

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券報告書  
**【提出先】** 関東財務局長殿  
**【提出日】** 2021年7月12日提出  
**【計算期間】** 第12期(自 2020年10月13日 至 2021年4月12日)  
**【ファンド名】** D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)  
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)  
**【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  
**【連絡場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号  
**【電話番号】** 03-6774-5100  
**【縦覧に供する場所】** 該当事項はありません。

## 第一部【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】

各ファンドは、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。

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

#### <ファンドの特色>

## 1 国内外の6資産に分散投資することにより、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。

- 主として、日本、先進国および新興国の債券・株式にマザーファンドを通じて実質的に投資します。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合があります。
- 実質的な組入外貨建資産に対しては、原則として、対円での為替ヘッジを行いません。
- 6資産の配分比率(以下、基本配分比率とします。)は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

## 2 基準価額の下落を一定水準(下値目安値<sup>(\*)</sup>)までに抑えることを目標とします。

- 資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時では基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
- 基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率とします。)を機動的に変更します。
- 下値目安値は、3ヵ月毎に改定します(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には翌営業日。)

(\*)基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)

## 3 下値目安値の異なる堅実型と積極型から選択できます。なお、2ファンド間でスイッチングが可能です。

- 各ファンドの下値目安値は、以下の通りとします。ただし、委託会社の判断により今後変更する場合があります。  
(堅実型)改定日の基準価額の-2.5%  
(積極型)改定日の基準価額の-3.5%

※スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

※基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

## ■ 分配方針

年2回の決算時(毎年4月、10月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

## 商品分類表

## 各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 商品分類定義

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

## 属性区分表

## 各ファンド

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

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

(注) 各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

資産複合(投資信託証券(債券、株式)、先物、ETF、短期金融資産)資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産(投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産)を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年 2 回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル(日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジなし	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

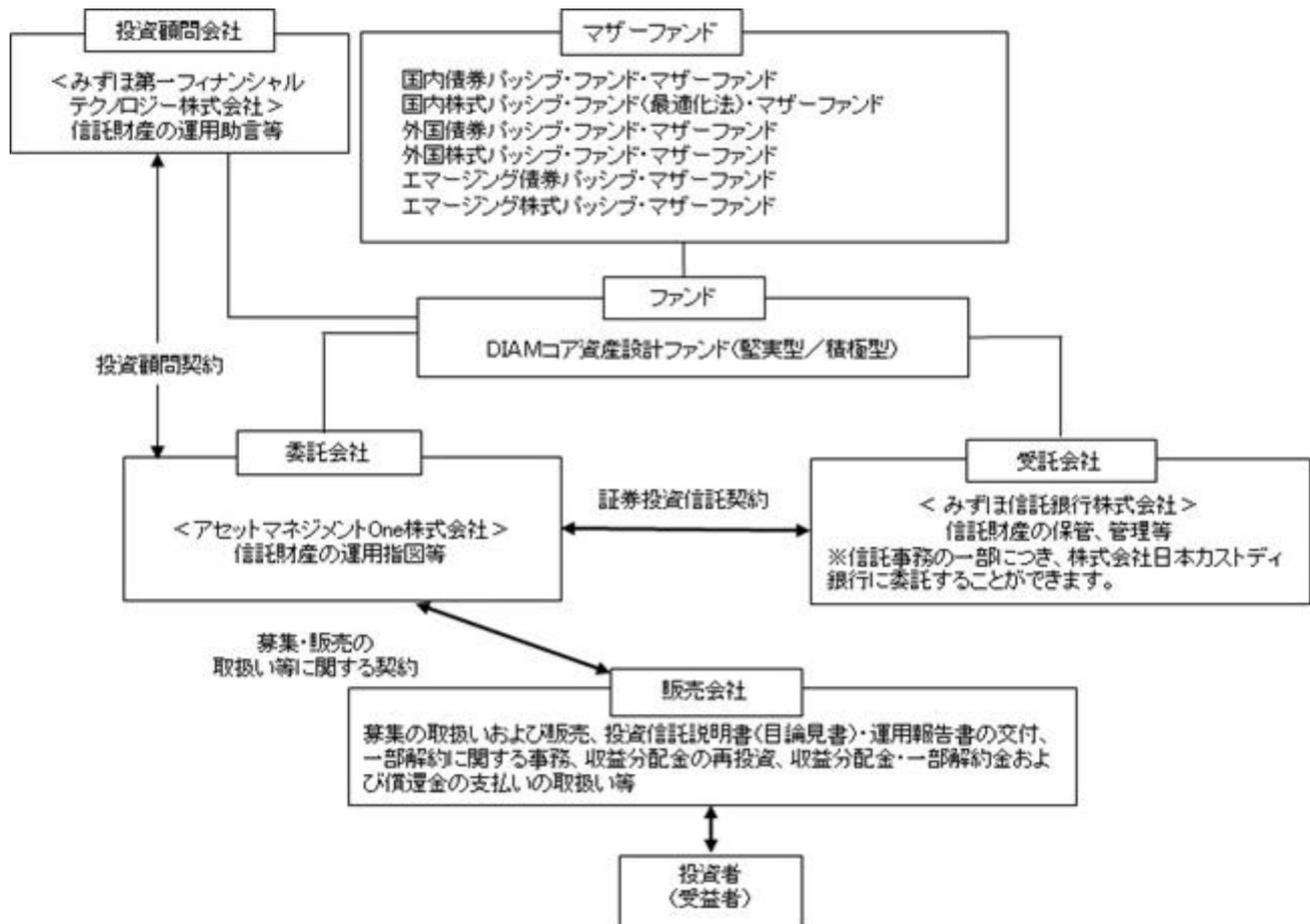
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ(<https://www.toushin.or.jp/>)でご覧いただけます。

## (2)【ファンドの沿革】

2015年8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

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

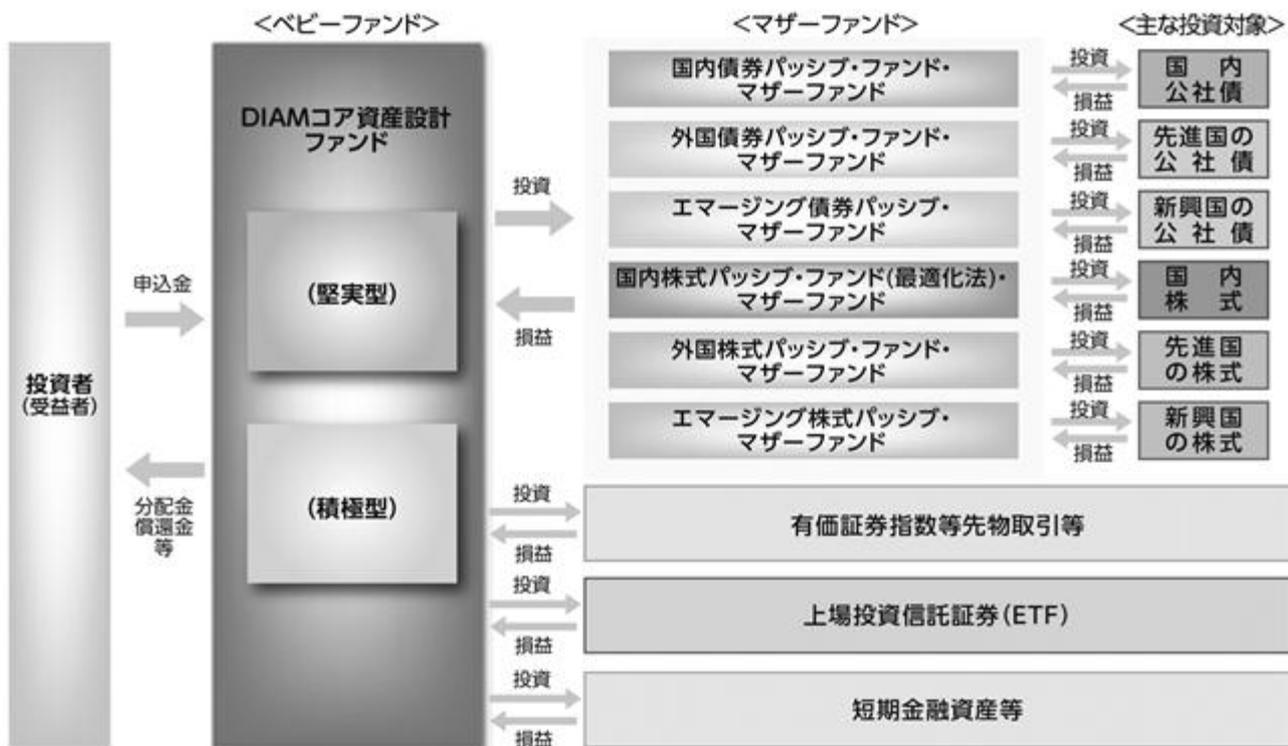
- ・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。当該契約の内容は、投資顧問サービスの内容、助言の基本方針、運用の責任等について規定したものです。

「ファミリーファンド方式」とは

## 各ファンドは「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(各ファンド)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（2021年4月30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

（2021年4月30日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### <基本方針>

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

#### <投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等に投資する場合があります。

#### <投資態度>

以下のマザーファンド受益証券（以下、それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）への投資を通じて、日本、先進国および新興国の債券・株式の6資産に実質的に分散投資を行います。マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、上場投資信託証券（ETF）、短期金融資産等（\*）に投資する場合があります。

（\*）市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド  
 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド  
 エマージング債券パッシブ・マザーファンド  
 エマージング株式パッシブ・マザーファンド

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

6資産の配分比率（以下、基本配分比率とします。）は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率（以下、合計資産比率といいます。）を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資



産価値下落時には基準価額の下落を一定水準(下値目安値(\*))までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。

(\* ) 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。 )。

基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

## 運用プロセス

### ・基本配分比率の決定

委託会社は、年に一度、統計的手法を用いて現金等を除く各資産への基本配分比率を決定します。

### ・下値目安値の決定

委託会社は、3ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の97.5%(堅実型)の場合)もしくは96.5%(積極型)の場合)の水準を翌3ヵ月間の下値目安値とします。

### ・リバランスの実施

委託会社は、各資産の上昇益を享受しつつも基準価額が下値目安値を下回らないことを目標として、基準価額と下値目安値の水準、市況などを基に、日々の合計資産比率の推奨値を決定します。ファンドの合計資産比率と推奨値との乖離が一定以上となった場合にはリバランスを実施します。6資産への投資比率は、基本配分比率と合計資産比率から決定します。

### ・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

基本配分比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

## (2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンドの各受益証券のほ

か次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうち、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
18. 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
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せん。)
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、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

## （参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
	<p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 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。 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</p>

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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</li><li>2. 最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。</li><li>3. 株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</li><li>4. 株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。</li><li>5. 非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。</li></ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px;"><p>東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「株東京証券取引所」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は株東京証券取引所が有しています。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p><p>当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、株東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。</p><p>株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。</p><p>株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。</p><p>以上の項目に限らず、株東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。</p></div>
------	---

## 運用プロセス

## 1.流動性基準等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、流動性が低い銘柄等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。

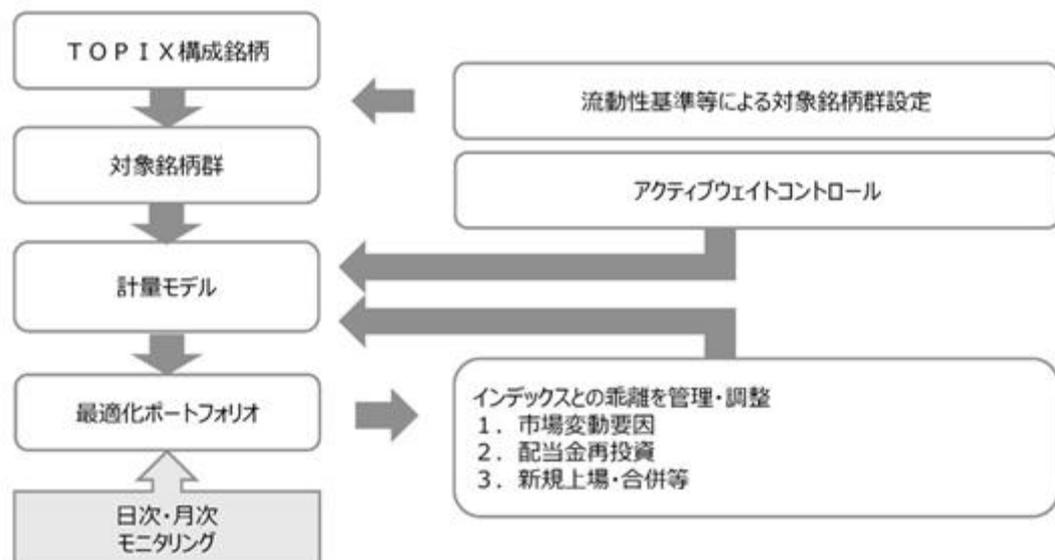
## 3.インデックスとの乖離を管理

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。

組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

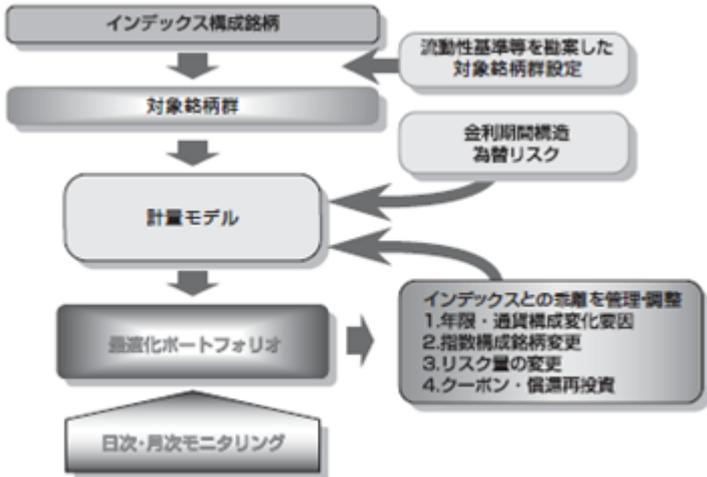
- ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
- ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施
- ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定



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

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



運用プロセス	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 年限・通貨構成変化要因</li> <li>・ 指数構成銘柄変更</li> <li>・ リスク量の変更</li> <li>・ クーポン・償還再投資</li> </ul> 
主な投資制限	<p>1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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

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

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

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

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

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

### 運用プロセス

#### 1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

#### 2.最適化法によるポートフォリオの構築

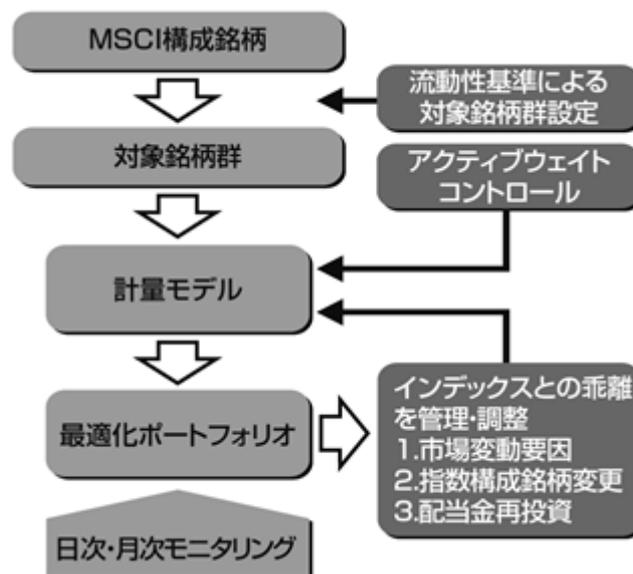
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

#### 3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</li> <li>2. 原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</li> <li>3. 組入債券は、当初組入時において、S&amp;PもしくはMoody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未滿となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</li> <li>4. 外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</li> </ol> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>

<p>運用プロセス</p>	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

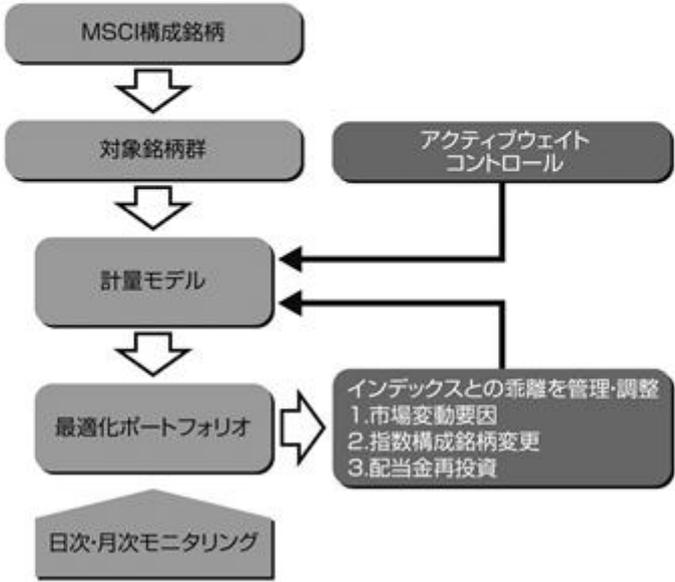
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式<sup>(*)</sup>に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。



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

本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックするMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIまたはその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマークおよびトレードネーム、ならびに、本ファンドまたは本ファンドの発行会社、所有者、その他の者もしくは団体に限りなく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。

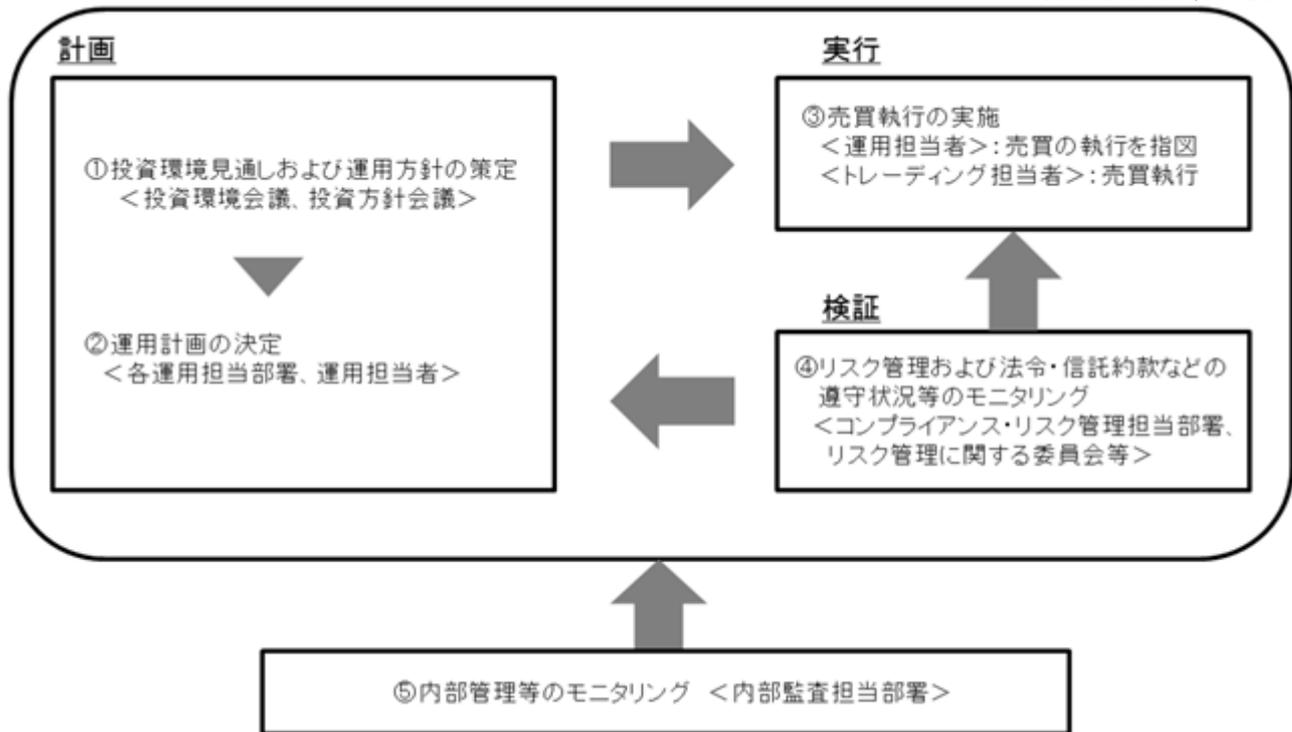
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。          日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD     A[MSCI構成銘柄] --&gt; B[対象銘柄群]     B --&gt; C[計量モデル]     C --&gt; D[最適化ポートフォリオ]     D --&gt; E[日次・月次モニタリング]          F[アクティブウェイトコントロール] --&gt; C     F --&gt; D          G["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --&gt; D     G --&gt; E          D --&gt; H[ ]     style H fill:none,stroke:none     H --&gt; E         </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 株式への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。</li> <li>3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</li> <li>4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</li> <li>5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</li> <li>6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</li> </ol>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

### （3）【運用体制】

#### a. ファンドの運用体制



#### 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

#### 運用計画の決定

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

#### 売買執行の実施

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

## モニタリング

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

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

## 内部管理等のモニタリング

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

### b. ファンドの関係法人に関する管理

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

### c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

## (4) 【分配方針】

### 収益分配方針

毎決算時(原則として毎年4月、10月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

#### (1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

#### (2) 分配対象額についての分配方針

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

#### (3) 留保益の運用方針

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

### 収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益(配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。)とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。)との合計額から、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  - 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

#### 収益分配金の支払い

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

「分配金自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、収益分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### (5) 【投資制限】

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

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

マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。))な投資信託証券をいいます。)を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。(約款「運用の基本方針」2. 運用方法 (3) 投資制限)

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する実質比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、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)

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)

非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)

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします(以下同じ。)
  - 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信

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

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

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

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

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

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

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



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

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等の1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)とマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるマザーファンドが限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。))を加えた額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ 規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- 2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同

じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の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基に算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

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

2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に

属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- 3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### 資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

### 3【投資リスク】

#### <基準価額の主な変動要因>

各ファンドは、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。

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

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

#### ・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・金利リスク

金利の上昇(債券の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

#### ・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。

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、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

## ・流動性リスク

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

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

## ・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。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

## &lt;その他の留意点&gt;

各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、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。

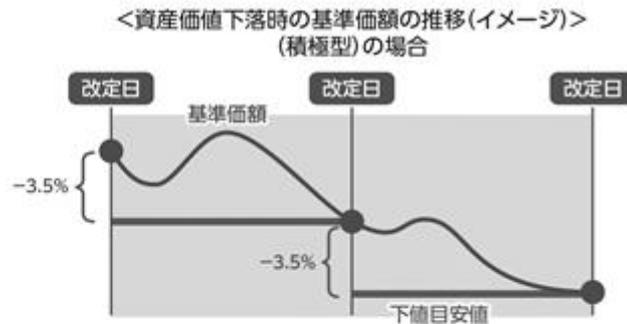
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

(堅実型)(積極型)の2つのファンド間でスイッチングを行うことができます。ただし、販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせください。

ファンドは下値目安値を改定日の基準価額をもとに決定し、損失の抑制をめざして合計資産比率を調整します。ただし損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

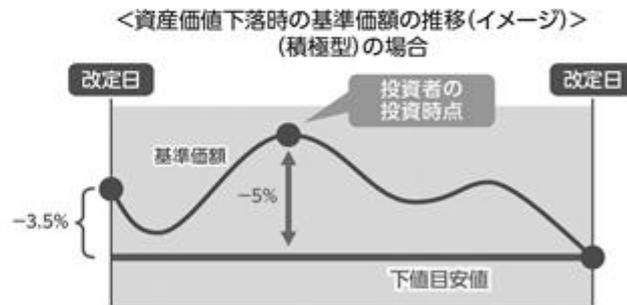
### ケース① 下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月(四半期)毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、ファンドの基準価額は長期的に2.5%(堅実型)の場合もしくは3.5%(積極型)の場合よりも下落する場合があります。



### ケース② 四半期中の投資について

ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点で投資者がファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2.5%(堅実型)の場合もしくは3.5%(積極型)の場合)以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません。

※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、お申込み(スイッチングのお申込みを含みます。)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(スイッチングのお申込みを含みます。)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。

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が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。

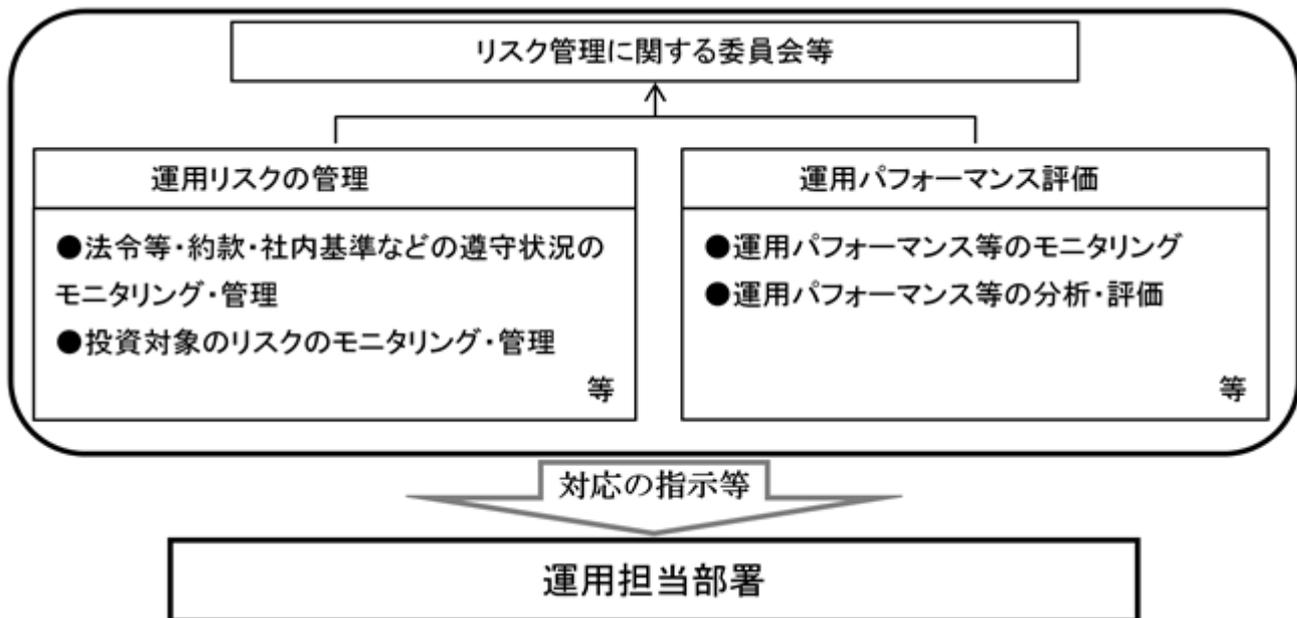
#### 注意事項

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



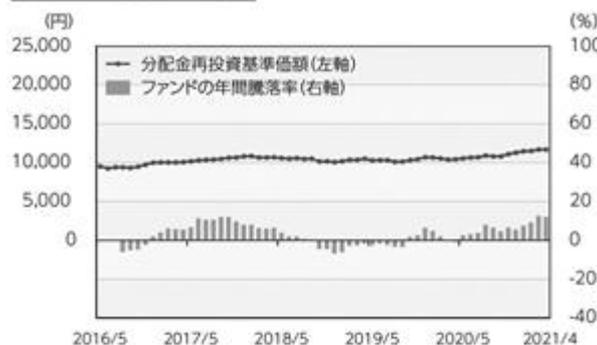
リスク管理体制は2021年4月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。



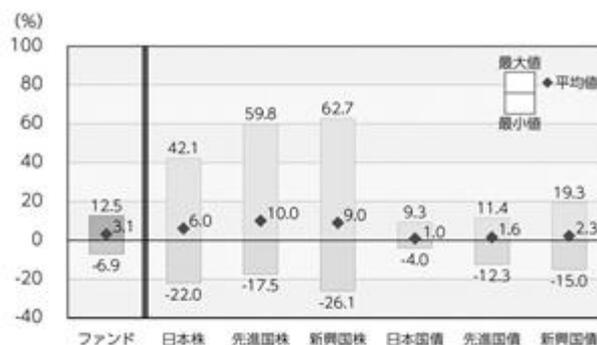
## <参考情報>

### 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

#### ( 堅 実 型 )

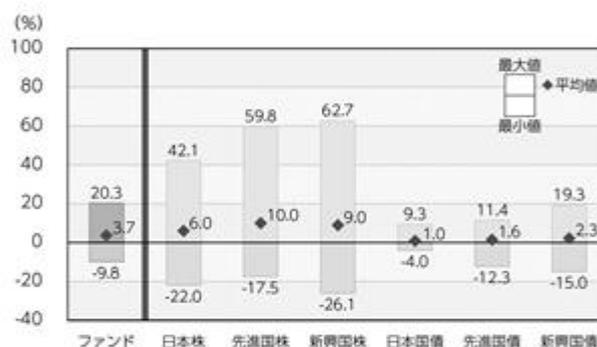


### ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2016年8月～2021年4月  
代表的な資産クラス:2016年5月～2021年4月

#### ( 積 極 型 )



ファンド:2016年8月～2021年4月  
代表的な資産クラス:2016年5月～2021年4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。

\*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。

\*すべ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(西東京証券取引所)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、西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発行された公算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】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

お申込手数料は、商品や投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務手続き等にかかる費用の対価として、販売会社に支払われます。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.155%（税抜1.05%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	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0.50%	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0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

上場投資信託は市場の需給により価格形成されるため、上場投資信託の費用は表示しておりません。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

#### (5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

##### 個人の受益者に対する課税

###### 収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

###### 解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

###### 損益通算について

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

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

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

#### 法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

#### 個別元本方式について

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

##### < 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

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

##### < 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

2021年4月30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	41,723,346	38.78
内 日本	41,723,346	38.78
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	65,864,180	61.22
純資産総額	107,587,526	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。

## D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

2021年4月30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	105,016,940	53.43
内 日本	105,016,940	53.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	91,531,037	46.57
純資産総額	196,547,977	100.00

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

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

(参考)

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	265,826,826,700	85.53
内 日本	265,826,826,700	85.53
地方債証券	16,695,302,000	5.37
内 日本	16,695,302,000	5.37
特殊債券	16,465,715,074	5.30
内 日本	16,465,715,074	5.30
社債券	11,172,660,820	3.59
内 日本	10,768,490,820	3.46
内 フランス	404,170,000	0.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	656,461,783	0.21
純資産総額	310,816,966,377	100.00

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

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

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	339,774,388,460	96.55
内 日本	339,774,388,460	96.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,141,596,010	3.45
純資産総額	351,915,984,470	100.00

## その他資産の投資状況

2021年4月30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)		12,188,615,000	3.46
	内 日本	12,188,615,000	3.46

(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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	135,198,922,445	97.62
内 アメリカ	59,819,027,074	43.19
内 フランス	14,488,996,064	10.46
内 イタリア	12,786,383,314	9.23
内 ドイツ	10,350,071,951	7.47
内 イギリス	8,802,457,530	6.36
内 スペイン	8,180,628,678	5.91
内 ベルギー	3,339,991,456	2.41
内 オーストラリア	2,783,535,764	2.01
内 カナダ	2,717,649,848	1.96
内 オランダ	2,608,132,141	1.88
内 オーストリア	2,065,907,190	1.49
内 アイルランド	1,105,860,144	0.80
内 メキシコ	1,066,656,982	0.77
内 フィンランド	875,995,213	0.63
内 ポーランド	867,246,114	0.63
内 デンマーク	692,196,212	0.50
内 マレーシア	625,755,743	0.45
内 イスラエル	613,777,308	0.44
内 シンガポール	602,936,548	0.44
内 スウェーデン	453,333,776	0.33
内 ノルウェー	352,383,395	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,293,388,476	2.38
純資産総額	138,492,310,921	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

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	489,389,034,558	94.87
内 アメリカ	337,728,503,133	65.47
内 イギリス	21,896,291,067	4.24
内 カナダ	17,799,651,410	3.45
内 フランス	16,930,206,992	3.28
内 スイス	16,249,131,053	3.15
内 ドイツ	15,093,059,173	2.93
内 オーストラリア	10,632,382,261	2.06
内 オランダ	9,651,507,562	1.87
内 アイルランド	9,291,483,274	1.80
内 スウェーデン	5,576,778,992	1.08

内 香港	4,045,223,768	0.78
内 スペイン	3,990,252,785	0.77
内 デンマーク	3,967,094,282	0.77
内 イタリア	3,013,444,497	0.58
内 フィンランド	1,962,935,701	0.38
内 ジャージー	1,880,435,590	0.36
内 シンガポール	1,509,917,221	0.29
内 ベルギー	1,437,685,999	0.28
内 パミュダ	1,290,381,907	0.25
内 ノルウェー	1,023,501,559	0.20
内 イスラエル	981,726,184	0.19
内 ケイマン諸島	961,103,128	0.19
内 ニュージーランド	544,557,243	0.11
内 ルクセンブルグ	462,982,920	0.09
内 オランダ領キュラソー	375,197,860	0.07
内 オーストリア	297,625,635	0.06
内 ポルトガル	237,251,587	0.05
内 パナマ	192,561,232	0.04
内 リベリア	190,206,845	0.04
内 マン島	127,642,974	0.02
内 パプアニューギニア	48,310,724	0.01
投資信託受益証券	932,651,022	0.18
内 オーストラリア	687,653,364	0.13
内 シンガポール	244,997,658	0.05
投資証券	10,254,137,897	1.99
内 アメリカ	9,460,657,497	1.83
内 フランス	271,587,215	0.05
内 イギリス	268,856,016	0.05
内 香港	188,197,017	0.04
内 カナダ	64,840,152	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,299,769,308	2.97
純資産総額	515,875,592,785	100.00

## その他資産の投資状況

2021年4月30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)	15,590,997,755	3.02
内 アメリカ	11,492,696,686	2.23
内 ドイツ	2,464,559,516	0.48
内 イギリス	726,736,583	0.14
内 カナダ	547,953,120	0.11
内 オーストラリア	359,051,850	0.07

(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。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
-------	---------	---------



国債証券		151,696,931,308	98.23
内	メキシコ	24,242,363,215	15.70
内	インドネシア	20,743,360,580	13.43
内	ロシア	20,158,808,557	13.05
内	ブラジル	16,285,412,927	10.55
内	コロンビア	14,336,390,966	9.28
内	フィリピン	13,698,517,505	8.87
内	南アフリカ	9,693,226,174	6.28
内	パナマ	8,969,914,974	5.81
内	ペルー	8,425,876,998	5.46
内	ハンガリー	6,371,852,049	4.13
内	ルーマニア	5,623,208,467	3.64
内	クロアチア	3,147,998,896	2.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,732,623,152	1.77
純資産総額		154,429,554,460	100.00

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

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

#### エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
株式	55,020,965,367	92.61	
内	ケイマン諸島	13,724,766,710	23.10
内	台湾	7,828,338,492	13.18
内	韓国	7,457,776,107	12.55
内	中国	6,084,536,146	10.24
内	インド	5,218,742,039	8.78
内	ブラジル	2,465,015,492	4.15
内	南アフリカ	2,018,836,485	3.40
内	サウジアラビア	1,569,182,158	2.64
内	ロシア	1,420,298,462	2.39
内	タイ	1,001,012,881	1.68
内	マレーシア	757,570,330	1.28
内	メキシコ	694,726,315	1.17
内	インドネシア	655,051,986	1.10
内	香港	643,123,400	1.08
内	バミューダ	409,491,438	0.69
内	カタール	371,458,119	0.63
内	フィリピン	348,044,470	0.59
内	ポーランド	329,380,540	0.55
内	アラブ首長国連邦	310,338,050	0.52
内	クエート	281,261,186	0.47
内	チリ	280,279,535	0.47
内	アメリカ	203,896,674	0.34
内	オランダ	164,961,314	0.28
内	トルコ	157,772,067	0.27
内	ハンガリー	118,870,339	0.20
内	ルクセンブルグ	108,698,767	0.18
内	コロンビア	83,622,111	0.14
内	チェコ	62,114,068	0.10

	内 ギリシャ	60,151,270	0.10
	内 キプロス	50,310,655	0.08
	内 ジャージー	36,185,129	0.06
	内 エジプト	35,817,456	0.06
	内 イギリス領バージン諸島	16,990,278	0.03
	内 マン島	16,735,920	0.03
	内 ペルー	16,505,241	0.03
	内 シンガポール	10,771,181	0.02
	内 パキスタン	4,583,534	0.01
	内 アルゼンチン	3,749,022	0.01
新株予約権証券		22,792	0.00
	内 タイ	22,792	0.00
投資信託受益証券		394,536,187	0.66
	内 メキシコ	263,508,459	0.44
	内 ブラジル	131,027,728	0.22
投資証券		53,002,358	0.09
	内 南アフリカ	29,070,368	0.05
	内 メキシコ	23,931,990	0.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,941,797,715	6.63
純資産総額		59,410,324,419	100.00

## その他資産の投資状況

2021年4月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	3,955,175,316	6.66
内 アメリカ	3,955,175,316	6.66

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

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

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

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)

