343.600	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	44.900	206,180.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	215.600	358,542.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,458	485.200	1,192,621.600	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	172.750	598,578.750	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	609.500	385,813.500	
	SWISS PRIME SITE AG	5,990	123.200	737,968.000	
	PARGESA HOLDING PORTEUR	3,000	75.750	227,250.000	
	DUFRY GROUP	3,138	79.020	247,964.760	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,505	911.000	1,371,055.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	45.220	807,131.780	
	SWISS RE LTD	22,597	100.450	2,269,868.650	
	ALCON INC	32,032	59.870	1,917,755.840	
	UBS GROUP AG	301,686	12.065	3,639,841.590	
スイス・フラン　小計		1,344,447		105,039,138.450 (11,891,480,864)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	52,284	340.600	17,807,930.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	28,768	296.800	8,538,342.400	
	ERICSSON LM-B SHS	236,160	83.560	19,733,529.600	
	LUNDBERGS B	7,382	421.600	3,112,251.200	
	SKF AB-B SHS	28,812	177.050	5,101,164.600	
	SANDVIK AB	87,784	167.600	14,712,598.400	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	99.620	13,032,985.740	
	SKANSKA AB-B SHS	24,400	230.300	5,619,320.000	
	SWEDBANK AB	71,958	156.800	11,283,014.400	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	112,106	106.100	11,894,446.600	
	VOLVO AB-B SHS	119,227	162.250	19,344,580.750	
	SWEDISH MATCH AB	12,941	609.000	7,881,069.000	

	TELE2 AB-B SHS	34,618	149.850	5,187,507.300	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	240.000	2,736,720.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	207.900	3,989,808.900	
	SECURITAS AB-B SHS	24,098	141.000	3,397,818.000	
	INVESTOR AB-B SHS	35,180	530.800	18,673,544.000	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	60,283	191.100	11,520,081.300	
	ASSA ABLOY AB-B	81,088	234.800	19,039,462.400	
	TELIA CO AB	231,855	40.860	9,473,595.300	
	LUNDIN PETROLEUM AB	12,146	282.900	3,436,103.400	
	BOLIDEN AB	21,855	217.000	4,742,535.000	
	ALFA LAVAL AB	23,343	232.900	5,436,584.700	
	KINNEVIK AB-B	18,310	216.800	3,969,608.000	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	7,844	434.600	3,409,002.400	
	ICA GRUPPEN AB	5,920	379.600	2,247,232.000	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	68.900	2,321,378.800	
	HEXAGON AB	21,145	545.000	11,524,025.000	
	EPIROC AB-A	48,955	113.650	5,563,735.750	
	EPIROC AB-B	30,899	109.950	3,397,345.050	
	ESSITY AB-B	46,640	302.500	14,108,600.000	
	NORDEA BANK ABP	259,268	83.260	21,586,653.680	
スウェーデン・クローナ　小計		1,940,382		293,822,574.070 (3,346,639,119)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,441	968.000	8,170,888.000	
	A P MOLLER A/S	491	7,654.000	3,758,114.000	
	AP MOLLER MAERSK A	273	7,165.000	1,956,045.000	
	DANSKE BANK A/S	51,034	115.000	5,868,910.000	
	GENMAB A/S	5,014	1,701.500	8,531,321.000	
	NOVOZYMES-B SHS	15,533	362.800	5,635,372.400	
	NOVO NORDISK A/S-B	136,925	426.200	58,357,435.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13,963	688.000	9,606,544.000	
	COLOPLAST-B	9,729	939.400	9,139,422.600	
	DSV PANALPINA A S	17,626	722.600	12,736,547.600	
	DEMANT A/S	7,244	218.000	1,579,192.000	
	H LUNDBECK A/S	4,840	254.200	1,230,328.000	
	TRYG A/S	11,107	201.000	2,232,507.000	
	PANDORA A/S	8,251	311.100	2,566,886.100	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	7,539	528.800	3,986,623.200	
	ISS A/S	11,107	151.200	1,679,378.400	
	ORSTED A/S	15,090	735.600	11,100,204.000	
デンマーク・クローネ　小計		324,207		148,135,718.300 (2,384,985,065)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	85,245	8.320	709,238.400	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	16.700	499,229.800	
	A2 MILK CO LTD	55,091	15.630	861,072.330	
	FISHER & PAYKEL	43,184	25.920	1,119,329.280	

	FLETCHER BUILDING LTD	64,104	5.400	346,161.600	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.740	756,613.020	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.400	333,363.600	
	MERIDIAN ENERGY LTD	75,656	5.380	407,029.280	
ニュージーランド・ドル　小計		574,531		5,032,037.310 (354,003,825)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	217.600	7,655,820.800	
	DNB ASA	71,352	171.250	12,219,030.000	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	28.030	2,610,686.170	
	TELENOR ASA	54,766	157.900	8,647,551.400	
	ORKLA ASA	64,938	84.660	5,497,651.080	
	EQUINOR ASA	81,022	150.200	12,169,504.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	12,171	373.500	4,545,868.500	
	AKER BP ASA	8,552	231.700	1,981,498.400	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	202.000	3,369,966.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	246.600	1,835,937.000	
ノルウェー・クローネ　小計		445,251		60,533,513.750 (717,322,138)	
ユーロ	CRH PLC	61,990	33.370	2,068,606.300	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	6,246	106.200	663,325.200	
	KERRY GROUP PLC-A	12,258	123.000	1,507,734.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	11,768	61.800	727,262.400	
	UMICORE	14,115	41.750	589,301.250	
	AIR LIQUIDE	36,317	133.750	4,857,398.750	
	AIRBUS SE	45,122	124.380	5,612,274.360	
	AXA	148,160	23.345	3,458,795.200	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,449	27.900	1,240,127.100	
	ADIDAS AG	13,900	265.050	3,684,195.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	87,030	17.435	1,517,368.050	
	DASSAULT AVIATION SA	163	1,049.000	170,987.000	
	DANONE	48,833	67.540	3,298,180.820	
	SAFRAN SA	25,898	137.000	3,548,026.000	
	INTESA SANPAOLO	1,157,631	2.376	2,750,531.250	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25,251	61.440	1,551,421.440	
	ACCOR SA	12,277	36.360	446,391.720	
	BOUYGUES	17,572	38.750	680,915.000	
	BNP PARIBAS	86,434	51.200	4,425,420.800	
	THALES SA	8,549	93.100	795,911.900	
	CAPGEMINI SA	12,515	110.450	1,382,281.750	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	4,264	35.530	151,499.920	
	INGENICO GROUP	4,334	135.800	588,557.200	
	UNICREDIT SPA	155,718	12.640	1,968,275.520	
	NATIXIS	70,166	4.247	297,995.000	
	KONINKLIJKE DSM NV	13,716	114.250	1,567,053.000	

COMMERZBANK AG	83,118	6.126	509,180.860	
EIFFAGE	6,461	107.050	691,650.050	
FRESENIUS SE & CO KGAA	31,463	47.645	1,499,054.630	
UNITED INTERNET	9,882	30.700	303,377.400	
FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	38.000	210,748.000	
PUBLICIS GROUPE	15,198	39.340	597,889.320	
FAURECIA	6,117	42.650	260,890.050	
IBERDROLA SA	477,267	10.930	5,216,528.310	
ENI SPA	197,838	12.168	2,407,292.780	
JERONIMO MARTINS	19,517	16.715	326,226.650	
KBC GROUPE	18,577	66.880	1,242,429.760	
HANNOVER RUECK SE	4,868	181.300	882,568.400	
WARTSILA OYJ	34,935	9.990	349,000.650	
L'OREAL	19,554	256.000	5,005,824.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,486	385.650	8,286,075.900	
GEA GROUP AG	11,838	26.590	314,772.420	
BOLLORE	71,347	3.444	245,719.060	
MEDIOBANCA SPA	41,639	8.848	368,421.870	
MICHELIN(CGDE)-B	12,422	104.400	1,296,856.800	
CONTINENTAL AG	8,312	107.480	893,373.760	
DEUTSCHE POST AG-REG	76,032	30.365	2,308,711.680	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	15,885	15.225	241,849.120	
NOKIAN RENKAAT OYJ	9,399	25.600	240,614.400	
OMV AG	12,817	40.680	521,395.560	
VERBUND AG	4,908	47.620	233,718.960	
PERNOD-RICARD	16,719	159.350	2,664,172.650	
PEUGEOT SA	43,905	17.805	781,728.520	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	12,649	59.820	756,663.180	
RENAULT SA	14,917	29.585	441,319.440	
REPSOL SA	114,998	11.315	1,301,202.370	
REMY COINTREAU	1,860	96.200	178,932.000	
MERCK KGAA	9,850	118.000	1,162,300.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	39,436	34.650	1,366,457.400	
RWE AG	46,489	33.620	1,562,960.180	
SEB SA	1,551	112.900	175,107.900	
SOCIETE GENERALE-A	61,181	29.940	1,831,759.140	
VINCI S.A.	39,237	100.600	3,947,242.200	
SODEXO	7,075	97.500	689,812.500	
SOLVAY SA	5,563	91.900	511,239.700	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	43,656	98.580	4,303,608.480	
VIVENDI SA	67,989	24.900	1,692,926.100	
SAP SE	76,071	121.240	9,222,848.040	
TELEFONICA S.A	367,755	5.997	2,205,426.730	
TOTAL SA	186,020	42.165	7,843,533.300	
VALEO	19,653	25.260	496,434.780	