2021年4月30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	3,950,962	3.1985 12,637,153	3.1068 12,274,848	- -	11.41
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,059,679	1.4777 10,432,089	1.5081 10,646,701	- -	9.90
3	外国債券パッシブ・ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,081,300	2.0227 6,232,546	2.0206 6,226,074	- -	5.79

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	811,706	5.1201 4,156,017	5.1949 4,216,731	- -	3.92
5	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	3,204,345	1.3025 4,173,673	1.3049 4,181,349	- -	3.89
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,987,461	2.1076 4,188,773	2.1020 4,177,643	- -	3.88

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	38.78
合計	38.78

(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。

#### D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

2021年4月30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	9,924,991	3.1989 31,749,123	3.1068 30,834,962	- -	15.69
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	17,758,804	1.4786 26,259,603	1.5081 26,782,052	- -	13.63
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	7,791,783	2.0211 15,748,369	2.0206 15,744,076	- -	8.01
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	2,052,468	5.1237 10,516,424	5.1949 10,662,366	- -	5.42
5	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	8,048,176	1.3029 10,486,309	1.3049 10,502,064	- -	5.34
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,991,161	2.1077 10,520,143	2.1020 10,491,420	- -	5.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	53.43
合計	53.43

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年4月30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	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,630,000,000	102.02 4,723,936,000	102.06 4,725,470,600	0.4 2025/3/20	1.52
2	420回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	4,300,000,000	100.39 4,317,114,000	100.39 4,317,114,000	0.1 2023/1/1	1.39
3	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,650,000,000	102.29 3,733,786,000	102.28 3,733,475,500	0.4 2025/9/20	1.20
4	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,650,000,000	102.18 3,729,859,000	102.13 3,727,854,500	0.6 2024/3/20	1.20
5	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,570,000,000	102.09 3,644,754,600	101.98 3,640,686,000	0.8 2023/6/20	1.17
6	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,340,000,000	102.18 3,412,987,000	102.17 3,412,645,000	0.4 2025/6/20	1.10
7	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,310,000,000	101.91 3,373,359,000	101.90 3,373,055,500	0.3 2025/12/20	1.09
8	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,300,000,000	100.98 3,332,483,000	100.99 3,332,967,000	0.1 2028/3/20	1.07
9	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,280,000,000	100.96 3,311,607,000	100.97 3,312,045,600	0.1 2026/6/20	1.07
10	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,140,000,000	102.18 3,208,546,000	102.13 3,207,039,000	0.5 2024/9/20	1.03
11	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,110,000,000	101.02 3,141,755,000	101.01 3,141,628,700	0.1 2026/12/20	1.01
12	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,050,000,000	100.88 3,077,128,000	100.93 3,078,426,000	0.1 2025/6/20	0.99
13	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,900,000,000	100.96 2,927,963,000	100.96 2,928,043,000	0.1 2025/9/20	0.94

14	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,860,000,000	102.02 2,917,955,000	101.93 2,915,341,000	0.6 2023/12/20	0.94
15	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,880,000,000	100.97 2,908,010,000	100.99 2,908,771,200	0.1 2026/9/20	0.94
16	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,810,000,000	101.04 2,839,308,200	101.01 2,838,493,400	0.1 2027/6/20	0.91
17	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,760,000,000	100.97 2,786,924,000	100.99 2,787,517,200	0.1 2027/12/20	0.90
18	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,680,000,000	101.04 2,708,055,000	100.99 2,706,558,800	0.1 2027/9/20	0.87
19	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,660,000,000	100.93 2,684,820,000	100.96 2,685,642,400	0.1 2028/6/20	0.86
20	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,620,000,000	100.88 2,643,122,000	100.92 2,644,182,600	0.1 2028/9/20	0.85
21	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,600,000,000	99.92 2,597,939,000	100.19 2,604,966,000	0.1 2030/12/20	0.84
22	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,590,000,000	100.12 2,593,169,700	100.32 2,598,443,400	0.1 2030/9/20	0.84
23	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,570,000,000	101.05 2,597,043,000	101.03 2,596,522,400	0.1 2027/3/20	0.84
24	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,570,000,000	100.76 2,589,673,000	100.82 2,591,228,200	0.1 2029/3/20	0.83
25	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,560,000,000	100.34 2,568,848,000	100.40 2,570,444,800	0.1 2030/6/20	0.83
26	132回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,500,000,000	100.30 2,507,700,000	100.25 2,506,325,000	0.1 2022/6/20	0.81
27	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,480,000,000	100.97 2,504,281,000	100.95 2,503,659,200	0.1 2026/3/20	0.81
28	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,440,000,000	100.85 2,460,924,000	100.87 2,461,398,800	0.1 2028/12/20	0.79
29	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,420,000,000	100.73 2,437,867,000	100.73 2,437,666,000	0.1 2029/6/20	0.78
30	417回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	2,400,000,000	100.34 2,408,184,000	100.33 2,408,088,000	0.1 2022/10/1	0.77

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	85.53
地方債証券	5.37
特殊債券	5.30
社債券	3.59
合計	99.79

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

## 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年4月30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	1,320,800	8,115.17 10,718,522,960	8,127.00 10,734,141,600	- -	3.05
2	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,015,000	9,619.47 9,763,770,572	9,885.00 10,033,275,000	- -	2.85
3	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	816,600	12,069.13 9,855,653,807	10,900.00 8,900,940,000	- -	2.53
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	127,900	55,626.80 7,114,668,398	52,520.00 6,717,308,000	- -	1.91
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,795,500	538.70 4,738,174,136	578.00 5,083,799,000	- -	1.44
6	任天堂 日本	株式 その他製品	74,500	63,279.62 4,714,332,276	62,690.00 4,670,405,000	- -	1.33
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	892,400	5,037.39 4,495,373,600	4,939.00 4,407,563,600	- -	1.25
8	信越化学工業 日本	株式 化学	236,100	18,237.15 4,305,791,809	18,450.00 4,356,045,000	- -	1.24
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,496,300	2,801.46 4,191,827,164	2,755.00 4,122,306,500	- -	1.17
10	日本電産 日本	株式 電気機器	313,900	14,072.76 4,417,440,919	12,655.00 3,972,404,500	- -	1.13
11	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,084,500	3,725.16 4,039,939,952	3,635.00 3,942,157,500	- -	1.12
12	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	76,400	42,473.31 3,244,961,174	48,320.00 3,691,648,000	- -	1.05

13	ダイキン工業 日本	株式 機械	166,000	23,209.01 3,852,696,291	21,930.00 3,640,380,000	- -	1.03
14	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,025,900	3,372.04 3,459,378,267	3,306.00 3,391,625,400	- -	0.96
15	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	889,900	3,672.68 3,268,318,265	3,802.00 3,383,399,800	- -	0.96
16	日立製作所 日本	株式 電気機器	626,600	5,016.54 3,143,364,193	5,381.00 3,371,734,600	- -	0.96
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	383,100	9,406.63 3,603,680,913	8,703.00 3,334,119,300	- -	0.95
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	1,026,300	3,076.86 3,157,787,632	3,232.00 3,317,001,600	- -	0.94
19	HOYA 日本	株式 精密機器	256,600	13,095.18 3,360,224,099	12,435.00 3,190,821,000	- -	0.91
20	第一三共 日本	株式 医薬品	1,119,300	3,212.95 3,596,265,372	2,787.00 3,119,489,100	- -	0.89
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	898,200	3,194.31 2,869,131,836	3,408.00 3,061,065,600	- -	0.87
22	ファナック 日本	株式 電気機器	114,500	28,096.97 3,217,103,785	25,175.00 2,882,537,500	- -	0.82
23	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,747,100	1,550.22 2,708,399,345	1,535.00 2,681,798,500	- -	0.76
24	SMC 日本	株式 機械	38,100	64,923.94 2,473,602,114	63,450.00 2,417,445,000	- -	0.69
25	三井物産 日本	株式 卸売業	1,042,300	2,079.79 2,167,770,149	2,303.50 2,400,938,050	- -	0.68
26	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	502,300	4,303.25 2,161,526,162	4,699.00 2,360,307,700	- -	0.67
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	781,500	2,903.78 2,269,306,364	3,020.00 2,360,130,000	- -	0.67
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	423,300	5,495.64 2,326,306,381	5,230.00 2,213,859,000	- -	0.63
29	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,303,800	1,721.20 2,244,101,467	1,682.00 2,192,991,600	- -	0.62
30	花王 日本	株式 化学	312,200	7,476.37 2,334,123,486	7,007.00 2,187,585,400	- -	0.62

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.55
合計	96.55

(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

2021年4月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.35
情報・通信業		9.22
化学		7.15
輸送用機器		6.86
機械		5.52
サービス業		5.33
医薬品		5.02
銀行業		4.86
卸売業		4.60
小売業		4.48
陸運業		3.25
食料品		3.17
精密機器		2.47
その他製品		2.36
建設業		2.30
不動産業		1.91
保険業		1.80
電気・ガス業		1.24
その他金融業		1.06
ガラス・土石製品		0.80
鉄鋼		0.80
証券、商品先物取引業		0.80
非鉄金属		0.74
金属製品		0.62
ゴム製品		0.60
繊維製品		0.46
空運業		0.44
石油・石炭製品		0.41
海運業		0.27
パルプ・紙		0.24
倉庫・運輸関連業		0.17
鉱業	0.17	
水産・農林業	0.09	
合計	96.55	

(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

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.75 03/31/22 アメリカ	国債証 券	761,420,700	101.84 775,459,393	101.55 773,258,408	1.75 2022/3/31	0.56
2	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証 券	717,848,700	103.34 741,851,765	102.96 739,103,746	2 2022/11/30	0.53
3	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	697,152,000	95.89 668,557,870	93.37 650,992,910	0.875 2030/11/15	0.47



4	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	601,293,600	107.02 643,525,076	106.33 639,414,669	2.75 2023/11/15	0.46
5	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	612,186,600	102.61 628,184,755	102.30 626,319,496	1.625 2022/11/15	0.45
6	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	601,293,600	103.73 623,748,157	103.30 621,140,984	2.125 2022/12/31	0.45
7	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	579,507,600	107.55 623,287,584	106.83 619,145,009	2.75 2024/2/15	0.45
8	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	676,455,300	93.92 635,392,345	91.51 619,035,865	0.625 2030/8/15	0.45
9	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証 券	577,329,000	106.45 614,584,761	105.44 608,743,813	2 2025/2/15	0.44
10	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	565,346,700	108.07 611,016,112	106.71 603,330,930	2.25 2025/11/15	0.44
11	US T N/B 1.75 05/15/22 アメリカ	国債証 券	588,222,000	102.04 600,262,169	101.75 598,538,859	1.75 2022/5/15	0.43
12	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証 券	564,257,400	106.80 602,653,349	105.57 595,688,297	2 2025/8/15	0.43
13	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証 券	571,882,500	102.64 586,983,771	102.32 585,151,958	1.75 2022/9/30	0.42
14	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証 券	581,686,200	100.02 581,845,249	100.00 581,686,200	0.125 2022/11/30	0.42
15	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証 券	542,471,400	103.17 559,720,292	102.80 557,707,213	1.75 2023/1/31	0.40
16	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	519,596,100	105.67 549,066,940	105.02 545,697,682	2 2024/5/31	0.39
17	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	510,881,700	107.10 547,162,279	106.17 542,412,679	2.25 2024/11/15	0.39
18	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	482,559,900	113.13 545,933,583	110.54 533,436,034	2.875 2028/5/15	0.39
19	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	304,896,900	179.14 546,193,312	173.83 530,020,575	4.5 2041/4/25	0.38
20	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証 券	523,953,300	99.75 522,648,656	99.80 522,950,416	0.25 2024/3/15	0.38
21	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	476,024,100	112.14 533,853,586	109.64 521,915,798	2.75 2028/2/15	0.38
22	US T N/B 2.125 06/30/22 アメリカ	国債証 券	493,452,900	102.74 507,022,854	102.37 505,153,126	2.125 2022/6/30	0.36
23	US T N/B 2.5 08/15/23 アメリカ	国債証 券	471,666,900	105.81 499,082,538	105.21 496,282,015	2.5 2023/8/15	0.36
24	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	461,863,200	107.26 495,420,448	106.52 492,010,594	2.5 2024/5/15	0.36
25	US T N/B 2.0 02/15/23 アメリカ	国債証 券	476,024,100	103.72 493,763,432	103.30 491,755,206	2 2023/2/15	0.36
26	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	447,702,300	111.60 499,642,757	108.88 487,470,852	2.625 2029/2/15	0.35
27	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証 券	335,254,600	147.62 494,934,354	145.28 487,061,905	5.5 2029/4/25	0.35
28	US T N/B 0.25 05/31/25 アメリカ	国債証 券	486,917,100	99.14 482,732,655	98.44 479,347,057	0.25 2025/5/31	0.35

29	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	388,050,600	124.54 483,311,589	122.77 476,423,691	2.5 2030/5/25	0.34
30	US T N/B 2.25 08/15/49 アメリカ	国債証券	479,292,000	100.82 483,243,161	98.81 473,619,127	2.25 2049/8/15	0.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.62
合計	97.62

(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

2021年4月30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	1,482,992	14,664.94 21,747,995,681	14,539.97 21,562,668,681	- -	4.18
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	626,536	26,666.77 16,707,691,649	27,505.91 17,233,445,521	- -	3.34
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	37,204	356,287.91 13,255,335,567	378,129.79 14,067,941,015	- -	2.73
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	209,759	29,563.74 6,201,261,372	35,893.52 7,528,989,763	- -	1.46
5	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	26,351	228,333.10 6,016,805,663	260,643.34 6,868,212,831	- -	1.33

6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	25,783	229,437.97 5,915,599,373	264,687.91 6,824,448,582	- -	1.32
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	66,165	87,700.83 5,802,725,737	73,745.60 4,879,378,285	- -	0.95
8	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	265,580	15,492.65 4,114,538,317	16,904.84 4,489,589,186	- -	0.87
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	229,593	18,093.36 4,154,110,794	17,886.30 4,106,570,653	- -	0.80
10	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	147,591	22,967.90 3,389,856,440	25,801.15 3,808,018,976	- -	0.74
11	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	82,659	36,017.51 2,977,171,869	43,740.84 3,615,574,217	- -	0.70
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	119,534	26,563.01 3,175,183,685	30,238.96 3,614,584,800	- -	0.70
13	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	54,034	64,748.24 3,498,606,599	66,773.00 3,608,012,319	- -	0.70
14	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	93,882	30,316.25 2,846,150,895	35,439.28 3,327,111,067	- -	0.64
15	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	77,603	37,451.86 2,906,377,324	42,368.32 3,287,909,008	- -	0.64
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	251,234	12,082.71 3,035,588,364	13,083.91 3,287,124,954	- -	0.64
17	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	158,055	20,488.77 3,238,352,995	20,187.99 3,190,813,850	- -	0.62
18	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	216,037	13,926.52 3,008,644,232	14,434.31 3,118,345,958	- -	0.60
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	678,468	3,674.19 2,492,824,848	4,478.11 3,038,255,895	- -	0.59
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	97,262	32,152.50 3,127,217,279	29,176.90 2,837,803,696	- -	0.55

21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	37,175	65,094.95 2,419,904,852	71,644.17 2,663,372,094	- -	0.52
22	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	398,143	5,818.24 2,316,495,126	6,143.65 2,446,052,038	- -	0.47
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	369,665	5,579.81 2,062,663,681	6,420.33 2,373,372,842	- -	0.46
24	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	41,923	54,050.13 2,265,943,787	56,217.68 2,356,813,953	- -	0.46
25	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	357,563	6,748.01 2,412,838,736	6,348.44 2,269,967,394	- -	0.44
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	360,099	5,919.82 2,131,723,616	6,243.86 2,248,410,478	- -	0.44
27	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	60,929	37,466.37 2,282,788,943	35,940.02 2,189,789,539	- -	0.42
28	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	38,560	60,410.52 2,329,429,851	55,445.36 2,137,973,467	- -	0.41
29	AT&T INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	621,475	3,145.36 1,954,768,186	3,413.86 2,121,632,496	- -	0.41
30	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	355,908	5,526.95 1,967,086,249	5,910.54 2,103,609,110	- -	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

2021年4月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	94.87
投資信託受益証券	0.18
投資証券	1.99
合計	97.03

（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

2021年4月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	6.90
銀行		6.09
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.60
情報技術サービス		4.59
コンピュータ・周辺機器		4.50

半導体・半導体製造装置	4.37
医薬品	4.36
インターネット販売・通信販売	3.27
保険	3.13
資本市場	3.09
石油・ガス・消耗燃料	3.02
ヘルスケア機器・用品	3.00
化学	2.15
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.93
ホテル・レストラン・レジャー	1.87
電力	1.77
機械	1.76
専門小売り	1.70
バイオテクノロジー	1.65
自動車	1.64
飲料	1.59
金属・鉱業	1.59
食品	1.58
娯楽	1.47
航空宇宙・防衛	1.45
各種電気通信サービス	1.45
繊維・アパレル・贅沢品	1.44
食品・生活必需品小売り	1.26
コングロマリット	1.18
メディア	1.12
家庭用品	1.10
陸運・鉄道	1.05
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.97
各種金融サービス	0.96
電気設備	0.88
総合公益事業	0.83
専門サービス	0.77
航空貨物・物流サービス	0.68
通信機器	0.65
タバコ	0.65
パーソナル用品	0.63
建設関連製品	0.59
電子装置・機器・部品	0.55
複合小売り	0.50
消費者金融	0.46
不動産管理・開発	0.43
商業サービス・用品	0.41
家庭用耐久財	0.40
商社・流通業	0.30
容器・包装	0.30
自動車部品	0.28
無線通信サービス	0.28
建設資材	0.27
建設・土木	0.23
ヘルスケア・テクノロジー	0.15

ガス	0.15
運送インフラ	0.14
エネルギー設備・サービス	0.14
紙製品・林産品	0.12
水道	0.11
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
販売	0.09
海運業	0.07
レジャー用品	0.07
旅客航空輸送業	0.06
合計	94.87

(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。

### エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年4月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	3,158,970,000	124.13 3,921,542,199	123.19 3,891,787,860	5.25 2047/6/23	2.52
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,614,320,000	117.98 3,084,493,251	117.75 3,078,374,871	5.1 2035/3/28	1.99
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,840,917,000	123.06 2,265,607,347	121.74 2,241,252,015	6.05 2040/1/11	1.45
4	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,742,880,000	126.90 2,211,819,292	126.13 2,198,350,316	5.625 2042/4/4	1.42
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,069,670,000	110.09 2,278,575,954	105.82 2,190,207,580	5 2045/6/15	1.42
6	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	2,004,312,000	109.14 2,187,586,289	109.07 2,186,193,292	4.875 2023/9/16	1.42
7	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,851,810,000	112.63 2,085,851,006	112.21 2,078,017,850	4.5 2029/4/22	1.35
8	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,784,273,400	113.63 2,027,594,763	113.56 2,026,340,419	5.375 2024/3/25	1.31
9	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,786,452,000	112.46 2,009,133,241	112.87 2,016,479,132	4.75 2026/5/27	1.31
10	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,786,452,000	111.23 1,987,159,882	112.12 2,003,059,305	4.375 2029/3/21	1.30
11	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,764,666,000	111.86 1,974,025,974	111.61 1,969,637,249	5.875 2025/9/16	1.28
12	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,405,197,000	135.40 1,902,777,257	132.92 1,867,928,372	6.7 2036/1/26	1.21

13	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,416,090,000	135.75 1,922,448,381	131.40 1,860,777,662	5.625 2050/11/18	1.20
14	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,851,810,000	100.82 1,867,105,950	99.73 1,846,828,631	2.783 2031/1/23	1.20
15	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,568,592,000	117.75 1,847,126,881	116.12 1,821,605,889	5.55 2045/1/21	1.18
16	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	1,089,300,000	163.46 1,780,581,762	161.53 1,759,611,648	7.625 2041/3/29	1.14
17	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,568,592,000	110.74 1,737,176,250	110.86 1,738,985,011	4.25 2027/6/23	1.13
18	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,742,880,000	99.09 1,727,141,793	99.33 1,731,324,705	3.875 2030/6/12	1.12
19	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,525,020,000	113.20 1,726,322,640	112.20 1,711,072,440	4.75 2032/4/27	1.11
20	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	1,742,880,000	100.25 1,747,324,344	97.84 1,705,233,792	3.125 2031/4/15	1.10
21	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,143,765,000	149.69 1,712,173,085	148.52 1,698,799,841	7.75 2038/1/17	1.10
22	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,721,094,000	98.04 1,687,492,798	98.30 1,691,981,694	5 2045/1/27	1.10
23	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,416,090,000	122.02 1,727,997,983	119.33 1,689,820,197	6.125 2041/1/18	1.09
24	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,459,662,000	114.38 1,669,670,870	114.34 1,669,116,198	6 2024/1/26	1.08
25	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,503,234,000	107.24 1,612,135,787	107.39 1,614,405,670	4.625 2028/1/13	1.05
26	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,350,732,000	112.08 1,514,015,237	112.29 1,516,811,253	4.15 2027/3/28	0.98
27	BRAZIL 8.25 01/20/34 ブラジル	国債証券	1,111,086,000	135.97 1,510,808,992	135.40 1,504,410,444	8.25 2034/1/20	0.97
28	INDONESIA 6.75 01/15/44 インドネシア	国債証券	1,034,835,000	145.21 1,502,762,822	143.90 1,489,189,655	6.75 2044/1/15	0.96
29	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	1,350,732,000	109.54 1,479,687,734	109.48 1,478,882,698	5.5 2023/4/4	0.96
30	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23 メキシコ	国債証券	1,361,625,000	108.68 1,479,820,858	108.57 1,478,404,768	4 2023/10/2	0.96

(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

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.23
合計	98.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年4月30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	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,499,083	2,387.23 3,578,663,405	2,348.09 3,519,996,792	- -	5.92
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	350,300	8,866.96 3,106,096,088	8,859.94 3,103,638,733	- -	5.22
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	115,410	26,000.50 3,000,717,901	25,509.22 2,944,019,934	- -	4.96
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	291,300	8,272.54 2,409,790,902	8,055.62 2,346,602,106	- -	3.95
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	220,000	4,071.50 895,731,320	4,338.07 954,376,720	- -	1.61
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	26,560	27,051.00 718,474,560	25,346.78 673,210,662	- -	1.13
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	174,243	2,859.50 498,249,252	2,995.59 521,961,285	- -	0.88
8	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,810,530	91.75 533,152,152	89.37 519,293,457	- -	0.87
9	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	225,221	2,217.65 499,461,446	2,284.58 514,536,752	- -	0.87



10	JD.COM INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	52,821	8,391.96 443,272,099	8,478.02 447,817,594	- -	0.75
11	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	363,500	1,264.10 459,501,440	1,210.08 439,866,806	- -	0.74
12	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	33,367	13,557.49 452,373,102	12,818.00 427,698,206	- -	0.72
13	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	91,507	3,815.66 349,159,828	4,637.49 424,363,483	- -	0.71
14	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	207,900	2,003.55 416,538,045	2,007.39 417,338,044	- -	0.70
15	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	104,663	3,809.59 398,723,536	3,757.49 393,271,013	- -	0.66
16	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	16,507	23,263.09 384,003,839	23,124.74 381,720,243	- -	0.64
17	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	24,048	14,521.45 349,212,029	14,976.78 360,161,742	- -	0.61
18	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	49,402	7,414.71 366,301,997	7,247.09 358,021,234	- -	0.60
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	762,225	483.31 368,396,490	453.96 346,024,234	- -	0.58
20	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	78,509	3,931.28 308,641,152	4,247.18 333,441,909	- -	0.56
21	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	25,446	11,633.72 296,031,740	12,537.84 319,037,952	- -	0.54

22	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC ケイマン諸島	株式 ライフサイエンス・ツール/サービス	201,500	1,473.15 296,839,725	1,568.55 316,063,631	- -	0.53
23	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	877,800	365.48 320,819,660	352.85 309,735,680	- -	0.52
24	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	168,888	1,656.28 279,725,926	1,734.16 292,879,759	- -	0.49
25	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	314,249	839.08 263,681,936	919.74 289,029,260	- -	0.49
26	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,694,235	76.32 281,955,836	73.65 272,108,114	- -	0.46
27	NAVER CORP 韓国	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	7,517	38,601.89 290,170,482	36,136.89 271,641,077	- -	0.46
28	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	57,248	4,728.82 270,715,601	4,610.56 263,945,911	- -	0.44
29	LG CHEM LTD 韓国	株式 化学	2,806	88,444.19 248,174,425	93,768.59 263,114,691	- -	0.44
30	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	368,681	671.00 247,388,195	669.70 246,906,269	- -	0.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

#### 投資有価証券の種類別投資比率

2021年4月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	92.61
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.66
投資証券	0.09
合計	93.37

(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

2021年4月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	11.49

インターネット販売・通信販売	9.63
半導体・半導体製造装置	8.79
インタラクティブ・メディアおよびサービス	7.25
コンピュータ・周辺機器	5.88
石油・ガス・消耗燃料	4.30
金属・鉱業	4.19
電子装置・機器・部品	2.61
化学	2.61
保険	2.59
自動車	2.46
情報技術サービス	1.82
不動産管理・開発	1.81
食品	1.61
無線通信サービス	1.36
医薬品	1.33
娯楽	1.17
食品・生活必需品小売り	1.08
飲料	1.03
資本市場	0.98
繊維・アパレル・贅沢品	0.95
各種電気通信サービス	0.95
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.93
コングロマリット	0.91
バイオテクノロジー	0.89
建設資材	0.85
ホテル・レストラン・レジャー	0.73
貯蓄・抵当・不動産金融	0.66
電力	0.62
各種消費者サービス	0.60
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.57
パーソナル用品	0.56
各種金融サービス	0.54
運送インフラ	0.54
専門小売り	0.53
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.53
ガス	0.50
自動車部品	0.50
機械	0.47
家庭用耐久財	0.44
建設・土木	0.43
電気設備	0.43
ソフトウェア	0.41
消費者金融	0.40
家庭用品	0.39
ヘルスケア機器・用品	0.38
複合小売り	0.38
商業サービス・用品	0.30
タバコ	0.26
航空貨物・物流サービス	0.25
陸運・鉄道	0.23

ヘルスケア・テクノロジー	0.21
紙製品・林産品	0.20
海運業	0.19
通信機器	0.19
メディア	0.16
旅客航空輸送業	0.13
水道	0.10
航空宇宙・防衛	0.08
レジャー用品	0.06
エネルギー設備・サービス	0.06
建設関連製品	0.04
専門サービス	0.02
商社・流通業	0.02
総合公益事業	0.02
容器・包装	0.01
販売	0.00
合計	92.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

### 【投資不動産物件】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

### 【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド  
 該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年4月30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 0306月	買建	641	12,547,666,530	12,188,615,000	3.46

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年4月30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 Jun21	買建	502	11,221,076,735	11,492,696,686	2.23
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun21	買建	472	2,447,019,365	2,464,559,516	0.48
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun21	買建	69	720,779,383	726,736,583	0.14
	モン トリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun21	買建	27	544,830,880	547,953,120	0.11
	シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Jun21	買建	24	353,492,250	359,051,850	0.07

（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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド  
 該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年4月30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	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun21	買建	534	3,909,698,675	3,955,175,316	6.66

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

直近日(2021年4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 (2015年10月13日)	301	301	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (2016年4月11日)	240	240	0.9460	0.9460
第3計算期間末 (2016年10月11日)	233	233	0.9477	0.9477
第4計算期間末 (2017年4月11日)	165	165	1.0000	1.0000
第5計算期間末 (2017年10月11日)	141	141	1.0538	1.0538
第6計算期間末 (2018年4月11日)	133	133	1.0645	1.0645
第7計算期間末 (2018年10月11日)	154	154	1.0294	1.0294
第8計算期間末 (2019年4月11日)	157	157	1.0513	1.0513
第9計算期間末 (2019年10月11日)	145	145	1.0129	1.0129
第10計算期間末 (2020年4月13日)	112	112	1.0386	1.0386
第11計算期間末 (2020年10月12日)	109	109	1.0934	1.0934
第12計算期間末 (2021年4月12日)	107	107	1.1720	1.1720
2020年4月末日	113	-	1.0432	-
5月末日	114	-	1.0546	-
6月末日	114	-	1.0661	-
7月末日	109	-	1.0708	-
8月末日	110	-	1.0917	-
9月末日	108	-	1.0794	-
10月末日	107	-	1.0795	-
11月末日	108	-	1.1109	-
12月末日	109	-	1.1277	-
2021年1月末日	110	-	1.1472	-
2月末日	107	-	1.1516	-
3月末日	107	-	1.1690	-
4月末日	107	-	1.1684	-

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

直近日(2021年4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 (2015年10月13日)	519	519	0.9901	0.9901
第2計算期間末 (2016年4月11日)	418	418	0.9230	0.9230
第3計算期間末 (2016年10月11日)	404	404	0.9286	0.9286
第4計算期間末 (2017年4月11日)	368	368	0.9691	0.9691
第5計算期間末 (2017年10月11日)	312	312	1.0451	1.0451
第6計算期間末 (2018年4月11日)	297	297	1.0571	1.0571
第7計算期間末 (2018年10月11日)	290	290	1.0089	1.0089
第8計算期間末 (2019年4月11日)	310	310	1.0353	1.0353
第9計算期間末 (2019年10月11日)	281	281	0.9819	0.9819
第10計算期間末 (2020年4月13日)	205	205	1.0067	1.0067
第11計算期間末 (2020年10月12日)	201	201	1.0975	1.0975
第12計算期間末 (2021年4月12日)	192	192	1.2155	1.2155
2020年4月末日	204	-	1.0136	-
5月末日	201	-	1.0338	-
6月末日	198	-	1.0491	-
7月末日	198	-	1.0586	-
8月末日	203	-	1.0908	-
9月末日	197	-	1.0772	-
10月末日	196	-	1.0786	-
11月末日	197	-	1.1259	-
12月末日	201	-	1.1479	-
2021年1月末日	199	-	1.1709	-
2月末日	191	-	1.1785	-
3月末日	193	-	1.2119	-
4月末日	196	-	1.2094	-

## 【分配の推移】

## D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

## D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

## D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	収益率（％）
第1計算期間	0.7
第2計算期間	4.7
第3計算期間	0.2
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.4
第6計算期間	1.0
第7計算期間	3.3
第8計算期間	2.1
第9計算期間	3.7
第10計算期間	2.5
第11計算期間	5.3
第12計算期間	7.2

（注）収益率は期間騰落率です。

## D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	収益率（％）
第1計算期間	1.0
第2計算期間	6.8
第3計算期間	0.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	7.8
第6計算期間	1.1
第7計算期間	4.6
第8計算期間	2.6



第9計算期間	5.2
第10計算期間	2.5
第11計算期間	9.0
第12計算期間	10.8

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	312,448,290	8,299,019
第2計算期間	41,355,881	91,105,022
第3計算期間	7,228,942	14,873,920
第4計算期間	6,056,134	87,803,625
第5計算期間	10,207,312	41,322,402
第6計算期間	12,455,819	20,836,255
第7計算期間	33,165,458	8,351,305
第8計算期間	16,604,344	16,654,728
第9計算期間	1,311,733	7,974,207
第10計算期間	1,606,500	36,538,844
第11計算期間	1,490,630	10,290,763
第12計算期間	1,235,368	9,345,780

(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。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	538,147,596	13,046,804
第2計算期間	67,620,276	138,974,156
第3計算期間	13,958,010	31,768,621
第4計算期間	14,712,909	70,413,301
第5計算期間	38,653,832	119,655,755
第6計算期間	34,785,616	52,794,441
第7計算期間	43,415,961	36,374,469
第8計算期間	26,771,880	14,887,931
第9計算期間	6,903,112	20,146,926
第10計算期間	3,492,125	85,806,510
第11計算期間	2,999,387	24,224,515
第12計算期間	5,001,682	29,781,945

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

&lt;&lt; 参考情報 &gt;&gt;

データの基準日:2021年4月30日

( 堅 実 型 )

## 基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2021年4月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2015年8月28日)

## 分配の推移(税引前)

2019年 4月	0円
2019年10月	0円
2020年 4月	0円
2020年10月	0円
2021年 4月	0円
設定来累計	0円

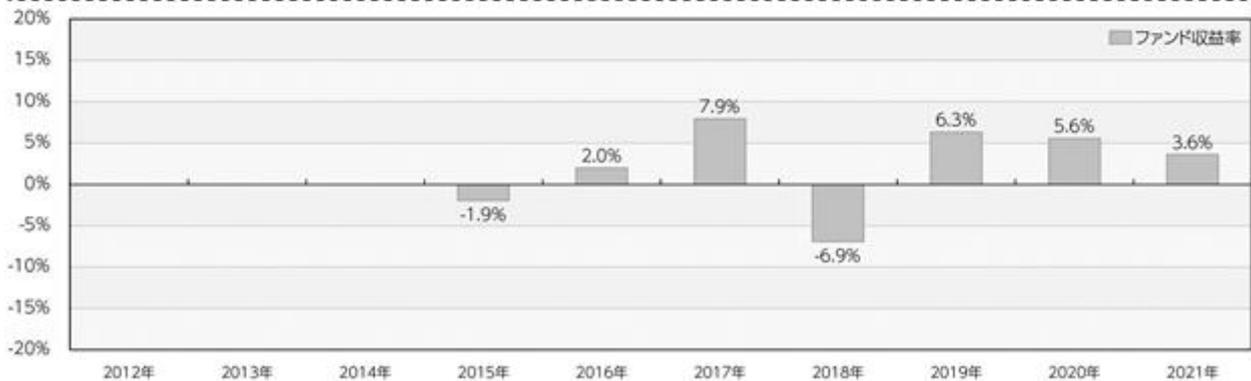
※分配金は1万口当たりです。

## 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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	11.41
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	9.90
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.79
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.92
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.89
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3.88

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

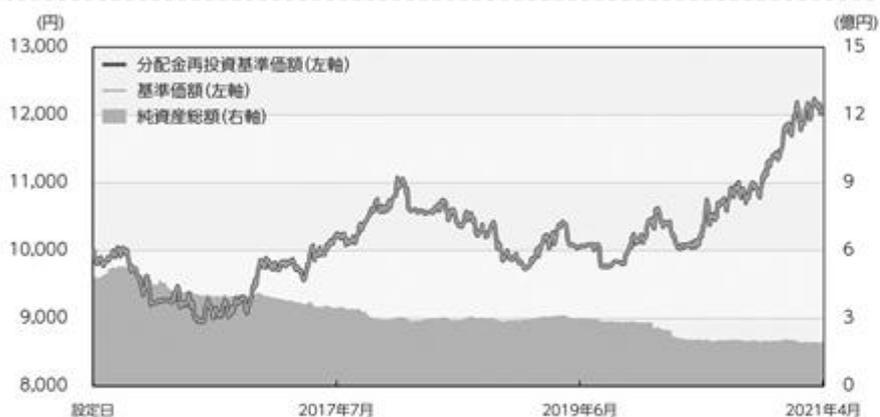
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年4月30日

## ( 積 極 型 )

## 基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2021年4月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。  
(設定日:2015年8月28日)

## 分配の推移(税引前)

2019年 4月	0円
2019年10月	0円
2020年 4月	0円
2020年10月	0円
2021年 4月	0円
設定来累計	0円

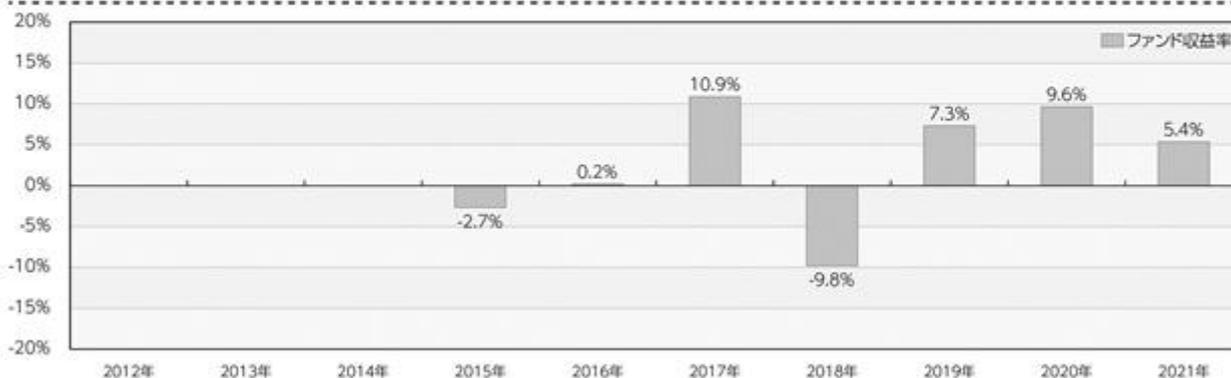
※分配金は1万口当たりです。

## 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	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	15.69
2	エマーシング株式パッシブ・マザーファンド	13.63
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.01
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.42
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.34
6	エマーシング債券パッシブ・マザーファンド	5.34

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2015年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年4月30日

## 主要な資産の状況

### ■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	338回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/3/20	1.52
2	420回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	1.39
3	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.20
4	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.20
5	329回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2023/6/20	1.17

### ■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	3.05
2	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.85
3	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.53
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.91
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.44

### ■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

#### 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	アメリカ	1.75	2022/3/31	0.56
2	US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	アメリカ	2	2022/11/30	0.53
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.47
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.46
5	US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	アメリカ	1.625	2022/11/15	0.45

### ■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	4.18
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.34
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.73
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	1.46
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.33

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年4月30日

## ■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.52
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.99
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.05	2040/1/11	1.45
4	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.42
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.42

## ■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

## 組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR	株式	台湾	半導体・半導体製造装置	5.92
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブメディアおよびサービス	5.22
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	4.96
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.95
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.61

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金自動けいぞく投資コース」があり、「分配金自動けいぞく投資コース」を取得申込者が選択した場合には、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

受益権の取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、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、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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

#### ・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により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1万口あ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。

各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

お申込日の翌営業日の基準価額に、3.3%（税抜3.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

償還乗換え等によるお申込みの場合、販売会社によりお申込手数料が優遇される場合があります。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合には、お申込手数料はかかりません。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金自動けいぞく投資コース」によるお申込みが可能です。お申込みになる販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、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、販売会社に対し振替受益権をもって行うものとします。

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

#### ・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各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

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

#### ・解約代金の受渡日

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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

#### <主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
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。

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2015年8月28日から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年4月12日から10月11日まで、および10月12日から翌年4月11日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

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

- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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。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、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。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、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合

しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。

- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 八. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

## 二．公告

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

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

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

## ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年4月11日、10月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

## 4【受益者の権利等】

### 収益分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を、持ち分に応じて請求する権利を有します。

受益者が収益分配金支払開始日から5年間支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

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

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から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、受益者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を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### 償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

### 一部解約請求権

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

#### 帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第12期計算期間(2020年10月13日から2021年4月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	32,238,518	18,897,507
親投資信託受益証券	77,621,628	89,288,890
流動資産合計	109,860,146	108,186,397
資産合計	109,860,146	108,186,397
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	30,636	29,894
未払委託者報酬	613,800	598,633
その他未払費用	2,116	2,003
流動負債合計	646,552	630,530
負債合計	646,552	630,530
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	99,880,953	91,770,541
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,332,641	15,785,326
(分配準備積立金)	7,858,269	14,283,284
元本等合計	109,213,594	107,555,867
純資産合計	109,213,594	107,555,867
負債純資産合計	109,860,146	108,186,397

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期 自 2020年4月14日 至 2020年10月12日	第12期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	26
有価証券売買等損益	6,491,793	8,267,262
営業収益合計	6,491,793	8,267,288
<b>営業費用</b>		
支払利息	13,727	3,802
受託者報酬	30,636	29,894
委託者報酬	613,800	598,633
その他費用	8,056	2,003
営業費用合計	666,219	634,332
営業利益又は営業損失( )	5,825,574	7,632,956
経常利益又は経常損失( )	5,825,574	7,632,956
当期純利益又は当期純損失( )	5,825,574	7,632,956
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( )	391,691	477,464
期首剰余金又は期首欠損金( )	4,191,409	9,332,641
剰余金増加額又は欠損金減少額	105,633	172,228
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	105,633	172,228
剰余金減少額又は欠損金増加額	398,284	875,035
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	398,284	875,035
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( )	9,332,641	15,785,326



## (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12期	
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月11日及び10月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2020年10月12日、当計算期間末日を2021年4月12日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	2020年10月12日現在	
1. 期首元本額	108,681,086円	99,880,953円
期中追加設定元本額	1,490,630円	1,235,368円
期中一部解約元本額	10,290,763円	9,345,780円
2. 受益権の総数	99,880,953口	91,770,541口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 2020年4月14日 至 2020年10月12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(507,677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(2,304,680円)、信託約款に規定される収益調整金(2,650,631円)及び分配準備積立金(5,045,912円)より分配対象収益は10,508,900円(1万口当たり1,052.14円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(633,316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(6,522,176円)、信託約款に規定される収益調整金(2,528,508円)及び分配準備積立金(7,127,792円)より分配対象収益は16,811,792円(1万口当たり1,831.93円)であります。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11期	第12期
	自 2020年4月14日 至 2020年10月12日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	第11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12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	2,780,408	3,525,289
合計	2,780,408	3,525,289

（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11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0934円 (10,934円)	1.1720円 (11,720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

2021年4月12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	8,511,678	27,224,602	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	6,577,075	8,566,640	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,887,631	9,664,859	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	6,453,486	13,053,466	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	15,005,870	22,174,174	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	4,082,914	8,605,149	
親投資信託受益証券 合計		42,518,654	89,288,890	
合計			89,288,890	

（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。



## 【D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,038,832	11,902,488
親投資信託受益証券	186,380,577	183,236,114
流動資産合計	202,419,409	195,138,602
資産合計	202,419,409	195,138,602
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	1,234,971
未払受託者報酬	55,355	54,383
未払委託者報酬	1,108,039	1,088,308
その他未払費用	3,913	3,789
流動負債合計	1,167,307	2,381,451
負債合計	1,167,307	2,381,451
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	183,367,275	158,587,012
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	17,884,827	34,170,139
(分配準備積立金)	16,501,610	32,325,820
元本等合計	201,252,102	192,757,151
純資産合計	201,252,102	192,757,151
負債純資産合計	202,419,409	195,138,602

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期 自 2020年4月14日 至 2020年10月12日	第12期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	6
有価証券売買等損益	18,685,867	21,555,537
営業収益合計	18,685,867	21,555,543
<b>営業費用</b>		
支払利息	13,628	2,338
受託者報酬	55,355	54,383
委託者報酬	1,108,039	1,088,308
その他費用	9,853	3,789
営業費用合計	1,186,875	1,148,818
営業利益又は営業損失( )	17,498,992	20,406,725
経常利益又は経常損失( )	17,498,992	20,406,725
当期純利益又は当期純損失( )	17,498,992	20,406,725
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( )	1,005,384	1,945,303
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,371,909	17,884,827
剰余金増加額又は欠損金減少額	186,220	745,905
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	186,220	745,905
剰余金減少額又は欠損金増加額	166,910	2,922,015
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	166,910	2,922,015
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( )	17,884,827	34,170,139

## (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12期	
	自 2020年10月13日	至 2021年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年4月11日及び10月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2020年10月12日、当計算期間末日を2021年4月12日としております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	2020年10月12日現在	2021年4月12日現在
1. 期首元本額	204,592,403円	183,367,275円
期中追加設定元本額	2,999,387円	5,001,682円
期中一部解約元本額	24,224,515円	29,781,945円
2. 受益権の総数	183,367,275口	158,587,012口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 2020年4月14日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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(1,487,750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(5,070,097円)、信託約款に規定される収益調整金(4,291,448円)及び分配準備積立金(9,943,763円)より分配対象収益は20,793,058円(1万口当たり1,133.95円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,443,935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(17,017,487円)、信託約款に規定される収益調整金(4,122,033円)及び分配準備積立金(13,864,398円)より分配対象収益は36,447,853円(1万口当たり2,298.28円)であります。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11期	第12期
	自 2020年4月14日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。	同左

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)



## 売買目的有価証券

種類	第11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12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	10,933,836	13,045,883
合計	10,933,836	13,045,883

（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11期 2020年10月12日現在	第12期 2021年4月12日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0975円 (10,975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

2021年4月12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	17,496,515	55,962,603	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	13,409,592	17,465,993	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	3,880,916	19,870,678	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	13,205,063	26,709,880	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	30,829,163	45,556,254	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	8,384,279	17,670,706	
親投資信託受益証券 合計		87,205,528	183,236,114	
合計			183,236,114	

(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)

「DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)」、「DIAMコア資産設計ファンド(積極型)」は、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド」受益証券、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,976,140,569
国債証券	264,503,696,200
地方債証券	16,689,475,500
特殊債券	16,538,735,481
社債券	11,065,916,220
未収入金	250,360,000
未収利息	293,206,519
前払費用	81,765,707
流動資産合計	311,399,296,196
資産合計	311,399,296,196
負債の部	
流動負債	
未払金	801,052,000
未払解約金	97,805,000
流動負債合計	898,857,000
負債合計	898,857,000
純資産の部	
元本等	
元本	238,388,248,809
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	72,112,190,387
元本等合計	310,500,439,196
純資産合計	310,500,439,196
負債純資産合計	311,399,296,196

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	175,050,543,528円
同期中追加設定元本額	155,892,831,216円
同期中一部解約元本額	92,555,125,935円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	22,622,158,151円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	75,443,664円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	66,948,042円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	14,464,911円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	728,794,112円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	161,056,797円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,767,783円
たわらノーロード 国内債券	13,643,525,439円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,567,286,180円
たわらノーロード バランス(堅実型)	536,000,051円
たわらノーロード バランス(標準型)	887,094,783円
たわらノーロード バランス(積極型)	105,858,193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)	39,959,760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)	903,945,794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)	944,852,773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)	302,711,689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)	109,580,438円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	13,884,299円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,636,246円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	21,333,885円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,220,208円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,057,926円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,578,625,435円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,195,113,749円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	10,995,454,500円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,411,539,090円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,025,518,984円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,164,613,215円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	336,152,225円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	92,027,879円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,946,750,943円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,176,727円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,920,938,927円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,289,764,431円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	269,480,672円
投資のソムリエ	28,933,781,690円
クルーズコントロール	1,909,297,920円
投資のソムリエ<DC年金>	1,599,461,486円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,792,461,268円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	509,707,041円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	6,577,075円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	13,409,592円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,896,484,347円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	31,728,896,881円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,007,644円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,971,998円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	28,260,966円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	50,459,306円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	689,825,906円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,580,692,125円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,741,906,026円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	11,674,958円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,368,951円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,527,535円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	35,970,521円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	947,065,334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)	1,160,665,099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)	1,535,294,474円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	588,094,931円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	926,982,406円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	7,791,126,421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)	1,500,770,877円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	671,946,050円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	313,906,424円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,426,312,470円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,555,345,540円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,535,191,474円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,542,790,980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)	1,546,435,533円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	187,803,612円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	103,510,162円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	42,795,837円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	121,142,546円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	45,869,343円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,400,606円

DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	50,434,159円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	138,161,117円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,087,198,264円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,491,039,590円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,730,332,034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)	400,028,911円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	206,029,664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)	2,491,701,996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)	221,394,187円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	11,206,475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)	2,801,001,378円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	55,896,517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)	458,642,371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)	718,803,015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)	1,201,448,302円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	339,045,909円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	107,748,137円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,348,346,339円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	382,409,178円
計	238,388,248,809円
2. 受益権の総数	238,388,248,809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 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	2021年4月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		143,735,300
地方債証券		5,732,500
特殊債券		16,805,501
社債券		8,836,400
合計		175,109,701

(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(2021年2月16日から2021年4月12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)

		2021年4月12日現在
1口当たり純資産額		1.3025円
(1万口当たり純資産額)		(13,025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

2021年4月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考

国債証券	414回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,800,000	
	415回 利付国庫債券(2年)	700,000,000	702,093,000	
	416回 利付国庫債券(2年)	1,270,000,000	1,274,051,300	
	417回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,408,280,000	
	419回 利付国庫債券(2年)	600,000,000	602,310,000	
	420回 利付国庫債券(2年)	4,300,000,000	4,317,415,000	
	421回 利付国庫債券(2年)	540,000,000	542,295,000	
	422回 利付国庫債券(2年)	1,200,000,000	1,205,424,000	
	132回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,506,675,000	
	133回 利付国庫債券(5年)	1,980,000,000	1,986,415,200	
	134回 利付国庫債券(5年)	1,690,000,000	1,696,574,100	
	135回 利付国庫債券(5年)	1,840,000,000	1,848,188,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,256,300,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	1,400,000,000	1,408,036,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	2,150,000,000	2,163,910,500	
	139回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,832,594,400	
	140回 利付国庫債券(5年)	1,690,000,000	1,702,708,800	
	141回 利付国庫債券(5年)	1,660,000,000	1,673,180,400	
	142回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,835,160,600	
	143回 利付国庫債券(5年)	1,700,000,000	1,714,773,000	
	144回 利付国庫債券(5年)	3,050,000,000	3,077,572,000	
	145回 利付国庫債券(5年)	2,900,000,000	2,927,811,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	2,000,000,000	2,018,820,000	
	2回 利付国庫債券(40年)	480,000,000	670,958,400	
	3回 利付国庫債券(40年)	290,000,000	407,406,500	
	4回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	1,058,542,500	
5回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	683,530,000		
6回 利付国庫債券(40年)	670,000,000	903,421,300		



7回 利付国庫債券(40年)	730,000,000	948,211,600	
8回 利付国庫債券(40年)	620,000,000	753,467,400	
9回 利付国庫債券(40年)	1,120,000,000	1,019,950,400	
10回 利付国庫債券(40年)	1,000,000,000	1,066,610,000	
11回 利付国庫債券(40年)	850,000,000	880,107,000	
12回 利付国庫債券(40年)	850,000,000	795,464,000	
13回 利付国庫債券(40年)	940,000,000	878,439,400	
323回 利付国庫債券(10年)	1,100,000,000	1,113,387,000	
324回 利付国庫債券(10年)	2,250,000,000	2,274,705,000	
325回 利付国庫債券(10年)	1,700,000,000	1,722,644,000	
326回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	506,975,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,218,768,000	
328回 利付国庫債券(10年)	1,860,000,000	1,886,133,000	
329回 利付国庫債券(10年)	3,570,000,000	3,642,363,900	
330回 利付国庫債券(10年)	1,250,000,000	1,278,425,000	
331回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	661,602,500	
332回 利付国庫債券(10年)	2,860,000,000	2,916,685,200	
333回 利付国庫債券(10年)	3,650,000,000	3,729,022,500	
334回 利付国庫債券(10年)	2,280,000,000	2,333,625,600	
335回 利付国庫債券(10年)	3,140,000,000	3,207,761,200	
336回 利付国庫債券(10年)	1,060,000,000	1,084,337,600	
337回 利付国庫債券(10年)	1,440,000,000	1,462,392,000	
338回 利付国庫債券(10年)	4,630,000,000	4,725,146,500	
339回 利付国庫債券(10年)	3,340,000,000	3,412,344,400	
340回 利付国庫債券(10年)	3,650,000,000	3,733,840,500	
341回 利付国庫債券(10年)	3,310,000,000	3,372,327,300	
342回 利付国庫債券(10年)	2,380,000,000	2,402,990,800	

343回 利付国庫債券(10年)	3,280,000,000	3,311,586,400	
344回 利付国庫債券(10年)	2,880,000,000	2,907,504,000	
345回 利付国庫債券(10年)	3,110,000,000	3,140,167,000	
346回 利付国庫債券(10年)	2,570,000,000	2,595,237,400	
347回 利付国庫債券(10年)	2,810,000,000	2,837,903,300	
348回 利付国庫債券(10年)	2,680,000,000	2,705,942,400	
349回 利付国庫債券(10年)	2,760,000,000	2,786,827,200	
350回 利付国庫債券(10年)	3,300,000,000	3,330,954,000	
351回 利付国庫債券(10年)	2,660,000,000	2,683,913,400	
352回 利付国庫債券(10年)	2,620,000,000	2,642,427,200	
353回 利付国庫債券(10年)	2,440,000,000	2,459,690,800	
354回 利付国庫債券(10年)	2,570,000,000	2,589,352,100	
355回 利付国庫債券(10年)	2,420,000,000	2,436,794,800	
356回 利付国庫債券(10年)	2,180,000,000	2,192,840,200	
357回 利付国庫債券(10年)	2,260,000,000	2,271,729,400	
358回 利付国庫債券(10年)	2,300,000,000	2,310,212,000	
359回 利付国庫債券(10年)	2,560,000,000	2,568,166,400	
360回 利付国庫債券(10年)	2,590,000,000	2,594,843,300	
361回 利付国庫債券(10年)	2,700,000,000	2,702,592,000	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,263,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	120,829,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	253,882,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	247,752,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	237,388,000	
11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	236,250,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,566,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	122,348,000	
14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	370,437,300	

15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	258,764,000	
16回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	194,638,500	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,590,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	408,880,000	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	256,170,000	
20回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	262,526,000	
21回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,538,000	
22回 利付国庫債券(30年)	220,000,000	290,426,400	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	264,676,000	
24回 利付国庫債券(30年)	190,000,000	252,232,600	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,930,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	526,936,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	562,548,000	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	646,012,800	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	747,443,200	
30回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	753,745,200	
31回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	602,181,400	
32回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	812,562,700	
33回 利付国庫債券(30年)	730,000,000	936,436,700	
34回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,086,475,400	
35回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,420,452,000	
36回 利付国庫債券(30年)	1,050,000,000	1,360,065,000	
37回 利付国庫債券(30年)	1,290,000,000	1,650,877,500	
38回 利付国庫債券(30年)	690,000,000	871,608,000	
39回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	784,466,100	

40回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	633,050,000	
41回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	997,640,000	
42回 利付国庫債券(30年)	910,000,000	1,135,843,800	
43回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	899,517,600	
44回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	737,759,600	
45回 利付国庫債券(30年)	780,000,000	942,201,000	
46回 利付国庫債券(30年)	750,000,000	906,442,500	
47回 利付国庫債券(30年)	810,000,000	997,936,200	
48回 利付国庫債券(30年)	810,000,000	962,466,300	
49回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	1,069,767,000	
50回 利付国庫債券(30年)	810,000,000	850,670,100	
51回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	765,330,600	
52回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	665,726,800	
53回 利付国庫債券(30年)	700,000,000	700,777,000	
54回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	837,784,000	
55回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	941,796,000	
56回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	648,290,600	
57回 利付国庫債券(30年)	790,000,000	825,392,000	
58回 利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,117,026,500	
59回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	692,654,800	
60回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	704,154,000	
61回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	568,568,000	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	481,695,000	
63回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	533,508,600	
64回 利付国庫債券(30年)	840,000,000	783,946,800	

65回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	475,146,600	
66回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	670,442,400	
67回 利付国庫債券(30年)	890,000,000	873,721,900	
68回 利付国庫債券(30年)	910,000,000	893,237,800	
69回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	905,562,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	376,890,500	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	366,696,800	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	152,254,200	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	206,060,700	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	262,584,000	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	487,757,600	
88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	393,484,000	
90回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	337,266,000	
92回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	977,801,700	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	280,752,500	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	508,036,500	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	401,289,000	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	572,665,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	514,746,000	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	693,210,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	422,848,800	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	462,996,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	407,729,000	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	464,752,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	458,600,000	

109回 利付国庫債券(20年)	220,000,000	253,063,800	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	384,829,500	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	341,808,500	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	643,758,500	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	904,534,400	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	648,367,500	
115回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	237,502,000	
116回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	381,363,200	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	768,859,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	364,941,300	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	347,688,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	456,276,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	632,356,200	
122回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	406,581,000	
123回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	776,217,000	
124回 利付国庫債券(20年)	390,000,000	461,982,300	
125回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	434,577,600	
126回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	403,739,800	
127回 利付国庫債券(20年)	420,000,000	494,604,600	
128回 利付国庫債券(20年)	1,020,000,000	1,204,518,000	
129回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	690,789,700	
130回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	798,177,200	
131回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	698,088,000	
132回 利付国庫債券(20年)	420,000,000	489,766,200	
133回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	929,553,500	

134回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,214,782,000	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	409,020,500	
136回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	509,454,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	409,909,500	
138回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	436,677,000	
139回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	522,072,000	
140回 利付国庫債券(20年)	1,490,000,000	1,748,723,600	
141回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	882,007,500	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	474,988,000	
143回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	886,600,800	
144回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	496,602,700	
145回 利付国庫債券(20年)	1,410,000,000	1,665,562,500	
146回 利付国庫債券(20年)	1,550,000,000	1,834,394,000	
147回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,853,703,400	
148回 利付国庫債券(20年)	1,390,000,000	1,615,777,700	
149回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,315,342,600	
150回 利付国庫債券(20年)	1,530,000,000	1,763,340,300	
151回 利付国庫債券(20年)	1,510,000,000	1,702,102,200	
152回 利付国庫債券(20年)	1,570,000,000	1,770,818,700	
153回 利付国庫債券(20年)	1,470,000,000	1,679,151,600	
154回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,388,952,900	
155回 利付国庫債券(20年)	1,530,000,000	1,684,208,700	
156回 利付国庫債券(20年)	940,000,000	952,746,400	
157回 利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,228,275,000	
158回 利付国庫債券(20年)	1,180,000,000	1,211,246,400	

159回	利付国庫債券(20年)	1,350,000,000	1,404,364,500		
160回	利付国庫債券(20年)	1,280,000,000	1,349,644,800		
161回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,194,033,500		
162回	利付国庫債券(20年)	920,000,000	954,260,800		
163回	利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,419,511,800		
164回	利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,486,688,800		
165回	利付国庫債券(20年)	1,090,000,000	1,108,410,100		
166回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,206,235,000		
167回	利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,267,500,000		
168回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,144,250,000		
169回	利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,121,940,000		
170回	利付国庫債券(20年)	920,000,000	895,739,600		
171回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,029,927,800		
172回	利付国庫債券(20年)	1,060,000,000	1,048,000,800		
173回	利付国庫債券(20年)	1,320,000,000	1,302,589,200		
174回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,281,501,000		
175回	利付国庫債券(20年)	1,300,000,000	1,304,667,000		
国債証券 合計		249,080,000,000	264,503,696,200		
地方債証券	708回	東京都公募公債	500,000,000	505,200,000	
	720回	東京都公募公債	300,000,000	305,613,000	
	726回	東京都公募公債	400,000,000	407,688,000	
	802回	東京都公募公債	400,000,000	399,116,000	
	14回	東京都公募公債 30年	100,000,000	129,781,000	
	5回	東京都公募公債 20年	100,000,000	108,237,000	
	9回	東京都公募公債 20年	200,000,000	224,842,000	
	10回	東京都公募公債 20年	300,000,000	337,260,000	
	30年度14回	北海道公募公債	300,000,000	301,719,000	
	36回2号	宮城県公募公債 10年	250,000,000	249,060,000	
	194回	神奈川県公募公債	300,000,000	303,933,000	
	208回	神奈川県公募公債	300,000,000	305,124,000	



16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	355,212,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	116,923,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	303,345,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	306,276,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	232,730,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	101,890,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,946,500	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,368,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	310,329,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	325,878,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	212,052,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	109,608,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	349,491,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	305,376,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	181,029,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	199,920,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	101,085,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	407,860,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	347,235,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	203,904,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	346,410,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	303,687,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	203,908,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,216,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,814,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	707,343,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,340,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,645,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,064,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,240,000	

	144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,184,000	
	146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	408,840,000	
	148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,525,000	
	166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,460,000	
	29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,026,000	
	488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	459,036,000	
	4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	113,397,000	
	30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	303,546,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	407,868,000	
	2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	129,124,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	203,434,000	
	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	201,344,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,445,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	207,474,000	
	29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	303,075,000	
地方債証券 合計		16,000,000,000	16,689,475,500	
特殊債券	9回 新関西国際空港社債	200,000,000	216,272,000	
	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,430,000	
	131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	98,085,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	219,937,500	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	269,184,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	707,917,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	101,712,000	
	169回 高速道路機構債	100,000,000	110,059,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	195,392,000	
	210回 高速道路機構債	100,000,000	102,753,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	578,245,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,475,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	509,720,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	336,880,500	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	333,495,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,720,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	233,316,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	804,824,000	

319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,722,000	
28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	523,076,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	229,368,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	234,136,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	352,086,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	233,160,000	
36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,033,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	231,586,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	406,028,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	510,215,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	553,154,360	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,490,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	224,452,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	400,804,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	231,842,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	212,860,000	
165回 都市再生機構債券	100,000,000	98,416,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	232,856,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	414,046,500	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,866,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,649,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,985,000	33,539,477	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,220,000	23,762,187	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,836,000	35,653,252	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,050,000	38,198,179	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,374,000	12,790,756	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,748,000	49,007,592	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,715,000	36,781,807	

	1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,820,000	60,321,674	
	29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,760,000	133,634,178	
	36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	196,832,000	208,315,178	
	114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	240,975,000	241,302,726	
	126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,617,000	255,303,553	
	128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,965,000	255,483,710	
	131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,627,000	259,775,303	
	132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,933,000	260,077,483	
	137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	267,075,000	269,625,566	
	い第828号 利付商工債	100,000,000	100,249,000	
	369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	400,272,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	115,996,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,000,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	300,144,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	508,055,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,184,000	
特殊債券 合計		15,609,532,000	16,538,735,481	
社債券	1回 B P C E S A円貨社債(ソーシャルボンド)	200,000,000	199,998,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	204,196,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	96,374,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,535,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,496,000	
	14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,662,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,615,000	
	6回 J Xホールディングス社債	100,000,000	102,292,000	
	14回 プリジストン社債	200,000,000	200,800,000	
	23回 ジェイ エフ イーホールディングス社債	100,000,000	99,988,000	
	23回 パナソニック社債	200,000,000	198,536,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,532,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,516,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	101,557,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	101,833,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,305,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	206,622,000	

10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,188,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	101,357,000	
18回	NTTファイナンス社債	200,000,000	201,582,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	203,008,000	
56回	三菱UFJリース社債	200,000,000	202,274,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	107,318,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,072,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	107,374,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	99,654,000	
21回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,887,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	324,741,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,916,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	234,856,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,441,000	
10回	西日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,748,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,813,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,059,000	
11回	東海旅客鉄道社債	300,000,000	305,754,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	210,642,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	106,346,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	134,012,400	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	97,435,000	
518回	中部電力社債	200,000,000	200,536,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	304,284,000	
377回	中国電力社債	400,000,000	410,092,000	
301回	北陸電力社債	100,000,000	102,156,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	104,671,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	411,908,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	204,170,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	206,108,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	411,440,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	165,607,820	
340回	北海道電力社債	300,000,000	304,731,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	202,704,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	215,970,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	307,341,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	306,342,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	201,154,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	102,459,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	101,714,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	202,194,000	
社債券 合計		10,781,000,000	11,065,916,220	
合計			308,797,823,401	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

## 国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,577,888,926
株式	344,931,255,952
派生商品評価勘定	63,735,460
未収入金	27,504,360
未収配当金	2,737,903,410
差入委託証拠金	644,160,000
流動資産合計	358,982,448,108
資産合計	358,982,448,108
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	30,064,960
前受金	71,165,000
未払解約金	149,251,000
流動負債合計	250,480,960
負債合計	250,480,960
純資産の部	
元本等	
元本	112,157,626,770
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	246,574,340,378
元本等合計	358,731,967,148
純資産合計	358,731,967,148
負債純資産合計	358,982,448,108

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	103,987,218,101円
同期中追加設定元本額	48,377,030,329円
同期中一部解約元本額	40,206,621,660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	16,521,581,177円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,346,134,755円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,802,636円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,658,570円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,814,621円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,167,124円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	23,209,699円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,265,330円
たわらノーロード TOPIX	904,872,655円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	666,161,399円
たわらノーロード バランス(堅実型)	24,315,686円
たわらノーロード バランス(標準型)	151,516,006円
たわらノーロード バランス(積極型)	227,818,816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)	1,750,523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)	106,847,484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)	249,722,787円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	171,608,619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)	242,645,528円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	474,980円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,169,890円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,936,223円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,840,857円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,645,556円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,561,134,956円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	991,164,342円



DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,353,144,978円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,429,821,205円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	324,563,721円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,126,818,055円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,073,730,854円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	31,789,513円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,023,706,018円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	21,497,518円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	302,674,443円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	261,308,083円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	445,951,184円
投資のソムリエ	18,691,342,042円
クルーズコントロール	827,996,174円
投資のソムリエ<DC年金>	1,033,446,231円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	287,321,539円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	376,972,979円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	8,511,678円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	17,496,515円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	536,403,276円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,875,277,337円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	20,309,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,591,683円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,234,980円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	46,013,153円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	107,532,965円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,717,986,886円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	255,551,335円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	11,495,619円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,760,868円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,903,346円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	11,856,999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)	23,829,892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)	29,371,292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)	68,321,700円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	14,678,803円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	24,770,536円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	435,951,476円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	38,910,669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)	456,171,362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)	39,021,505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)	63,744,593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)	105,628,204円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,472,667円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	32,895,788円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,480,170円

D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,955,597円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	13,704,070円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	37,517,416円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	624,199,391円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	676,510,638円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,927,305,181円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	108,625,592円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	33,581,091円
D I A M 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)	337,389,775円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	90,202,974円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,520,991円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	427,872,992円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	22,774,131円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	93,394,269円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	219,632,884円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	293,639,414円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	42,012,712円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	18,806,528円
D I A M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)	321,266,809円
D I A M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)	992,662,363円
D I A M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)	1,314,318,490円
D I A M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)	52,594,563円
MHAMトピックスファンド	641,618,864円
計	112,157,626,770円
2. 受益権の総数	112,157,626,770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 2020年10月13日 至 2021年4月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	<p>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。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年4月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	3,503,186,501
合計	3,503,186,501

(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(2021年2月9日から2021年4月12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	2021年4月12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	12,699,615,000	-	12,733,500,000	33,885,000
合計	12,699,615,000	-	12,733,500,000	33,885,000

(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)

2021年4月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1985円 (31,985円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年4月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,800	3,010.00	17,458,000	
日本水産	162,100	529.00	85,750,900	
マルハニチロ	27,400	2,610.00	71,514,000	
ハウスイ	800	997.00	797,600	
雪国まいたけ	10,700	1,908.00	20,415,600	
カネコ種苗	5,000	1,637.00	8,185,000	
サカタのタネ	20,800	3,935.00	81,848,000	
ホクト	14,800	2,042.00	30,221,600	
ホクリヨウ	2,500	710.00	1,775,000	
ヒノキヤグループ	4,200	2,603.00	10,932,600	
ショーボンドホールディングス	25,000	4,945.00	123,625,000	
ミライト・ホールディングス	60,700	1,866.00	113,266,200	
タマホーム	10,700	2,193.00	23,465,100	
サンヨーホームズ	2,500	779.00	1,947,500	
日本アクア	7,000	611.00	4,277,000	
ファーストコーポレーション	5,400	792.00	4,276,800	
ベステラ	3,200	1,728.00	5,529,600	
Robot Home	32,400	187.00	6,058,800	
キャンディル	3,000	549.00	1,647,000	
スペースバリューホールディングス	21,300	797.00	16,976,100	
住石ホールディングス	30,100	117.00	3,521,700	

日鉄鉱業	4,100	6,610.00	27,101,000
三井松島ホールディングス	7,300	950.00	6,935,000
I N P E X	642,700	744.00	478,168,800
石油資源開発	23,000	2,039.00	46,897,000
K & O エナジーグループ	8,300	1,448.00	12,018,400
ダイセキ環境ソリューション	3,300	979.00	3,230,700
第一カッター興業	4,200	1,583.00	6,648,600
明豊ファシリティワークス	5,700	674.00	3,841,800
安藤・間	111,900	875.00	97,912,500
東急建設	51,200	581.00	29,747,200
コムシスホールディングス	61,900	3,525.00	218,197,500
ビーアールホールディングス	20,500	585.00	11,992,500
高松コンストラクショングループ	11,000	2,217.00	24,387,000
東建コーポレーション	5,400	10,690.00	57,726,000
ソネック	1,800	853.00	1,535,400
ヤマウラ	7,800	924.00	7,207,200
オリエンタル白石	58,600	305.00	17,873,000
大成建設	125,600	4,265.00	535,684,000
大林組	403,700	1,045.00	421,866,500
清水建設	378,300	908.00	343,496,400
飛鳥建設	11,300	1,155.00	13,051,500
長谷工コーポレーション	132,100	1,600.00	211,360,000
松井建設	16,300	732.00	11,931,600
銭高組	1,300	4,800.00	6,240,000
鹿島建設	295,800	1,554.00	459,673,200
不動テトラ	9,800	1,960.00	19,208,000
大末建設	5,400	942.00	5,086,800
鉄建建設	8,100	1,875.00	15,187,500
西松建設	28,800	2,821.00	81,244,800
三井住友建設	97,500	493.00	48,067,500
大豊建設	8,900	3,960.00	35,244,000
前田建設工業	101,200	979.00	99,074,800
佐田建設	7,300	440.00	3,212,000
ナカノフドー建設	10,600	398.00	4,218,800
奥村組	22,100	2,876.00	63,559,600
東鉄工業	17,400	2,591.00	45,083,400
イチケン	2,800	2,021.00	5,658,800
富士ピー・エス	5,500	600.00	3,300,000
浅沼組	4,700	4,705.00	22,113,500
戸田建設	167,800	821.00	137,763,800
熊谷組	18,700	3,040.00	56,848,000
北野建設	2,200	2,526.00	5,557,200
植木組	3,400	1,523.00	5,178,200
矢作建設工業	18,100	836.00	15,131,600
ピーエス三菱	13,200	666.00	8,791,200
日本ハウスホールディングス	27,700	334.00	9,251,800
大東建託	44,200	12,800.00	565,760,000
新日本建設	17,200	868.00	14,929,600
N I P P O	33,500	3,045.00	102,007,500
東亜道路工業	2,500	4,285.00	10,712,500

前田道路	25,000	2,197.00	54,925,000
日本道路	4,000	8,100.00	32,400,000
東亜建設工業	10,800	2,473.00	26,708,400
日本国土開発	39,600	623.00	24,670,800
若築建設	7,300	1,345.00	9,818,500
東洋建設	45,400	577.00	26,195,800
五洋建設	171,600	895.00	153,582,000
世紀東急工業	19,400	895.00	17,363,000
福田組	4,600	5,160.00	23,736,000
日本ドライケミカル	3,200	1,703.00	5,449,600
住友林業	95,000	2,505.00	237,975,000
日本基礎技術	12,700	523.00	6,642,100
バコーボレーション	18,100	402.00	7,276,200
大和ハウス工業	372,800	3,273.00	1,220,174,400
ライト工業	23,300	1,855.00	43,221,500
積水ハウス	437,700	2,380.50	1,041,944,850
日特建設	10,700	819.00	8,763,300
北陸電気工事	7,200	1,164.00	8,380,800
ユアテック	23,100	800.00	18,480,000
日本リーテック	8,300	1,900.00	15,770,000
四電工	1,800	2,953.00	5,315,400
中電工	18,700	2,418.00	45,216,600
関電工	65,900	987.00	65,043,300
きんでん	82,000	1,910.00	156,620,000
東京エネシス	13,300	917.00	12,196,100
トーエネック	4,100	3,860.00	15,826,000
住友電設	11,400	2,498.00	28,477,200
日本電設工業	22,100	1,977.00	43,691,700
協和エクシオ	61,100	3,015.00	184,216,500
新日本空調	10,700	2,358.00	25,230,600
日本工営	7,900	3,080.00	24,332,000
九電工	28,600	4,280.00	122,408,000
三機工業	28,700	1,446.00	41,500,200
日揮ホールディングス	134,500	1,318.00	177,271,000
中外炉工業	4,300	2,083.00	8,956,900
ヤマト	12,900	655.00	8,449,500
太平電業	9,100	2,700.00	24,570,000
高砂熱学工業	36,600	1,699.00	62,183,400
三晃金属工業	1,700	2,851.00	4,846,700
NEC ネットエスアイ	41,700	1,924.00	80,230,800
朝日工業社	2,400	2,973.00	7,135,200
明星工業	26,300	780.00	20,514,000
大気社	19,600	3,130.00	61,348,000
ダイダン	9,100	2,924.00	26,608,400
日比谷総合設備	13,300	1,935.00	25,735,500
ニッポン	38,300	1,615.00	61,854,500
日清製粉グループ本社	145,900	1,843.00	268,893,700
日東富士製粉	800	7,250.00	5,800,000
昭和産業	11,000	3,055.00	33,605,000
鳥越製粉	11,700	825.00	9,652,500

中部飼料	15,900	1,457.00	23,166,300
フィード・ワン	17,800	902.00	16,055,600
東洋精糖	1,800	1,221.00	2,197,800
日本甜菜製糖	7,100	1,639.00	11,636,900
D M三井製糖ホールディングス	10,500	1,886.00	19,803,000
塩水港精糖	15,500	244.00	3,782,000
日新製糖	4,900	1,818.00	8,908,200
L I F U L L	42,600	406.00	17,295,600
ミクシィ	23,500	2,786.00	65,471,000
ジェイエイシーリクルートメント	8,100	1,803.00	14,604,300
日本M&Aセンター	201,600	3,015.00	607,824,000
メンバーズ	3,600	2,629.00	9,464,400
中広	1,300	340.00	442,000
UTグループ	17,800	3,710.00	66,038,000
アイティメディア	4,100	1,958.00	8,027,800
タケエイ	13,700	1,321.00	18,097,700
E・Jホールディングス	4,700	1,100.00	5,170,000
夢真ビーネックスグループ	32,600	1,452.00	47,335,200
コシダカホールディングス	28,900	602.00	17,397,800
アルトナー	3,000	818.00	2,454,000
パソナグループ	13,300	1,872.00	24,897,600
C D S	2,500	1,524.00	3,810,000
リンクアンドモチベーション	22,300	649.00	14,472,700
G C A	15,800	835.00	13,193,000
エス・エム・エス	41,700	3,395.00	141,571,500
サニーサイドアップグループ	4,200	781.00	3,280,200
パーソルホールディングス	123,000	2,168.00	266,664,000
リニカル	7,100	769.00	5,459,900
クックパッド	38,500	316.00	12,166,000
エスクリ	4,000	403.00	1,612,000
アイ・ケイ・ケイ	5,900	731.00	4,312,900
森永製菓	30,300	3,895.00	118,018,500
中村屋	2,600	3,875.00	10,075,000
江崎グリコ	35,500	4,365.00	154,957,500
名糖産業	5,900	1,516.00	8,944,400
井村屋グループ	7,300	2,535.00	18,505,500
不二家	8,300	2,244.00	18,625,200
山崎製パン	96,900	1,711.00	165,795,900
第一屋製パン	3,100	975.00	3,022,500
モロゾフ	1,800	5,730.00	10,314,000
亀田製菓	7,400	4,730.00	35,002,000
寿スピリッツ	12,400	7,030.00	87,172,000
カルビー	58,900	2,763.00	162,740,700
森永乳業	23,700	5,830.00	138,171,000
六甲バター	8,800	1,691.00	14,880,800
ヤクルト本社	88,700	5,470.00	485,189,000
明治ホールディングス	85,500	6,970.00	595,935,000
雪印メグミルク	31,200	2,290.00	71,448,000
プリマハム	18,200	3,565.00	64,883,000
日本ハム	49,400	4,975.00	245,765,000