E.ON SE	181,317	11.170	2,025,310.890	
VOEST-ALPINE AG	9,875	21.200	209,350.000	
HENKEL AG & CO KGAA	7,585	80.750	612,488.750	
SIEMENS AG-REG	59,113	100.900	5,964,501.700	
UPM-KYMMENE OYJ	39,909	29.460	1,175,719.140	
ING GROEP NV-CVA	304,508	9.510	2,895,871.080	
PUMA AG	7,351	75.000	551,325.000	
BAYER AG	72,011	70.500	5,076,775.500	
STORA ENSO OYJ-R SHS	41,915	11.555	484,327.820	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,759	90.020	1,238,585.180	
DAIMLER AG	69,481	39.725	2,760,132.720	
BASF SE	70,554	58.730	4,143,636.420	
BEIERSDORF AG	8,371	102.750	860,120.250	
HOCHTIEF AG	1,707	99.500	169,846.500	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	59.340	713,919.540	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	16,214	73.540	1,192,377.560	
ORANGE	151,246	13.230	2,000,984.580	
SAMPO OYJ-A SHS	36,141	39.250	1,418,534.250	
RANDSTAD NV	9,074	50.820	461,140.680	
ALLIANZ SE	32,944	222.750	7,338,276.000	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	201,606	4.705	948,556.230	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	89,026	22.900	2,038,695.400	
HERMES INTL	2,483	670.400	1,664,603.200	
ENDESA S.A.	23,417	25.080	587,298.360	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,096	13.510	217,456.960	
ERSTE GROUP BANK AG	20,943	33.630	704,313.090	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	11,091	263.200	2,919,151.200	
ARCELOR MITTAL (NL)	46,714	13.990	653,528.860	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,953	150.600	1,498,921.800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	20,137	28.990	583,771.630	
HEINEKEN NV	19,582	100.350	1,965,053.700	
AKZO NOBEL	17,491	81.000	1,416,771.000	
ASML HOLDING NV	33,053	270.650	8,945,794.450	
AEGON NV	150,349	3.520	529,228.480	
BANKINTER S.A.	57,960	5.946	344,630.160	
VOLKSWAGEN AG	2,645	158.300	418,703.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,401	157.000	2,260,957.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	523,594	4.912	2,571,893.720	
KERING	5,830	535.100	3,119,633.000	
CNP ASSURANCES	13,987	15.490	216,658.630	
FORTUM OYJ	37,452	21.020	787,241.040	
AGEAS	14,365	45.850	658,635.250	
UCB SA	9,095	89.620	815,093.900	

THYSSENKRUPP AG	27,110	9.566	259,334.260	
CARREFOUR SA	51,094	15.720	803,197.680	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	23.010	543,312.120	
ATOS SE	7,304	72.560	529,978.240	
NOKIA OYJ	430,800	3.699	1,593,529.200	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	71,925	42.865	3,083,065.120	
WOLTERS KLUWER-CVA	20,687	68.100	1,408,784.700	
SANOFI	87,169	91.570	7,982,065.330	
STMICROELECTRONICS NV	55,611	26.310	1,463,125.410	
ELISA OYJ	10,787	57.000	614,859.000	
BANCO SANTANDER SA	1,264,063	3.620	4,575,908.060	
METSO OYJ	8,585	30.640	263,044.400	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	18.980	656,632.080	
QIAGEN N.V.	17,974	34.000	611,116.000	
DEUTSCHE BANK AG-REG	149,384	8.940	1,335,492.960	
BMW VORZUG	4,116	49.040	201,848.640	
ENEL SPA	632,333	8.030	5,077,633.990	
COLRUYT NV	4,673	45.410	212,200.930	
VOPAK (KON.)	5,364	47.980	257,364.720	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	263,592	16.160	4,259,646.720	
SARTORIUS AG	2,712	231.200	627,014.400	
LEONARDO SPA	28,316	10.290	291,371.640	
UBISOFT ENTERTAINMENT	5,935	74.340	441,207.900	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	99,068	20.140	1,995,229.520	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	104.700	394,823.700	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.495	726,117.350	
EUROFINS SCIENTIFIC	899	462.200	415,517.800	
TELEPERFORMANCE	4,383	236.000	1,034,388.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	14,525	152.850	2,220,146.250	
EURAZEO	2,748	63.800	175,322.400	
BANCO SABADELL	413,631	0.843	348,690.930	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,689	87.980	588,498.220	
FRAPORT AG	3,149	64.660	203,614.340	
HEINEKEN HOLDING NV-A	9,791	89.650	877,763.150	
INDITEX	83,883	29.620	2,484,614.460	
JC DECAUX SA	6,058	21.420	129,762.360	
ANDRITZ AG	6,265	32.940	206,369.100	
MAPFRE SA	84,474	2.254	190,404.390	
ESSILORLUXOTTICA	21,761	133.700	2,909,445.700	
SNAM SPA	169,163	4.790	810,290.770	
CREDIT AGRICOLE SA	86,205	12.700	1,094,803.500	
ENAGAS	18,095	25.050	453,279.750	
WENDEL	2,220	120.000	266,400.000	
WIRECARD AG	8,963	128.400	1,150,849.200	
TENARIS SA	36,959	8.900	328,935.100	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.513	391,252.270	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.506	251,783.570	

ATLANTIA SPA	37,365	21.110	788,775.150	
ILIAD SA	2,102	134.600	282,929.200	
PROXIMUS	14,283	24.150	344,934.450	
SES FDR	28,847	11.030	318,182.410	
TERNA SPA	113,654	6.374	724,430.590	
BIOMERIEUX	3,248	95.450	310,021.600	
GRIFOLS SA	23,518	32.880	773,271.840	
FERROVIAL SA	38,666	28.690	1,109,327.540	
LANXESS AG	6,856	52.920	362,819.520	
NESTE OYJ	32,931	37.470	1,233,924.570	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	21.450	206,799.450	
RECORDATI SPA	6,859	38.490	264,002.910	
GALAPAGOS NV	3,426	227.600	779,757.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	39,752	8.080	321,196.160	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	247.900	1,033,247.200	
KONE OYJ	26,502	53.700	1,423,157.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,884	182.900	344,583.600	
ENGIE	139,272	16.095	2,241,582.840	
ALSTOM	15,712	45.730	718,509.760	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	37.580	136,565.720	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,542	13.220	165,805.240	
ELECTRICITE DE FRANCE	53,800	13.300	715,540.000	
IPSEN SA	3,646	65.400	238,448.400	
DEUTSCHE WOHNEN	26,947	38.560	1,039,076.320	
ARKEMA SA	5,033	84.460	425,087.180	
LEGRAND SA	20,673	75.400	1,558,744.200	
UNILEVER NV	113,134	52.340	5,921,433.560	
ADP	2,313	158.100	365,685.300	
ORION OYJ	8,051	38.110	306,823.610	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	13.740	550,809.120	
SYMRISE AG	9,988	95.060	949,459.280	
SCOR SE	10,116	35.540	359,522.640	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	31.900	554,964.300	
PRYSMIAN SPA	21,452	22.050	473,016.600	
CAIXABANK	297,224	2.618	778,132.430	
BUREAU VERITAS SA	23,179	24.020	556,759.580	
GETLINK	37,646	16.500	621,159.000	
SUEZ SA	26,620	15.550	413,941.000	
AMADEUS IT GROUP SA	33,891	67.140	2,275,441.740	
BRENNTAG AG	12,353	46.330	572,314.490	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	25.210	431,494.360	
EDENRED	19,188	49.140	942,898.320	
BANKIA SA	100,675	1.633	164,402.270	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	61,541	2.573	158,344.990	

	KION GROUP AG	4,567	53.800	245,704.600	
	VONOVIA SE	38,617	53.200	2,054,424.400	
	BANK OF IRELAND GROUP PLC	82,256	3.764	309,611.580	
	KNORR-BREMSE AG	4,492	95.370	428,402.040	
	SIEMENS HEALTHINEERS AG	11,468	39.780	456,197.040	
	FERRARI NV	8,934	151.300	1,351,714.200	
	METRO AG	10,774	11.465	123,523.910	
	CNH INDUSTRIAL NV	77,951	8.086	630,311.780	
	AROUNDTOWN SA	71,783	8.670	622,358.610	
	AIB GROUP PLC	41,352	2.320	95,936.640	
	MONCLER SPA	14,353	35.160	504,651.480	
	PROSUS NV	36,871	67.810	2,500,222.510	
	ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	20,137	0.428	8,618.630	
	WORLDLINE SA	7,758	72.850	565,170.300	
	NN GROUP NV	21,720	34.860	757,159.200	
	FINECOBANK SPA	45,048	10.060	453,182.880	
	ZALANDO SE	9,964	45.140	449,774.960	
	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	79,084	11.340	896,812.560	
	AENA SME SA	5,338	158.450	845,806.100	
	CELLNEX TELECOM SAU	19,780	47.060	930,846.800	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	9,000	86.050	774,450.000	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	14.240	487,734.240	
	EXOR NV	7,971	67.500	538,042.500	
	ALTICE EUROPE NV	56,763	6.120	347,389.560	
	COVESTRO AG	12,708	38.670	491,418.360	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	58,731	64.080	3,763,482.480	
	POSTE ITALIANE SPA	40,015	10.495	419,957.420	
	AMUNDI SA	4,119	72.150	297,185.850	
	ADYEN NV	818	826.200	675,831.600	
	PIRELLI & C SPA	34,086	4.459	151,989.470	
	UNIPER SE	14,252	28.620	407,892.240	
	DELIVERY HERO SE	8,081	72.760	587,973.560	
ユーロ　小計		15,265,769		318,470,631.320 (38,321,571,067)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	19,100	94.850	1,811,635.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.940	2,942,160.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.700	1,734,462.000	
	CLP HOLDINGS LTD	121,000	81.800	9,897,800.000	
	PCCW LTD	331,000	4.820	1,595,420.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	54.650	2,705,175.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	94,440	260.800	24,629,952.000	
	MTR CORP	126,000	43.900	5,531,400.000	