林兼産業	4,000	660.00	2,640,000
丸大食品	12,900	1,705.00	21,994,500
S Foods	11,600	3,695.00	42,862,000
柿安本店	4,300	2,595.00	11,158,500
伊藤ハム米久ホールディングス	83,700	723.00	60,515,100
学情	4,200	1,487.00	6,245,400
スタジオアリス	6,100	2,289.00	13,962,900
クロスキャット	3,200	1,106.00	3,539,200
シミックホールディングス	5,900	1,565.00	9,233,500
エプロ	3,000	949.00	2,847,000
システナ	45,100	2,397.00	108,104,700
N J S	3,000	2,083.00	6,249,000
デジタルアーツ	7,300	10,030.00	73,219,000
日鉄ソリューションズ	18,800	3,730.00	70,124,000
総合警備保障	49,100	5,070.00	248,937,000
キューブシステム	6,700	1,200.00	8,040,000
いちご	141,100	317.00	44,728,700
エイジア	1,900	1,777.00	3,376,300
日本駐車場開発	124,900	161.00	20,108,900
コア	5,400	1,500.00	8,100,000
カカクコム	90,900	3,020.00	274,518,000
アイロムグループ	4,200	2,409.00	10,117,800
セントケア・ホールディング	9,000	1,245.00	11,205,000
サイネックス	2,500	687.00	1,717,500
ルネサンス	7,800	1,173.00	9,149,400
ディップ	19,100	2,807.00	53,613,700
S B Sホールディングス	9,600	2,708.00	25,996,800
デジタルホールディングス	8,400	2,000.00	16,800,000
新日本科学	14,800	733.00	10,848,400
キャリアデザインセンター	2,600	1,079.00	2,805,400
ベネフィット・ワン	44,900	2,817.00	126,483,300
エムスリー	216,900	7,928.00	1,719,583,200
ツカダ・グローバルホールディング	10,400	349.00	3,629,600
プラス	1,600	563.00	900,800
アウトソーシング	70,400	1,786.00	125,734,400
ウェルネット	12,400	583.00	7,229,200
ワールドホールディングス	4,200	2,878.00	12,087,600
ディー・エヌ・エー	52,000	2,216.00	115,232,000
博報堂DYホールディングス	171,000	1,824.00	311,904,000
ぐるなび	21,300	601.00	12,801,300
タカミヤ	15,300	563.00	8,613,900
ジャパンベストレスキューシステム	9,600	833.00	7,996,800
ファンコミュニケーションズ	33,800	416.00	14,060,800
ライク	3,200	2,033.00	6,505,600
ビジネス・ブレークスルー	5,600	468.00	2,620,800
エスプール	31,500	1,042.00	32,823,000
W D Bホールディングス	5,700	2,525.00	14,392,500
手間いらず	1,100	5,580.00	6,138,000
ティア	7,800	489.00	3,814,200
C D G	1,400	1,580.00	2,212,000



アドウェイズ	14,800	832.00	12,313,600
バリューコマース	8,200	3,705.00	30,381,000
インフォマート	124,500	996.00	124,002,000
サッポロホールディングス	44,200	2,290.00	101,218,000
アサヒグループホールディングス	282,400	4,792.00	1,353,260,800
キリンホールディングス	547,900	2,044.00	1,119,907,600
宝ホールディングス	95,700	1,481.00	141,731,700
オエノンホールディングス	37,500	400.00	15,000,000
養命酒製造	4,200	1,855.00	7,791,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	98,800	1,785.00	176,358,000
サントリー食品インターナショナル	86,500	3,965.00	342,972,500
ダイドーグループホールディングス	7,400	5,310.00	39,294,000
伊藤園	39,300	6,360.00	249,948,000
キーコーヒー	12,900	2,097.00	27,051,300
ユニカフェ	4,200	1,020.00	4,284,000
ジャパンフーズ	1,600	1,232.00	1,971,200
日清オイリオグループ	16,600	3,185.00	52,871,000
不二製油グループ本社	31,700	2,916.00	92,437,200
かどや製油	1,000	4,015.00	4,015,000
J-オイルミルズ	12,100	1,907.00	23,074,700
ローソン	32,000	5,100.00	163,200,000
サンエー	9,600	4,515.00	43,344,000
カワチ薬品	8,900	2,750.00	24,475,000
エービーシー・マート	19,700	6,260.00	123,322,000
ハードオフコーポレーション	5,800	799.00	4,634,200
高千穂交易	5,100	1,113.00	5,676,300
アスクル	11,000	4,075.00	44,825,000
ゲオホールディングス	17,100	1,196.00	20,451,600
アダストリア	17,500	1,932.00	33,810,000
ジーフット	8,200	411.00	3,370,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	2,300	410.00	943,000
オルパヘルスケアホールディングス	1,700	1,677.00	2,850,900
伊藤忠食品	2,500	5,410.00	13,525,000
くら寿司	7,400	8,220.00	60,828,000
キャンドウ	5,900	2,065.00	12,183,500
エレマテック	10,100	1,021.00	10,312,100
アイケイ	2,600	850.00	2,210,000
パルグループホールディングス	11,100	1,571.00	17,438,100
JALUX	3,600	1,692.00	6,091,200
エディオン	53,700	1,202.00	64,547,400
あらた	10,100	4,765.00	48,126,500
サーラコーポレーション	26,200	619.00	16,217,800
ワッツ	5,700	927.00	5,283,900
トーマンデバイス	1,700	4,110.00	6,987,000
ハローズ	4,700	2,871.00	13,493,700
J Pホールディングス	35,300	318.00	11,225,400
フジオフードグループ本社	10,600	1,429.00	15,147,400
あみやき亭	2,600	2,903.00	7,547,800
東京エレクトロン デバイス	4,200	4,635.00	19,467,000

ひらまつ	23,600	157.00	3,705,200
フィールズ	11,100	559.00	6,204,900
双日	698,500	308.00	215,138,000
アルフレッサホールディングス	131,300	2,146.00	281,769,800
大黒天物産	2,800	7,710.00	21,588,000
ハニーズホールディングス	9,800	1,079.00	10,574,200
ファーマライズホールディングス	3,600	809.00	2,912,400
キッコーマン	92,800	6,560.00	608,768,000
味の素	307,300	2,225.00	683,742,500
ブルドックソース	5,800	2,430.00	14,094,000
キュービー	71,900	2,589.00	186,149,100
ハウス食品グループ本社	48,300	3,605.00	174,121,500
カゴメ	52,800	3,410.00	180,048,000
焼津水産化学工業	5,200	994.00	5,168,800
アリアケジャパン	12,000	6,630.00	79,560,000
ピエトロ	1,300	1,817.00	2,362,100
エバラ食品工業	2,500	2,662.00	6,655,000
やまみ	1,100	2,123.00	2,335,300
ニチレイ	61,600	2,814.00	173,342,400
横浜冷凍	33,700	909.00	30,633,300
東洋水産	66,400	4,625.00	307,100,000
イトアンドホールディングス	4,400	1,983.00	8,725,200
大冷	1,600	1,961.00	3,137,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,300	967.00	7,059,100
日清食品ホールディングス	50,700	8,020.00	406,614,000
永谷園ホールディングス	6,500	2,298.00	14,937,000
一正蒲鉾	4,200	1,311.00	5,506,200
フジッコ	14,100	1,951.00	27,509,100
ロック・フィールド	14,000	1,654.00	23,156,000
日本たばこ産業	692,800	2,090.00	1,447,952,000
ケンコーマヨネーズ	8,000	1,825.00	14,600,000
わらべや日洋ホールディングス	8,500	1,908.00	16,218,000
なとり	7,500	1,967.00	14,752,500
イフジ産業	2,500	949.00	2,372,500
ピックルスコーポレーション	3,000	3,190.00	9,570,000
ファーマフーズ	11,300	3,185.00	35,990,500
北の達人コーポレーション	44,800	661.00	29,612,800
ユーグレナ	55,800	1,072.00	59,817,600
スター・マイカ・ホールディングス	6,600	1,232.00	8,131,200
SREホールディングス	1,400	5,280.00	7,392,000
ADワークスグループ	24,400	164.00	4,001,600
片倉工業	17,100	1,511.00	25,838,100
ゲンゼ	9,300	4,100.00	38,130,000
ヒューリック	269,300	1,295.00	348,743,500
神栄	1,700	1,270.00	2,159,000
ラサ商事	7,100	919.00	6,524,900
アルペン	9,700	2,590.00	25,123,000
ハブ	4,000	702.00	2,808,000
ラクーンホールディングス	9,000	2,954.00	26,586,000
クオールホールディングス	17,000	1,538.00	26,146,000

アルコニックス	13,400	1,590.00	21,306,000
神戸物産	87,600	2,945.00	257,982,000
ソリトンシステムズ	6,300	1,698.00	10,697,400
ジンズホールディングス	6,700	8,500.00	56,950,000
ビックカメラ	75,300	1,267.00	95,405,100
DCMホールディングス	78,300	1,158.00	90,671,400
ペッパーフードサービス	14,200	298.00	4,231,600
ハイパー	2,300	551.00	1,267,300
MonotaRO	180,200	2,979.00	536,815,800
東京一番フーズ	2,700	599.00	1,617,300
DDホールディングス	5,700	579.00	3,300,300
あいホールディングス	18,200	2,220.00	40,404,000
ディーブイエックス	4,200	1,028.00	4,317,600
きちりホールディングス	3,800	568.00	2,158,400
アークランドサービスホールディングス	10,700	2,273.00	24,321,100
J.フロントリテイリング	151,300	1,023.00	154,779,900
ドトール・日レスホールディングス	20,100	1,706.00	34,290,600
マツモトキヨシホールディングス	52,400	4,695.00	246,018,000
ブロンコビリー	6,600	2,387.00	15,754,200
ZOZO	74,700	3,405.00	254,353,500
トレジャー・ファクトリー	3,800	1,049.00	3,986,200
物語コーポレーション	6,700	7,300.00	48,910,000
ココカラファイン	11,300	8,120.00	91,756,000
三越伊勢丹ホールディングス	221,600	752.00	166,643,200
東洋紡	49,800	1,411.00	70,267,800
ユニチカ	37,200	404.00	15,028,800
富士紡ホールディングス	5,900	4,325.00	25,517,500
日清紡ホールディングス	78,600	860.00	67,596,000
倉敷紡績	11,600	1,869.00	21,680,400
ダイワボウホールディングス	57,500	1,677.00	96,427,500
シキボウ	7,200	974.00	7,012,800
日東紡績	19,000	3,950.00	75,050,000
トヨタ紡織	37,600	1,901.00	71,477,600
マクニカ・富士エレホールディングス	30,200	2,271.00	68,584,200
Hamee	3,100	1,742.00	5,400,200
ラクト・ジャパン	5,600	2,778.00	15,556,800
ウエルシアホールディングス	67,000	3,655.00	244,885,000
クリエイトSDホールディングス	18,700	3,570.00	66,759,000
グリムス	2,600	1,985.00	5,161,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22,400	739.00	16,553,600
八洲電機	9,900	979.00	9,692,100
メディアスホールディングス	7,300	927.00	6,767,100
レスターホールディングス	13,300	2,055.00	27,331,500
ジュテックホールディングス	2,500	1,017.00	2,542,500
丸善CHIホールディングス	16,600	393.00	6,523,800
大光	5,400	702.00	3,790,800
OCHIホールディングス	3,900	1,303.00	5,081,700
TOKAIホールディングス	61,700	943.00	58,183,100

黒谷	3,600	823.00	2,962,800
ミサワ	2,500	716.00	1,790,000
ティーライフ	1,800	1,389.00	2,500,200
C o m i n i x	1,800	765.00	1,377,000
エー・ピーホールディングス	2,200	456.00	1,003,200
三洋貿易	12,500	1,108.00	13,850,000
チムニー	3,900	1,274.00	4,968,600
シュッピン	8,500	1,139.00	9,681,500
ビューティガレージ	2,200	3,940.00	8,668,000
オイシックス・ラ・大地	12,500	2,915.00	36,437,500
ウイン・パートナーズ	9,200	1,043.00	9,595,600
ネクステージ	21,900	1,930.00	42,267,000
ジョイフル本田	37,200	1,426.00	53,047,200
鳥貴族ホールディングス	3,600	1,637.00	5,893,200
ホットランド	9,300	1,310.00	12,183,000
すかいらーくホールディングス	142,000	1,694.00	240,548,000
S F Pホールディングス	6,000	1,431.00	8,586,000
綿半ホールディングス	9,500	1,304.00	12,388,000
日本毛織	41,700	1,020.00	42,534,000
ダイトウボウ	20,900	110.00	2,299,000
トーア紡コーポレーション	4,300	472.00	2,029,600
ガイドーリミテッド	18,000	183.00	3,294,000
ヨシックス	2,500	2,219.00	5,547,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	37,000	1,167.00	43,179,000
三栄建築設計	5,100	1,978.00	10,087,800
野村不動産ホールディングス	77,100	2,672.00	206,011,200
三重交通グループホールディングス	26,000	493.00	12,818,000
サムティ	18,000	1,995.00	35,910,000
ディア・ライフ	17,800	470.00	8,366,000
コーセーアールイー	3,900	623.00	2,429,700
日本商業開発	7,900	1,723.00	13,611,700
プレサンスコーポレーション	20,800	1,762.00	36,649,600
フィル・カンパニー	2,400	2,254.00	5,409,600
T H E グローバル社	7,900	263.00	2,077,700
ハウスコム	1,300	1,276.00	1,658,800
日本管理センター	6,700	1,289.00	8,636,300
サンセイランディック	3,900	899.00	3,506,100
エストラスト	1,400	697.00	975,800
フージャースホールディングス	20,800	702.00	14,601,600
オープンハウス	39,900	4,920.00	196,308,000
東急不動産ホールディングス	345,000	640.00	220,800,000
飯田グループホールディングス	105,800	2,715.00	287,247,000
イーグランド	2,500	917.00	2,292,500
ムゲンエステート	7,900	507.00	4,005,300
帝国繊維	14,100	2,299.00	32,415,900
日本コークス工業	108,700	111.00	12,065,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,500	1,370.00	8,905,000
ミタチ産業	3,200	685.00	2,192,000
B E E N O S	5,800	3,030.00	17,574,000

あさひ	9,300	1,517.00	14,108,100
日本調剤	7,800	1,752.00	13,665,600
コスモス薬品	12,900	16,150.00	208,335,000
シップヘルスケアホールディングス	44,600	2,990.00	133,354,000
トーエル	6,000	946.00	5,676,000
ソフトクリエイトホールディングス	5,000	2,694.00	13,470,000
オンリー	2,700	480.00	1,296,000
セブン&アイ・ホールディングス	496,000	4,366.00	2,165,536,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	67,600	863.00	58,338,800
明治電機工業	3,300	1,437.00	4,742,100
ツルハホールディングス	27,700	13,490.00	373,673,000
デリカフーズホールディングス	5,700	640.00	3,648,000
スターティアホールディングス	2,500	1,242.00	3,105,000
サンマルクホールディングス	9,900	1,720.00	17,028,000
フェリシモ	2,700	1,278.00	3,450,600
トリドールホールディングス	31,400	1,671.00	52,469,400
帝人	118,700	1,844.00	218,882,800
東レ	912,900	688.50	628,531,650
クラレ	198,500	1,222.00	242,567,000
旭化成	835,600	1,226.00	1,024,445,600
サカイオーベックス	3,300	3,015.00	9,949,500
TOKYO BASE	11,200	730.00	8,176,000
稲葉製作所	7,300	1,543.00	11,263,900
宮地エンジニアリンググループ	4,100	2,347.00	9,622,700
トーカロ	33,000	1,530.00	50,490,000
アルファ	4,900	1,155.00	5,659,500
SUMCO	162,800	2,746.00	447,048,800
川田テクノロジーズ	2,500	4,625.00	11,562,500
RS Technologies	4,100	7,150.00	29,315,000
ジェイテックコーポレーション	1,000	2,923.00	2,923,000
信和	7,000	815.00	5,705,000
ビーロット	5,800	685.00	3,973,000
ファーストブラザーズ	2,500	1,016.00	2,540,000
ハウストゥ	5,900	1,132.00	6,678,800
シーアールイー	3,200	1,399.00	4,476,800
プロパティエージェント	2,200	2,268.00	4,989,600
ケイアイスター不動産	4,000	3,835.00	15,340,000
アグレ都市デザイン	2,400	994.00	2,385,600
グッドコムアセット	5,900	1,505.00	8,879,500
ジェイ・エス・ビー	2,500	3,065.00	7,662,500
テンポイノベーション	3,600	917.00	3,301,200
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	985.00	2,265,500
住江織物	2,400	2,248.00	5,395,200
日本フェルト	5,900	446.00	2,631,400
イチカワ	1,400	1,371.00	1,919,400
エコナックホールディングス	22,300	97.00	2,163,100
日東製網	1,400	1,913.00	2,678,200
芦森工業	2,500	1,055.00	2,637,500
アツギ	10,000	553.00	5,530,000

ウイルプラスホールディングス	2,200	1,297.00	2,853,400	
J Mホールディングス	9,600	2,182.00	20,947,200	
コメダホールディングス	27,800	1,958.00	54,432,400	
サツドラホールディングス	1,600	2,285.00	3,656,000	
アレンザホールディングス	7,300	1,314.00	9,592,200	
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,910.00	6,112,000	
パロックジャパンリミテッド	8,800	803.00	7,066,400	
クスリのアオキホールディングス	12,600	8,180.00	103,068,000	
ダイニック	4,000	783.00	3,132,000	
共和レザー	7,300	759.00	5,540,700	
ピーバンドットコム	1,600	821.00	1,313,600	
力の源ホールディングス	5,800	638.00	3,700,400	
FOOD & LIFE COMPANIES	69,500	5,350.00	371,825,000	
アセンテック	3,100	1,602.00	4,966,200	
セーレン	31,100	1,987.00	61,795,700	
ソトー	4,200	815.00	3,423,000	
東海染工	1,400	1,122.00	1,570,800	
小松マテーレ	20,600	973.00	20,043,800	
ワコールホールディングス	31,500	2,504.00	78,876,000	
ホギメディカル	17,000	3,350.00	56,950,000	
クラウドシアホールディングス	2,500	280.00	700,000	
T S Iホールディングス	37,500	324.00	12,150,000	
マツオカコーポレーション	4,100	1,938.00	7,945,800	
ワールド	16,400	1,435.00	23,534,000	
T I S	126,400	2,609.00	329,777,600	
J N Sホールディングス	5,900	590.00	3,481,000	
電算システム	4,700	3,315.00	15,580,500	
グリー	77,500	577.00	44,717,500	
G M Oベパボ	900	7,400.00	6,660,000	
コーエーテクモホールディングス	33,350	5,190.00	173,086,500	
三菱総合研究所	5,600	4,070.00	22,792,000	
ボルテージ	3,000	640.00	1,920,000	
電算	1,000	2,516.00	2,516,000	
A G S	6,600	830.00	5,478,000	
ファインデックス	10,600	1,171.00	12,412,600	
ブレインパッド	3,100	5,330.00	16,523,000	
K L a b	23,200	847.00	19,650,400	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	16,700	1,319.00	22,027,300	
イーブクイニシアティブジャパン	2,200	2,854.00	6,278,800	
ネクソン	319,200	3,565.00	1,137,948,000	
アイスタイル	38,200	468.00	17,877,600	
エムアップホールディングス	3,200	3,070.00	9,824,000	
エイチーム	8,700	1,759.00	15,303,300	
エニグモ	11,900	1,444.00	17,183,600	
テクノスジャパン	9,600	702.00	6,739,200	
e n i s h	6,400	544.00	3,481,600	
コロブラ	41,400	870.00	36,018,000	
オルトプラス	7,300	515.00	3,759,500	

ブロードリーフ	62,700	559.00	35,049,300
クロス・マーケティンググループ	5,800	518.00	3,004,400
デジタルハーツホールディングス	5,700	1,642.00	9,359,400
システム情報	9,200	1,059.00	9,742,800
メディアドゥ	4,700	6,600.00	31,020,000
じげん	30,400	427.00	12,980,800
ブイキューブ	6,800	2,851.00	19,386,800
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	684.00	1,710,000
サイバーリンクス	4,100	1,663.00	6,818,300
ディー・エル・イー	9,900	323.00	3,197,700
フィックスターズ	13,200	1,020.00	13,464,000
CARTA HOLDINGS	5,100	1,529.00	7,797,900
オブティム	8,900	2,878.00	25,614,200
セレス	4,100	4,405.00	18,060,500
SHIFT	5,700	13,820.00	78,774,000
特種東海製紙	7,800	4,695.00	36,621,000
ティーガイア	13,400	1,925.00	25,795,000
セック	1,800	2,768.00	4,982,400
テクマトリックス	19,600	2,103.00	41,218,800
プロシップ	3,800	1,381.00	5,247,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	30,300	2,216.00	67,144,800
GMOペイメントゲートウェイ	27,000	14,620.00	394,740,000
ザッパラス	5,000	441.00	2,205,000
システムリサーチ	3,800	1,997.00	7,588,600
インターネットイニシアティブ	33,600	2,628.00	88,300,800
さくらインターネット	13,200	798.00	10,533,600
ヴィンクス	3,500	1,078.00	3,773,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,600	6,680.00	17,368,000
SRAホールディングス	6,800	2,675.00	18,190,000
システムインテグレータ	3,500	674.00	2,359,000
朝日ネット	10,400	790.00	8,216,000
eBASE	14,900	978.00	14,572,200
アバント	13,400	1,777.00	23,811,800
アドソル日進	4,300	2,964.00	12,745,200
ODKソリューションズ	2,300	792.00	1,821,600
フリービット	7,400	988.00	7,311,200
コムチュア	11,600	2,663.00	30,890,800
サイバーコム	2,400	1,562.00	3,748,800
アステリア	9,000	850.00	7,650,000
アイル	7,100	1,841.00	13,071,100
王子ホールディングス	567,400	722.00	409,662,800
日本製紙	55,700	1,312.00	73,078,400
三菱製紙	18,600	365.00	6,789,000
北越コーポレーション	90,500	580.00	52,490,000
中越パルプ工業	5,100	1,250.00	6,375,000
巴川製紙所	4,100	819.00	3,357,900
大王製紙	61,000	1,895.00	115,595,000
阿波製紙	3,200	464.00	1,484,800

マークラインズ	5,200	3,000.00	15,600,000
メディカル・データ・ビジョン	14,300	2,079.00	29,729,700
gumi	17,300	966.00	16,711,800
ショーケース	2,500	945.00	2,362,500
モバイルファクトリー	2,500	1,666.00	4,165,000
テラスカイ	4,100	3,415.00	14,001,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,600	2,238.00	12,532,800
PCIホールディングス	4,700	1,552.00	7,294,400
パイプドHD	2,500	1,710.00	4,275,000
アイピーシー	2,200	1,039.00	2,285,800
ネオジャパン	2,500	1,773.00	4,432,500
PR TIMES	2,500	3,750.00	9,375,000
ランドコンピュータ	1,600	1,121.00	1,793,600
ダブルスタンダード	1,600	4,065.00	6,504,000
オープンドア	7,400	1,875.00	13,875,000
マイネット	4,100	855.00	3,505,500
アカツキ	5,000	4,410.00	22,050,000
ベネフィットジャパン	900	1,802.00	1,621,800
Ubicomホールディングス	3,200	3,300.00	10,560,000
カナミックネットワーク	11,400	750.00	8,550,000
ノムラシステムコーポレーション	5,600	308.00	1,724,800
レンゴー	129,900	923.00	119,897,700
トーモク	7,800	1,879.00	14,656,200
ザ・バック	9,600	3,005.00	28,848,000
チェンジ	17,700	3,715.00	65,755,500
シンクロ・フード	7,400	416.00	3,078,400
オークネット	6,600	1,355.00	8,943,000
キャピタル・アセット・プランニング	1,600	1,325.00	2,120,000
セグエグループ	3,100	1,359.00	4,212,900
エイトレッド	2,500	2,376.00	5,940,000
AOI TYO HOLDINGS	12,900	637.00	8,217,300
マクロミル	25,800	907.00	23,400,600
ビーグリー	2,500	1,514.00	3,785,000
オロ	4,000	3,715.00	14,860,000
ユーザーローカル	1,900	4,895.00	9,300,500
テモナ	2,600	843.00	2,191,800
ニーズウェル	2,500	651.00	1,627,500
サインポスト	2,700	1,059.00	2,859,300
昭和電工	95,700	3,370.00	322,509,000
住友化学	992,000	561.00	556,512,000
住友精化	6,000	4,095.00	24,570,000
日産化学	69,500	5,910.00	410,745,000
ラサ工業	4,100	2,337.00	9,581,700
クレハ	10,800	7,960.00	85,968,000
多木化学	4,900	6,040.00	29,596,000
テイカ	9,100	1,472.00	13,395,200
石原産業	22,200	914.00	20,290,800
片倉コープアグリ	2,500	1,233.00	3,082,500
日本曹達	17,700	3,420.00	60,534,000



東ソー	194,600	2,096.00	407,881,600
トクヤマ	37,200	2,768.00	102,969,600
セントラル硝子	23,900	2,331.00	55,710,900
東亜合成	77,100	1,327.00	102,311,700
大阪ソーダ	13,000	2,667.00	34,671,000
関東電化工業	29,800	915.00	27,267,000
デンカ	46,000	4,380.00	201,480,000
イビデン	61,800	5,270.00	325,686,000
信越化学工業	233,100	19,090.00	4,449,879,000
日本カーバイド工業	4,400	1,282.00	5,640,800
堺化学工業	8,900	2,097.00	18,663,300
第一稀元素化学工業	12,700	1,376.00	17,475,200
エア・ウォーター	128,500	1,930.00	248,005,000
日本酸素ホールディングス	103,600	2,116.00	219,217,600
日本化学工業	3,500	3,025.00	10,587,500
東邦アセチレン	2,200	1,313.00	2,888,600
日本パーカライジング	63,500	1,141.00	72,453,500
高圧ガス工業	20,100	749.00	15,054,900
チタン工業	1,600	2,119.00	3,390,400
四国化成工業	17,000	1,334.00	22,678,000
戸田工業	2,500	2,096.00	5,240,000
ステラ ケミファ	6,800	3,260.00	22,168,000
保土谷化学工業	3,800	4,745.00	18,031,000
日本触媒	22,900	6,280.00	143,812,000
大日精化工業	10,600	2,457.00	26,044,200
カネカ	32,700	4,540.00	148,458,000
協和キリン	129,500	3,275.00	424,112,500
三菱瓦斯化学	126,300	2,653.00	335,073,900
三井化学	108,800	3,520.00	382,976,000
J S R	126,400	3,455.00	436,712,000
東京応化工業	21,800	7,420.00	161,756,000
大阪有機化学工業	11,600	4,285.00	49,706,000
三菱ケミカルホールディングス	842,900	823.90	694,465,310
K Hネオケム	20,700	2,697.00	55,827,900
ダイセル	169,200	880.00	148,896,000
住友ベークライト	19,900	4,420.00	87,958,000
積水化学工業	266,700	2,149.00	573,138,300
日本ゼオン	113,800	1,699.00	193,346,200
アイカ工業	35,000	4,075.00	142,625,000
宇部興産	63,500	2,275.00	144,462,500
積水樹脂	20,700	2,150.00	44,505,000
タキロンシーアイ	27,600	692.00	19,099,200
旭有機材	7,200	1,467.00	10,562,400
ニチバン	6,800	1,874.00	12,743,200
リケンテクノス	30,400	531.00	16,142,400
大倉工業	5,900	2,083.00	12,289,700
積水化成成品工業	16,900	596.00	10,072,400
群栄化学工業	2,500	2,436.00	6,090,000
タイガースポリマー	7,300	469.00	3,423,700
ミライアル	4,100	1,386.00	5,682,600

ダイキアクシス	4,600	958.00	4,406,800
ダイキョーニシカワ	26,600	764.00	20,322,400
竹本容器	4,400	883.00	3,885,200
森六ホールディングス	6,900	2,206.00	15,221,400
恵和	1,800	2,496.00	4,492,800
日本化薬	78,000	1,052.00	82,056,000
カーリットホールディングス	12,400	712.00	8,828,800
E P S ホールディングス	16,700	1,164.00	19,438,800
ソルクシーズ	4,700	928.00	4,361,600
レグス	2,800	1,676.00	4,692,800
プレステージ・インターナショナル	46,000	814.00	37,444,000
フェイス	4,000	793.00	3,172,000
プロトコーポレーション	11,200	1,211.00	13,563,200
アミューズ	6,800	2,450.00	16,660,000
野村総合研究所	230,600	3,295.00	759,827,000
ドリームインキュベータ	3,900	1,103.00	4,301,700
サイバネットシステム	9,000	903.00	8,127,000
クイック	7,600	1,202.00	9,135,200
T A C	6,800	250.00	1,700,000
C E ホールディングス	6,700	589.00	3,946,300
日本システム技術	2,400	1,519.00	3,645,600
電通グループ	138,100	3,485.00	481,278,500
インテージホールディングス	15,700	1,350.00	21,195,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	5,700	886.00	5,050,200
東邦システムサイエンス	3,200	930.00	2,976,000
ぴあ	3,500	2,939.00	10,286,500
イオンファンタジー	4,600	2,122.00	9,761,200
ソースネクスト	59,200	358.00	21,193,600
シーティーエス	13,700	895.00	12,261,500
ネクシィーズグループ	3,900	1,130.00	4,407,000
インフォコム	11,500	2,955.00	33,982,500
メディカルシステムネットワーク	11,100	834.00	9,257,400
日本精化	9,100	1,503.00	13,677,300
扶桑化学工業	9,900	4,345.00	43,015,500
トリケミカル研究所	10,600	3,860.00	40,916,000
HEROZ	3,500	3,060.00	10,710,000
ラクスル	10,200	5,370.00	54,774,000
I P S	2,400	2,768.00	6,643,200
F I G	13,700	271.00	3,712,700
システムサポート	3,800	1,565.00	5,947,000
A D E K A	58,100	2,247.00	130,550,700
日油	47,600	5,940.00	282,744,000
ミヨシ油脂	4,700	1,264.00	5,940,800
新日本理化	20,500	303.00	6,211,500
ハリマ化成グループ	9,500	950.00	9,025,000
イーソル	6,700	1,279.00	8,569,300
アルテリア・ネットワークス	13,900	1,616.00	22,462,400
E D U L A B	1,100	7,850.00	8,635,000
東海ソフト	1,500	1,168.00	1,752,000

ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	1,883.00	4,330,900	
東名	800	1,189.00	951,200	
ヴィッツ	500	2,143.00	1,071,500	
トピラシステムズ	1,100	1,410.00	1,551,000	
Sansan	8,300	10,150.00	84,245,000	
Link-U	800	1,135.00	908,000	
ギフトィ	5,700	3,385.00	19,294,500	
花王	308,300	7,352.00	2,266,621,600	
第一工業製薬	4,200	3,845.00	16,149,000	
石原ケミカル	3,200	2,177.00	6,966,400	
日華化学	4,600	943.00	4,337,800	
ニイタカ	2,500	2,754.00	6,885,000	
三洋化成工業	7,400	5,450.00	40,330,000	
ベース	1,000	6,370.00	6,370,000	
武田薬品工業	1,070,900	3,754.00	4,020,158,600	
アステラス製薬	1,115,900	1,640.00	1,830,076,000	
大日本住友製薬	95,300	1,895.00	180,593,500	
塩野義製薬	161,900	5,755.00	931,734,500	
わかもと製薬	15,400	390.00	6,006,000	
日本新薬	36,600	7,730.00	282,918,000	
ピオフェルミン製薬	2,500	2,811.00	7,027,500	
中外製薬	402,700	4,324.00	1,741,274,800	
科研製薬	22,000	4,325.00	95,150,000	
エーザイ	142,100	7,252.00	1,030,509,200	
理研ビタミン	12,200	1,360.00	16,592,000	
ロート製薬	61,400	2,917.00	179,103,800	
小野薬品工業	295,800	2,803.50	829,275,300	
久光製薬	37,400	6,730.00	251,702,000	
有機合成薬品工業	9,900	297.00	2,940,300	
持田製薬	17,900	4,140.00	74,106,000	
参天製薬	224,100	1,436.00	321,807,600	
扶桑薬品工業	4,100	2,519.00	10,327,900	
日本ケミファ	1,300	2,456.00	3,192,800	
ツムラ	42,900	4,010.00	172,029,000	
日医工	36,400	963.00	35,053,200	
テルモ	394,700	3,949.00	1,558,670,300	
H.U.グループホールディングス	34,500	3,455.00	119,197,500	
キッセイ薬品工業	22,900	2,383.00	54,570,700	
生化学工業	22,900	1,028.00	23,541,200	
栄研化学	22,700	2,078.00	47,170,600	
日水製薬	5,200	980.00	5,096,000	
鳥居薬品	8,100	2,871.00	23,255,100	
JCRファーマ	36,200	3,220.00	116,564,000	
東和薬品	18,700	2,364.00	44,206,800	
富士製薬工業	8,800	1,258.00	11,070,400	
ゼリア新薬工業	23,500	2,055.00	48,292,500	
第一三共	1,105,200	2,976.50	3,289,627,800	
キョーリン製薬ホールディングス	28,600	1,908.00	54,568,800	
大幸薬品	15,700	1,232.00	19,342,400	

ダイト	8,200	3,560.00	29,192,000
大塚ホールディングス	267,700	4,536.00	1,214,287,200
大正製薬ホールディングス	30,500	6,660.00	203,130,000
ペプチドリーム	65,400	4,860.00	317,844,000
大日本塗料	14,200	901.00	12,794,200
日本ペイントホールディングス	519,400	1,565.00	812,861,000
関西ペイント	141,600	2,893.00	409,648,800
神東塗料	10,000	210.00	2,100,000
中国塗料	30,400	1,001.00	30,430,400
日本特殊塗料	9,500	1,066.00	10,127,000
藤倉化成	17,300	577.00	9,982,100
太陽ホールディングス	9,300	6,000.00	55,800,000
D I C	53,200	2,910.00	154,812,000
サカタインクス	27,600	1,035.00	28,566,000
東洋インキS Cホールディングス	26,800	2,138.00	57,298,400
T & K T O K A	10,100	826.00	8,342,600
アルプス技研	10,900	2,110.00	22,999,000
サニックス	19,100	323.00	6,169,300
ダイオーズ	2,500	989.00	2,472,500
日本空調サービス	13,500	735.00	9,922,500
オリエンタルランド	130,800	16,200.00	2,118,960,000
フォーカスシステムズ	8,300	963.00	7,992,900
ダスキン	28,600	2,765.00	79,079,000
パーク24	68,000	1,991.00	135,388,000
明光ネットワークジャパン	15,700	633.00	9,938,100
ファルコホールディングス	5,800	1,680.00	9,744,000
クレスコ	8,500	1,632.00	13,872,000
フジ・メディア・ホールディングス	130,800	1,344.00	175,795,200
秀英予備校	3,000	420.00	1,260,000
田谷	1,800	556.00	1,000,800
ラウンドワン	41,900	1,134.00	47,514,600
リゾートトラスト	56,400	1,772.00	99,940,800
オービック	39,900	20,070.00	800,793,000
ジャストシステム	18,000	6,220.00	111,960,000
T D C ソフト	11,100	1,031.00	11,444,100
Zホールディングス	1,735,300	542.20	940,879,660
ビー・エム・エル	15,900	3,705.00	58,909,500
ワタベウェディング	1,800	247.00	444,600
トレンドマイクロ	67,400	5,430.00	365,982,000
りらいあコミュニケーションズ	18,800	1,423.00	26,752,400
I Dホールディングス	4,900	1,374.00	6,732,600
リソー教育	62,000	325.00	20,150,000
日本オラクル	25,600	10,500.00	268,800,000
早稲田アカデミー	4,700	898.00	4,220,600
アルファシステムズ	3,300	3,775.00	12,457,500
フューチャー	15,300	2,018.00	30,875,400
C A C H o l d i n g s	8,100	1,479.00	11,979,900
S B テクノロジー	4,400	3,255.00	14,322,000
トーセ	3,600	824.00	2,966,400
ユー・エス・エス	137,700	2,138.00	294,402,600

オービックビジネスコンサルタント	13,000	5,760.00	74,880,000
伊藤忠テクノソリューションズ	57,700	3,565.00	205,700,500
アイティフォー	16,600	818.00	13,578,800
東京個別指導学院	10,700	650.00	6,955,000
東計電算	2,000	4,590.00	9,180,000
サイバーエージェント	303,000	1,919.00	581,457,000
楽天グループ	573,200	1,320.00	756,624,000
エクスネット	2,500	1,054.00	2,635,000
クリーク・アンド・リバー社	6,300	1,503.00	9,468,900
モーニングスター	13,400	487.00	6,525,800
テー・オー・ダブリュー	21,500	346.00	7,439,000
大塚商会	68,400	5,310.00	363,204,000
サイボウズ	14,800	2,498.00	36,970,400
山田コンサルティンググループ	7,200	1,166.00	8,395,200
セントラルスポーツ	4,400	2,454.00	10,797,600
パラカ	3,300	1,688.00	5,570,400
電通国際情報サービス	15,600	4,145.00	64,662,000
A C C E S S	11,700	833.00	9,746,100
デジタルガレージ	20,700	4,725.00	97,807,500
イーエムシステムズ	20,900	886.00	18,517,400
ウェザーニューズ	3,800	5,510.00	20,938,000
C I J	8,700	935.00	8,134,500
ビジネスエンジニアリング	1,300	3,735.00	4,855,500
日本エンタープライズ	12,500	255.00	3,187,500
WOWOW	6,000	2,806.00	16,836,000
スカラ	11,200	770.00	8,624,000
インテリジェント ウェイブ	7,400	691.00	5,113,400
フルキャストホールディングス	10,600	1,925.00	20,405,000
エン・ジャパン	21,900	3,420.00	74,898,000
あすか製薬ホールディングス	14,700	1,397.00	20,535,900
サワイグループホールディングス	28,400	5,150.00	146,260,000
富士フイルムホールディングス	226,300	6,735.00	1,524,130,500
コニカミノルタ	261,000	602.00	157,122,000
資生堂	256,000	7,574.00	1,938,944,000
ライオン	167,200	2,184.00	365,164,800
高砂香料工業	8,000	2,697.00	21,576,000
マンダム	27,000	2,108.00	56,916,000
ミルボン	17,100	6,100.00	104,310,000
ファンケル	46,800	3,710.00	173,628,000
コーセー	24,100	15,740.00	379,334,000
コタ	8,370	1,572.00	13,157,640
シーボン	1,400	1,962.00	2,746,800
ポーラ・オルビスホールディングス	54,900	2,625.00	144,112,500
ノエビアホールディングス	10,900	4,995.00	54,445,500
アジュバンコスメジャパン	3,200	1,022.00	3,270,400
新日本製薬	2,500	2,217.00	5,542,500
エステー	8,400	1,937.00	16,270,800
アグロ カネショウ	4,900	1,601.00	7,844,900
コニシ	21,200	1,779.00	37,714,800
長谷川香料	22,300	2,206.00	49,193,800

星光PMC	7,400	805.00	5,957,000
小林製薬	36,000	10,170.00	366,120,000
荒川化学工業	10,700	1,318.00	14,102,600
メック	8,800	2,410.00	21,208,000
日本高純度化学	3,600	2,777.00	9,997,200
タカラバイオ	33,800	2,872.00	97,073,600
JCU	14,600	4,210.00	61,466,000
新田ゼラチン	8,300	669.00	5,552,700
OATアグリオ	2,500	1,416.00	3,540,000
デクセリアルズ	35,900	1,979.00	71,046,100
アース製薬	9,700	6,490.00	62,953,000
北興化学工業	11,900	1,082.00	12,875,800
大成ラミック	4,200	2,904.00	12,196,800
クミアイ化学工業	53,100	1,001.00	53,153,100
日本農薬	23,000	581.00	13,363,000
富士興産	3,900	1,234.00	4,812,600
ニチレキ	15,300	1,597.00	24,434,100
ユシロ化学工業	7,300	1,162.00	8,482,600
ビーピー・カストロール	4,600	1,415.00	6,509,000
富士石油	31,200	232.00	7,238,400
MORESCO	4,900	1,155.00	5,659,500
出光興産	142,800	2,699.00	385,417,200
ENEOSホールディングス	1,936,600	475.30	920,465,980
コスモエネルギーホールディングス	40,800	2,385.00	97,308,000
横浜ゴム	74,500	1,996.00	148,702,000
TOYO TIRE	67,600	1,947.00	131,617,200
ブリヂストン	342,400	4,391.00	1,503,478,400
住友ゴム工業	115,500	1,325.00	153,037,500
藤倉コンポジット	11,700	521.00	6,095,700
オカモト	8,000	4,080.00	32,640,000
アキレス	9,100	1,467.00	13,349,700
フコク	4,700	809.00	3,802,300
ニッタ	13,300	2,701.00	35,923,300
クリエートメディック	4,400	995.00	4,378,000
住友理工	25,000	736.00	18,400,000
三ツ星ベルト	15,600	1,848.00	28,828,800
バンドー化学	22,700	771.00	17,501,700
AGC	118,200	4,845.00	572,679,000
日本板硝子	65,400	635.00	41,529,000
石塚硝子	2,400	1,939.00	4,653,600
有沢製作所	18,100	983.00	17,792,300
日本山村硝子	5,700	991.00	5,648,700
日本電気硝子	47,700	2,674.00	127,549,800
オハラ	5,100	1,703.00	8,685,300
住友大阪セメント	23,300	3,675.00	85,627,500
太平洋セメント	76,200	2,803.00	213,588,600
リソルホールディングス	900	4,010.00	3,609,000
日本ヒューム	12,000	744.00	8,928,000
日本コンクリート工業	27,500	411.00	11,302,500
三谷セキサン	5,900	4,050.00	23,895,000

アジアパイルホールディングス	20,100	524.00	10,532,400	
東海カーボン	125,700	1,808.00	227,265,600	
日本カーボン	7,200	4,670.00	33,624,000	
東洋炭素	7,600	2,073.00	15,754,800	
ノリタケカンパニーリミテド	7,300	3,530.00	25,769,000	
TOTO	92,000	6,350.00	584,200,000	
日本碍子	141,400	2,013.00	284,638,200	
日本特殊陶業	97,900	1,846.00	180,723,400	
ダントーホールディングス	9,300	335.00	3,115,500	
MARUWA	4,300	11,230.00	48,289,000	
品川リフラクトリーズ	3,000	2,876.00	8,628,000	
黒崎播磨	2,300	4,835.00	11,120,500	
ヨータイ	9,300	1,059.00	9,848,700	
イソライト工業	5,700	678.00	3,864,600	
東京窯業	17,000	328.00	5,576,000	
ニッカトー	5,800	726.00	4,210,800	
フジインコーポレーテッド	10,500	4,540.00	47,670,000	
クニミネ工業	4,100	1,278.00	5,239,800	
エーアンドエーマテリアル	2,500	1,039.00	2,597,500	
ニチアス	32,600	2,811.00	91,638,600	
日本製鉄	607,300	1,850.50	1,123,808,650	
神戸製鋼所	233,100	740.00	172,494,000	
中山製鋼所	18,600	441.00	8,202,600	
合同製鐵	6,900	2,103.00	14,510,700	
ジェイ エフ イー ホールディングス	368,400	1,355.00	499,182,000	
東京製鐵	49,800	965.00	48,057,000	
共英製鋼	14,100	1,647.00	23,222,700	
大和工業	27,100	3,335.00	90,378,500	
東京鐵鋼	4,900	1,953.00	9,569,700	
大阪製鐵	6,800	1,357.00	9,227,600	
淀川製鋼所	17,300	2,472.00	42,765,600	
丸一鋼管	41,200	2,535.00	104,442,000	
モリ工業	3,900	2,581.00	10,065,900	
大同特殊鋼	20,700	5,010.00	103,707,000	
日本高周波鋼業	4,200	419.00	1,759,800	
日本冶金工業	9,800	1,998.00	19,580,400	
山陽特殊製鋼	15,300	1,640.00	25,092,000	
愛知製鋼	7,300	3,680.00	26,864,000	
日立金属	120,000	1,912.00	229,440,000	
日本金属	3,100	1,162.00	3,602,200	
大平洋金属	8,500	2,208.00	18,768,000	
新日本電工	82,300	385.00	31,685,500	
栗本鐵工所	5,800	1,762.00	10,219,600	
虹 技	1,400	1,184.00	1,657,600	
日本鑄鉄管	1,500	1,460.00	2,190,000	
日本製鋼所	38,600	2,630.00	101,518,000	
三菱製鋼	9,500	893.00	8,483,500	
日亜鋼業	19,300	329.00	6,349,700	
日本精線	1,800	3,655.00	6,579,000	

エンビプロ・ホールディングス	5,600	1,010.00	5,656,000	
大紀アルミニウム工業所	19,100	1,013.00	19,348,300	
日本軽金属ホールディングス	34,700	2,109.00	73,182,300	
三井金属鉱業	34,400	3,795.00	130,548,000	
東邦亜鉛	7,200	2,313.00	16,653,600	
三菱マテリアル	84,000	2,542.00	213,528,000	
住友金属鉱山	162,500	4,780.00	776,750,000	
DOWAホールディングス	32,100	4,675.00	150,067,500	
古河機械金属	21,100	1,316.00	27,767,600	
エス・サイエンス	59,200	40.00	2,368,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,900	959.00	12,371,100	
東邦チタニウム	22,900	1,015.00	23,243,500	
UACJ	19,200	2,603.00	49,977,600	
CKサンエツ	2,400	3,795.00	9,108,000	
古河電気工業	39,700	2,954.00	117,273,800	
住友電気工業	444,000	1,656.00	735,264,000	
フジクラ	153,800	530.00	81,514,000	
昭和電線ホールディングス	12,300	1,753.00	21,561,900	
東京特殊電線	1,600	2,616.00	4,185,600	
タツタ電線	22,200	624.00	13,852,800	
カナレ電気	2,500	1,813.00	4,532,500	
平河ヒューテック	7,100	1,309.00	9,293,900	
リョービ	15,400	1,692.00	26,056,800	
アーレスティ	15,800	479.00	7,568,200	
アサヒホールディングス	47,400	2,216.00	105,038,400	
東洋製罐グループホールディングス	81,100	1,342.00	108,836,200	
ホッカンホールディングス	6,500	1,463.00	9,509,500	
コロナ	7,300	947.00	6,913,100	
横河ブリッジホールディングス	22,000	2,097.00	46,134,000	
駒井ハルテック	2,500	2,066.00	5,165,000	
高田機工	900	2,666.00	2,399,400	
三和ホールディングス	120,000	1,428.00	171,360,000	
文化シャッター	37,700	1,007.00	37,963,900	
三協立山	16,300	882.00	14,376,600	
アルインコ	8,400	1,009.00	8,475,600	
東洋シャッター	2,500	655.00	1,637,500	
LIXIL	175,100	3,180.00	556,818,000	
日本フィルコン	9,200	515.00	4,738,000	
ノーリツ	26,500	1,725.00	45,712,500	
長府製作所	13,000	2,148.00	27,924,000	
リンナイ	24,700	11,880.00	293,436,000	
ユニプレス	21,100	1,083.00	22,851,300	
ダイニチ工業	6,000	847.00	5,082,000	
日東精工	16,400	602.00	9,872,800	
三洋工業	1,400	1,869.00	2,616,600	
岡部	26,400	776.00	20,486,400	
ジーテクト	15,800	1,520.00	24,016,000	
東プレ	23,800	1,550.00	36,890,000	
高周波熱錬	24,200	574.00	13,890,800	
東京製綱	9,000	1,193.00	10,737,000	



サンコール	11,200	463.00	5,185,600
モリテックスチール	9,700	449.00	4,355,300
パイオラックス	18,900	1,577.00	29,805,300
エイチワン	12,500	866.00	10,825,000
日本発条	126,800	815.00	103,342,000
中央発條	4,100	982.00	4,026,200
アドバネクス	1,700	1,493.00	2,538,100
三浦工業	55,000	6,050.00	332,750,000
タクマ	43,200	2,407.00	103,982,400
テクノプロ・ホールディングス	24,600	8,660.00	213,036,000
アトラグループ	2,600	358.00	930,800
インターワークス	3,900	385.00	1,501,500
アイ・アールジャパンホールディングス	5,000	14,430.00	72,150,000
Keeper 技研	7,900	2,248.00	17,759,200
ファーストロジック	2,500	781.00	1,952,500
三機サービス	2,500	1,131.00	2,827,500
Gunosy	7,300	822.00	6,000,600
デザインワン・ジャパン	3,900	255.00	994,500
イー・ガーディアン	5,400	2,861.00	15,449,400
リブセンス	6,700	236.00	1,581,200
ジャパンマテリアル	38,000	1,387.00	52,706,000
ベクトル	15,400	1,283.00	19,758,200
ウチヤマホールディングス	6,300	394.00	2,482,200
チャーム・ケア・コーポレーション	9,100	1,304.00	11,866,400
キャリアリンク	4,000	2,714.00	10,856,000
IBJ	9,800	953.00	9,339,400
アサンテ	4,400	1,785.00	7,854,000
バリューHR	4,900	1,636.00	8,016,400
M&Aキャピタルパートナーズ	10,100	5,350.00	54,035,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,600	1,717.00	7,898,200
ERIホールディングス	3,000	603.00	1,809,000
アビスト	1,900	2,982.00	5,665,800
シグマクシス	6,700	1,854.00	12,421,800
ウィルグループ	9,000	1,112.00	10,008,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	18,000	281.00	5,058,000
メドピア	5,700	6,120.00	34,884,000
レアジョブ	1,700	2,110.00	3,587,000
リクルートホールディングス	881,200	5,222.00	4,601,626,400
エラン	17,000	1,411.00	23,987,000
ツガミ	26,400	1,712.00	45,196,800
オークマ	14,800	6,460.00	95,608,000
芝浦機械	13,300	2,776.00	36,920,800
アマダ	186,300	1,235.00	230,080,500
アイダエンジニアリング	33,500	1,012.00	33,902,000
滝澤鉄工所	4,200	1,126.00	4,729,200
FUJI	50,800	2,948.00	149,758,400
牧野フライス製作所	14,900	4,275.00	63,697,500
オーエスジー	62,900	1,945.00	122,340,500

ダイジェット工業	1,000	1,325.00	1,325,000
旭ダイヤモンド工業	34,000	532.00	18,088,000
D M G 森精機	80,500	1,794.00	144,417,000
ソディック	27,900	1,054.00	29,406,600
ディスコ	17,300	37,750.00	653,075,000
日東工器	6,100	1,968.00	12,004,800
日進工具	10,000	1,588.00	15,880,000
パンチ工業	10,700	601.00	6,430,700
富士ダイス	7,000	661.00	4,627,000
土木管理総合試験所	6,000	342.00	2,052,000
ネットマーケティング	5,800	585.00	3,393,000
日本郵政	931,100	931.60	867,412,760
ベルシステム24ホールディングス	20,600	1,748.00	36,008,800
鎌倉新書	12,300	1,306.00	16,063,800
S M N	2,500	792.00	1,980,000
一蔵	1,800	416.00	748,800
グローバルキッズCOMPANY	2,400	1,039.00	2,493,600
エアトリ	6,600	2,206.00	14,559,600
アトラエ	7,500	1,809.00	13,567,500
ストライク	4,400	4,775.00	21,010,000
ソラスト	30,200	1,443.00	43,578,600
セラク	3,900	2,101.00	8,193,900
インソース	10,100	2,305.00	23,280,500
豊田自動織機	104,200	9,350.00	974,270,000
豊和工業	7,100	906.00	6,432,600
O K K	5,200	456.00	2,371,200
石川製作所	3,200	1,875.00	6,000,000
東洋機械金属	9,100	467.00	4,249,700
津田駒工業	2,500	919.00	2,297,500
エンシュウ	2,500	939.00	2,347,500
島精機製作所	18,800	2,345.00	44,086,000
オプトラン	15,900	3,005.00	47,779,500
N C ホールディングス	3,300	734.00	2,422,200
イワキ	8,200	886.00	7,265,200
フリー	12,400	1,063.00	13,181,200
ヤマシンフィルタ	25,600	883.00	22,604,800
日阪製作所	16,100	871.00	14,023,100
やまびこ	24,700	1,255.00	30,998,500
平田機工	5,900	7,500.00	44,250,000
ペガサスミシン製造	13,200	516.00	6,811,200
マルマエ	4,600	1,554.00	7,148,400
タツモ	5,400	2,006.00	10,832,400
ナブテスコ	74,900	5,430.00	406,707,000
三井海洋開発	13,500	2,269.00	30,631,500
レオン自動機	12,300	1,210.00	14,883,000
S M C	37,600	66,030.00	2,482,728,000
ホソカワミクロン	4,300	6,670.00	28,681,000
ユニオンツール	4,700	3,705.00	17,413,500
オイレス工業	18,000	1,662.00	29,916,000
日精エー・エス・ビー機械	3,800	5,490.00	20,862,000

サトーホールディングス	16,700	2,795.00	46,676,500
技研製作所	11,300	4,815.00	54,409,500
日本エアテック	4,100	1,252.00	5,133,200
カワタ	3,500	941.00	3,293,500
日精樹脂工業	9,900	991.00	9,810,900
オカダアイオン	4,100	1,207.00	4,948,700
ワイエイシーホールディングス	5,000	1,004.00	5,020,000
小松製作所	583,200	3,364.00	1,961,884,800
住友重機械工業	73,600	3,225.00	237,360,000
日立建機	60,200	3,445.00	207,389,000
日工	19,300	725.00	13,992,500
巴工業	5,200	2,120.00	11,024,000
井関農機	12,800	1,667.00	21,337,600
TOWA	12,100	2,220.00	26,862,000
丸山製作所	2,500	1,704.00	4,260,000
北川鉄工所	5,900	1,597.00	9,422,300
シンニッタン	15,600	265.00	4,134,000
ローツェ	5,700	8,910.00	50,787,000
タカキタ	4,600	655.00	3,013,000
クボタ	676,300	2,510.00	1,697,513,000
荏原実業	3,100	4,900.00	15,190,000
東洋エンジニアリング	16,600	753.00	12,499,800
三菱化工機	4,100	2,806.00	11,504,600
月島機械	23,700	1,314.00	31,141,800
帝国電機製作所	9,000	1,312.00	11,808,000
東京機械製作所	4,600	507.00	2,332,200
新東工業	30,700	762.00	23,393,400
澁谷工業	11,300	3,515.00	39,719,500
アイチコーポレーション	22,400	857.00	19,196,800
小森コーポレーション	32,900	766.00	25,201,400
鶴見製作所	9,900	1,733.00	17,156,700
住友精密工業	2,200	2,278.00	5,011,600
日本ギア工業	6,500	325.00	2,112,500
酒井重工業	2,200	2,154.00	4,738,800
荏原製作所	53,300	5,000.00	266,500,000
石井鐵工所	1,300	2,940.00	3,822,000
西島製作所	13,200	863.00	11,391,600
北越工業	13,400	1,078.00	14,445,200
ダイキン工業	163,900	22,735.00	3,726,266,500
オルガノ	4,100	7,320.00	30,012,000
トーヨーカネツ	4,700	2,651.00	12,459,700
栗田工業	69,700	4,890.00	340,833,000
椿本チエイン	18,300	2,967.00	54,296,100
大同工業	5,000	923.00	4,615,000
日機装	41,600	1,148.00	47,756,800
木村化工機	10,600	753.00	7,981,800
レイズネクスト	21,900	1,188.00	26,017,200
アネスト岩田	21,900	1,033.00	22,622,700
ダイフク	70,800	11,050.00	782,340,000
サムコ	3,100	3,430.00	10,633,000

加藤製作所	7,000	1,123.00	7,861,000	
油研工業	1,800	1,689.00	3,040,200	
タダノ	62,100	1,178.00	73,153,800	
フジテック	44,400	2,332.00	103,540,800	
C K D	29,900	2,499.00	74,720,100	
キトー	10,800	1,823.00	19,688,400	
平和	35,800	1,873.00	67,053,400	
理想科学工業	9,900	1,390.00	13,761,000	
S A N K Y O	30,400	2,969.00	90,257,600	
日本金銭機械	14,200	625.00	8,875,000	
マースグループホールディングス	8,200	1,656.00	13,579,200	
フクシマガリレイ	8,900	4,375.00	38,937,500	
オーイズミ	5,600	406.00	2,273,600	
ダイコク電機	5,900	1,031.00	6,082,900	
竹内製作所	21,500	2,898.00	62,307,000	
アマノ	33,800	2,694.00	91,057,200	
J U K I	17,900	935.00	16,736,500	
サンデンホールディングス	17,900	383.00	6,855,700	
蛇の目ミシン工業	11,400	852.00	9,712,800	
ブラザー工業	157,000	2,399.00	376,643,000	
マックス	17,900	1,602.00	28,675,800	
モリタホールディングス	20,600	1,720.00	35,432,000	
グローリー	33,100	2,403.00	79,539,300	
新晃工業	12,000	2,247.00	26,964,000	
大和冷機工業	20,500	1,138.00	23,329,000	
セガサミーホールディングス	117,000	1,748.00	204,516,000	
日本ピストンリング	4,900	1,169.00	5,728,100	
リケン	5,900	2,459.00	14,508,100	
T P R	17,400	1,627.00	28,309,800	
ツバキ・ナカシマ	24,700	1,679.00	41,471,300	
ホシザキ	40,400	10,500.00	424,200,000	
大豊工業	10,600	1,053.00	11,161,800	
日本精工	264,300	1,104.00	291,787,200	
N T N	297,300	338.00	100,487,400	
ジェイテクト	123,400	1,121.00	138,331,400	
不二越	12,100	4,655.00	56,325,500	
ミネベアミツミ	221,800	2,846.00	631,242,800	
日本トムソン	35,300	679.00	23,968,700	
T H K	80,300	3,970.00	318,791,000	
ユーシン精機	8,500	898.00	7,633,000	
前澤給装工業	9,100	1,157.00	10,528,700	
イーグル工業	16,000	1,225.00	19,600,000	
前澤工業	7,900	599.00	4,732,100	
日本ピラー工業	13,100	1,843.00	24,143,300	
キッツ	40,200	681.00	27,376,200	
日立製作所	618,700	5,094.00	3,151,657,800	
東芝	191,000	4,530.00	865,230,000	
三菱電機	1,287,400	1,665.50	2,144,164,700	
富士電機	77,400	5,050.00	390,870,000	
東洋電機製造	5,100	1,332.00	6,793,200	

安川電機	138,600	5,490.00	760,914,000	
シンフォニアテクノロジー	16,800	1,432.00	24,057,600	
明電舎	21,900	2,521.00	55,209,900	
オリジン	2,700	1,388.00	3,747,600	
山洋電気	6,000	5,920.00	35,520,000	
デンヨー	11,000	2,036.00	22,396,000	
ベイクレント・コンサルティング	8,000	26,640.00	213,120,000	
Orchestra Holdings	2,600	3,125.00	8,125,000	
アイモバイル	4,200	1,442.00	6,056,400	
キャリアインデックス	5,000	637.00	3,185,000	
MS-Japan	4,900	1,135.00	5,561,500	
船場	1,700	900.00	1,530,000	
グレイステクノロジー	12,100	3,310.00	40,051,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	35,400	2,325.00	82,305,000	
フルテック	1,900	1,476.00	2,804,400	
グリーンズ	4,400	563.00	2,477,200	
ツナググループ・ホールディングス	1,800	315.00	567,000	
GAMEWITH	3,900	681.00	2,655,900	
ソウルドアウト	2,800	1,660.00	4,648,000	
MS&Consulting	2,200	632.00	1,390,400	
エル・ティー・エス	900	4,240.00	3,816,000	
ミダック	2,500	4,715.00	11,787,500	
日総工産	9,500	820.00	7,790,000	
キュービーネットホールディングス	5,700	1,827.00	10,413,900	
RPAホールディングス	13,800	672.00	9,273,600	
三櫻工業	17,700	1,150.00	20,355,000	
マキタ	167,900	4,920.00	826,068,000	
東芝テック	13,900	4,365.00	60,673,500	
芝浦メカトロニクス	2,400	5,900.00	14,160,000	
マブチモーター	35,500	4,825.00	171,287,500	
日本電産	310,000	13,990.00	4,336,900,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,600	968.00	7,356,800	
トレックス・セミコンダクター	7,000	1,826.00	12,782,000	
東光高岳	6,500	1,610.00	10,465,000	
ダブル・スコープ	25,100	700.00	17,570,000	
宮越ホールディングス	4,700	894.00	4,201,800	
ダイヘン	14,000	4,960.00	69,440,000	
ヤーマン	21,000	1,511.00	31,731,000	
JVCケンウッド	110,300	225.00	24,817,500	
ミマキエンジニアリング	12,000	662.00	7,944,000	
I-PEX	5,900	2,010.00	11,859,000	
日新電機	30,200	1,224.00	36,964,800	
大崎電気工業	25,500	611.00	15,580,500	
オムロン	107,100	8,910.00	954,261,000	
日東工業	18,800	2,002.00	37,637,600	
I D E C	17,400	1,819.00	31,650,600	
正興電機製作所	2,800	1,975.00	5,530,000	
不二電機工業	2,500	1,297.00	3,242,500	

ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,200	3,010.00	139,062,000	
サクサホールディングス	3,000	1,578.00	4,734,000	
メルコホールディングス	4,300	3,810.00	16,383,000	
テクノメディカ	3,000	1,693.00	5,079,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,800	2,770.00	10,526,000	
日本電気	163,500	6,630.00	1,084,005,000	
富士通	115,800	16,540.00	1,915,332,000	
沖電気工業	52,300	1,159.00	60,615,700	
岩崎通信機	4,700	906.00	4,258,200	
電気興業	6,100	2,673.00	16,305,300	
サンケン電気	15,000	5,400.00	81,000,000	
ナカヨ	2,200	1,521.00	3,346,200	
アイホン	7,300	1,827.00	13,337,100	
ルネサスエレクトロニクス	553,900	1,261.00	698,467,900	
セイコーエプソン	159,500	1,792.00	285,824,000	
ワコム	93,100	730.00	67,963,000	
アルバック	23,600	5,040.00	118,944,000	
アクセル	5,400	1,024.00	5,529,600	
E I Z O	10,900	4,055.00	44,199,500	
ジャパンディスプレイ	437,100	49.00	21,417,900	
日本信号	30,300	986.00	29,875,800	
京三製作所	28,000	411.00	11,508,000	
能美防災	17,100	2,185.00	37,363,500	
ホーチキ	9,300	1,381.00	12,843,300	
星和電機	6,400	629.00	4,025,600	
エレコム	29,600	2,435.00	72,076,000	
パナソニック	1,372,900	1,375.00	1,887,737,500	
シャープ	171,100	1,907.00	326,287,700	
アンリツ	77,300	2,442.00	188,766,600	
富士通ゼネラル	39,400	3,050.00	120,170,000	
ソニーグループ	806,300	12,175.00	9,816,702,500	
T D K	62,200	16,410.00	1,020,702,000	
帝国通信工業	5,900	1,093.00	6,448,700	
タムラ製作所	46,200	509.00	23,515,800	
アルプスアルパイン	105,000	1,345.00	141,225,000	
池上通信機	4,200	870.00	3,654,000	
日本電波工業	12,400	762.00	9,448,800	
鈴木	5,700	1,271.00	7,244,700	
日本トリム	2,600	4,235.00	11,011,000	
ローランド ディー・ジー	7,600	1,812.00	13,771,200	
フォスター電機	13,400	1,256.00	16,830,400	
S M K	3,300	2,855.00	9,421,500	
ヨコオ	9,600	2,770.00	26,592,000	
ティアック	7,900	146.00	1,153,400	
ホシデン	35,100	1,115.00	39,136,500	
ヒロセ電機	19,800	17,790.00	352,242,000	
日本航空電子工業	29,400	1,718.00	50,509,200	
T O A	15,200	899.00	13,664,800	
マクセルホールディングス	25,400	1,460.00	37,084,000	

古野電気	16,400	1,159.00	19,007,600	
ユニデンホールディングス	3,200	2,587.00	8,278,400	
スマダコーポレーション	10,800	1,082.00	11,685,600	
アイコム	5,500	2,746.00	15,103,000	
リオン	5,500	3,030.00	16,665,000	
本多通信工業	10,100	502.00	5,070,200	
船井電機	14,600	919.00	13,417,400	
横河電機	128,800	2,084.00	268,419,200	
新電元工業	4,900	3,250.00	15,925,000	
アズビル	87,100	4,890.00	425,919,000	
東亜ディーケーケー	6,600	827.00	5,458,200	
日本光電工業	53,200	3,180.00	169,176,000	
チノー	4,100	1,415.00	5,801,500	
共和電業	14,500	400.00	5,800,000	
日本電子材料	4,600	2,079.00	9,563,400	
堀場製作所	25,400	7,070.00	179,578,000	
アドバンテスト	95,700	10,650.00	1,019,205,000	
小野測器	4,600	554.00	2,548,400	
エスベック	11,400	1,889.00	21,534,600	
キーエンス	126,300	50,950.00	6,434,985,000	
日置電機	6,000	4,325.00	25,950,000	
シスメックス	100,300	11,130.00	1,116,339,000	
日本マイクロニクス	22,300	1,830.00	40,809,000	
メガチップス	13,000	3,670.00	47,710,000	
OBARA GROUP	7,700	3,945.00	30,376,500	
IMAGICA GROUP	10,800	538.00	5,810,400	
澤藤電機	1,400	2,452.00	3,432,800	
デンソー	283,500	7,106.00	2,014,551,000	
原田工業	5,500	892.00	4,906,000	
コーセル	15,700	1,091.00	17,128,700	
イリソ電子工業	10,800	5,140.00	55,512,000	
オブテックスグループ	21,200	1,686.00	35,743,200	
千代田インテグレ	5,600	1,945.00	10,892,000	
アイ・オー・データ機器	4,700	1,100.00	5,170,000	
レーザーテック	56,400	18,000.00	1,015,200,000	
スタンレー電気	90,300	3,295.00	297,538,500	
岩崎電気	4,600	1,516.00	6,973,600	
ウシオ電機	66,100	1,458.00	96,373,800	
岡谷電機産業	9,600	394.00	3,782,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	12,200	385.00	4,697,000	
エノモト	3,600	2,234.00	8,042,400	
日本セラミック	13,000	2,741.00	35,633,000	
遠藤照明	7,300	649.00	4,737,700	
古河電池	9,100	1,637.00	14,896,700	
双信電機	6,300	454.00	2,860,200	
山一電機	8,200	1,534.00	12,578,800	
図研	8,400	2,916.00	24,494,400	
日本電子	23,500	4,425.00	103,987,500	
カシオ計算機	103,500	2,076.00	214,866,000	
ファナック	113,100	27,600.00	3,121,560,000	

日本シイエムケイ	27,600	474.00	13,082,400
エンプラス	5,800	4,300.00	24,940,000
大真空	4,200	2,528.00	10,617,600
ローム	53,500	11,560.00	618,460,000
浜松ホトニクス	92,200	6,570.00	605,754,000
三井ハイテック	12,600	4,830.00	60,858,000
新光電気工業	43,200	3,510.00	151,632,000
京セラ	196,100	7,197.00	1,411,331,700
協栄産業	1,600	1,370.00	2,192,000
太陽誘電	57,200	5,490.00	314,028,000
村田製作所	378,300	9,127.00	3,452,744,100
双葉電子工業	21,900	926.00	20,279,400
日東電工	82,300	9,360.00	770,328,000
北陸電気工業	5,000	946.00	4,730,000
東海理化電機製作所	33,900	1,871.00	63,426,900
ニチコン	40,400	1,175.00	47,470,000
日本ケミコン	13,000	1,891.00	24,583,000
K O A	17,900	1,610.00	28,819,000
三井E & Sホールディングス	49,400	543.00	26,824,200
日立造船	102,100	829.00	84,640,900
三菱重工業	202,100	3,362.00	679,460,200
川崎重工業	100,100	2,642.00	264,464,200
I H I	86,500	2,213.00	191,424,500
名村造船所	38,600	211.00	8,144,600
サノヤスホールディングス	16,800	158.00	2,654,400
スプリックス	3,500	954.00	3,339,000
マネジメントソリューションズ	5,900	2,261.00	13,339,900
プロレド・パートナーズ	1,700	3,220.00	5,474,000
and factory	1,000	719.00	719,000
テノ・ホールディングス	900	1,146.00	1,031,400
フロンティア・マネジメント	2,300	1,853.00	4,261,900
ピアラ	800	1,702.00	1,361,600
コプロ・ホールディングス	1,600	1,432.00	2,291,200
ギークス	1,600	1,713.00	2,740,800
カーブスホールディングス	33,900	1,049.00	35,561,100
フォーラムエンジニアリング	6,300	1,091.00	6,873,300
日本車輛製造	4,600	2,483.00	11,421,800
三菱ロジスネクスト	17,100	1,275.00	21,802,500
近畿車輛	1,700	1,372.00	2,332,400
F P G	39,100	688.00	26,900,800
島根銀行	4,600	677.00	3,114,200
じもとホールディングス	8,700	738.00	6,420,600
全国保証	33,000	5,150.00	169,950,000
めぶきフィナンシャルグループ	657,900	249.00	163,817,100
ジャパンインベストメントアドバイザ	6,400	1,525.00	9,760,000
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,800	1,287.00	20,334,600
九州フィナンシャルグループ	259,600	459.00	119,156,400
かんぼ生命保険	157,300	2,216.00	348,576,800
ゆうちょ銀行	360,000	997.00	358,920,000



富山第一銀行	31,000	297.00	9,207,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	772,500	432.00	333,720,000	
ジェイリース	4,100	890.00	3,649,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	84,500	745.00	62,952,500	
マーキュリアインベストメント	5,200	782.00	4,066,400	
イントラスト	3,600	672.00	2,419,200	
日本モーゲージサービス	6,400	1,115.00	7,136,000	
CASA	3,500	964.00	3,374,000	
アルヒ	18,700	1,892.00	35,380,400	
プレミアグループ	5,900	2,638.00	15,564,200	
日産自動車	1,518,200	575.40	873,572,280	
いすゞ自動車	373,100	1,146.00	427,572,600	
トヨタ自動車	1,304,200	8,435.00	11,000,927,000	
日野自動車	160,800	943.00	151,634,400	
三菱自動車工業	475,900	310.00	147,529,000	
エフテック	9,100	742.00	6,752,200	
レシップホールディングス	5,000	578.00	2,890,000	
GMB	2,500	932.00	2,330,000	
ファルテック	2,500	801.00	2,002,500	
武蔵精密工業	28,700	2,103.00	60,356,100	
日産車体	18,900	789.00	14,912,100	
新明和工業	36,300	994.00	36,082,200	
極東開発工業	22,200	1,721.00	38,206,200	
トピー工業	10,800	1,367.00	14,763,600	
ティラド	4,100	1,943.00	7,966,300	
曙ブレーキ工業	69,400	190.00	13,186,000	
タチエス	19,800	1,210.00	23,958,000	
NOK	62,300	1,466.00	91,331,800	
フタバ産業	32,300	591.00	19,089,300	
KYB	14,300	2,953.00	42,227,900	
市光工業	19,000	726.00	13,794,000	
大同メタル工業	26,800	587.00	15,731,600	
プレス工業	64,000	338.00	21,632,000	
ミクニ	17,400	314.00	5,463,600	
太平洋工業	27,100	1,230.00	33,333,000	
河西工業	17,600	442.00	7,779,200	
アイシン	94,200	4,025.00	379,155,000	
マツダ	403,700	893.00	360,504,100	
今仙電機製作所	11,200	760.00	8,512,000	
本田技研工業	1,013,400	3,229.00	3,272,268,600	
スズキ	255,300	4,705.00	1,201,186,500	
SUBARU	368,900	2,089.50	770,816,550	
安永	6,000	1,256.00	7,536,000	
ヤマハ発動機	181,900	2,831.00	514,958,900	
小糸製作所	77,100	7,140.00	550,494,000	
TBK	12,800	435.00	5,568,000	
エクセディ	17,500	1,643.00	28,752,500	
ミツバ	23,500	679.00	15,956,500	