	HANG SENG BANK LTD	57,700	161.500	9,318,550.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	35.800	4,133,110.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	101,500	57.350	5,821,025.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	776,755	15.000	11,651,325.000	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	157,000	53.900	8,462,300.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	73,500	22.400	1,646,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	275,000	27.000	7,425,000.000	
	NWS HOLDINGS LTD	135,000	9.870	1,332,450.000	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	50,500	20.350	1,027,675.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	484,266	9.900	4,794,233.400	
	SINO LAND CO	255,400	10.580	2,702,132.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	125,000	111.100	13,887,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	30,500	71.400	2,177,700.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	113,500	67.850	7,700,975.000	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	70,000	29.000	2,030,000.000	
	WHEELOCK & CO LTD	64,000	47.250	3,024,000.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.960	1,397,760.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	16.680	2,074,992.000	
	AIA GROUP LTD	935,627	77.350	72,370,748.450	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	12.080	3,491,120.000	
	SANDS CHINA LTD	199,200	38.100	7,589,520.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	24.000	2,500,800.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	95,750	40.200	3,849,150.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.840	1,803,200.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	101,900	23.550	2,399,745.000	
	WH GROUP LTD	742,500	8.430	6,259,275.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	208,832	68.750	14,357,200.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	198,332	49.600	9,837,267.200	
香港・ドル　小計		7,279,712		265,913,157.050 (3,783,944,225)	
合計		85,875,801		338,725,330,310 (338,725,330,310)	

（２）株式以外の有価証券

令和2年2月25日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	84,575.000	1,106,241.000	
		GOODMAN GROUP	132,051.000	2,122,059.570	
		GPT GROUP	158,232.000	974,709.120	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	1,077,196.860	
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,546,586.240	
		STOCKLAND	194,018.000	1,014,714.140	
		VICINITY CENTRES	270,443.000	624,723.330	
	オーストラリア・ドル　小計		1,589,005.000	8,466,230.260 (620,574,677)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	200,806.000	650,611.440	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206,300.000	414,663.000	
		CAPITALAND MALL TRUST	199,000.000	491,530.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	442,290.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	345,780.000	
	シンガポール・ドル　小計		990,506.000	2,344,874.440 (186,089,236)	
投資信託受益証券　合計			2,579,511	806,663,913 (806,663,913)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,741.000	854,105.690	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8,646.000	1,441,634.040	
		AMERICAN TOWER CORP	34,213.000	8,385,948.430	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108,247.000	1,096,542.110	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,491.000	2,368,762.890	
		BOSTON PROPERTIES INC	12,027.000	1,736,097.450	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,062.000	961,232.260	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	31,583.000	5,254,147.880	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	15,605.000	2,110,888.350	
		DUKE REALTY TRUST	27,278.000	1,028,926.160	
		EQUINIX INC	6,522.000	4,206,037.800	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,626.000	1,042,116.480	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,869.000	2,390,881.510	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,075.000	1,653,485.750	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	9,261.000	1,007,689.410	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,000.000	767,280.000	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40,162.000	1,490,010.200	

	HOST HOTELS & RESORTS INC	55,116.000	905,555.880	
	INVITATION HOMES INC	42,384.000	1,324,500.000	
	IRON MOUNTAIN INC	23,977.000	804,428.350	
	KIMCO REALTY	32,980.000	625,630.600	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	39,953.000	956,474.820	
	MID AMERICA	8,834.000	1,288,968.940	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13,649.000	800,513.850	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17,771.000	798,806.450	
	PROLOGIS INC	56,079.000	5,382,462.420	
	PUBLIC STORAGE	12,188.000	2,760,216.360	
	REALTY INCOME CORP	23,491.000	1,930,255.470	
	REGENCY CENTERS CORP	11,403.000	723,178.260	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	8,778.000	2,593,986.780	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	23,306.000	3,281,018.680	
	SL GREEN	7,097.000	645,330.210	
	SUN COMMUNITIES INC	7,418.000	1,265,881.700	
	UDR INC	22,345.000	1,128,869.400	
	VENTAS INC	29,505.000	1,860,290.250	
	VEREIT INC	82,604.000	827,692.080	
	VICI PROPERTIES INC	34,200.000	940,500.000	
	VORNADO REALTY TRUST	12,472.000	777,878.640	
	WELLTOWER INC	32,099.000	2,780,736.370	
	WEYERHAEUSER CO	57,621.000	1,714,800.960	
	WP CAREY INC	13,039.000	1,150,952.530	
アメリカ・ドル　小計		1,077,717.000	75,064,715.410 (8,325,427,587)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	384,842.320	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	527,828.030	
	SEGRO PLC	87,247.000	782,256.600	
イギリス・ポンド　小計		212,909.000	1,694,926.950 (242,899,981)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,819.000	457,176.930	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,676.000	380,741.040	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10,748.000	230,329.640	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	367,379.760	
	SMARTCENTRES REIT	3,067.000	95,721.070	
カナダ・ドル　小計		52,777.000	1,531,348.440 (127,760,400)	
ユーロ	COVIVIO	4,265.000	465,311.500	
	GECINA SA	3,670.000	654,361.000	
	ICADE	2,234.000	225,410.600	
	KLEPIERRE	17,042.000	508,192.440	

		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10,898.000	1,291,413.000	
	ユーロ　小計		38,109.000	3,144,688.540 (378,400,372)	
	香港・ドル	LINK REIT	157,900.000	11,858,290.000	
	香港・ドル　小計		157,900.000	11,858,290.000 (168,743,467)	
投資証券　合計			1,539,412	9,243,231,807 (9,243,231,807)	
合計				10,049,895,720 (10,049,895,720)	

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

（注）

１．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

３．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式	608銘柄	65.94	－	－	70.11
	投資証券	41銘柄	－	－	2.32	
イギリス・ポンド	株式	93銘柄	5.36	－	－	5.57
	投資証券	3銘柄	－	－	0.07	
イスラエル・シュケル	株式	8銘柄	0.11	－	－	0.11
オーストラリア・ドル	株式	62銘柄	2.21	－	－	2.45
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.17	－	
カナダ・ドル	株式	84銘柄	3.59	－	－	3.73
	投資証券	5銘柄	－	－	0.04	
シンガポール・ドル	株式	20銘柄	0.37	－	－	0.44
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.32	－	－	3.41
スウェーデン・クローナ	株式	32銘柄	0.93	－	－	0.96
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.67	－	－	0.68
ニュージーランド・ドル	株式	8銘柄	0.10	－	－	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.20	－	－	0.21
ユーロ	株式	237銘柄	10.70	－	－	11.10
	投資証券	5銘柄	－	－	0.11	
香港・ドル	株式	36銘柄	1.06	－	－	1.13
	投資証券	1銘柄	－	－	0.05	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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2月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,621,073,264
コール・ローン	409,801,270
国債証券	127,282,939,063
派生商品評価勘定	73
未収入金	360,716,568
未収利息	894,999,253
前払費用	8,834,563
流動資産合計	130,578,364,054
資産合計	130,578,364,054
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	389,177
未払解約金	270,465,200
流動負債合計	270,854,377
負債合計	270,854,377
純資産の部	
元本等	
元本	66,694,972,797
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	63,612,536,880
元本等合計	130,307,509,677
純資産合計	130,307,509,677
負債純資産合計	130,578,364,054

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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	108,779,748,990円
同期中追加設定元本額	14,418,787,868円
同期中一部解約元本額	56,503,564,061円
元本の内訳	

ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	8,868,724,545円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,775,654円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	22,123,281円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	25,741,467円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	80,085,833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）	35,465,308円
たわらノーロード　先進国債券	6,519,501,876円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	149,609,426円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	479,712,374円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	11,720,157円
たわらノーロード　バランス（標準型）	55,719,256円
たわらノーロード　バランス（積極型）	11,572,520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）	1,913,072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）	135,107,966円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	178,584,954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）	60,674,836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）	37,118,801円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	68,332円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,616,898円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	4,040,132円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,282,053円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,349,638円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	5,848,865,458円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	639,979円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	585,714,796円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	1,821,374,172円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,899,253,523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	797,283,999円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	632,041,626円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	20,946,445円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	607,750,277円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	22,230,425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）	89,691,387円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	147,541,325円
クルーズコントロール	1,255,331,264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＞	177,161,233円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,269,534円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,786,439円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,504,090円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	38,912,796円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	120,359,994円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	139,662円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,165,889,077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）	818,056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）	6,588,503,236円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	3,322,079,347円

外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,199,859,662円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	6,073,392,201円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	71,552,724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）	255,255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）	606,183,336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）	455,700,977円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,453,454円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	68,261,200円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	19,577,030円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,136,190円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,431,781円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,799,804円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,762,682,039円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,924,647,331円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,376,447,915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）	604,894,639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）	234,213,008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）	2,604,999,197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）	639,500,550円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,558,564円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	91,625,774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）	449,766,733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）	644,060,493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）	1,039,369,608円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	73,750,748円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	41,093,493円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	364,076円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	170,414円
計	66,694,972,797円
２．　受益権の総数	66,694,972,797口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　平成31年2月26日 至　令和2年2月25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2月25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2月25日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	765,487,472
合計	765,487,472

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（令和2年2月22日から令和2年2月25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2月25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	185,281,730	－	185,670,834	△389,104
イギリス・ポンド	7,490,000	－	7,489,927	73
マレーシア・リンギット	177,791,730	－	178,180,907	△389,177
合計	185,281,730	－	185,670,834	△389,104

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年2月25日現在
1口当たり純資産額	1.9538円
（1万口当たり純資産額）	(19,538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2月25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	3,670,225.000	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,443,431.250	
		US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,304,856.230	
		US T N/B 1.375 04/30/21	11,210,000.000	11,213,065.150	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,479,192.170	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,106,015.620	
		US T N/B 1.375 09/30/23	3,100,000.000	3,117,437.500	

		US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,217,704.280	
		US T N/B 1.5 08/15/26	4,290,000.000	4,345,635.930	
		US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	755,009.760	
		US T N/B 1.5 09/30/21	5,120,000.000	5,134,599.980	
		US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,264,579.660	
		US T N/B 1.625 05/15/26	4,290,000.000	4,378,146.070	
		US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,937,835.920	
		US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,017,778.870	
		US T N/B 1.625 08/15/29	4,380,000.000	4,477,181.240	
		US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,399,386.700	
		US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,679,053.890	
		US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,055,089.030	
		US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,061,538.240	
		US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,460,539.010	
		US T N/B 1.75 05/15/23	5,990,000.000	6,089,677.310	
		US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	839,629.290	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,369,835.930	
		US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,774,178.120	
		US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,319,726.560	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,400,000.000	2,480,437.480	
		US T N/B 1.75 12/31/26	740,000.000	761,737.500	
		US T N/B 1.875 02/28/22	1,680,000.000	1,700,081.240	
		US T N/B 1.875 06/30/26	720,000.000	746,043.740	
		US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,455,912.500	
		US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,738,075.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,209,456.230	
		US T N/B 2.0 02/15/22	8,470,000.000	8,590,432.810	
		US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,470,373.430	
		US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,497,093.750	
		US T N/B 2.0 05/31/21	10,130,000.000	10,211,910.470	
		US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,923,534.370	
		US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,385,176.530	
		US T N/B 2.0 11/15/21	10,400,000.000	10,523,906.220	
		US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,326,623.410	
		US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,724,889.060	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,345,906.250	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,227,262.500	
		US T N/B 2.125 05/15/25	5,150,000.000	5,381,347.630	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,153,941.390	
		US T N/B 2.125 06/30/22	6,530,000.000	6,662,640.620	
		US T N/B 2.125 08/15/21	11,000,000.000	11,128,046.820	
		US T N/B 2.125 09/30/21	8,840,000.000	8,952,571.830	
		US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,047,200.000	
		US T N/B 2.125 12/31/21	9,160,000.000	9,299,546.820	
		US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,658,000.000	
		US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	363,671.870	
		US T N/B 2.25 02/15/27	4,670,000.000	4,964,428.880	
		US T N/B 2.25 03/31/21	9,760,000.000	9,853,025.000	
		US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,266,467.950	

		US T N/B 2.25 04/30/21	8,170,000.000	8,255,210.480	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,438,187.500	
		US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,869,263.260	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,720,000.000	2,947,800.000	
		US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,625,000.000	
		US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,910,942.940	
		US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,470,989.810	
		US T N/B 2.25 11/15/27	4,040,000.000	4,315,225.000	
		US T N/B 2.25 12/31/23	4,830,000.000	5,017,539.810	
		US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,874,537.490	
		US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,328,140.620	
		US T N/B 2.375 05/15/29	4,840,000.000	5,260,853.080	
		US T N/B 2.375 08/15/24	6,110,000.000	6,416,931.990	
		US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	3,111,921.870	
		US T N/B 2.5 01/15/22	3,850,000.000	3,936,775.380	
		US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,080,245.310	
		US T N/B 2.5 02/15/22	1,070,000.000	1,095,454.290	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,840,000.000	3,210,531.250	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,234,257.010	
		US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,731,488.260	
		US T N/B 2.5 03/31/23	1,020,000.000	1,059,604.680	
		US T N/B 2.5 05/15/24	6,240,000.000	6,568,087.460	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,790,000.000	3,167,521.870	
		US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,519,099.190	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,348,950.000	
		US T N/B 2.625 02/15/29	5,130,000.000	5,676,264.800	
		US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,297,980.450	
		US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,903,748.420	
		US T N/B 2.625 12/15/21	3,770,000.000	3,859,390.200	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,221,367.170	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,465,864.830	
		US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,634,628.090	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,839,775.000	
		US T N/B 2.75 02/28/25	3,510,000.000	3,769,685.130	
		US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,608,275.000	
		US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,429,412.500	
		US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	851,657.020	
		US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,437,587.500	
		US T N/B 2.75 08/15/42	1,800,000.000	2,116,476.550	
		US T N/B 2.75 08/15/47	770,000.000	920,510.930	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,283,755.450	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,770,815.610	
		US T N/B 2.75 11/15/23	6,020,000.000	6,356,743.750	
		US T N/B 2.75 11/15/42	2,110,000.000	2,482,052.320	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,640,000.000	3,159,337.480	
		US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,959,869.500	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,720,000.000	3,266,124.990	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,430,000.000	4,236,317.940	
		US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,740,108.580	

		US T N/B 2.875 07/31/25	3,390,000.000	3,680,003.880	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,680,000.000	5,251,837.500	
		US T N/B 2.875 08/15/45	2,090,000.000	2,528,410.140	
		US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	888,825.000	
		US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,909,093.750	
		US T N/B 2.875 11/15/21	4,880,000.000	5,010,196.830	
		US T N/B 2.875 11/15/46	2,220,000.000	2,704,584.370	
		US T N/B 2.875 11/30/23	5,640,000.000	5,981,043.750	
		US T N/B 2.875 11/30/25	3,480,000.000	3,791,568.750	
		US T N/B 3.0 02/15/47	2,540,000.000	3,169,642.160	
		US T N/B 3.0 02/15/48	3,110,000.000	3,898,190.620	
		US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,872,757.000	
		US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,198,739.050	
		US T N/B 3.0 05/15/45	2,500,000.000	3,082,421.870	
		US T N/B 3.0 05/15/47	2,350,000.000	2,934,746.080	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,210,000.000	4,036,825.740	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,542,848.430	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,102,849.990	
		US T N/B 3.0 11/15/44	2,290,000.000	2,817,415.620	
		US T N/B 3.0 11/15/45	1,630,000.000	2,016,360.930	
		US T N/B 3.125 02/15/42	1,380,000.000	1,721,280.450	
		US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,796,287.490	
		US T N/B 3.125 05/15/21	8,000,000.000	8,170,312.480	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,414,359.360	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,830,000.000	3,551,650.000	
		US T N/B 3.125 11/15/28	4,840,000.000	5,542,934.330	
		US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	946,793.750	
		US T N/B 3.375 05/15/44	2,420,000.000	3,153,467.940	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,330,000.000	4,476,768.750	
		US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,172,320.300	
		US T N/B 3.625 02/15/44	2,790,000.000	3,768,679.680	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,250,325.000	
		US T N/B 3.75 08/15/41	410,000.000	556,735.150	
		US T N/B 3.75 11/15/43	2,620,000.000	3,597,996.870	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,525,296.070	
		US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,157,160.930	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,110,000.000	1,600,221.080	
		US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	788,949.210	
		US T N/B 4.375 05/15/40	1,300,000.000	1,898,203.110	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,527,743.740	
		US T N/B 4.375 11/15/39	410,000.000	596,293.750	
		US T N/B 4.5 02/15/36	730,000.000	1,034,660.930	
		US T N/B 4.5 05/15/38	700,000.000	1,019,812.500	
		US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,164,015.620	
		US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,126,347.640	
		US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,841,812.500	
		US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	758,867.180	
		US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	651,317.180	
		US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,123,693.350	