豊田合成	41,600	2,859.00	118,934,400
愛三工業	20,600	703.00	14,481,800
盟和産業	1,700	900.00	1,530,000
日本プラスト	11,200	572.00	6,406,400
ヨロズ	11,100	1,306.00	14,496,600
エフ・シー・シー	21,100	1,828.00	38,570,800
新家工業	3,300	1,651.00	5,448,300
シマノ	48,200	26,660.00	1,285,012,000
テイ・エス テック	59,900	1,613.00	96,618,700
三十三フィナンシャルグループ	11,100	1,340.00	14,874,000
第四北越フィナンシャルグループ	20,600	2,401.00	49,460,600
ひろぎんホールディングス	187,700	633.00	118,814,100
ダイレクトマーケティングミックス	4,700	3,580.00	16,826,000
ポピンズホールディングス	2,500	4,285.00	10,712,500
L I T A L I C O	5,000	4,140.00	20,700,000
ジャムコ	7,600	970.00	7,372,000
小野建	11,500	1,391.00	15,996,500
はるやまホールディングス	6,600	681.00	4,494,600
南陽	2,400	1,697.00	4,072,800
ノジマ	22,400	2,840.00	63,616,000
佐鳥電機	8,200	799.00	6,551,800
カッパ・クリエイト	18,000	1,518.00	27,324,000
エコートレーディング	2,700	656.00	1,771,200
伯東	7,800	1,300.00	10,140,000
コンドーテック	9,900	1,046.00	10,355,400
中山福	7,800	503.00	3,923,400
ライトオン	9,500	717.00	6,811,500
ナガイレーベン	16,900	2,712.00	45,832,800
三菱食品	14,000	2,962.00	41,468,000
良品計画	168,200	2,508.00	421,845,600
三城ホールディングス	16,200	279.00	4,519,800
松田産業	9,200	2,256.00	20,755,200
第一興商	18,800	4,565.00	85,822,000
メディバルホールディングス	127,000	2,205.00	280,035,000
アドヴァン	12,900	1,013.00	13,067,700
S P K	5,900	1,317.00	7,770,300
萩原電気ホールディングス	4,700	2,577.00	12,111,900
アルビス	4,100	2,417.00	9,909,700
アズワン	9,100	14,360.00	130,676,000
スズデン	3,900	1,281.00	4,995,900
尾家産業	3,200	1,288.00	4,121,600
シモジマ	7,100	1,298.00	9,215,800
ドウシシャ	12,100	1,896.00	22,941,600
小津産業	2,600	2,126.00	5,527,600
コナカ	15,300	332.00	5,079,600
高速	6,800	1,457.00	9,907,600
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,673.00	2,174,900
G - 7ホールディングス	7,400	2,758.00	20,409,200
たけびし	3,900	1,535.00	5,986,500
イオン北海道	17,100	1,252.00	21,409,200

コジマ	21,700	770.00	16,709,000
ヒマラヤ	4,600	992.00	4,563,200
コーナン商事	18,100	3,225.00	58,372,500
ネットワンシステムズ	51,400	3,590.00	184,526,000
エコス	4,600	1,878.00	8,638,800
ワタミ	16,700	962.00	16,065,400
マルシェ	3,200	487.00	1,558,400
リックス	2,500	1,544.00	3,860,000
システムソフト	27,600	168.00	4,636,800
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	253,700	2,541.00	644,651,700
丸文	11,400	534.00	6,087,600
西松屋チェーン	27,800	1,798.00	49,984,400
ゼンショーホールディングス	68,000	2,920.00	198,560,000
ハビネット	10,600	1,556.00	16,493,600
幸楽苑ホールディングス	8,000	1,705.00	13,640,000
ハークスレイ	2,300	913.00	2,099,900
橋本総業ホールディングス	2,300	2,682.00	6,168,600
日本ライフライン	40,900	1,415.00	57,873,500
サイゼリヤ	18,800	2,283.00	42,920,400
タカショー	8,300	779.00	6,465,700
V Tホールディングス	47,900	443.00	21,219,700
マルカ	4,100	2,002.00	8,208,200
アルゴグラフィックス	9,800	3,215.00	31,507,000
魚力	3,900	1,922.00	7,495,800
I D O M	42,800	710.00	30,388,000
日本エム・ディ・エム	7,300	2,215.00	16,169,500
ポブラ	3,600	337.00	1,213,200
フジ・コーポレーション	3,300	2,848.00	9,398,400
ユナイテッドアローズ	14,300	1,998.00	28,571,400
進和	7,600	2,125.00	16,150,000
エスケイジャパン	2,800	479.00	1,341,200
ダイترون	5,500	1,814.00	9,977,000
ハイデイ日高	18,200	1,773.00	32,268,600
シークス	16,200	1,574.00	25,498,800
京都きもの友禅	7,000	262.00	1,834,000
コロワイド	42,100	1,907.00	80,284,700
ピーシーデポコーポレーション	14,700	489.00	7,188,300
田中商事	3,300	698.00	2,303,400
オーハシテクニカ	6,700	1,593.00	10,673,100
壱番屋	9,100	4,840.00	44,044,000
白銅	4,000	1,715.00	6,860,000
トップカルチャー	5,200	358.00	1,861,600
P L A N T	3,300	745.00	2,458,500
スギホールディングス	25,200	8,480.00	213,696,000
ダイコー通産	1,100	1,670.00	1,837,000
薬王堂ホールディングス	5,600	2,613.00	14,632,800
島津製作所	165,500	4,090.00	676,895,000
J M S	10,800	975.00	10,530,000
クボテック	3,300	381.00	1,257,300

長野計器	9,200	1,110.00	10,212,000
バイ・テクノロジー	5,900	5,830.00	34,397,000
スター精密	19,900	1,670.00	33,233,000
東京計器	8,100	956.00	7,743,600
愛知時計電機	1,300	4,340.00	5,642,000
インターアクション	6,400	2,388.00	15,283,200
オーバル	11,500	291.00	3,346,500
東京精密	21,800	5,480.00	119,464,000
マニー	51,100	2,813.00	143,744,300
ニコン	196,600	1,050.00	206,430,000
トプコン	64,800	1,457.00	94,413,600
オリンパス	712,200	2,257.00	1,607,435,400
理研計器	11,400	2,889.00	32,934,600
SCREENホールディングス	22,200	10,820.00	240,204,000
キヤノン電子	12,000	1,784.00	21,408,000
タムロン	10,500	2,300.00	24,150,000
HOYA	253,400	13,740.00	3,481,716,000
シード	5,700	839.00	4,782,300
ノーリツ鋼機	11,500	2,717.00	31,245,500
エー・アンド・デイ	10,700	1,387.00	14,840,900
朝日インテック	135,400	3,140.00	425,156,000
キヤノン	639,400	2,601.00	1,663,079,400
リコー	327,500	1,156.00	378,590,000
シチズン時計	162,600	381.00	61,950,600
リズム	3,300	859.00	2,834,700
大研医器	10,400	584.00	6,073,600
メニコン	19,700	6,930.00	136,521,000
シンシア	1,300	997.00	1,296,100
中本パックス	3,300	1,616.00	5,332,800
スノーピーク	7,600	3,805.00	28,918,000
パラマウントベッドホールディングス	24,800	2,255.00	55,924,000
トランザクション	7,000	1,304.00	9,128,000
粧美堂	3,200	411.00	1,315,200
ニホンフラッシュ	10,900	1,375.00	14,987,500
前田工織	14,100	3,345.00	47,164,500
永大産業	18,100	298.00	5,393,800
アートネイチャー	12,500	686.00	8,575,000
バンダイナムコホールディングス	106,500	8,302.00	884,163,000
アイフィスジャパン	3,500	760.00	2,660,000
共立印刷	23,600	135.00	3,186,000
SHOEI	11,300	4,500.00	50,850,000
フランスベッドホールディングス	16,800	960.00	16,128,000
マーベラス	19,700	890.00	17,533,000
パイロットコーポレーション	22,800	3,545.00	80,826,000
萩原工業	7,300	1,477.00	10,782,100
エイベックス	21,900	1,471.00	32,214,900
トッパン・フォームズ	23,200	1,146.00	26,587,200
フジシールインターナショナル	26,500	2,483.00	65,799,500
タカラトミー	57,700	1,005.00	57,988,500
廣済堂	8,800	1,016.00	8,940,800

エステールホールディングス	4,200	635.00	2,667,000	
レック	15,300	1,260.00	19,278,000	
タカノ	4,900	645.00	3,160,500	
三光合成	13,400	439.00	5,882,600	
プロネクサス	11,200	1,222.00	13,686,400	
ホクシン	9,200	126.00	1,159,200	
ウッドワン	3,800	1,291.00	4,905,800	
大建工業	8,800	2,084.00	18,339,200	
きもと	20,400	225.00	4,590,000	
凸版印刷	195,400	1,942.00	379,466,800	
大日本印刷	155,400	2,309.00	358,818,600	
共同印刷	4,100	2,915.00	11,951,500	
N I S S H A	26,500	1,352.00	35,828,000	
光村印刷	900	1,787.00	1,608,300	
藤森工業	11,500	4,420.00	50,830,000	
TAKARA & COMPANY	6,400	1,915.00	12,256,000	
前澤化成工業	8,400	1,112.00	9,340,800	
未来工業	4,600	1,841.00	8,468,600	
アシックス	113,900	1,810.00	206,159,000	
ツツミ	3,200	2,196.00	7,027,200	
ウェーブロックホールディングス	4,200	751.00	3,154,200	
J S P	7,600	1,847.00	14,037,200	
ニチハ	18,000	3,175.00	57,150,000	
ローランド	7,400	4,295.00	31,783,000	
エフピコ	23,700	4,435.00	105,109,500	
小松ウオール工業	4,100	1,946.00	7,978,600	
ヤマハ	76,500	6,300.00	481,950,000	
河合楽器製作所	3,600	3,465.00	12,474,000	
クリナップ	12,300	531.00	6,531,300	
ピジョン	82,600	4,110.00	339,486,000	
天馬	9,600	2,243.00	21,532,800	
オリバー	2,500	2,895.00	7,237,500	
兼松サステック	800	1,770.00	1,416,000	
キングジム	11,300	950.00	10,735,000	
象印マホービン	34,700	1,956.00	67,873,200	
リンテック	27,700	2,528.00	70,025,600	
信越ポリマー	20,000	1,035.00	20,700,000	
東リ	33,600	252.00	8,467,200	
イトーキ	25,100	410.00	10,291,000	
任天堂	73,600	64,670.00	4,759,712,000	
三菱鉛筆	21,100	1,562.00	32,958,200	
松風	5,900	1,997.00	11,782,300	
タカラスタANDARD	26,800	1,667.00	44,675,600	
コクヨ	61,600	1,774.00	109,278,400	
ナカバヤシ	13,100	614.00	8,043,400	
ニフコ	47,300	4,005.00	189,436,500	
立川ブラインド工業	5,700	1,329.00	7,575,300	
グロープライド	6,000	4,700.00	28,200,000	
オカムラ	44,300	1,283.00	56,836,900	
バルカー	10,700	2,153.00	23,037,100	

MUTOHホールディングス	1,300	1,627.00	2,115,100	
伊藤忠商事	886,900	3,487.00	3,092,620,300	
丸紅	1,250,200	911.80	1,139,932,360	
スクロール	18,000	992.00	17,856,000	
高島	1,700	1,762.00	2,995,400	
ヨンドシーホールディングス	11,800	1,900.00	22,420,000	
三陽商会	6,500	784.00	5,096,000	
長瀬産業	71,300	1,756.00	125,202,800	
ナイガイ	4,100	347.00	1,422,700	
蝶理	8,100	1,691.00	13,697,100	
豊田通商	127,200	4,810.00	611,832,000	
オンワードホールディングス	75,800	302.00	22,891,600	
三共生興	19,500	536.00	10,452,000	
兼松	50,700	1,471.00	74,579,700	
美津濃	12,800	2,254.00	28,851,200	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,454.00	2,617,200	
ルックホールディングス	4,200	1,260.00	5,292,000	
三井物産	1,029,200	2,293.00	2,359,955,600	
日本紙パルプ商事	6,700	3,670.00	24,589,000	
東京エレクトロン	75,400	49,450.00	3,728,530,000	
カメイ	16,400	1,257.00	20,614,800	
東都水産	1,500	4,335.00	6,502,500	
OUGホールディングス	1,900	2,829.00	5,375,100	
スターゼン	9,100	2,402.00	21,858,200	
セイコーホールディングス	18,100	1,978.00	35,801,800	
山善	49,500	1,039.00	51,430,500	
椿本興業	1,800	3,730.00	6,714,000	
住友商事	800,100	1,546.50	1,237,354,650	
日本ユニシス	44,000	3,445.00	151,580,000	
内田洋行	5,000	4,895.00	24,475,000	
三菱商事	771,700	3,068.00	2,367,575,600	
第一実業	5,700	4,205.00	23,968,500	
キヤノンマーケティングジャパン	31,500	2,525.00	79,537,500	
西華産業	6,700	1,633.00	10,941,100	
佐藤商事	11,000	1,034.00	11,374,000	
菱洋エレクトロ	9,600	2,715.00	26,064,000	
東京産業	12,500	621.00	7,762,500	
ユアサ商事	13,000	3,095.00	40,235,000	
神鋼商事	2,800	2,231.00	6,246,800	
トルク	6,300	262.00	1,650,600	
阪和興業	25,300	3,310.00	83,743,000	
正栄食品工業	8,200	4,425.00	36,285,000	
カナデン	10,700	1,204.00	12,882,800	
菱電商事	9,300	1,680.00	15,624,000	
ニプロ	96,000	1,313.00	126,048,000	
フルサト工業	6,800	1,352.00	9,193,600	
岩谷産業	30,300	6,720.00	203,616,000	
ナイス	5,100	1,861.00	9,491,100	
昭光通商	3,800	794.00	3,017,200	
二チモウ	1,700	2,058.00	3,498,600	

極東貿易	3,200	1,404.00	4,492,800
イワキ	16,700	710.00	11,857,000
兼松エレクトロニクス	7,100	3,755.00	26,660,500
三愛石油	31,400	1,273.00	39,972,200
稲畑産業	30,300	1,673.00	50,691,900
G S Iクレオス	5,900	1,273.00	7,510,700
明和産業	11,700	487.00	5,697,900
クワザワホールディングス	4,700	629.00	2,956,300
キムラタン	73,900	25.00	1,847,500
ヤマエ久野	9,200	1,174.00	10,800,800
ゴールドウイン	20,700	6,910.00	143,037,000
ユニ・チャーム	273,200	4,603.00	1,257,539,600
デサント	21,600	2,045.00	44,172,000
キング	5,000	560.00	2,800,000
ワキタ	25,000	1,131.00	28,275,000
ヤマトインターナショナル	11,400	341.00	3,887,400
東邦ホールディングス	40,700	1,973.00	80,301,100
サンゲツ	34,300	1,618.00	55,497,400
ミツウロコグループホールディングス	18,600	1,398.00	26,002,800
シナネンホールディングス	4,700	2,925.00	13,747,500
伊藤忠エネクス	28,600	1,065.00	30,459,000
サンリオ	35,500	1,803.00	64,006,500
サンワテクノス	8,200	1,151.00	9,438,200
リョーサン	13,900	2,214.00	30,774,600
新光商事	17,400	784.00	13,641,600
トーヨー	5,900	1,863.00	10,991,700
三信電気	7,100	1,969.00	13,979,900
東陽テクニカ	13,400	1,103.00	14,780,200
モスフードサービス	18,000	3,185.00	57,330,000
加賀電子	11,400	2,507.00	28,579,800
三益半導体工業	9,900	2,949.00	29,195,100
都築電気	4,600	1,747.00	8,036,200
ソーダニッカ	12,600	551.00	6,942,600
立花エレテック	9,600	1,631.00	15,657,600
木曽路	16,700	2,381.00	39,762,700
S R Sホールディングス	16,100	848.00	13,652,800
千趣会	23,200	382.00	8,862,400
タカキュー	10,700	144.00	1,540,800
リテールパートナーズ	15,300	1,365.00	20,884,500
ケーヨー	23,700	707.00	16,755,900
上新電機	14,900	3,020.00	44,998,000
日本瓦斯	62,500	1,998.00	124,875,000
ロイヤルホールディングス	22,100	2,041.00	45,106,100
東天紅	800	1,018.00	814,400
いなげや	14,100	1,665.00	23,476,500
チヨダ	13,200	915.00	12,078,000
ライフコーポレーション	9,600	3,495.00	33,552,000
リンガーハット	15,600	2,321.00	36,207,600
MrMaxHD	17,200	704.00	12,108,800
テンアライド	12,700	334.00	4,241,800

AOKIホールディングス	25,000	633.00	15,825,000	
オークワ	19,900	1,190.00	23,681,000	
コメリ	19,600	2,986.00	58,525,600	
青山商事	28,100	839.00	23,575,900	
しまむら	14,800	11,490.00	170,052,000	
はせがわ	5,700	311.00	1,772,700	
高島屋	92,200	1,144.00	105,476,800	
松屋	27,700	933.00	25,844,100	
エイチ・ツー・オー リテイリング	59,800	840.00	50,232,000	
近鉄百貨店	4,900	3,285.00	16,096,500	
丸井グループ	107,200	2,119.00	227,156,800	
クレディセゾン	74,100	1,308.00	96,922,800	
アクシアル リテイリング	10,700	4,665.00	49,915,500	
井筒屋	6,800	246.00	1,672,800	
イオン	487,900	3,081.00	1,503,219,900	
イズミ	25,700	4,265.00	109,610,500	
フォーバル	4,600	824.00	3,790,400	
平和堂	23,500	2,335.00	54,872,500	
フジ	15,400	2,091.00	32,201,400	
ヤオコー	14,300	7,020.00	100,386,000	
ゼビオホールディングス	15,200	928.00	14,105,600	
ケーズホールディングス	113,000	1,532.00	173,116,000	
PALTAC	20,400	5,860.00	119,544,000	
三谷産業	16,900	459.00	7,757,100	
Olympicグループ	6,500	856.00	5,564,000	
日産東京販売ホールディングス	15,400	251.00	3,865,400	
新生銀行	103,500	1,687.00	174,604,500	
あおぞら銀行	75,600	2,410.00	182,196,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,685,000	583.10	5,064,223,500	
りそなホールディングス	1,464,440	454.80	666,027,312	
三井住友トラスト・ホールディングス	240,200	3,745.00	899,549,000	
三井住友フィナンシャルグループ	878,700	3,884.00	3,412,870,800	
千葉銀行	423,300	701.00	296,733,300	
群馬銀行	261,400	369.00	96,456,600	
武蔵野銀行	18,900	1,727.00	32,640,300	
千葉興業銀行	32,900	282.00	9,277,800	
筑波銀行	52,400	178.00	9,327,200	
七十七銀行	40,000	1,463.00	58,520,000	
青森銀行	9,800	2,424.00	23,755,200	
秋田銀行	7,800	1,415.00	11,037,000	
山形銀行	14,000	1,048.00	14,672,000	
岩手銀行	8,200	2,265.00	18,573,000	
東邦銀行	113,600	231.00	26,241,600	
東北銀行	6,400	1,034.00	6,617,600	
みちのく銀行	8,100	1,025.00	8,302,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	114,300	2,010.00	229,743,000	
静岡銀行	309,200	851.00	263,129,200	
十六銀行	15,900	2,108.00	33,517,200	
スルガ銀行	110,900	407.00	45,136,300	
八十二銀行	285,800	378.00	108,032,400	



山梨中央銀行	14,700	864.00	12,700,800
大垣共立銀行	25,200	2,089.00	52,642,800
福井銀行	10,900	1,866.00	20,339,400
北國銀行	12,000	2,558.00	30,696,000
清水銀行	5,400	1,641.00	8,861,400
富山銀行	2,200	2,798.00	6,155,600
滋賀銀行	25,300	2,308.00	58,392,400
南都銀行	18,400	1,853.00	34,095,200
百五銀行	114,900	315.00	36,193,500
京都銀行	45,400	6,480.00	294,192,000
紀陽銀行	45,000	1,540.00	69,300,000
ほくほくフィナンシャルグループ	84,300	979.00	82,529,700
山陰合同銀行	80,300	532.00	42,719,600
中国銀行	109,300	893.00	97,604,900
鳥取銀行	4,200	1,113.00	4,674,600
伊予銀行	168,500	625.00	105,312,500
百十四銀行	13,300	1,587.00	21,107,100
四国銀行	18,100	752.00	13,611,200
阿波銀行	19,400	2,280.00	44,232,000
大分銀行	7,300	2,018.00	14,731,400
宮崎銀行	7,900	2,257.00	17,830,300
佐賀銀行	7,300	1,445.00	10,548,500
沖縄銀行	11,600	2,875.00	33,350,000
琉球銀行	27,800	748.00	20,794,400
セブン銀行	423,600	249.00	105,476,400
みずほフィナンシャルグループ	1,725,100	1,551.00	2,675,630,100
高知銀行	4,400	807.00	3,550,800
山口フィナンシャルグループ	158,500	694.00	109,999,000
芙蓉総合リース	13,300	7,310.00	97,223,000
みずほリース	19,600	3,345.00	65,562,000
東京センチュリー	29,500	7,330.00	216,235,000
SBIホールディングス	155,700	3,095.00	481,891,500
日本証券金融	53,900	800.00	43,120,000
アイフル	212,400	311.00	66,056,400
日本アジア投資	10,900	254.00	2,768,600
長野銀行	4,200	1,268.00	5,325,600
名古屋銀行	10,200	2,973.00	30,324,600
北洋銀行	191,700	293.00	56,168,100
愛知銀行	4,200	2,913.00	12,234,600
中京銀行	4,600	1,701.00	7,824,600
大光銀行	3,900	1,454.00	5,670,600
愛媛銀行	18,100	965.00	17,466,500
トマト銀行	4,900	1,071.00	5,247,900
京葉銀行	54,300	439.00	23,837,700
栃木銀行	60,700	184.00	11,168,800
北日本銀行	4,100	1,899.00	7,785,900
東和銀行	22,100	637.00	14,077,700
福島銀行	14,200	242.00	3,436,400
大東銀行	6,400	651.00	4,166,400
リコーリース	10,000	3,515.00	35,150,000

イオンフィナンシャルサービス	77,500	1,319.00	102,222,500
アコム	255,400	513.00	131,020,200
ジャックス	13,900	2,206.00	30,663,400
オリエントコーポレーション	342,900	144.00	49,377,600
オリックス	770,800	1,815.50	1,399,387,400
三菱HCキャピタル	438,220	635.00	278,269,700
ジャフコグループ	19,500	6,990.00	136,305,000
九州リースサービス	7,100	688.00	4,884,800
トモニホールディングス	98,200	311.00	30,540,200
大和証券グループ本社	951,000	580.60	552,150,600
野村ホールディングス	1,938,200	580.00	1,124,156,000
岡三証券グループ	108,200	463.00	50,096,600
丸三証券	37,800	655.00	24,759,000
東洋証券	41,300	194.00	8,012,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	135,000	413.00	55,755,000
光世証券	3,200	755.00	2,416,000
水戸証券	33,700	315.00	10,615,500
いちよし証券	25,100	616.00	15,461,600
松井証券	62,300	942.00	58,686,600
SOMPOホールディングス	224,000	4,134.00	926,016,000
日本取引所グループ	343,000	2,802.50	961,257,500
マネックスグループ	113,500	1,058.00	120,083,000
極東証券	17,000	849.00	14,433,000
岩井コスモホールディングス	13,000	1,762.00	22,906,000
藍澤證券	22,900	1,031.00	23,609,900
フィデアホールディングス	123,300	130.00	16,029,000
池田泉州ホールディングス	145,600	173.00	25,188,800
アニコムホールディングス	35,700	970.00	34,629,000
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	308,600	3,219.00	993,383,400
マネーパートナーズグループ	13,800	261.00	3,601,800
スパークス・グループ	58,200	317.00	18,449,400
小林洋行	3,200	283.00	905,600
第一生命ホールディングス	670,700	1,999.00	1,340,729,300
東京海上ホールディングス	421,000	5,181.00	2,181,201,000
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	728.00	4,368,000
イー・ギャランティ	14,600	2,136.00	31,185,600
アサックス	7,100	709.00	5,033,900
NECキャピタルソリューション	5,200	2,009.00	10,446,800
T&Dホールディングス	379,200	1,377.00	522,158,400
アドバンスクリエイト	5,000	1,052.00	5,260,000
三井不動産	578,400	2,463.00	1,424,599,200
三菱地所	833,800	1,923.00	1,603,397,400
平和不動産	21,900	3,630.00	79,497,000
東京建物	125,100	1,706.00	213,420,600
ダイビル	32,900	1,348.00	44,349,200
京阪神ビルディング	22,000	1,504.00	33,088,000
住友不動産	285,400	3,795.00	1,083,093,000
太平洋興発	5,600	685.00	3,836,000

テーオーシー	25,100	783.00	19,653,300
東京楽天地	2,300	4,800.00	11,040,000
レオパレス21	104,400	159.00	16,599,600
スターツコーポレーション	15,000	2,869.00	43,035,000
フジ住宅	14,700	734.00	10,789,800
空港施設	13,500	594.00	8,019,000
明和地所	5,900	671.00	3,958,900
ゴールドクレスト	11,300	1,689.00	19,085,700
リログループ	67,200	2,350.00	157,920,000
エスリード	5,000	1,695.00	8,475,000
日神グループホールディングス	19,000	498.00	9,462,000
日本エスコン	23,100	793.00	18,318,300
タカラレーベン	53,100	375.00	19,912,500
A V A N T I A	7,200	925.00	6,660,000
イオンモール	63,500	1,788.00	113,538,000
毎日コムネット	3,900	786.00	3,065,400
ファースト住建	5,500	1,384.00	7,612,000
ランド	676,000	12.00	8,112,000
カチタス	31,500	3,215.00	101,272,500
東祥	7,800	1,875.00	14,625,000
トーセイ	17,600	1,143.00	20,116,800
穴吹興産	2,800	2,116.00	5,924,800
サンフロンティア不動産	15,300	958.00	14,657,400
エフ・ジェー・ネクスト	12,500	1,092.00	13,650,000
インテリックス	2,800	786.00	2,200,800
ランドビジネス	4,700	383.00	1,800,100
サンネクスタグループ	4,100	1,023.00	4,194,300
グランディハウス	8,800	458.00	4,030,400
東武鉄道	134,100	2,936.00	393,717,600
相鉄ホールディングス	44,200	2,400.00	106,080,000
東急	324,600	1,432.00	464,827,200
京浜急行電鉄	165,300	1,510.00	249,603,000
小田急電鉄	206,100	2,931.00	604,079,100
京王電鉄	71,900	7,190.00	516,961,000
京成電鉄	96,400	3,480.00	335,472,000
富士急行	17,500	5,890.00	103,075,000
新京成電鉄	3,200	2,184.00	6,988,800
東日本旅客鉄道	226,500	7,536.00	1,706,904,000
西日本旅客鉄道	114,700	6,006.00	688,888,200
東海旅客鉄道	106,900	15,985.00	1,708,796,500
西武ホールディングス	155,200	1,156.00	179,411,200
鴻池運輸	20,700	1,200.00	24,840,000
西日本鉄道	35,600	2,944.00	104,806,400
ハマキョウレックス	9,900	3,170.00	31,383,000
サカイ引越センター	5,900	4,980.00	29,382,000
近鉄グループホールディングス	121,700	4,130.00	502,621,000
阪急阪神ホールディングス	162,400	3,480.00	565,152,000
南海電気鉄道	58,000	2,491.00	144,478,000
京阪ホールディングス	54,400	4,345.00	236,368,000
神戸電鉄	3,100	3,585.00	11,113,500

名古屋鉄道	100,200	2,546.00	255,109,200
山陽電気鉄道	8,900	1,893.00	16,847,700
アルプス物流	8,400	920.00	7,728,000
トランコム	3,800	8,890.00	33,782,000
日本通運	42,400	8,230.00	348,952,000
ヤマトホールディングス	170,800	3,065.00	523,502,000
山九	31,300	4,905.00	153,526,500
日新	9,700	1,448.00	14,045,600
丸運	8,200	274.00	2,246,800
丸全昭和運輸	9,900	3,225.00	31,927,500
センコーグループホールディングス	67,500	1,051.00	70,942,500
トナミホールディングス	2,500	5,520.00	13,800,000
ニッコンホールディングス	41,000	2,230.00	91,430,000
日本石油輸送	900	2,690.00	2,421,000
福山通運	15,600	4,470.00	69,732,000
セイノーホールディングス	91,300	1,535.00	140,145,500
エスライン	3,200	908.00	2,905,600
神奈川中央交通	2,600	3,700.00	9,620,000
日立物流	27,000	3,545.00	95,715,000
丸和運輸機関	25,700	1,940.00	49,858,000
C & F ロジホールディングス	12,400	1,792.00	22,220,800
日本郵船	101,900	3,905.00	397,919,500
商船三井	72,300	3,985.00	288,115,500
川崎汽船	37,500	2,643.00	99,112,500
NSユニテッド海運	5,800	1,902.00	11,031,600
明治海運	13,300	480.00	6,384,000
飯野海運	57,100	518.00	29,577,800
共栄タンカー	2,500	987.00	2,467,500
九州旅客鉄道	94,100	2,460.00	231,486,000
SGホールディングス	230,500	2,505.00	577,402,500
日本航空	297,100	2,324.00	690,460,400
ANAホールディングス	329,000	2,462.00	809,998,000
パスコ	2,500	1,493.00	3,732,500
西本Wismettacホールディングス	2,700	2,871.00	7,751,700
シルバーライフ	1,700	2,471.00	4,200,700
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	2,178.00	2,395,800
一家ダイニングプロジェクト	1,100	569.00	625,900
Genky DrugStores	5,600	3,840.00	21,504,000
コア商事ホールディングス	3,600	1,748.00	6,292,800
国際紙パルプ商事	27,600	246.00	6,789,600
ナルミヤ・インターナショナル	2,500	1,235.00	3,087,500
ブックオフグループホールディングス	7,300	1,006.00	7,343,800
ギフト	1,100	2,404.00	2,644,400
三菱倉庫	42,100	3,395.00	142,929,500
三井倉庫ホールディングス	13,000	2,281.00	29,653,000
住友倉庫	44,000	1,501.00	66,044,000
澁澤倉庫	6,800	2,230.00	15,164,000
ヤマタネ	5,700	1,496.00	8,527,200
東陽倉庫	18,100	342.00	6,190,200

乾汽船	6,400	1,088.00	6,963,200
日本トランスシティ	27,500	534.00	14,685,000
ケイヒン	1,800	1,379.00	2,482,200
中央倉庫	7,000	1,128.00	7,896,000
川西倉庫	2,400	1,186.00	2,846,400
安田倉庫	10,700	971.00	10,389,700
ファイズホールディングス	2,300	952.00	2,189,600
東洋埠頭	3,200	1,500.00	4,800,000
宇徳	9,200	505.00	4,646,000
上組	67,900	2,195.00	149,040,500
サンリツ	2,500	735.00	1,837,500
キムラユニティー	3,900	1,211.00	4,722,900
キューソー流通システム	3,100	1,620.00	5,022,000
近鉄エクスプレス	23,200	2,816.00	65,331,200
東海運	8,500	360.00	3,060,000
エーアイティー	7,800	1,034.00	8,065,200
内外トランスライン	4,300	1,509.00	6,488,700
ショーエイコーポレーション	2,700	1,110.00	2,997,000
日本コンセプト	4,100	1,648.00	6,756,800
TBSホールディングス	83,800	2,193.00	183,773,400
日本テレビホールディングス	105,200	1,444.00	151,908,800
朝日放送グループホールディングス	13,400	717.00	9,607,800
テレビ朝日ホールディングス	39,100	2,082.00	81,406,200
スカパーJ S A Tホールディングス	83,300	489.00	40,733,700
テレビ東京ホールディングス	9,300	2,423.00	22,533,900
日本BS放送	4,300	1,129.00	4,854,700
ビジョン	15,400	1,035.00	15,939,000
スマートバリュー	3,300	867.00	2,861,100
USEN-NEXT HOLDINGS	4,700	2,548.00	11,975,600
ワイヤレスゲート	5,200	446.00	2,319,200
コネクシオ	7,500	1,390.00	10,425,000
日本通信	110,400	276.00	30,470,400
クロップス	2,500	911.00	2,277,500
日本電信電話	1,477,500	2,861.50	4,227,866,250
KDDI	1,013,000	3,471.00	3,516,123,000
ソフトバンク	1,148,200	1,435.00	1,647,667,000
光通信	14,900	22,850.00	340,465,000
エムティーアイ	12,300	836.00	10,282,800
GMOインターネット	45,200	3,590.00	162,268,000
ファイバーゲート	4,100	1,768.00	7,248,800
アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	462.00	1,432,200
KADOKAWA	32,700	4,510.00	147,477,000
学研ホールディングス	17,000	1,427.00	24,259,000
ゼンリン	23,000	1,342.00	30,866,000
昭文社ホールディングス	4,700	465.00	2,185,500
インプレスホールディングス	10,800	246.00	2,656,800
東京電力ホールディングス	1,091,400	355.00	387,447,000
中部電力	393,800	1,358.00	534,780,400

関西電力	487,800	1,117.00	544,872,600	
中国電力	185,800	1,312.00	243,769,600	
北陸電力	117,700	735.00	86,509,500	
東北電力	301,400	1,035.00	311,949,000	
四国電力	106,900	836.00	89,368,400	
九州電力	284,200	1,060.00	301,252,000	
北海道電力	120,300	473.00	56,901,900	
沖縄電力	25,200	1,470.00	37,044,000	
電源開発	102,300	1,871.00	191,403,300	
エフオン	7,800	1,109.00	8,650,200	
イーレックス	18,800	1,949.00	36,641,200	
レノバ	21,800	3,250.00	70,850,000	
東京瓦斯	247,500	2,342.50	579,768,750	
大阪瓦斯	233,100	2,076.00	483,915,600	
東邦瓦斯	63,300	6,500.00	411,450,000	
北海道瓦斯	7,200	1,556.00	11,203,200	
広島ガス	27,500	395.00	10,862,500	
西部ガスホールディングス	14,600	2,807.00	40,982,200	
静岡ガス	36,700	938.00	34,424,600	
メタウォーター	14,700	2,330.00	34,251,000	
アイネット	6,500	1,514.00	9,841,000	
松竹	8,300	13,350.00	110,805,000	
東宝	74,500	4,675.00	348,287,500	
エイチ・アイ・エス	17,900	2,216.00	39,666,400	
東映	4,100	23,650.00	96,965,000	
ラックランド	3,600	2,494.00	8,978,400	
エヌ・ティ・ティ・データ	336,500	1,726.00	580,799,000	
共立メンテナンス	20,400	3,540.00	72,216,000	
イチネンホールディングス	13,000	1,359.00	17,667,000	
建設技術研究所	8,000	2,541.00	20,328,000	
スペース	8,300	950.00	7,885,000	
長大	4,900	1,798.00	8,810,200	
アインホールディングス	18,300	6,780.00	124,074,000	
燦ホールディングス	5,100	1,128.00	5,752,800	
ピー・シー・エー	1,800	4,400.00	7,920,000	
スバル興業	900	8,240.00	7,416,000	
東京テアトル	5,000	1,276.00	6,380,000	
タナベ経営	2,500	1,385.00	3,462,500	
ビジネスブレイン太田昭和	4,200	1,858.00	7,803,600	
ナガワ	4,000	8,560.00	34,240,000	
東京都競馬	8,000	6,000.00	48,000,000	
常磐興産	5,100	1,464.00	7,466,400	
カナモト	21,900	2,839.00	62,174,100	
D T S	26,200	2,578.00	67,543,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53,900	6,050.00	326,095,000	
シーイーシー	13,300	1,460.00	19,418,000	
カプコン	108,200	3,710.00	401,422,000	
西尾レントオール	11,300	3,130.00	35,369,000	
アイ・エス・ピー	5,700	1,272.00	7,250,400	

アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	76,900	26.00	1,999,400	
日本空港ビルデング	44,000	5,240.00	230,560,000	
トランス・コスモス	11,800	3,180.00	37,524,000	
乃村工藝社	52,700	916.00	48,273,200	
ジャステック	8,100	1,279.00	10,359,900	
S C S K	29,100	6,550.00	190,605,000	
藤田観光	4,800	1,973.00	9,470,400	
K N T - C Tホールディングス	6,500	1,007.00	6,545,500	
日本管財	13,300	2,187.00	29,087,100	
トーカイ	12,100	2,505.00	30,310,500	
白洋舎	1,000	2,394.00	2,394,000	
セコム	121,200	9,340.00	1,132,008,000	
日本システムウエア	4,100	2,110.00	8,651,000	
セントラル警備保障	5,900	3,350.00	19,765,000	
アイネス	12,300	1,430.00	17,589,000	
丹青社	23,100	874.00	20,189,400	
メイテック	15,000	5,970.00	89,550,000	
T K C	21,400	3,450.00	73,830,000	
富士ソフト	13,400	5,520.00	73,968,000	
応用地質	14,400	1,342.00	19,324,800	
船井総研ホールディングス	25,200	2,122.00	53,474,400	
N S D	40,800	1,843.00	75,194,400	
進学会ホールディングス	5,400	443.00	2,392,200	
丸紅建材リース	900	1,889.00	1,700,100	
オオバ	8,500	881.00	7,488,500	
コナミホールディングス	45,900	6,620.00	303,858,000	
いであ	2,800	1,809.00	5,065,200	
学究社	3,800	1,330.00	5,054,000	
ベネッセホールディングス	45,100	2,591.00	116,854,100	
イオンディライト	15,100	3,415.00	51,566,500	
ナック	5,900	967.00	5,705,300	
福井コンピュータホールディングス	5,700	4,545.00	25,906,500	
ダイセキ	20,600	4,275.00	88,065,000	
ステップ	4,600	1,553.00	7,143,800	
日鉄物産	9,100	3,970.00	36,127,000	
泉州電業	3,600	3,545.00	12,762,000	
元気寿司	3,500	2,661.00	9,313,500	
トラスコ中山	29,000	2,869.00	83,201,000	
ヤマダホールディングス	424,800	586.00	248,932,800	
オートバックスセブン	47,000	1,507.00	70,829,000	
モリト	9,700	636.00	6,169,200	
アークランドサカモト	19,800	1,672.00	33,105,600	
ニトリホールディングス	50,400	20,125.00	1,014,300,000	
グルメ杵屋	9,300	959.00	8,918,700	
愛眼	8,200	234.00	1,918,800	
ケーユーホールディングス	6,500	1,013.00	6,584,500	
吉野家ホールディングス	41,600	2,169.00	90,230,400	
加藤産業	18,300	3,500.00	64,050,000	
北恵	3,500	953.00	3,335,500	