	US T N/B 5.375 02/15/31	1,000,000.000	1,403,906.250	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	867,039.060	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,070,146.870	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,220,273.430	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	1,039,761.710	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,170,390.620	
	US T N/B 8.0 11/15/21	6,000,000.000	6,683,671.840	
アメリカ・ドル　小計		526,550,000.000 (58,399,660,500)	567,851,255.350 (62,980,382,729)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.5 07/22/22	1,920,000.000	1,924,435.200	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,577,803.960	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	430,000.000	444,190.000	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	820,000.000	839,753.800	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	960,000.000	1,018,435.200	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	963,396.000	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,450,000.000	1,632,120.000	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,830,000.000	2,010,612.010	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	510,000.000	614,952.900	
	UK TREASURY 1.625 10/22/71	580,000.000	774,723.400	
	UK TREASURY 1.75 01/22/49	580,000.000	692,752.000	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,020,000.000	1,301,214.000	
	UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,581,790.500	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,540,000.000	1,757,294.000	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	860,802.960	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,256,321.330	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,130,000.000	1,825,734.550	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,380,000.000	1,525,073.050	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,540,000.000	2,284,282.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,992,576.000	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	890,000.000	1,821,296.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,679,686.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	990,000.000	2,034,252.000	
	UK TREASURY 4.0 03/07/22	1,040,000.000	1,115,077.600	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,130,000.000	1,713,984.000	

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,110,000.000	1,581,861.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,473,012.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	970,000.000	1,254,297.300	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,561,440.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,170,000.000	2,071,485.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	990,000.000	1,830,411.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,000,000.000	2,022,500.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	1,365,300.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,080,000.000	1,864,080.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,120,000.000	1,613,136.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	990,000.000	1,657,755.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,610,000.000	1,977,434.200	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,122,915.200	
イギリス・ポンド　小計		41,500,000.000 (5,947,365,000)	56,638,185.160 (8,116,818,315)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 2.0 12/21/21	1,770,000.000	1,813,051.710	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,740,000.000	1,937,490.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	890,000.000	929,256.740	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,200,000.000	1,385,140.310	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,150,149.510	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	651,363.110	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,330,000.000	1,521,160.900	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	2,080,000.000	2,407,915.120	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,832,064.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	1,159,189.390	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,520,000.000	1,716,908.550	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	2,820,000.000	3,403,510.170	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	720,000.000	959,537.230	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	850,000.000	1,184,580.910	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,434,584.760	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,130,000.000	1,616,882.870	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,670,000.000	2,129,883.760	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	1,710,000.000	1,969,727.790	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	1,180,000.000	1,322,490.070	
オーストラリア・ドル　小計		27,560,000.000 (2,020,148,000)	32,524,886.900 (2,384,074,210)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	230,000.000	337,373.200	
	CANADA 0.75 09/01/21	600,000.000	594,342.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	800,000.000	787,592.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	800,000.000	793,680.000	

	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,218,034.400	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	813,752.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,160,000.000	1,175,265.600	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,020,000.000	1,082,311.800	
	CANADA 2.0 09/01/23	740,000.000	758,159.600	
	CANADA 2.0 12/01/51	420,000.000	496,398.000	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	550,850.200	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,500,000.000	1,579,020.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	665,662.500	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,683,328.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,310,112.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	980,000.000	1,315,258.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	523,215.000	
	CANADA 3.25 06/01/21	4,700,000.000	4,806,502.000	
	CANADA 3.5 12/01/45	1,020,000.000	1,502,817.000	
	CANADA 4.0 06/01/41	880,000.000	1,315,811.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	870,000.000	1,366,926.600	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,100,000.000	1,531,970.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,113,645.600	
カナダ・ドル　小計		24,880,000.000 (2,075,738,400)	28,322,026.700 (2,362,906,688)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 2.125 06/01/26	210,000.000	218,043.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	200,000.000	215,200.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	355,640.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	492,540.300	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	444,600.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	200,000.000	222,564.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	415,325.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	586,742.750	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	1,600,000.000	1,665,280.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	577,675.200	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	825,995.000	
シンガポール・ドル　小計		5,480,000.000 (434,892,800)	6,019,605.250 (477,715,873)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.75 05/12/28	3,740,000.000	4,057,372.280	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,170,000.000	2,364,583.900	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,639,334.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	7,122,425.280	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	5,275,785.300	
スウェーデン・クローナ　小計		19,610,000.000 (223,357,900)	23,459,500.760 (267,203,714)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,727,401.310	
	DENMARK 1.5 11/15/23	5,500,000.000	5,954,850.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	6,060,850.430	
	DENMARK 4.5 11/15/39	8,390,000.000	16,440,446.630	
デンマーク・クローネ　小計		26,340,000.000	36,183,548.370	

		(424,074,000)	(582,555,129)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,822,734.760	
	NORWAY 1.75 02/17/27	3,970,000.000	4,096,007.800	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,891,238.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,176,605.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,624,576.000	
ノルウェー・クローネ　小計		19,810,000.000 (234,748,500)	20,611,161.560 (244,242,264)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 2.25 04/25/22	4,000,000.000	4,065,362.400	
	POLAND 2.5 01/25/23	1,350,000.000	1,386,223.330	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,369,224.140	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,440,000.000	2,536,787.720	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,280,000.000	2,371,895.400	
	POLAND 2.75 04/25/28	1,900,000.000	2,013,334.800	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,563,206.210	
	POLAND 4.0 10/25/23	3,100,000.000	3,365,220.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,910,664.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,902,578.000	
ポーランド・ズロチ　小計		22,900,000.000 (639,826,000)	24,484,496.500 (684,096,832)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,049,143.900	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,246,613.560	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,109,938.200	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,284,032.510	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	848,206.080	
	MALAYSIA 4.127 04/15/32	1,850,000.000	2,015,263.090	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,565,331.070	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,318,528.470	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	2,007,159.300	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,439,910.800	
	MALAYSIA 5.248 09/15/28	1,600,000.000	1,868,731.670	
マレーシア・リンギット　小計		20,980,000.000 (551,564,200)	22,752,858.650 (598,172,654)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,780,862.400	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	27,596,000.000	31,669,169.600	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,347,998.990	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	19,146,224.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,936,900.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	14,643,000.000	16,243,040.610	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,752,990.000	

	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	5,000,000.000	5,735,986.500	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,745,080.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	15,109,000.000	17,191,171.290	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	13,181,678.750	
メキシコ・ペソ　小計		145,488,000.000 (848,195,040)	161,731,102.640 (942,892,328)	
ユーロ	AUSTRIA 0.5 02/20/29	340,000.000	365,233.780	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	554,950.500	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	820,000.000	894,968.650	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	580,000.000	627,127.320	
	AUSTRIA 07/15/23	350,000.000	357,490.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	477,979.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	702,964.480	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	370,000.000	490,501.600	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	223,320.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	596,708.370	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	750,000.000	815,805.000	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	330,000.000	657,600.900	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	648,871.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	460,000.000	787,534.200	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	823,044.280	
	AUSTRIA 3.5 09/15/21	1,420,000.000	1,511,590.000	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	280,000.000	306,124.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	250,000.000	578,880.250	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,517,539.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	784,078.140	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	1,005,911.200	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	240,000.000	246,576.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	679,404.000	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	555,699.170	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	900,000.000	962,349.470	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	650,000.000	705,562.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	963,512.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	610,000.000	675,826.320	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	720,000.000	785,569.680	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	913,125.960	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	510,000.000	596,847.900	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	150,000.000	182,256.450	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	640,000.000	828,431.360	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	390,000.000	518,561.770	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	590,000.000	768,264.370	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	320,000.000	514,752.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	160,000.000	175,401.480	
	BELGIUM 2.25 06/22/57	320,000.000	495,011.200	
	BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,195,205.550	

		BELGIUM 3.0 06/22/34	470,000.000	671,575.290	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	630,000.000	1,140,077.610	
		BELGIUM 4.0 03/28/22	1,080,000.000	1,185,987.200	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	794,887.640	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,070,000.000	1,932,532.350	
		BELGIUM 4.25 09/28/21	1,240,000.000	1,336,779.270	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,342,364.620	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	790,000.000	1,032,012.550	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,210,000.000	2,108,414.110	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,834,291.080	
		BUNDESOBL 04/05/24	630,000.000	648,151.560	
		BUNDESOBL 04/08/22	1,340,000.000	1,359,483.600	
		BUNDESOBL 04/14/23	1,130,000.000	1,154,927.120	
		BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,425,468.800	
		BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,312,576.000	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,166,360.010	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	330,000.000	329,585.520	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,800,000.000	1,912,014.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,670,000.000	1,791,400.650	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,541,563.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,360,000.000	1,441,164.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,260,000.000	1,348,603.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,556,540.700	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,735,227.200	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,710,000.000	1,782,421.920	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	430,000.000	451,348.210	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,443,072.130	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	670,000.000	732,336.800	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,040,000.000	1,418,200.160	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	970,000.000	1,034,134.750	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	850,000.000	910,972.200	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,010,000.000	1,105,126.850	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,742,814.150	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,500,000.000	1,648,315.500	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,629,275.800	
		DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	1,650,000.000	1,733,737.500	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	1,500,000.000	1,642,399.500	
		DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	1,070,000.000	1,117,936.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,660,000.000	2,722,383.400	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,730,000.000	2,910,145.450	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	1,150,000.000	1,211,490.500	

		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	900,000.000	1,593,675.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,500,000.000	2,608,039.500	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	840,000.000	1,581,980.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	873,546.000	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,220,000.000	2,141,368.400	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	920,000.000	1,866,082.000	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	2,066,261.600	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,100,000.000	1,650,044.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,068,060.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,196,122.800	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,089,480.800	
		FINLAND 0.5 04/15/26	300,000.000	318,450.300	
		FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	320,863.200	
		FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	257,830.080	
		FINLAND 0.5 09/15/29	270,000.000	290,700.360	
		FINLAND 0.75 04/15/31	380,000.000	421,308.280	
		FINLAND 0.875 09/15/25	300,000.000	323,714.400	
		FINLAND 04/15/22	320,000.000	324,601.920	
		FINLAND 09/15/23	230,000.000	235,279.190	
		FINLAND 1.125 04/15/34	230,000.000	269,113.910	
		FINLAND 1.375 04/15/47	130,000.000	171,407.600	
		FINLAND 1.5 04/15/23	170,000.000	181,526.000	
		FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	423,508.800	
		FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	310,737.000	
		FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	546,753.200	
		FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	480,972.460	
		FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	536,820.810	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,332,572.800	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	610,000.000	624,198.970	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	1,380,000.000	1,443,714.600	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,620,000.000	2,764,912.200	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,195,822.880	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,190,000.000	2,348,906.400	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,610,000.000	2,849,065.560	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,140,000.000	2,341,695.000	
		FRANCE OAT 03/25/23	1,900,000.000	1,937,234.300	
		FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,787,075.200	
		FRANCE OAT 03/25/25	1,270,000.000	1,304,197.290	
		FRANCE OAT 05/25/21	2,510,000.000	2,529,578.000	
		FRANCE OAT 05/25/22	3,000,000.000	3,044,145.000	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	1,650,000.000	1,819,695.900	

		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,720,000.000	1,869,707.420	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,740,000.000	2,051,009.340	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,990,000.000	2,357,752.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	2,290,000.000	2,721,035.930	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,560,000.000	1,996,887.360	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	1,930,000.000	2,081,181.330	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	650,000.000	938,981.810	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,280,000.000	1,653,017.600	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,979,171.080	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,490,000.000	2,099,052.400	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,222,787.600	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	3,030,000.000	3,266,340.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,770,000.000	3,551,943.300	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,700,000.000	3,361,899.600	
		FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,850,000.000	3,077,298.900	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,640,000.000	2,775,579.950	
		FRANCE OAT 3.25 10/25/21	2,980,000.000	3,175,207.880	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,800,000.000	3,492,720.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	960,000.000	2,018,496.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	790,000.000	1,754,353.000	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,594,502.280	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,500,000.000	4,133,815.000	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,270,000.000	4,262,179.240	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,836,647.000	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,912,402.640	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,120,000.000	3,710,970.960	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,474,306.090	
		IRISH 0.4 05/15/35	220,000.000	228,690.000	
		IRISH 0.8 03/15/22	370,000.000	380,266.310	
		IRISH 0.9 05/15/28	580,000.000	635,912.000	
		IRISH 1.0 05/15/26	680,000.000	738,160.400	
		IRISH 1.1 05/15/29	340,000.000	380,505.220	
		IRISH 1.3 05/15/33	260,000.000	303,329.260	
		IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	243,224.520	
		IRISH 1.5 05/15/50	270,000.000	340,213.500	
		IRISH 1.7 05/15/37	320,000.000	399,430.400	
		IRISH 10/18/22	220,000.000	223,233.250	
		IRISH 2.0 02/18/45	540,000.000	742,040.460	
		IRISH 2.4 05/15/30	690,000.000	869,797.440	
		IRISH 3.4 03/18/24	510,000.000	591,436.290	
		IRISH 3.9 03/20/23	240,000.000	273,007.030	
		IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	1,038,153.350	
		ITALY BTPS 0.35 11/01/21	1,700,000.000	1,714,793.400	
		ITALY BTPS 0.45 06/01/21	910,000.000	917,889.700	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	999,276.600	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	1,002,540.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	944,703.840	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,098,997.000	
		ITALY BTPS 1.2 04/01/22	770,000.000	791,021.000	

		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,411,015.140	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,040,000.000	1,078,825.280	
		ITALY BTPS 1.35 04/15/22	1,660,000.000	1,710,561.940	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,624,833.210	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	1,500,000.000	1,556,834.550	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,096,555.200	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,787,600.880	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,500,000.000	1,601,550.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	640,000.000	677,420.800	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,610,000.000	1,719,641.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,526,439.620	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,055,541.390	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,600,000.000	1,758,691.200	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	130,000.000	142,703.600	
		ITALY BTPS 2.15 12/15/21	1,680,000.000	1,749,720.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	520,000.000	576,732.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,139,544.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,100,000.000	1,261,667.440	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	610,000.000	678,930.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	550,000.000	613,303.350	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	970,000.000	1,070,437.680	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,200,642.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	660,000.000	785,400.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,400,000.000	1,632,570.800	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,141,536.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	780,000.000	928,590.000	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	520,000.000	644,788.560	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,276,971.300	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	970,000.000	1,225,385.480	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,364,614.140	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,640,000.000	2,037,139.120	
		ITALY BTPS 3.75 05/01/21	2,300,000.000	2,407,985.000	
		ITALY BTPS 3.75 08/01/21	3,200,000.000	3,381,088.000	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,900,000.000	2,195,355.000	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,057,044.120	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	970,000.000	1,330,258.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,277,501.800	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	2,017,940.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,596,466.200	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,202,860.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/21	2,470,000.000	2,653,768.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	750,000.000	993,885.750	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,528,324.240	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/22	1,700,000.000	1,875,950.000	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,203,660.050	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,383,444.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,076,396.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,440,000.000	2,259,648.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,030,000.000	2,841,594.000	

		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,309,852.760	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,249,347.350	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,967,360.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,000,000.000	3,038,800.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,562,206.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,551,420.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,577,107.000	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,020,000.000	1,066,524.240	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	838,062.810	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	340,000.000	377,928.730	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	1,003,027.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,000,000.000	1,092,827.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	750,000.000	826,902.000	
		NETHERLANDS 01/15/22	460,000.000	465,692.500	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,230,000.000	1,261,270.290	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,110,000.000	1,202,160.180	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	915,858.570	
		NETHERLANDS 2.25 07/15/22	880,000.000	941,995.120	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	910,000.000	1,240,217.160	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	900,000.000	1,569,478.500	
		NETHERLANDS 3.25 07/15/21	1,860,000.000	1,961,398.860	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/23	300,000.000	339,360.000	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	960,000.000	1,770,102.720	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,625,450.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,259,700.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	340,000.000	347,865.560	
		SPAIN 0.35 07/30/23	1,120,000.000	1,147,028.500	
		SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,599,406.100	
		SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,371,958.190	
		SPAIN 0.5 04/30/30	850,000.000	875,209.300	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,080,000.000	1,125,199.080	
		SPAIN 0.75 07/30/21	1,700,000.000	1,730,642.500	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,070,000.000	1,168,504.200	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,376,237.560	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,540,000.000	1,709,862.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,370,000.000	1,534,712.360	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,480,000.000	1,642,648.430	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,341,769.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,660,000.000	1,816,114.700	

	SPAIN 1.85 07/30/35	490,000.000	585,263.350	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,530,000.000	1,725,536.440	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,650,000.000	1,945,153.650	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,580,000.000	1,787,844.260	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,140,000.000	1,428,420.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,225,082.900	
	SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,757,976.220	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,040,000.000	1,516,138.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	760,000.000	1,345,154.400	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,488,084.400	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,340,000.000	2,127,163.030	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,430,000.000	1,679,863.900	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,730,023.670	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,070,000.000	1,901,875.780	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,357,707.990	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	2,096,406.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	880,000.000	1,264,472.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	830,000.000	1,620,072.850	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,709,572.400	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	2,032,394.340	
	SPAIN 5.85 01/31/22	1,810,000.000	2,031,806.450	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,170,000.000	1,620,970.650	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,408,319.740	
ユーロ　小計		317,970,000.000 (38,261,330,100)	390,071,468.770 (46,937,299,837)	
南アフリカ・ランド	SOUTH AFRICA 10.5 12/21/26	16,420,000.000	18,631,941.480	
	SOUTH AFRICA 6.25 03/31/36	7,460,000.000	5,385,685.820	
	SOUTH AFRICA 6.5 02/28/41	3,570,000.000	2,501,499.350	
	SOUTH AFRICA 7.0 02/28/31	7,030,000.000	6,045,800.000	
	SOUTH AFRICA 7.75 02/28/23	3,600,000.000	3,724,944.120	
	SOUTH AFRICA 8.0 01/31/30	10,900,000.000	10,316,794.950	
	SOUTH AFRICA 8.25 03/31/32	6,590,000.000	6,131,889.560	
	SOUTH AFRICA 8.5 01/31/37	8,820,000.000	7,882,829.400	
	SOUTH AFRICA 8.75 01/31/44	10,000,000.000	8,865,793.400	
	SOUTH AFRICA 8.75 02/28/48	16,040,000.000	14,125,189.700	
	SOUTH AFRICA 8.875 02/28/35	8,410,000.000	7,920,731.430	
	SOUTH AFRICA 9.0 01/31/40	4,860,000.000	4,458,520.740	
南アフリカ・ランド　小計		103,700,000.000	95,991,619.950	

		(761,158,000)	(704,578,490)	
国債証券　合計		110,822,058,440 (110,822,058,440)	127,282,939,063 (127,282,939,063)	
合計			127,282,939,063 (127,282,939,063)	