イノテック	7,200	1,346.00	9,691,200	
イエローハット	23,800	1,877.00	44,672,600	
松屋フーズホールディングス	6,000	3,500.00	21,000,000	
JBCホールディングス	8,500	1,445.00	12,282,500	
JKホールディングス	11,500	847.00	9,740,500	
サガミホールディングス	17,200	1,100.00	18,920,000	
日伝	10,600	2,158.00	22,874,800	
関西スーパーマーケット	9,500	1,116.00	10,602,000	
ミロク情報サービス	12,500	2,006.00	25,075,000	
北沢産業	7,900	270.00	2,133,000	
杉本商事	6,500	2,282.00	14,833,000	
因幡電機産業	33,800	2,713.00	91,699,400	
王将フードサービス	8,400	5,730.00	48,132,000	
プレナス	14,300	1,879.00	26,869,700	
ミニストップ	9,500	1,448.00	13,756,000	
アークス	24,000	2,359.00	56,616,000	
パローホールディングス	26,000	2,444.00	63,544,000	
東テック	4,200	2,827.00	11,873,400	
ミスミグループ本社	158,900	3,240.00	514,836,000	
藤久	2,800	796.00	2,228,800	
アルテック	9,500	336.00	3,192,000	
ベルク	6,300	6,050.00	38,115,000	
大庄	6,800	998.00	6,786,400	
タキヒヨー	4,200	1,786.00	7,501,200	
ファーストリテイリング	17,000	87,310.00	1,484,270,000	
ソフトバンクグループ	1,002,200	10,030.00	10,052,066,000	
蔵王産業	2,200	1,398.00	3,075,600	
スズケン	53,600	4,145.00	222,172,000	
サンドラッグ	47,700	3,995.00	190,561,500	
サックスパーホールディングス	10,800	604.00	6,523,200	
ジェコス	9,000	953.00	8,577,000	
ヤマザワ	2,700	1,742.00	4,703,400	
やまや	2,600	2,359.00	6,133,400	
グローセル	13,900	435.00	6,046,500	
ペルーナ	27,200	1,196.00	32,531,200	
合計	136,471,480		344,931,255,952	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,433,888,928
コール・ローン	285,971,323
国債証券	133,540,450,748
派生商品評価勘定	1,453
未収入金	1,358,046,415
未収利息	860,940,945
前払費用	50,578,033
流動資産合計	137,529,877,845
資産合計	
137,529,877,845	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	98,448
未払金	235,256,465
未払解約金	72,630,000
流動負債合計	307,984,913
負債合計	
307,984,913	
純資産の部	
元本等	
元本	67,839,896,050
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	69,381,996,882
元本等合計	137,221,892,932
純資産合計	
137,221,892,932	
負債純資産合計	
137,529,877,845	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	65,397,237,567円
同期中追加設定元本額	12,198,884,833円
同期中一部解約元本額	9,756,226,350円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,567,379,232円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,558,401円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	17,623,749円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	14,211,719円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	63,562,797円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	41,974,082円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,474,865円
たわらノーロード 先進国債券	10,325,612,396円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,260,893円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,051,441,717円
たわらノーロード バランス(堅実型)	28,834,690円
たわらノーロード バランス(標準型)	137,012,008円
たわらノーロード バランス(積極型)	27,193,057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)	4,428,166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)	232,508,194円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	230,292,851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)	50,867,011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)	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	300,143円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,663,051円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,362,419円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,418,305円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,312,931円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,027,399,300円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	329,955,772円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	636,481,202円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,055,973,090円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	368,954,138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	658,369,823円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,546,557円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	454,142,483円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	38,867,719円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,346,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	97,448,211円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	173,452,364円
クルーズコントロール	1,881,767,140円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	112,880,979円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	238,422,256円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,453,486円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	13,205,063円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	127,710,903円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,943,648円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	9,386,714円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,203,086,501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)	1,808,787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)	2,409,222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)	102,319,415円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,153,055円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,925,462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)	5,590,310,260円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,065,265,177円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,323,887,149円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,413,947,911円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	61,541,483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)	3,060,714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)	484,650,861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)	267,384,657円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,579,544円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,033,990円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,816,228円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,030,001円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	32,485,721円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	59,343,488円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,304,563,171円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,739,131,493円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,048,453,270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)	429,838,612円

D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	186,032,661円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	2,148,489,778円
D I A M世界アセットバランスファンドV A (適格機関投資家向け)	524,880,790円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	3,609,956円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	451,088,663円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	463,221,377円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	619,340,890円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	66,456,237円
計	67,839,896,050円
2. 受益権の総数	67,839,896,050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 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	2021年4月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	1,541,977,539	
合計	1,541,977,539	

(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(2021年2月23日から2021年4月12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	2021年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	1,262,350,000	-	1,262,446,995	96,995
アメリカ・ドル	790,960,000	-	791,012,615	52,615
イギリス・ポンド	87,520,000	-	87,527,153	7,153
オーストラリア・ドル	27,770,000	-	27,769,103	897
カナダ・ドル	37,400,000	-	37,399,444	556
デンマーク・クローネ	16,060,000	-	16,061,829	1,829
メキシコ・ペソ	16,390,000	-	16,400,548	10,548
ユーロ	286,250,000	-	286,276,303	26,303
合計	1,262,350,000	-	1,262,446,995	96,995

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

( 1口当たり情報に関する注記 )

	2021年4月12日現在
1口当たり純資産額 ( 1万口当たり純資産額 )	2,0227円 ( 20,227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

2021年4月12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 0.125 02/15/24	4,000,000.000	3,979,218.720	
		US T N/B 0.125 04/30/22	1,000,000.000	1,000,651.800	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,996,484.360	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,597,124.990	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,995,859.360	
		US T N/B 0.125 08/31/22	4,000,000.000	4,000,937.480	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,995,000.000	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,339,791.360	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,000,000.000	1,991,953.120	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	2,003,320.200	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,395,441.780	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,803,718.730	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,946,093.750	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	980,585.930	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	979,179.680	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,934,492.180	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,953,281.240	
		US T N/B 0.375 01/31/26	2,000,000.000	1,956,171.860	
		US T N/B 0.375 03/31/22	1,500,000.000	1,504,481.250	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,978,945.320	
		US T N/B 0.375 07/31/27	2,000,000.000	1,898,671.860	
		US T N/B 0.375 09/30/27	1,700,000.000	1,607,761.700	
		US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,540,729.290	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,938,945.290	
		US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,013,242.000	
		US T N/B 0.5 03/31/25	800,000.000	796,359.370	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,924,375.000	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,439,824.210	
		US T N/B 0.5 06/30/27	1,700,000.000	1,629,410.150	
		US T N/B 0.5 08/31/27	2,000,000.000	1,910,234.360	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,855,507.790	
		US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,748,144.530	
US T N/B 0.625 05/15/30	4,220,000.000	3,868,717.950			
US T N/B 0.625 08/15/30	6,210,000.000	5,670,021.060			

US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,916,562.500	
US T N/B 0.625 12/31/27	4,430,000.000	4,240,081.070	
US T N/B 0.75 01/31/28	2,000,000.000	1,927,421.860	
US T N/B 0.75 03/31/26	2,570,000.000	2,555,443.340	
US T N/B 0.875 11/15/30	6,400,000.000	5,963,499.960	
US T N/B 1.125 02/15/31	4,360,000.000	4,147,620.290	
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,020,664.060	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,101,546.820	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,020,000.000	2,982,014.040	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,741,851.540	
US T N/B 1.125 08/15/40	4,100,000.000	3,388,746.050	
US T N/B 1.25 03/31/28	2,910,000.000	2,894,995.310	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,780,000.000	2,902,774.220	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,504,907.800	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,379,681.230	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,090,625.000	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,550,149.190	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,540,000.000	3,602,915.620	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,122,644.520	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,542,421.870	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,810,000.000	3,293,119.880	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,547,970.310	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	3,947,513.630	
US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,025,273.430	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,052,656.240	
US T N/B 1.5 08/15/22	1,210,000.000	1,232,782.020	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,174,492.180	
US T N/B 1.5 09/15/22	750,000.000	764,736.320	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,277,773.430	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,070,390.620	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,334,137.500	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,088,945.290	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,200,805.450	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,988,812.500	
US T N/B 1.625 08/15/22	3,980,000.000	4,062,242.950	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,380,000.000	3,413,667.930	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,963,160.140	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,000,000.000	4,140,625.000	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,427,109.370	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,753,694.510	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,400,000.000	3,726,937.490	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,020,000.000	1,052,791.390	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,124,147.640	
US T N/B 1.75 03/31/22	6,990,000.000	7,103,314.400	
US T N/B 1.75 05/15/22	5,400,000.000	5,497,453.090	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,706,582.790	
US T N/B 1.75 06/15/22	830,000.000	846,081.250	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,397,839.840	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,850,140.200	

US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,376,738.250	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	1,975,844.520	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,671,062.490	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,740,000.000	1,806,745.300	
US T N/B 1.875 02/15/41	1,460,000.000	1,378,958.580	
US T N/B 1.875 02/15/51	1,490,000.000	1,342,396.870	
US T N/B 1.875 06/30/26	450,000.000	471,498.040	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,483,315.620	
US T N/B 1.875 08/31/22	3,680,000.000	3,769,412.480	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,269,296.860	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,518,853.120	
US T N/B 2.0 02/15/25	5,300,000.000	5,587,980.420	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,040,844.490	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	5,009,804.260	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,467,935.110	
US T N/B 2.0 11/15/26	2,640,000.000	2,779,425.000	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,791,046.460	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,367,132.800	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,295,156.220	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,320,000.000	3,518,032.780	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,174,281.250	
US T N/B 2.125 06/30/22	4,530,000.000	4,641,480.440	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,096,987.080	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	2,097,968.740	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,708,240.610	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	369,031.250	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,782,275.360	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,297,005.830	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,488,332.020	
US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,862,433.190	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,550,000.000	1,531,230.450	
US T N/B 2.25 08/15/49	2,400,000.000	2,360,718.730	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,981,476.130	
US T N/B 2.25 11/15/25	5,190,000.000	5,536,270.310	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,475,907.810	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,190,312.500	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,888,493.740	
US T N/B 2.375 05/15/27	3,100,000.000	3,325,355.460	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,002,199.570	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	4,172,809.340	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	2,798,024.570	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,128,566.380	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,159,787.480	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,042,797.640	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,752,207.010	
US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,159,085.130	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,518,912.500	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	1,875,400.360	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,561,722.630	



US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,365,214.820	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,469,946.060	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,883,882.800	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,320,488.270	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,918,251.550	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,253,879.670	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,483,218.750	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,688,035.890	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,786,174.180	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,798,376.550	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,621,114.060	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,448,955.850	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	857,983.190	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,460,962.860	
US T N/B 2.75 08/15/42	630,000.000	686,306.250	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,043,325.000	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,300,539.060	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,784,012.500	
US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,876,859.330	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,327,321.860	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,327,166.380	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,892,381.250	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,000,000.000	2,219,921.860	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,445,229.250	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,759,874.200	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,031,977.320	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,680,000.000	4,066,831.210	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,890,000.000	2,098,047.640	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	894,731.250	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,936,192.180	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,440,000.000	1,600,087.480	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	1,863,962.490	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	2,893,119.500	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,504,836.690	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,110,768.750	
US T N/B 3.0 05/15/45	300,000.000	339,960.930	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,290,000.000	1,467,727.720	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,710,000.000	3,089,611.680	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,550,173.820	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,112,149.990	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,790,000.000	2,027,454.680	
US T N/B 3.0 11/15/45	650,000.000	737,775.380	
US T N/B 3.125 02/15/42	680,000.000	786,462.500	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,663,256.240	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,660,000.000	3,098,172.640	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,023,164.060	
US T N/B 3.125 11/15/28	2,840,000.000	3,192,004.680	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	877,800.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	2,030,000.000	2,440,123.430	

	US T N/B 3.375 11/15/48	2,660,000.000	3,245,927.290	
	US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,092,445.300	
	US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,032,660.930	
	US T N/B 3.625 08/15/43	1,670,000.000	2,080,585.140	
	US T N/B 3.75 08/15/41	710,000.000	895,043.750	
	US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,726,562.500	
	US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,417,938.260	
	US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,076,793.750	
	US T N/B 4.25 11/15/40	510,000.000	683,001.560	
	US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	735,539.060	
	US T N/B 4.375 05/15/40	1,200,000.000	1,628,156.240	
	US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,419,193.740	
	US T N/B 4.375 11/15/39	910,000.000	1,230,775.000	
	US T N/B 4.5 02/15/36	730,000.000	975,063.270	
	US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	732,965.620	
	US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,082,732.020	
	US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,046,425.770	
	US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,710,093.740	
	US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	709,179.680	
	US T N/B 5.25 02/15/29	490,000.000	630,185.930	
	US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,087,535.150	
	US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	941,609.370	
	US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	839,464.840	
	US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,046,850.000	
	US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,181,250.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	995,497.650	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,141,367.180	
	アメリカ・ドル 小計	520,190,000.000 (57,090,852,500)	540,527,890.370 (59,322,935,968)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,200,000.000	1,186,440.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,502,199.600	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,000,000.000	999,278.800	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	970,325.200	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	750,000.000	702,799.500	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	1,171,273.680	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	470,000.000	365,012.340	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,250,000.000	1,269,990.000	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,200,000.000	1,119,504.480	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	860,000.000	716,319.800	

UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,584,615.550	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	250,000.000	226,587.500	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	921,774.670	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,120,000.000	1,149,860.530	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	732,818.800	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,020,000.000	1,016,097.480	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	952,784.460	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	910,000.000	949,257.400	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	999,970.950	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	520,000.000	568,313.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	597,032.500	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	810,000.000	894,418.200	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	910,000.000	1,045,007.600	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	1,530,000.000	1,567,544.970	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,562,883.840	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	850,313.340	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,242,205.580	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,418,755.800	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	522,393.600	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,816,584.860	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,858,278.400	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,768,790.400	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	940,000.000	1,537,135.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	870,000.000	1,618,983.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	940,000.000	1,347,620.090	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	810,000.000	1,096,686.540	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	920,000.000	1,386,211.840	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	970,985.650	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,467,815.040	

	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,739,809.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,452,735.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,880,227.200	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	760,000.000	1,090,840.760	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,180,000.000	1,902,895.840	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,190,913.420	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,385,811.680	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,672,210.650	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,063,851.040	
イギリス・ボンド 小計		46,450,000.000 (6,990,260,500)	57,054,165.580 (8,586,081,378)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	300,000.000	302,601.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,050,000.000	1,043,179.200	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,018,181.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	960,573.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,144,617.860	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,816,837.280	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,864,768.400	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,260,000.000	1,651,398.840	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,920,000.000	3,153,588.320	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,428,396.500	
イスラエル・シュケル 小計		16,270,000.000 (542,256,322)	18,384,141.400 (612,717,695)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,439,540.230	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,428,104.810	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,680,000.000	1,652,844.870	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,483,372.970	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,740,000.000	1,639,037.460	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	990,000.000	935,227.610	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,610,054.830	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,000,000.000	804,900.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	980,000.000	1,049,580.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,216,631.780	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,138,165.170		

	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	776,077.730	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	574,849.280	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,802,535.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,284,258.380	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,860,000.000	2,048,046.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	938,828.040	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,200,000.000	1,336,121.640	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,840,000.000	2,105,171.960	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	703,620.390	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	919,959.320	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,365,283.980	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	980,000.000	1,262,682.470	
オーストラリア・ドル 小計		30,750,000.000 (2,571,622,500)	32,514,894.420 (2,719,220,620)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	500,000.000	500,445.000	
	CANADA 0.25 03/01/26	1,100,000.000	1,064,547.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	2,350,000.000	2,315,220.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,100,000.000	1,005,092.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	695,856.000	
	CANADA 1.0 09/01/22	1,500,000.000	1,517,430.000	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	715,932.000	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,786,252.800	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,242,246.500	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	821,296.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	3,160,000.000	3,251,766.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	720,000.000	759,506.400	
	CANADA 2.0 09/01/23	920,000.000	957,131.200	
	CANADA 2.0 12/01/51	1,480,000.000	1,508,060.800	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	558,021.100	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,000,000.000	1,062,090.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	655,079.000	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,600,000.000	1,701,200.000	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,240,000.000	2,306,684.800	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	1,004,207.000	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	435,312.500	
	CANADA 3.5 12/01/45	820,000.000	1,080,661.600	
	CANADA 4.0 06/01/41	540,000.000	739,724.400	
CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	569,981.100		
CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,342,730.000		
CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	1,045,519.200		
カナダ・ドル 小計		28,700,000.000 (2,512,972,000)	30,641,992.800 (2,683,012,890)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	204,581.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	320,000.000	313,336.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	310,000.000	327,050.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	499,785.600	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	361,930.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	100,000.000	105,899.500	

	SINGAPORE 2.625 05/01/28	130,000.000	141,206.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	472,500.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	425,220.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	734,230.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	521,230.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	411,558.400	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	592,900.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	800,000.000	829,840.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	560,880.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	825,995.000	
シンガポール・ドル 小計		6,780,000.000 (554,604,000)	7,328,141.500 (599,441,975)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,200,000.000	2,149,163.740	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,609,531.000	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,307,625.550	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,496,755.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	8,200,000.000	8,584,001.080	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,180,000.000	6,868,173.900	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,807,063.500	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	3,000,000.000	3,131,139.000	
スウェーデン・クローナ 小計		31,810,000.000 (408,758,500)	34,953,452.770 (449,151,868)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	3,660,000.000	3,701,724.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,150,000.000	2,026,590.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,525,301.460	
	DENMARK 0.5 11/15/29	2,670,000.000	2,825,994.750	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,500,000.000	3,689,654.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,871,817.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,680,000.000	13,705,734.900	
デンマーク・クローネ 小計		32,110,000.000 (563,851,600)	39,346,816.610 (690,930,100)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,600,000.000	1,565,280.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,718,810.000	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,861,022.880	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,000,000.000	1,035,775.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,928,250.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,700,000.000	1,754,612.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,179,089.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,856,790.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,613,378.800	
ノルウェー・クローネ 小計		25,670,000.000 (331,399,700)	26,513,008.180 (342,282,936)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 07/25/22	1,200,000.000	1,199,296.590	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,050,000.000	2,954,034.510	
	POLAND 2.25 10/25/24	600,000.000	637,500.000	

	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,975,704.950	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,440,933.660	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,080,000.000	2,260,721.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,550,000.000	2,778,796.700	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,010,000.000	3,321,234.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	232,218.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,643,586.660	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,440,000.000	4,871,568.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,931,112.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	1,720,000.000	1,862,347.200	
ポーランド・ズロチ 小計		27,820,000.000 (802,267,596)	30,109,053.270 (868,278,856)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.418 08/15/22	3,000,000.000	3,056,421.300	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,250,866.360	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,099,220.000	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	900,000.000	903,027.690	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,217,415.840	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	850,998.400	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,567,182.000	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,323,644.930	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,985,993.460	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,305,654.240	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,783,963.780	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,133,893.000		
マレーシア・リングgit 小計		22,230,000.000 (589,828,590)	23,478,281.000 (622,949,230)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	20,000,000.000	20,706,736.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	10,343,868.950	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	26,076,461.880	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	14,859,000.000	14,940,873.090	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	19,579,238.180	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	10,000,000.000	10,908,535.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	14,013,725.330	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,559,623.400	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,000,000.000	21,683,756.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	9,454,000.000	9,884,724.240	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	15,042,440.000	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	19,552,416.700	

	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	8,125,000.000	9,098,542.370	
メキシコ・ペソ	小計	182,942,000.000 (995,735,012)	199,390,941.140 (1,085,264,954)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	390,000.000	395,621.070	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	110,000.000	110,828.650	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,712.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	200,000.000	186,100.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	820,000.000	870,408.680	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	520,000.000	550,602.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	620,000.000	668,244.680	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	290,000.000	306,928.750	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	727,290.600	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	170,000.000	165,830.580	
	AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	659,652.500	
	AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	816,692.000	
	AUSTRIA 09/20/22	470,000.000	474,590.300	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	692,165.120	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	490,000.000	613,817.610	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	204,045.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	540,000.000	584,244.900	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	370,000.000	392,784.970	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	612,801.350	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	480,000.000	625,408.800	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	762,133.900	
	AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	788,893.280	
	AUSTRIA 3.65 04/20/22	280,000.000	292,348.000	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	450,299.430	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,442,245.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	590,000.000	750,060.800	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	954,468.600	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	500,000.000	512,223.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	170,000.000	169,547.800	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	817,200.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	674,751.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	320,000.000	313,203.200	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	550,966.800	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	240,000.000	206,703.900	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,206,348.000	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	903,890.400	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	880,000.000	952,864.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	1,170,000.000	1,277,228.160	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	520,000.000	560,863.780	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	810,000.000	896,111.100	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	808,871.760	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	230,000.000	268,950.040	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	640,000.000	771,856.640	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	490,000.000	606,792.970	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	686,334.820	



BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	605,220.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	883,651.200	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	501,655.410	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,050,000.000	1,159,655.490	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	807,848.650	
BELGIUM 3.75 06/22/45	650,000.000	1,100,219.250	
BELGIUM 4.0 03/28/32	530,000.000	763,014.970	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,060,000.000	1,812,484.460	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,190,000.000	1,276,355.920	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	538,713.030	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,807,880.540	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,240,000.000	1,754,575.200	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	500,000.000	515,990.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,284,859.370	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,300,000.000	1,339,260.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	300,000.000	309,417.000	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,573,704.890	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,045,143.060	
BUNDESOBL 10/07/22	1,400,000.000	1,414,812.000	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,303,744.000	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,158,346.050	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,747,865.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	800,000.000	823,920.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,600,000.000	1,613,424.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,064,460.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	518,465.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,220,000.000	1,135,599.180	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,500,000.000	1,553,820.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,058,588.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,190,000.000	1,257,716.470	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,520,625.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,860,000.000	1,947,215.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,912,717.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,430,000.000	1,533,017.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,800,000.000	1,924,065.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,737,304.800	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,667,348.200	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,418,383.300	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,901,015.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,620,000.000	2,069,359.640	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,478,553.130	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,727,337.150	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,410,000.000	1,508,401.080	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	1,650,000.000	1,701,527.850	

DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,250,000.000	1,339,568.750	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	1,540,000.000	1,586,691.560	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,119,686.730	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,731,203.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,860,000.000	2,949,675.220	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,844,282.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,330,000.000	2,189,940.760	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	2,030,317.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	600,000.000	834,342.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,361,445.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,180,000.000	2,260,124.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,961,754.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,652,779.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	1,002,422.400	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,134,019.100	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	1,030,217.100	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	184,023.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	172,148.800	
FINLAND 0.125 04/15/36	210,000.000	207,612.300	
FINLAND 0.125 04/15/52	210,000.000	188,200.320	
FINLAND 0.25 09/15/40	170,000.000	167,697.520	
FINLAND 0.5 04/15/26	430,000.000	453,072.940	
FINLAND 0.5 09/15/27	300,000.000	318,374.400	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	255,163.080	
FINLAND 0.5 09/15/29	570,000.000	605,706.510	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	271,656.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	390,000.000	415,592.970	
FINLAND 09/15/23	230,000.000	233,806.500	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	328,861.160	
FINLAND 1.375 04/15/47	150,000.000	186,378.000	
FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	490,703.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	400,000.000	413,336.990	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	302,769.040	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	516,388.250	
FINLAND 2.75 07/04/28	380,000.000	467,229.000	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	515,144.300	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,223,895.440	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,113,662.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	500,000.000	509,027.600	

FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,300,000.000	2,354,765.300	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,450,000.000	2,478,809.550	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,700,000.000	2,710,827.000	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,550,000.000	2,649,786.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,920,000.000	2,005,566.720	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,070,000.000	2,175,427.170	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	1,820,000.000	1,923,057.500	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	700,000.000	699,815.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	300,000.000	244,236.720	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	60,000.000	58,733.400	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	2,750,000.000	2,956,519.500	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,330,000.000	1,307,798.310	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	2,340,000.000	2,519,028.720	
FRANCE OAT 03/25/23	2,700,000.000	2,735,479.620	
FRANCE OAT 03/25/24	2,720,000.000	2,771,413.440	
FRANCE OAT 03/25/25	2,470,000.000	2,526,115.930	
FRANCE OAT 05/25/22	1,590,000.000	1,602,014.040	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,350,000.000	2,553,232.700	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,378,814.360	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,340,000.000	2,658,897.540	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,499,447.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,566,230.800	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	1,870,000.000	2,230,741.700	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,291,770.920	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	1,075,307.000	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,990,000.000	2,456,694.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,680,000.000	2,911,554.680	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,228,793.970	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,159,877.060	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,121,881.860	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	2,940,000.000	3,645,253.080	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	2,780,000.000	3,354,431.400	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	2,350,000.000	2,439,488.000	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,545,427.200	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,398,946.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,060,000.000	2,061,700.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,223,598.910	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,457,796.830	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,730,000.000	3,074,234.700	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,310,000.000	4,092,381.430	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,650,000.000	2,692,077.300	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,724,198.800	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,483,984.000	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,343,409.200	
IRISH 0.0 10/18/31	360,000.000	357,672.600	
IRISH 0.2 05/15/27	280,000.000	289,820.440	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	459,321.750	
IRISH 0.4 05/15/35	240,000.000	244,367.520	
IRISH 0.9 05/15/28	430,000.000	466,339.730	

IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	688,164.220	
IRISH 1.1 05/15/29	380,000.000	419,102.760	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	387,000.240	
IRISH 1.35 03/18/31	210,000.000	238,526.610	
IRISH 1.5 05/15/50	400,000.000	477,660.400	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	472,130.490	
IRISH 10/18/22	220,000.000	222,113.760	
IRISH 2.0 02/18/45	560,000.000	734,577.200	
IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	773,641.260	
IRISH 3.4 03/18/24	560,000.000	626,100.160	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	620,288.020	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	988,373.600	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,006,500.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,013,800.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,098,039.240	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	300,000.000	306,382.500	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	510,150.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	410,000.000	403,267.610	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,002,797.740	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,400,000.000	1,451,730.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,000,000.000	1,015,965.000	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	980,000.000	996,219.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	942,466.400	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	600,000.000	576,600.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,096,182.900	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,200,888.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,200,000.000	1,248,480.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,431,561.730	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,606,597.720	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,061,004.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,421,787.970	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	900,000.000	923,481.000	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,099,040.800	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	200,000.000	198,280.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,690,000.000	1,798,474.340	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,184,040.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,840,000.000	1,998,943.980	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,611,287.840	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	700,000.000	695,352.000	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,274,563.200	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	635,340.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	861,030.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	971,190.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,390,000.000	1,543,422.640	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,059,018.350	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,540,000.000	1,710,020.460	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,580,000.000	1,743,762.260	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	920,000.000	1,028,836.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,173,816.000	

ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,340,000.000	1,569,834.120	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	1,133,930.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	992,849.300	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,392,699.500	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,281,348.900	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,020,000.000	1,247,154.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	719,741.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,200,000.000	1,410,771.360	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,182,426.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,595,211.310	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	530,000.000	679,317.430	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,323,667.620	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	610,000.000	786,533.630	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,415,815.080	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,925,234.080	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,010,000.000	1,143,884.280	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	840,000.000	1,247,685.600	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,319,186.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,090,000.000	1,238,397.170	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,983,058.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,539,615.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,123,820.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,390,000.000	1,824,921.400	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,575,504.940	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,144,044.100	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,400,832.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,121,217.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,150,000.000	1,850,350.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,750,000.000	2,437,750.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	1,150,000.000	1,243,693.950	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,138,242.400	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,974,272.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	970,000.000	1,466,252.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,505,284.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,503,576.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,471,792.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	460,000.000	473,368.520	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	510,000.000	461,515.830	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	971,227.750	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,420,000.000	1,474,315.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	827,734.350	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	590,000.000	627,091.640	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	940,000.000	994,285.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,020,000.000	1,099,527.360	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	850,000.000	921,854.750	

NETHERLANDS 01/15/24	830,000.000	846,227.330	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	820,000.000	892,681.020	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	980,000.000	1,016,297.240	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	780,000.000	1,019,705.140	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	990,000.000	1,615,031.550	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	390,000.000	421,044.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,160,000.000	2,010,673.440	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	950,000.000	1,539,095.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,196,469.350	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,418,900.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	500,000.000	505,866.600	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	1,000,296.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	600,000.000	583,620.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	940,000.000	960,840.740	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,420,000.000	1,447,903.000	
SPAIN 0.4 04/30/22	1,570,000.000	1,585,354.600	
SPAIN 0.45 10/31/22	1,340,000.000	1,360,991.100	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,150,000.000	1,175,378.200	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,220,470.460	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,268,040.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	870,000.000	804,271.500	
SPAIN 1.2 10/31/40	970,000.000	1,001,198.110	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,770,000.000	1,931,070.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,550,000.000	1,679,109.260	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,240,000.000	1,360,892.560	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,662,661.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,292,449.860	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,060,000.000	1,163,821.700	
SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	273,459.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,210,000.000	1,329,306.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,565,259.050	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,290,000.000	1,487,617.680	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,411,388.710	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,684,699.840	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,535,353.500	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,502,012.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,150,447.530	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,713,494.860	
SPAIN 2.9 10/31/46	870,000.000	1,196,674.560	
SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,453,959.530	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,270,000.000	1,435,911.530	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,110,000.000	1,675,753.680	
SPAIN 4.4 10/31/23	480,000.000	540,500.160	
SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,665,430.770	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,270,000.000	2,130,353.370	

	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,298,089.760	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,985,022.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,180,000.000	1,634,064.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,669,063.760	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,617,110.740	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,520,000.000	2,409,751.760	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,370,000.000	1,815,715.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,304,193.000	
	ユーロ 小計	355,900,000.000 (46,480,540,000)	420,813,034.290 (54,958,182,278)	
国債証券 合計		120,434,948,819.800 (120,434,948,820)	133,540,450,748 (133,540,450,748)	
合計			133,540,450,748 (133,540,450,748)	

(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 208銘柄	43.23	44.42
イギリス・ポンド	国債証券 48銘柄	6.26	6.43
イスラエル・シケル	国債証券 10銘柄	0.45	0.46
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	1.98	2.04
カナダ・ドル	国債証券 26銘柄	1.96	2.01
シンガポール・ドル	国債証券 16銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.33	0.34
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.50	0.52
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.25	0.26
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.63	0.65
マレーシア・リングギット	国債証券 12銘柄	0.45	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.79	0.81
ユーロ	国債証券 324銘柄	40.05	41.15

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	14,492,983,036
コール・ローン	478,390,920
株式	471,489,789,591
投資信託受益証券	917,681,171
投資証券	9,529,725,241
派生商品評価勘定	496,173,538
未収入金	671,905
未収配当金	545,571,035
差入委託証拠金	5,642,725,823
流動資産合計	503,593,712,260
資産合計	503,593,712,260
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	66,994
未払解約金	130,335,000
流動負債合計	130,401,994
負債合計	130,401,994
純資産の部	
元本等	
元本	98,331,117,304
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	405,132,192,962
元本等合計	503,463,310,266
純資産合計	503,463,310,266
負債純資産合計	503,593,712,260



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年4月12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	95,596,418,253円
同期中追加設定元本額	26,490,875,442円
同期中一部解約元本額	23,756,176,391円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,583,704,312円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,664,453円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,094,397円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,332,488円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,822,955円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,046,918円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,539,536円
たわらノーロード 先進国株式	20,680,414,728円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	225,905,611円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,324,691,785円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	425,111,573円
たわらノーロード バランス(堅実型)	47,197,346円
たわらノーロード バランス(標準型)	382,704,912円
たわらノーロード バランス(積極型)	449,198,596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)	1,107,077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)	130,404,574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)	348,405,879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)	234,481,159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)	361,398,378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)	602,136円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,278,943円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,927,045円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,817,783円
たわらノーロード 全世界株式	95,313,464円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	47,425,632,985円
One DC 先進国株式インデックスファンド	784,761,465円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	173,702,624円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	916,154,914円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,087,092,632円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	110,420,184円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	329,907,963円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	285,073,321円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	21,408,640円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	668,457,892円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	160,050,732円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	194,076,118円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	173,088,747円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	288,790,483円
投資のソムリエ	4,048,297,699円
クルーズコントロール	275,927,718円
投資のソムリエ<DC年金>	224,539,288円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	190,049,961円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	113,257,497円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,887,631円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,880,916円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	82,609,825円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	907,717,249円
ワールドアセットバランス(基本コース)	287,193,473円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	929,334,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	17,364,631円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,197,697円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	809,655円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	24,746,512円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	34,178,619円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	563,528,107円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	164,353,423円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,270,036円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,897,605円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,045,055円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,753,132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)	527,338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)	557,257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)	8,768,590円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	245,460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)	245,245,385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)	62,954,510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)	1,390,939,329円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,220,380,462円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	901,171,039円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	94,198,774円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	10,737,791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)	819,550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)	41,114,507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)	68,085,411円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,818,194円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	31,831,537円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,409,559円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	840,877円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,821,403円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	36,301,985円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	268,079,056円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	381,436,019円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,242,004,519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)	348,894,733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)	64,530,989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)	435,816,288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)	19,292,392円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,396,697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)	183,787,514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)	14,696,125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)	60,221,643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)	94,341,089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)	189,225,066円
計	98,331,117,304円
2. 受益権の総数	98,331,117,304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 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	2021年4月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）

株式	18,966,004,580
投資信託受益証券	45,856,453
投資証券	454,314,447
合計	19,466,175,480

（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（2021年2月16日から2021年4月12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	2021年4月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建	156,837,156	-	156,847,456	10,300	
アメリカ・ドル	80,219,940	-	80,225,276	5,336	
イギリス・ポンド	19,260,800	-	19,262,374	1,574	
オーストラリア・ドル	6,105,136	-	6,104,938	198	
カナダ・ドル	10,507,200	-	10,507,044	156	
ユーロ	40,744,080	-	40,747,824	3,744	
買建	136,392,349	-	136,848,484	456,135	
アメリカ・ドル	84,379,600	-	84,725,996	346,396	
イギリス・ポンド	9,166,897	-	9,179,810	12,913	
オーストラリア・ドル	7,703,620	-	7,693,932	9,688	
カナダ・ドル	5,309,257	-	5,341,117	31,860	
ユーロ	29,832,975	-	29,907,629	74,654	
合計	293,229,505	-	293,695,940	445,835	

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

#### 株式関連

種類	2021年4月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引					
先物取引					
買建	20,699,029,409	-	21,194,690,118	495,660,709	

合計	20,699,029,409	-	21,194,690,118	495,660,709
----	----------------	---	----------------	-------------

## (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)

	2021年4月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		5.1201円 (51,201円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2021年4月12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	36,305	3,372.200	122,427,721.000	
	ABBOTT LABORATORIES	150,581	120.900	18,205,242.900	
	AES CORP	58,916	27.720	1,633,151.520	
	ABIOMED INC	3,987	333.810	1,330,900.470	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	75,796	135.730	10,287,791.080	
	ADVANCED MICRO DEVICES	102,200	82.760	8,458,072.000	
	ADOBE INC	40,776	504.040	20,552,735.040	
	CHUBB LTD	38,231	160.690	6,143,339.390	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,689	284.360	5,314,404.040	
	ALLEGHANY CORP	898	660.750	593,353.500	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	70.540	426,908.080	
	ALLSTATE CORP	26,594	117.100	3,114,157.400	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	59,699	226.980	13,550,479.020	
	AMGEN INC	49,562	248.950	12,338,459.900	
	HESS CORP	24,776	73.800	1,828,468.800	
	AMERICAN EXPRESS CO	58,075	147.780	8,582,323.500	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	43,862	85.890	3,767,307.180	
	AFLAC INC	57,954	51.640	2,992,744.560	
	AMERICAN INTL GROUP	72,678	46.600	3,386,794.800	
	AMERCO	929	614.570	570,935.530	
ANALOG DEVICES	31,093	161.240	5,013,435.320		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,449	155.010	2,859,779.490		