（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	161銘柄	48.33	49.48
イギリス・ポンド	国債証券	38銘柄	6.23	6.38
オーストラリア・ドル	国債証券	19銘柄	1.83	1.87
カナダ・ドル	国債証券	23銘柄	1.81	1.86
シンガポール・ドル	国債証券	11銘柄	0.37	0.38
スウェーデン・クローナ	国債証券	5銘柄	0.21	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券	4銘柄	0.45	0.46
ノルウェー・クローネ	国債証券	5銘柄	0.19	0.19
ポーランド・ズロチ	国債証券	10銘柄	0.52	0.54
マレーシア・リンギット	国債証券	11銘柄	0.46	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券	11銘柄	0.72	0.74
ユーロ	国債証券	281銘柄	36.02	36.88
南アフリカ・ランド	国債証券	12銘柄	0.54	0.55

（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3期中間計算期間（令和2年2月26日から令和2年8月25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】

【４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 令和2年2月25日現在	第3期中間計算期間末 令和2年8月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,498,573	35,345,956
親投資信託受益証券	484,035,341	1,116,628,253
未収入金	－	117,000
流動資産合計	501,533,914	1,152,091,209
資産合計	501,533,914	1,152,091,209
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,100,532	449,602
未払受託者報酬	43,041	94,190
未払委託者報酬	258,377	565,353
その他未払費用	7,949	16,919
流動負債合計	2,409,899	1,126,064
負債合計	2,409,899	1,126,064
純資産の部		
元本等		
元本	476,387,146	1,094,581,947
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	22,736,869	56,383,198
（分配準備積立金）	9,407,683	7,302,637
元本等合計	499,124,015	1,150,965,145
純資産合計	499,124,015	1,150,965,145
負債純資産合計	501,533,914	1,152,091,209

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自　平成31年2月26日 至　令和1年8月25日	第3期中間計算期間 自　令和2年2月26日 至　令和2年8月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	836,532	25,481,912
営業収益合計	836,532	25,481,912
営業費用		
支払利息	2,998	7,123
受託者報酬	25,618	94,190
委託者報酬	165,083	565,353
その他費用	4,792	16,919
営業費用合計	198,491	683,585
営業利益又は営業損失（△）	638,041	24,798,327
経常利益又は経常損失（△）	638,041	24,798,327
中間純利益又は中間純損失（△）	638,041	24,798,327
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（△）	126,609	△3,821,717
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,696,107	22,736,869
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,099,882	10,609,407
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	2,099,882	10,609,407
剰余金減少額又は欠損金増加額	625,478	5,583,122
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	625,478	5,583,122
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（△）	3,681,943	56,383,198

（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3期中間計算期間 自　令和2年2月26日 至　令和2年8月25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。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第2期 令和2年2月25日現在	第3期中間計算期間末 令和2年8月25日現在
１．　期首元本額	194,621,025円	476,387,146円
期中追加設定元本額	459,829,471円	779,864,133円
期中一部解約元本額	178,063,350円	161,669,332円
２．　受益権の総数	476,387,146口	1,094,581,947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2期 令和2年2月25日現在	第3期中間計算期間末 令和2年8月25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2期 令和2年2月25日現在	第3期中間計算期間末 令和2年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0477円 (10,477円)	1.0515円 (10,515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、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国債券パッシブ・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8月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,319,176,301
株式	231,942,427,470
派生商品評価勘定	180,030,290
未収入金	37,245,020
未収配当金	283,620,550
流動資産合計	237,762,499,631
資産合計	237,762,499,631
負債の部	
流動負債	
前受金	156,885,000
未払解約金	96,452,000
流動負債合計	253,337,000
負債合計	253,337,000
純資産の部	
元本等	
元本	91,030,570,720
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	146,478,591,911
元本等合計	237,509,162,631
純資産合計	237,509,162,631
負債純資産合計	237,762,499,631

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2月26日 至　令和2年8月25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8月25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	98,480,866,315円
同期中追加設定元本額	28,105,180,492円
同期中一部解約元本額	35,555,476,087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	15,241,593,187円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	3,114,013,913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）	9,364,072円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	32,835,196円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	22,268,527円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,952,586円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	725,594,771円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	508,734,201円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	18,639,068円
たわらノーロード　バランス（標準型）	110,409,623円
たわらノーロード　バランス（積極型）	164,438,389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）	723,517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）	49,063,016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）	148,174,443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）	99,409,362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）	175,482,295円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	404,155円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,276,719円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	3,794,563円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,370,734円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	5,394,355円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	35,750,245,686円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,094,029,715円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,561,201,582円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,576,703,893円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	368,040,430円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,249,302,906円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,142,083,520円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	37,792,869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）	331,204,634円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	263,826,802円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	441,524,336円
投資のソムリエ	5,510,130,185円
クルーズコントロール	1,088,452,596円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	480,155,429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＞	362,592,626円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	1,045,284円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	8,243,327円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	22,431,039円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	159,052,030円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,507,311,248円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	10,856,011円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	5,879,445円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,533,990円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	14,462,117円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	90,619,535円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,031,532,737円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	252,841,454円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	2,708,496円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	1,340,803円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	1,318,574円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	3,193,693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）	3,830,972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）	4,586,305円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	112,531,148円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	52,519,196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）	219,570,802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）	6,143,524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）	90,400,590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）	182,974,955円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	12,437,508円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	42,741,259円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,169,890円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,624,158円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,901,048円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	57,082,676円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	863,908,782円

	ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	881,020,067円
	ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,475,579,024円
	ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	177,810,597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）	47,811,776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）	461,471,460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）	115,643,652円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,369,764円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,145,932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）	467,579,803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）	32,486,955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）	120,647,492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）	312,047,725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）	395,661,899円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,643,104円
	ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,525,984円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,217,846円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	113,638円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	130,752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）	404,410,942円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０３）（適格機関投資家限定）	1,274,945,305円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,685,747,142円
	ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０９）（適格機関投資家限定）	67,341,342円
	計	91,030,570,720円
２．	受益権の総数	91,030,570,720口
３．	差入代用有価証券	
	株式	1,787,250,000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8月25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8月25日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 　先物取引 　　買建	4,492,235,000	－	4,672,360,000	180,125,000
合計	4,492,235,000	－	4,672,360,000	180,125,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.6091円 (26,091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8月25日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,567,093,976
国債証券	177,818,508,000
地方債証券	16,796,862,000
特殊債券	15,305,943,567
社債券	9,569,946,230
未収利息	501,663,807
前払費用	24,161,279
流動資産合計	221,584,178,859
資産合計	221,584,178,859
負債の部	
流動負債	
未払解約金	50,054,000
流動負債合計	50,054,000
負債合計	50,054,000
純資産の部	
元本等	
元本	169,564,177,814
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	51,969,947,045
元本等合計	221,534,124,859
純資産合計	221,534,124,859
負債純資産合計	221,584,178,859

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2月26日 至　令和2年8月25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8月25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	169,257,068,344円
同期中追加設定元本額	52,703,070,185円
同期中一部解約元本額	52,395,960,715円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	19,604,189,576円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	76,387,550円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	62,545,953円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	13,628,388円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	803,421,056円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	239,377,758円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,201,963円
たわらノーロード　国内債券	11,810,768,160円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	959,800,398円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	323,276,072円
たわらノーロード　バランス（標準型）	513,879,379円
たわらノーロード　バランス（積極型）	62,380,632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）	20,617,566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）	605,218,950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）	577,398,436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）	141,171,611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）	10,048,867円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	9,136,081円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	6,109,601円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	10,430,756円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,751,888円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	741,286円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,037,999,300円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	7,264,766,463円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	9,617,405,066円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,819,034,050円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	1,848,851,563円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,957,469,795円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	308,751,808円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	74,261,775円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,238,625,325円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	9,343,546円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	3,569,781,296円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,051,416,620円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	208,756,311円
投資のソムリエ	8,926,181,975円
クルーズコントロール	2,110,278,014円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	759,312,987円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	3,175,357,394円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	393,255,629円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	2,020,681円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,281,894円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	14,490,573円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,289,779,179円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	12,447,033,979円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	8,004,716円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,334,095円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	12,629,058円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	16,122,681円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	453,793,883円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,889,741,754円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,713,359,856円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	2,081,188円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	990,198円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	972,499円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	7,586,371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）	450,865,709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）	552,942,023円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,496,983,121円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,870,899,721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）	893,319,589円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	317,205,504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Ⅱ（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Ⅲ（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Ⅳ（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Ⅴ（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）	762,353,523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）	134,532,022円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	53,456,414円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	124,713,207円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	60,557,089円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,627,743円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	74,240,941円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	157,456,681円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,241,219,441円

	ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,424,427,997円
	ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,542,084,448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）	489,076,244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）	219,305,371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）	2,572,065,265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）	212,696,130円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	13,038,874円
	ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	52,099,504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）	2,286,685,143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）	61,239,402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）	464,748,369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）	762,576,210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）	1,229,651,261円
	ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	330,839,353円
	ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,996,657円
	ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,054,176円
	ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	734,920円
	ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	401,998円
	Ｏｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドＩ（適格機関投資家限定）	1,034,577,783円
	計	169,564,177,814円
２．	受益権の総数	169,564,177,814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8月25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8月25日現在
1口当たり純資産額	1.3065円
（1万口当たり純資産額）	(13,065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8月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,343,877,090
コール・ローン	533,460,049
株式	338,329,545,343
新株予約権証券	3,007,046
投資信託受益証券	659,902,159
投資証券	7,401,816,274
派生商品評価勘定	180,334,278
未収入金	5,356,168
未収配当金	569,847,736
差入委託証拠金	3,205,114,332
流動資産合計	353,232,260,475
資産合計	353,232,260,475
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,666,100
未払解約金	90,839,700
流動負債合計	93,505,800
負債合計	93,505,800
純資産の部	
元本等	
元本	86,933,580,091
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	266,205,174,584
元本等合計	353,138,754,675
純資産合計	353,138,754,675
負債純資産合計	353,232,260,475

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2月26日 至　令和2年8月25日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	令和2年8月25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	88,613,273,386円
同期中追加設定元本額	20,686,503,262円
同期中一部解約元本額	22,366,196,557円

元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,969,079,335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）	9,199,295円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	34,424,027円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	34,055,691円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,662,437円
たわらノーロード　先進国株式	16,114,222,439円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	109,090,057円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,092,272,228円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	326,275,661円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	35,613,705円
たわらノーロード　バランス（標準型）	274,977,702円
たわらノーロード　バランス（積極型）	322,173,564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）	1,033,912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）	124,200,394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）	306,866,375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）	209,071,398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）	326,208,897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）	357,458円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	1,738,128円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,592,983円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,077,186円
たわらノーロード　全世界株式	64,004,267円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	45,241,640,427円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	299,910,852円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	188,709,416円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	944,133,577円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,123,260,014円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	119,456,443円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	357,178,043円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	295,598,004円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	27,808,364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	172,199,979円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	213,428,011円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	175,381,520円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	283,915,654円
投資のソムリエ	1,288,290,728円
クルーズコントロール	359,937,131円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	111,342,784円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	200,619,502円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	111,323,104円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	345,213円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,825,987円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	4,942,408円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	81,007,660円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	769,432,831円
ワールドアセットバランス（基本コース）	427,026,187円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	693,860,002円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	1,153,039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）	783,474円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	2,330,177円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	29,022,849円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	745,970,799円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	161,648,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	300,392円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	141,000円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	139,965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）	893,249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）	1,085,767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）	261,237,304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）	85,758,999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）	1,743,240,864円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	297,528,972円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	203,270,676円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,195,260円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,411,614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）	57,221,578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）	115,617,649円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,868,098円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	41,236,190円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,158,386円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,198,208円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,001,185円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	54,086,308円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	364,814,682円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	486,639,177円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,563,606,676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）	549,975,575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）	88,866,332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）	590,220,568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）	24,268,729円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,604,397円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,699,876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）	196,353,152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）	20,931,357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）	77,736,213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）	130,903,793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）	253,528,919円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,344,131円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	216,723円

ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	249,625円
計	86,933,580,091円
２．　受益権の総数	86,933,580,091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8月25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8月25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	29,522,865	－	29,523,930	△1,065
イギリス・ポンド	29,522,865	－	29,523,930	△1,065
買建	570,276,119	－	570,914,300	638,181
アメリカ・ドル	448,194,500	－	448,698,000	503,500
オーストラリア・ドル	9,326,957	－	9,357,840	30,883
カナダ・ドル	17,971,657	－	17,937,920	△33,737
ユーロ	94,783,005	－	94,920,540	137,535
合計	599,798,984	－	600,438,230	637,116

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	令和2年8月25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	6,697,500,553	－	6,874,531,615	177,031,062
合計	6,697,500,553	－	6,874,531,615	177,031,062

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	令和2年8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	4.0622円 (40,622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8月25日現在
資産の部	
流動資産	
預金	439,874,144
コール・ローン	267,612,907
国債証券	127,548,491,775
未収利息	740,180,169
前払費用	45,961,092
流動資産合計	129,042,120,087
資産合計	129,042,120,087
負債の部	
流動負債	
未払解約金	29,672,900
流動負債合計	29,672,900
負債合計	29,672,900
純資産の部	
元本等	
元本	64,638,591,218
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	64,373,855,969
元本等合計	129,012,447,187
純資産合計	129,012,447,187
負債純資産合計	129,042,120,087

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2月26日 至　令和2年8月25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8月25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	66,694,972,797円
同期中追加設定元本額	10,884,192,162円
同期中一部解約元本額	12,940,573,741円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,054,847,696円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	6,100,144円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	17,551,332円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	15,887,441円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	64,162,675円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	67,168,137円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	27,047,736円
たわらノーロード　先進国債券	8,358,292,369円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	151,831,844円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	655,569,729円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	17,759,882円
たわらノーロード　バランス（標準型）	81,157,140円
たわらノーロード　バランス（積極型）	16,380,848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）	2,635,772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）	179,649,721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）	229,243,469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）	76,744,919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）	40,868,196円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	195,440円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,237,239円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	5,439,701円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,300,614円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	2,944,429円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,007,437,803円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	35,030,274円

ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	585,116,337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	1,808,206,538円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	355,591,561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	586,562,144円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,628,872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	2,103,026,165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＞	187,703,243円
クルーズコントロール＜ＤＣ年金＞	2,014,304円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,291,357円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	14,418,406円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	84,881,257円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	129,207,446円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	2,020,712円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,183,565,773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）	2,834,841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）	3,442,275円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	459,678,226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）	5,895,751,949円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,947,577,200円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,329,031,976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）	63,986,344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）	4,464,798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）	529,911,159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）	356,854,218円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	35,422,341円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	55,086,099円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,045,773円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,077,049円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	49,197,934円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	69,545,488円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,461,962,606円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,745,067,045円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,010,145,359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）	538,645,957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）	203,446,021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）	2,270,861,998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）	508,977,269円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,308,666円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド３５ＶＡ（適格機関投資家限定）	76,769,634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）	378,287,972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）	504,148,058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）	650,740,388円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	66,602,434円
ＤＩＡＭバランス２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,742,002円
ＤＩＡＭバランス４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	347,346円
ＤＩＡＭバランス６０ＶＡ（適格機関投資家限定）	159,728円
計	64,638,591,218円
２．　受益権の総数	64,638,591,218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8月25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8月25日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9959円 (19,959円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

令和2年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	1,157,590,430円
Ⅱ　負債総額	1,826,743円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,155,763,687円
Ⅳ　発行済数量	1,100,804,026口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0499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8月31日現在

Ⅰ　資産総額	236,185,318,826円
Ⅱ　負債総額	142,673,550円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	236,042,645,276円
Ⅳ　発行済数量	90,846,562,242口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5983円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	227,574,078,700円
Ⅱ　負債総額	5,393,189,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	222,180,889,700円
Ⅳ　発行済数量	170,329,923,607口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3044円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	379,896,148,348円
Ⅱ　負債総額	1,487,747,550円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	378,408,400,798円
Ⅳ　発行済数量	92,047,628,086口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	4.1110円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

令和2年8月31日現在

Ⅰ　資産総額	129,627,584,344円
Ⅱ　負債総額	1,105,343,853円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	128,522,240,491円
Ⅳ　発行済数量	64,847,752,561口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9819円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【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8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8月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年8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	1,233,048,725,219
追加型株式投資信託	859	14,042,319,951,738
単位型公社債投資信託	36	91,165,290,214
単位型株式投資信託	193	1,256,166,938,083
合計	1,114	16,622,700,905,254

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		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		2,411,540		3,524,781
ソフトウエア		885,545		3,299,065
ソフトウエア仮勘定		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		9,269,808		9,482,127
投資有価証券		1,611,931		261,361
関係会社株式		4,499,196		5,299,196
長期差入保証金		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	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	利益準備金	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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの：決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
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おります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第34期（2019年3月31日現在）

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

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			
その他有価証券	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）
①非上場株式	276,764	259,369
②関係会社株式	4,499,196	5,299,196

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

②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

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

（注）非上場株式（貸借対照表計上額276,764千円）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			
①株式	―	―	―
②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			
①株式	―	―	―
②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 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第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	―	―
	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
	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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

ａ．名称

みずほ信託銀行株式会社

ｂ．資本金の額

2020年3月末日現在　247,369百万円

ｃ．事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
富国生命保険相互会社	（※）128,000	日本において保険業務を営んでおります。

（注）資本金の額は2020年3月末日現在

（※）「基金」および「基金償却積立て額」の総額

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2) 信託財産の計算

(3) 信託財産に関する報告書の作成

(4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1) 募集の取扱い

(2) 追加設定の申込事務

(3) 信託契約の一部解約事務

(4) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払い

(5) 受益者に対する収益分配金の再投資

(6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7) その他上記に付帯する業務

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
①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
②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。
①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
②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第１「ファンドの状況」５「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。
(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。
(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。
(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用する場合があります。

独立監査人の監査報告書

２０２０年5月２７日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

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

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の２０１９年４月１日から２０２０年３月３１日までの第３５期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の２０２０年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠
当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任
監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。
監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。
・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以　上

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

（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

令和２年４月３日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会　御 中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　丘本　正彦　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の平成３１年２月２６日から令和２年２月２５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、４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の令和２年２月２５日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以　上

（注１）上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

令和２年１０月９日

アセットマネジメントOne株式会社

取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　　山野　浩　　印

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４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の令和２年２月２６日から令和２年８月２５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に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞の令和２年８月２５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２月２６日から令和２年８月２５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）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。