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	60,719	61.760	3,750,005.440	
VALERO ENERGY CORP	37,400	71.090	2,658,766.000	
ANSYS INC	7,643	366.700	2,802,688.100	
APPLE INC	1,446,944	132.995	192,436,317.280	
APPLIED MATERIALS INC	77,629	138.910	10,783,444.390	
ALBEMARLE CORP	9,546	147.320	1,406,316.720	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48,789	58.540	2,856,108.060	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	81.770	758,662.060	
AMEREN CORP	22,273	80.530	1,793,644.690	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	115.690	769,454.190	
AUTOLIV INC	7,570	92.920	703,404.400	
AUTODESK INC	18,460	297.570	5,493,142.200	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	36,414	189.440	6,898,268.160	
AUTOZONE INC	2,054	1,438.500	2,954,679.000	
AVERY DENNISON CORP	7,627	197.130	1,503,510.510	
BALL CORP	26,848	89.860	2,412,561.280	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	116,548	266.010	31,002,933.480	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	70,629	48.620	3,433,981.980	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,966	84.920	3,648,672.720	
BECTON DICKINSON & CO	24,581	247.930	6,094,367.330	
AMETEK INC	18,720	131.290	2,457,748.800	
VERIZON COMM INC	352,802	57.490	20,282,586.980	
WR BERKLEY CORP	12,511	79.620	996,125.820	
BEST BUY CO INC	19,478	122.480	2,385,665.440	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,708	602.570	1,029,189.560	
YUM! BRANDS INC	25,239	114.960	2,901,475.440	
FIRSTENERGY CORP	47,800	34.770	1,662,006.000	
BOEING CO	45,620	252.360	11,512,663.200	
ROBERT HALF INTL INC	8,955	81.350	728,489.250	
BORGWARNER INC	21,938	46.480	1,019,678.240	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	120,360	39.320	4,732,555.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	97.450	1,142,016.550	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,579	184.020	1,762,727.580	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,130	1,222.410	2,603,733.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	192,001	62.610	12,021,182.610	
ONEOK INC	39,284	50.920	2,000,341.280	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	6,186	118.240	731,432.640	
UNITED RENTALS INC	6,451	324.710	2,094,704.210	

SEMPRA ENERGY	24,078	134.280	3,233,193.840	
FEDEX CORP	21,185	286.580	6,071,197.300	
VERISIGN INC	7,766	205.300	1,594,359.800	
AMPHENOL CORP	49,708	68.460	3,403,009.680	
BROWN-FORMAN CORP	25,320	70.980	1,797,213.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.350	616,813.600	
CSX CORP	64,552	98.290	6,344,816.080	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.380	546,010.080	
CAMPBELL SOUP CO	16,623	48.070	799,067.610	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	80.530	1,581,689.730	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,231	224.150	3,189,878.650	
CARDINAL HEALTH INC	25,949	60.050	1,558,237.450	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	64,967	29.300	1,903,533.100	
CATERPILLAR INC	46,042	230.750	10,624,191.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	115.370	1,138,125.050	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	142.340	1,413,863.220	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	80,424	12.820	1,031,035.680	
CERNER CORP	27,258	72.790	1,984,109.820	
JPMORGAN CHASE & CO	260,077	156.280	40,644,833.560	
CHURCH & DWIGHT CO INC	19,878	86.790	1,725,211.620	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	105.090	1,352,718.480	
CINTAS CORP	7,352	352.480	2,591,432.960	
CISCO SYSTEMS INC	359,389	52.090	18,720,573.010	
CLOROX COMPANY	11,142	190.130	2,118,428.460	
COCA-COLA CO/THE	347,445	53.180	18,477,125.100	
COPART INC	18,628	118.030	2,198,662.840	
COGNEX CORP	14,100	85.540	1,206,114.000	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,610	79.780	5,473,705.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	22,956	148.480	3,408,506.880	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	240.980	1,253,818.940	
NRG ENERGY, INC.	21,039	38.730	814,840.470	
COMCAST CORP-CL A	388,322	53.570	20,802,409.540	
CONAGRA BRANDS INC	43,383	36.190	1,570,030.770	
CONSOLIDATED EDISON INC	29,844	75.170	2,243,373.480	
CMS ENERGY CORP	25,936	60.460	1,568,090.560	
COOPER COS INC	4,321	386.050	1,668,122.050	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	50.000	825,650.000	
CORNING INC	64,261	44.750	2,875,679.750	
SEALED AIR CORP	13,870	46.690	647,590.300	
HEICO CORP-CL A	6,236	118.230	737,282.280	
CUMMINS INC	13,193	259.380	3,422,000.340	
DR HORTON INC	28,837	93.930	2,708,659.410	
DANAHER CORP	54,269	232.360	12,609,944.840	
MOODY'S CORP	14,168	314.290	4,452,860.720	



COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,276	80.550	3,646,981.800	
TARGET CORP	42,522	205.360	8,732,317.920	
DEERE & CO	25,162	377.000	9,486,074.000	
MORGAN STANLEY	119,118	80.720	9,615,204.960	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	103.550	1,981,532.800	
COSTAR GROUP INC	3,291	887.490	2,920,729.590	
THE WALT DISNEY CO	153,976	187.890	28,930,550.640	
DOLLAR TREE INC	19,806	117.550	2,328,195.300	
DOVER CORP	12,652	139.960	1,770,773.920	
OMNICOM GROUP	17,161	77.660	1,332,723.260	
DTE ENERGY CO	16,016	135.460	2,169,527.360	
DUKE ENERGY CORP	62,409	97.540	6,087,373.860	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,636	143.100	1,665,111.600	
EBAY INC	58,336	62.470	3,644,249.920	
BANK OF AMERICA CORP	663,233	39.990	26,522,687.670	
CITIGROUP INC	176,962	72.420	12,815,588.040	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,705	112.230	1,201,422.150	
EATON CORP PLC	33,574	140.450	4,715,468.300	
CADENCE DESIGN SYS INC	23,058	145.350	3,351,480.300	
DISH NETWORK CORP	21,420	37.560	804,535.200	
ECOLAB INC	21,503	219.440	4,718,618.320	
PERKINELMER INC	9,755	133.390	1,301,219.450	
ELECTRONIC ARTS INC	24,459	140.460	3,435,511.140	
SALESFORCE.COM INC	77,394	231.280	17,899,684.320	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	221.500	496,824.500	
EMERSON ELECTRIC CO	50,006	91.940	4,597,551.640	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	99.130	1,140,292.390	
ENTERGY CORP	17,338	101.140	1,753,565.320	
EOG RESOURCES INC	48,927	71.770	3,511,490.790	
EQUIFAX INC	10,182	185.810	1,891,917.420	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	19,170	302.120	5,791,640.400	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,073	108.920	1,532,831.160	
EXXON MOBIL CORP	359,727	55.870	20,097,947.490	
FMC CORP	11,416	111.880	1,277,222.080	
NEXTERA ENERGY INC	166,525	77.940	12,978,958.500	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	309.130	1,003,435.980	
FAIR ISAAC CORP	2,482	518.350	1,286,544.700	
ASSURANT INC	5,523	146.960	811,660.080	
FASTENAL CO	50,482	50.060	2,527,128.920	
FIFTH THIRD BANCORP	59,097	38.440	2,271,688.680	
M&T BANK CORP	10,244	153.630	1,573,785.720	
FISERV INC	48,409	124.290	6,016,754.610	
FORD MOTOR CO	328,346	12.510	4,107,608.460	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	30.680	819,585.520	
FREEMONT-MCMORAN INC	122,095	34.040	4,156,113.800	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	132.550	2,375,561.100	
DENTSPLY SIRONA INC	19,366	64.200	1,243,297.200	

GENERAL DYNAMICS CORP	20,623	183.000	3,774,009.000	
GENERAL MILLS INC	51,179	60.130	3,077,393.270	
GENUINE PARTS CO	11,643	116.890	1,360,950.270	
GILEAD SCIENCES INC	106,737	65.110	6,949,646.070	
GARTNER INC	7,895	188.190	1,485,760.050	
MCKESSON CORP	14,289	190.870	2,727,341.430	
NVIDIA CORP	52,661	576.000	30,332,736.000	
GENERAL ELECTRIC CO	743,782	13.600	10,115,435.200	
WW GRAINGER INC	3,622	401.620	1,454,667.640	
HALLIBURTON CO	77,483	21.070	1,632,566.810	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,919	95.290	3,136,851.510	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,675	330.810	9,155,166.750	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	17,810	208.120	3,706,617.200	
HASBRO INC	11,383	95.240	1,084,116.920	
HENRY SCHEIN INC	12,161	69.390	843,851.790	
HEICO CORP	3,623	131.340	475,844.820	
HERSHEY FOODS CORP	12,044	159.500	1,921,018.000	
HP INC	115,849	32.980	3,820,700.020	
F5 NETWORKS INC	5,529	210.420	1,163,412.180	
CROWN HOLDINGS INC NPR	10,348	104.870	1,085,194.760	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	25.410	709,929.990	
HOLOGIC INC	21,443	73.630	1,578,848.090	
HOME DEPOT INC	91,713	319.230	29,277,540.990	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	77.070	1,255,316.160	
HORMEL FOODS CORP	26,254	46.350	1,216,872.900	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	23.240	1,140,270.600	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	332.420	968,339.460	
HUMANA INC	11,155	417.740	4,659,889.700	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	169.510	1,278,783.440	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	93,857	16.270	1,527,053.390	
BIOGEN INC	13,023	268.170	3,492,377.910	
IDEX CORP	5,774	217.420	1,255,383.080	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,407	222.630	5,878,990.410	
INTUIT INC	22,222	417.610	9,280,129.420	
IDEXX LABORATORIES INC	7,042	502.880	3,541,280.960	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	42.360	464,265.600	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,173	169.550	3,420,332.150	
INTEL CORP	348,814	68.260	23,810,043.640	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	19,906	140.280	2,792,413.680	
INTERNATIONAL PAPER CO	32,598	54.940	1,790,934.120	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	29.400	1,038,319.800	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10,502	135.110	1,418,925.220	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	155.720	1,070,419.280	
INCYTE CORP	15,341	79.960	1,226,666.360	
JOHNSON & JOHNSON	224,116	161.250	36,138,705.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,886	66.790	2,129,665.940	
KLA CORPORATION	13,096	352.850	4,620,923.600	
DEVON ENERGY CORP	49,345	22.040	1,087,563.800	
KELLOGG CO	22,333	62.660	1,399,385.780	
KEYCORP	79,472	20.610	1,637,917.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	28,412	136.690	3,883,636.280	
BLACKROCK INC/NEW YORK	12,926	808.350	10,448,732.100	
KROGER CO	71,262	37.780	2,692,278.360	
LAM RESEARCH CORP	12,215	662.000	8,086,330.000	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	419.720	1,385,915.440	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	137.840	1,163,093.920	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	103.870	1,470,072.110	
PLUG POWER INC	42,511	32.300	1,373,105.300	
LENNAR CORP	24,511	105.520	2,586,400.720	
ELI LILLY & CO	73,165	184.490	13,498,210.850	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	62.700	1,134,243.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	60,851	175.940	10,706,124.940	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	25,661	131.910	3,384,942.510	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,476	386.230	8,294,675.480	
LOEWS CORP	16,956	53.610	909,011.160	
LOWE'S COS INC	62,278	198.510	12,362,805.780	
DOMINION ENERGY INC	68,891	76.300	5,256,383.300	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,870	41.770	1,707,139.900	
MCCORMICK & CO INC	19,416	88.110	1,710,743.760	
MCDONALD'S CORPORATION	63,524	231.480	14,704,535.520	
S&P GLOBAL INC	20,364	369.100	7,516,352.400	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	254.770	870,294.320	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,174.920	1,411,078.920	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	52,402	85.990	4,506,047.980	
MARSH & MCLENNAN COS	43,065	126.180	5,433,941.700	
MASCO CORP	23,151	62.980	1,458,049.980	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,123	346.040	1,772,762.920	
METLIFE INC	67,434	61.920	4,175,513.280	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,591	95.770	2,259,310.070	
MEDTRONIC PLC	114,289	122.000	13,943,258.000	

ACTIVISION BLIZZARD INC	65,490	95.780	6,272,632.200	
CVS HEALTH CORP	111,087	74.070	8,228,214.090	
MERCK & CO. INC.	215,294	76.310	16,429,085.140	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	36,651	42.960	1,574,526.960	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,588	254.750	2,187,793.000	
MICROSOFT CORP	611,577	255.850	156,471,975.450	
MICRON TECH INC	94,390	95.300	8,995,367.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	21,852	161.730	3,534,123.960	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	56,605	49.600	2,807,608.000	
3M CO	49,087	198.000	9,719,226.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	202.930	1,009,779.680	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,021	191.060	2,678,852.260	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	262.200	2,188,321.200	
ILLUMINA INC	12,362	403.370	4,986,459.940	
XCEL ENERGY INC	46,591	67.430	3,141,631.130	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	93.350	752,214.300	
NETAPP INC	19,804	73.880	1,463,119.520	
NEWELL BRANDS INC	33,317	27.030	900,558.510	
NEWMONT CORP	67,812	61.510	4,171,116.120	
NVR INC	308	4,902.130	1,509,856.040	
NIKE INC-CL B	106,971	135.450	14,489,221.950	
NORDSON CORP	4,644	203.120	943,289.280	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,428	272.490	5,838,915.720	
EVERSOURCE ENERGY	28,392	86.180	2,446,822.560	
NISOURCE INC	33,097	24.710	817,826.870	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	108.720	1,887,922.800	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,126	339.950	4,802,133.700	
WELLS FARGO & CO	334,139	40.500	13,532,629.500	
NUCOR CORP	26,612	80.290	2,136,677.480	
CHENIERE ENERGY INC	19,976	73.120	1,460,645.120	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	38,373	134.170	5,148,505.410	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	78,449	24.590	1,929,060.910	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,821	249.280	1,949,618.880	
OGE ENERGY CORP	16,028	32.200	516,101.600	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,576	516.710	3,397,884.960	
ORACLE CORP	166,555	75.580	12,588,226.900	
PACCAR INC	30,769	93.360	2,872,593.840	
PTC INC	9,801	146.040	1,431,338.040	
EXELON CORP	81,572	44.830	3,656,872.760	
PARKER HANNIFIN CORP	10,734	321.090	3,446,580.060	
PAYCHEX INC	27,217	96.360	2,622,630.120	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,331	592.560	3,751,497.360	

PPL CORPORATION	60,646	28.640	1,736,901.440	
PEPSICO INC	117,695	142.570	16,779,776.150	
PENTAIR PLC	12,644	62.070	784,813.080	
PFIZER INC	472,948	36.600	17,309,896.800	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,211	45.450	918,589.950	
CONOCOPHILLIPS	114,576	51.230	5,869,728.480	
PG&E CORP	123,999	11.510	1,427,228.490	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	18,337	147.190	2,699,023.030	
ALTRIA GROUP INC	158,373	51.490	8,154,625.770	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,681	180.210	6,430,073.010	
BROWN & BROWN INC	20,308	47.830	971,331.640	
GARMIN LTD	12,365	137.650	1,702,042.250	
PPG INDUSTRIES INC	21,001	150.470	3,160,020.470	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	238.710	800,394.630	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,511	363.210	13,624,370.310	
T ROWE PRICE GROUP INC	18,759	179.520	3,367,615.680	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	126.690	1,510,904.940	
PROCTER & GAMBLE CO	211,260	136.370	28,809,526.200	
PROGRESSIVE CORP	49,860	95.680	4,770,604.800	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	44,503	61.250	2,725,808.750	
PULTE GROUP INC	21,939	54.560	1,196,991.840	
GLOBAL PAYMENTS INC	25,351	213.300	5,407,368.300	
QUALCOMM INC	96,191	140.570	13,521,568.870	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	127.030	1,364,810.320	
EXACT SCIENCES CORP	13,911	125.540	1,746,386.940	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,691	169.020	623,852.820	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,891	475.170	4,224,736.470	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	129.150	787,427.550	
RESMED INC	12,108	199.160	2,411,429.280	
US BANCORP	115,025	57.290	6,589,782.250	
SEAGEN INC	10,602	142.850	1,514,495.700	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	40.060	1,377,382.980	
ROSS STORES INC	29,812	128.220	3,822,494.640	
ROLLINS INC	18,567	35.430	657,828.810	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,769	421.580	3,696,835.020	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,692	264.590	2,564,406.280	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,567	89.880	1,848,561.960	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	91.760	1,009,727.040	
ACCENTURE PLC-CL A	53,936	287.710	15,517,926.560	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	120,849	58.850	7,111,963.650	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,818	239.980	2,596,103.640	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	22,302	151.650	3,382,098.300	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	52,840	149.930	7,922,301.200	
BOOKING HOLDINGS INC	3,471	2,450.060	8,504,158.260	
SCHLUMBERGER LTD	116,310	26.760	3,112,455.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	129,941	67.570	8,780,113.370	
POOL CORP	3,532	369.490	1,305,038.680	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	18,291	169.480	3,099,958.680	
BUNGE LTD	10,954	79.450	870,295.300	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	62.710	668,049.630	
ANTHEM INC	21,104	361.010	7,618,755.040	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	116.810	1,616,183.160	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	61.960	1,551,354.480	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	20,620	255.290	5,264,079.800	
CENTENE CORP	48,785	62.610	3,054,428.850	
SVB FINANCIAL GROUP	4,631	497.690	2,304,802.390	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	67.270	763,581.770	
SNAP-ON INC	3,976	235.590	936,705.840	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	31,837	94.350	3,003,820.950	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	183.970	1,145,397.220	
EDISON INTERNATIONAL	31,223	59.710	1,864,325.330	
SOUTHERN CO	88,870	62.730	5,574,815.100	
TRUIST FINANCIAL CORP	113,764	60.020	6,828,115.280	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	63.420	838,412.400	
AT&T INC	607,265	30.040	18,242,240.600	
CHEVRON CORP	163,751	102.920	16,853,252.920	
STANLEY BLACK & DECKER INC	14,274	201.910	2,882,063.340	
STATE STREET CORP	29,438	86.470	2,545,503.860	
STARBUCKS CORP	99,749	113.180	11,289,591.820	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	51.190	898,230.930	
STRYKER CORP	28,616	253.320	7,249,005.120	
NETFLIX INC	37,545	555.310	20,849,113.950	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	21.930	1,073,583.150	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	50.080	490,433.440	
SYNOPSIS INC	12,609	261.850	3,301,666.650	
SYSCO CORP	40,556	80.860	3,279,358.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,922	784.480	7,783,610.560	
TELEFLEX INC	4,122	427.090	1,760,464.980	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	11.040	975,074.880	
TERADYNE INC	14,284	133.060	1,900,629.040	
TEXAS INSTRUMENTS INC	78,300	195.430	15,302,169.000	

TEXTRON INC	19,486	58.380	1,137,592.680	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,676	478.880	16,126,762.880	
GLOBE LIFE INC	8,329	99.410	827,985.890	
DAVITA INC	6,497	109.000	708,173.000	
TRACTOR SUPPLY CO	10,462	177.690	1,858,992.780	
TRIMBLE INC	20,280	80.400	1,630,512.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,534	442.670	1,564,395.780	
TYSON FOODS INC	24,155	76.560	1,849,306.800	
UGI CORP	14,379	41.900	602,480.100	
UNION PACIFIC CORP	57,357	223.240	12,804,376.680	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	128,936	78.290	10,094,399.440	
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,749	376.300	30,385,848.700	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	138.180	1,069,098.660	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,139	177.210	1,442,312.190	
VF CORP	29,520	84.940	2,507,428.800	
VIACOMCBS INC	50,493	41.880	2,114,646.840	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,012	213.350	4,696,260.200	
VULCAN MATERIALS CO	10,992	172.530	1,896,449.760	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,288	54.180	3,374,763.840	
WALMART INC	120,802	139.780	16,885,703.560	
WASTE MANAGEMENT INC	35,667	134.680	4,803,631.560	
WATERS CORP	5,084	307.140	1,561,499.760	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,458	296.520	1,914,926.160	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	128.210	1,321,332.260	
VAIL RESORTS INC	3,590	304.390	1,092,760.100	
WESTERN DIGITAL CORP	27,103	72.930	1,976,621.790	
WABTEC CORP	14,123	79.520	1,123,060.960	
WHIRLPOOL CORP	5,005	236.990	1,186,134.950	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	13,987	188.730	2,639,766.510	
WYNN RESORTS LTD	8,309	131.390	1,091,719.510	
NASDAQ INC	10,097	156.100	1,576,141.700	
CME GROUP INC	30,424	204.630	6,225,663.120	
WILLIAMS COS INC	101,276	23.600	2,390,113.600	
LKQ CORP	25,055	44.080	1,104,424.400	
ALLIANT ENERGY CORP	18,893	54.010	1,020,410.930	
WEC ENERGY GROUP INC	26,247	92.350	2,423,910.450	
CARMAX INC	14,684	131.630	1,932,854.920	
XILINX INC	20,603	129.720	2,672,621.160	
TJX COMPANIES INC	101,134	69.450	7,023,756.300	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,459	507.510	2,262,987.090	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.970	540,239.000	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	64.240	1,323,344.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	33.030	564,813.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,239	138.230	1,415,336.970	
CBRE GROUP INC	27,871	80.420	2,241,385.820	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	25.810	328,612.920	
REGIONS FINANCIAL CORP	85,582	21.230	1,816,905.860	
DOMINO'S PIZZA INC	3,317	390.350	1,294,790.950	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	3,737	376.870	1,408,363.190	
T-MOBILE US INC	47,449	129.030	6,122,344.470	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,277	61.940	1,875,357.380	
MOSAIC CO/THE	32,592	31.470	1,025,670.240	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,402	534.560	1,818,573.120	
CELANESE CORP	10,141	152.330	1,544,778.530	
DEXCOM INC	8,096	382.890	3,099,877.440	
DISCOVERY INC-A	14,886	42.000	625,212.000	
EXPEDIA GROUP INC	11,410	174.980	1,996,521.800	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	46.010	850,034.750	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,707	240.790	2,337,348.530	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	25.710	874,731.330	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	47,255	117.170	5,536,868.350	
LIVE NATION	13,804	86.000	1,187,144.000	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,232	1,531.420	3,418,129.440	
TRANSDIGM GROUP INC	4,297	615.240	2,643,686.280	
MASTERCARD INC	75,764	380.080	28,796,381.120	
WESTERN UNION CO	35,367	25.190	890,894.730	
OWENS CORNING	8,304	96.850	804,242.400	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	100.660	1,295,091.560	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	20.310	352,378.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,959	156.000	1,553,604.000	
DELTA AIR LINES INC	14,723	49.270	725,402.210	
INSULET CORP	6,122	287.130	1,757,809.860	
DISCOVER FINANCIAL	27,544	100.180	2,759,357.920	
TE CONNECTIVITY LTD	27,350	131.540	3,597,619.000	
MASIMO CORP	4,505	234.170	1,054,935.850	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,458	318.120	3,326,898.960	
VMWARE INC	7,464	154.000	1,149,456.000	
MERCADOLIBRE INC	3,800	1,584.730	6,021,974.000	
ULTA BEAUTY INC	4,737	322.220	1,526,356.140	
INVESCO LTD	33,443	26.320	880,219.760	



MSCI INC	7,461	448.500	3,346,258.500	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	132,760	91.070	12,090,453.200	
VISA INC	144,543	222.520	32,163,708.360	
KEURIG DR PEPPER INC	48,480	35.170	1,705,041.600	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	16,083	151.680	2,439,469.440	
DISCOVERY INC-C	24,122	35.740	862,120.280	
MARATHON PETROLEUM CORP	54,652	52.830	2,887,265.160	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	100.690	1,182,503.360	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	170,023	16.530	2,810,480.190	
XYLEM INC	14,341	108.000	1,548,828.000	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	104.080	2,564,114.880	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	206.870	720,735.080	
SPLUNK INC	13,441	142.270	1,912,251.070	
EPAM SYSTEMS INC	4,954	423.060	2,095,839.240	
ZILLOW GROUP INC	4,265	147.600	629,514.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	47.030	696,702.420	
HCA HEALTHCARE INC	22,757	190.880	4,343,856.160	
VERISK ANALYTICS INC	13,730	182.700	2,508,471.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,257	161.400	848,479.800	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,713	286.420	1,922,737.460	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	14,394	171.800	2,472,889.200	
NXP SEMICONDUCTOR NV	23,642	209.190	4,945,669.980	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	82.260	959,727.420	
LEAR CORP	4,681	179.010	837,945.810	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,704	100.090	871,183.360	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	72.430	1,466,200.490	
DOLLAR GENERAL CORP	22,156	206.660	4,578,758.960	
FORTINET INC	12,146	197.620	2,400,292.520	
HORIZON PHARMA PLC	19,642	91.480	1,796,850.160	
TESLA INC	64,513	677.020	43,676,591.260	
GENERAC HOLDINGS INC	5,632	330.410	1,860,869.120	
ENPHASE ENERGY INC	10,163	151.350	1,538,170.050	
GENERAL MOTORS CO	109,071	60.160	6,561,711.360	
XPO LOGISTICS INC	7,614	131.330	999,946.620	
ALLY FINANCIAL INC	30,467	47.150	1,436,519.050	
VOYA FINANCIAL INC	10,611	66.520	705,843.720	
APTIV PLC	24,029	142.430	3,422,450.470	
PHILLIPS 66	36,465	79.030	2,881,828.950	

GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	104.070	746,390.040	
FACEBOOK INC	204,656	312.460	63,946,813.760	
IQVIA HOLDINGS INC	16,046	207.660	3,332,112.360	
SERVICENOW INC	16,504	530.000	8,747,120.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,027	349.510	2,805,516.770	
WORKDAY INC	15,141	257.610	3,900,473.010	
ABBVIE INC	150,153	107.540	16,147,453.620	
ZOETIS INC	40,091	159.850	6,408,546.350	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,862	26.680	823,398.160	
CDW CORP	11,795	175.440	2,069,314.800	
HOWMET AEROSPACE INC	34,315	32.230	1,105,972.450	
TWILIO INC	11,862	368.240	4,368,062.880	
COUPA SOFTWARE INC	5,718	265.260	1,516,756.680	
SNAP INC	78,492	63.270	4,966,188.840	
TRADE DESK INC A	3,760	692.560	2,604,025.600	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	14,827	45.480	674,331.960	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	46.720	388,897.280	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	46.830	665,220.150	
OKTA INC	9,828	244.260	2,400,587.280	
BLACK KNIGHT INC	13,669	74.880	1,023,534.720	
BAKER HUGHES CO	56,969	20.110	1,145,646.590	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	77.410	1,020,341.210	
ALTICE USA INC-A	21,506	32.730	703,891.380	
BROADCOM INC	34,416	485.090	16,694,857.440	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,293	317.300	1,996,768.900	
MONGODB INC	4,349	297.960	1,295,828.040	
BURLINGTON STORES INC	5,894	324.700	1,913,781.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	29.750	1,065,764.000	
VEEVA SYSTEMS INC	11,319	264.230	2,990,819.370	
TWITTER INC	67,415	71.190	4,799,273.850	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	58.550	773,679.700	
EVERGY INC	18,131	60.660	1,099,826.460	
ALLEGION PLC	7,353	131.690	968,316.570	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	89.660	1,026,965.640	
STERIS PLC	7,390	199.150	1,471,718.500	
DOCUSIGN INC	15,982	212.970	3,403,686.540	
WIX.COM LTD	4,918	298.180	1,466,449.240	
DROPBOX INC	28,170	26.990	760,308.300	
KKR & CO INC	42,868	51.330	2,200,414.440	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	16,541	322.650	5,336,953.650	
MODERNA INC	23,442	140.920	3,303,446.640	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,623	124.350	2,813,170.050	
ARAMARK	17,359	38.890	675,091.510	
CIGNA CORP	30,647	246.100	7,542,226.700	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,759	93.880	1,948,854.920	

DOW INC	61,683	63.140	3,894,664.620	
AMCOR PLC	125,600	11.730	1,473,288.000	
PINTEREST INC	43,223	85.530	3,696,863.190	
PELTON INTERACTIVE INC	20,525	118.600	2,434,265.000	
FOX CORP-A	31,751	37.460	1,189,392.460	
FOX CORP-B	13,009	36.080	469,364.720	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	14,762	202.680	2,991,962.160	
CHEWY INC	6,586	84.100	553,882.600	
AVANTOR INC	44,509	31.730	1,412,270.570	
DYNATRACE INC	15,949	52.890	843,542.610	
CLOUDFLARE INC	16,628	70.880	1,178,592.640	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	78.950	557,781.750	
CARRIER GLOBAL CORP	68,808	42.750	2,941,542.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	33,388	70.750	2,362,201.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	82,351	57.680	4,750,005.680	
CORTEVA INC	61,954	47.130	2,919,892.020	
MATCH GROUP INC	21,285	143.870	3,062,272.950	
SLACK TECHNOLOGIES INC	38,755	42.290	1,638,948.950	
BLACKSTONE GROUP INC	56,804	76.900	4,368,227.600	
CARLYLE GROUP INC	12,509	38.010	475,467.090	
10X GENOMICS INC	5,312	194.640	1,033,927.680	
DATADOG INC	14,775	88.800	1,312,020.000	
INGERSOLL RAND INC	31,282	50.580	1,582,243.560	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	381.230	1,650,725.900	
PPD INC	10,828	38.300	414,712.400	
AON PLC	19,301	237.000	4,574,337.000	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	241.260	1,704,260.640	
AIRBNB INC	4,882	179.500	876,319.000	
ZENDESK INC	9,370	144.340	1,352,465.800	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	42.310	713,388.910	
VIATRIS INC	103,126	13.395	1,381,372.770	
DRAFTKINGS INC	14,671	62.310	914,150.010	
SNOWFLAKE INC	2,127	226.890	482,595.030	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	315.550	1,591,003.100	
IHS MARKIT LTD	31,494	101.650	3,201,365.100	
FNF GROUP	24,567	43.660	1,072,595.220	
CATALENT INC	14,673	109.260	1,603,171.980	
SYNCHRONY FINANCIAL	46,538	42.800	1,991,826.400	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	37,788	45.370	1,714,441.560	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	135.750	469,287.750	
WAYFAIR INC	5,840	327.490	1,912,541.600	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16,395	146.230	2,397,440.850	
HUBSPOT INC	3,654	516.560	1,887,510.240	
QORVO INC	10,168	191.860	1,950,832.480	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	1,162	143.540	166,793.480	

	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,950	148.180	2,215,291.000	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	29.870	508,327.660	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,257	263.950	1,123,635.150	
	GODADDY INC	14,540	85.490	1,243,024.600	
	ETSY INC	10,580	218.570	2,312,470.600	
	TRANSUNION	16,760	95.850	1,606,446.000	
	SQUARE INC	32,546	261.650	8,515,660.900	
	DUPONT DE NEMOURS INC	45,230	75.860	3,431,147.800	
	CARVANA CO	5,347	271.300	1,450,641.100	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	53.860	985,422.560	
	TELADOC HEALTH INC	9,788	181.260	1,774,172.880	
	WESTROCK CO	22,778	52.800	1,202,678.400	
	KRAFT HEINZ CO	56,429	40.140	2,265,060.060	
	NOVOCURE LTD	7,408	132.090	978,522.720	
	FORTIVE CORP	23,950	70.960	1,699,492.000	
	WASTE CONNECTIONS INC	23,285	114.490	2,665,899.650	
	ALPHABET INC-CL A	25,682	2,270.670	58,315,346.940	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	103,208	15.790	1,629,654.320	
	PAYPAL HOLDINGS INC	94,688	266.770	25,259,917.760	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	33.250	1,172,960.250	
	SUNRUN INC	10,000	51.600	516,000.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	13,376	145.110	1,940,991.360	
	ALPHABET INC-CL C	25,182	2,285.880	57,563,030.160	
	ZSCALER INC	6,609	185.040	1,222,929.360	
	CABLE ONE INC	392	1,786.750	700,406.000	
	LINDE PLC	44,578	284.800	12,695,814.400	
	ATHENE HOLDING LTD	8,838	50.450	445,877.100	
	ROKU INC	9,202	373.660	3,438,419.320	
	AVALARA INC	7,102	142.560	1,012,461.120	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	11,819	614.240	7,259,702.560	
	VISTRA CORP	38,032	17.500	665,560.000	
アメリカ・ドル	小計	26,662,744		3,091,966,859.900 (339,343,362,872)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	17.300	610,015.300	
	ASHTED GROUP	39,955	45.730	1,827,142.150	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	24.060	527,707.980	
	BHP GROUP PLC	177,855	21.500	3,823,882.500	
	BARCLAYS PLC	1,454,662	1.857	2,701,307.330	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	80,307	7.946	638,119.420	
	BT GROUP PLC	795,507	1.535	1,221,103.240	
	BUNZL PLC	28,834	24.090	694,611.060	
	AVIVA PLC	315,962	4.046	1,278,382.250	

CRODA INTERNATIONAL	12,568	66.120	830,996.160	
DIAGEO PLC	198,641	31.830	6,322,743.030	
SCHRODERS PLC	11,354	36.260	411,696.040	
DCC PLC	7,898	62.940	497,100.120	
NATIONAL GRID PLC	310,448	9.005	2,795,584.240	
KINGFISHER PLC	168,984	3.439	581,135.970	
BAE SYSTEMS PLC	268,285	5.150	1,381,667.750	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	195,213	27.860	5,438,634.180	
HALMA PLC	29,184	25.590	746,818.560	
NEXT PLC	11,467	82.960	951,302.320	
IMPERIAL BRANDS PLC	79,783	15.420	1,230,253.860	
JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	31.340	598,813.380	
ANGLO AMERICAN PLC	103,119	30.830	3,179,158.770	
COMPASS GROUP PLC	148,354	15.585	2,312,097.090	
HSBC HOLDINGS PLC	1,733,425	4.374	7,582,000.950	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	521,984	2.964	1,547,160.570	
UNILEVER PLC	219,416	41.310	9,064,074.960	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.827	420,597.320	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	9.578	648,564.690	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	95,487	6.836	652,749.130	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	24.840	774,163.440	
PEARSON PLC	65,009	8.058	523,842.520	
PERSIMMON PLC	28,126	32.100	902,844.600	
PRUDENTIAL PLC	219,690	15.575	3,421,671.750	
RIO TINTO PLC	92,663	56.630	5,247,505.690	
VODAFONE GROUP PLC	2,261,808	1.346	3,044,393.560	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	63,262	66.110	4,182,250.820	
RELX PLC	162,911	19.105	3,112,414.650	
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	5.142	872,936.770	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	746,540	1.118	834,631.720	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.966	831,724.160	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	13.430	668,666.270	
SSE PLC	90,917	15.415	1,401,485.550	
BP PLC	1,715,850	2.950	5,061,757.500	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,238	6.522	568,966.230	
SMITHS GROUP PLC	29,094	16.135	469,431.690	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	122.400	804,657.600	
STANDARD CHARTERED PLC	240,093	4.975	1,194,462.670	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,262,988	0.432	2,705,610.810	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.900	658,908.600	
TESCO PLC	679,368	2.344	1,592,438.590	

3I GROUP PLC	76,050	12.410	943,780.500		
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	14.000	1,076,992.000		
GLAXOSMITHKLINE PLC	425,704	13.196	5,617,589.980		
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,667	74.780	1,994,158.260		
WPP PLC	95,372	9.436	899,930.190		
ASTRAZENECA PLC	111,539	72.870	8,127,846.930		
WHITBREAD PLC	18,594	34.660	644,468.040		
INTERTEK GROUP PLC	13,842	60.540	837,994.680		
BURBERRY GROUP PLC	32,218	20.440	658,535.920		
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	51.620	859,576.240		
SAINSBURY (J) PLC	132,694	2.456	325,896.460		
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	31.500	500,629.500		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	9,184	46.340	425,586.560		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	339,058	13.958	4,732,571.560		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	322,365	13.354	4,304,862.210		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	12,491	24.330	303,906.030		
AVEVA GROUP PLC	10,408	37.760	393,006.080		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	3.015	622,033.690		
EXPERIAN PLC	76,868	26.530	2,039,308.040		
MONDI PLC	38,299	19.075	730,553.420		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	16.670	466,943.370		
FRESNILLO PLC NPR	17,385	8.944	155,491.440		
OCADO GROUP PLC	42,789	21.500	919,963.500		
INFORMA PLC	128,510	5.842	750,755.420		
GLENCORE PLC	839,927	2.887	2,424,869.240		
ENTAIN PLC	49,618	15.665	777,265.970		
EVRAZ PLC	48,765	5.992	292,199.880		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	3.031	341,575.510		
COCA-COLA HBC AG	15,208	24.130	366,969.040		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	32,247	7.486	241,401.040		
FERGUSON PLC	20,531	93.100	1,911,436.100		
M&G PLC	204,940	2.180	446,769.200		
JD SPORTS FASHION PLC	36,811	9.170	337,556.870		
AUTO TRADER GROUP PLC	81,805	5.694	465,797.670		
MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.736	737,235.800		
イギリス・ポンド 小計	25,296,674		146,065,641.850 (21,981,418,442)		
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	27.070	2,770,858.130	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	23.120	3,021,853.360	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	475.900	837,584.000	

	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	14.290	1,459,494.860	
	ICL GROUP LTD	68,048	21.040	1,431,729.920	
	NICE LTD	5,535	761.500	4,214,902.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	89.400	933,693.600	
	AZRIELI GROUP	4,414	215.200	949,892.800	
イスラエル・シュケル 小計		425,397		15,620,009.170 (520,593,038)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	67.640	1,140,004.560	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	239,197	28.740	6,874,521.780	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	305,187	25.210	7,693,764.270	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	143,130	20.890	2,989,985.700	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.430	1,249,922.870	
	AMP LTD	302,414	1.260	381,041.640	
	ASX LTD	15,518	72.780	1,129,400.040	
	BHP GROUP LTD	251,772	46.670	11,750,199.240	
	AMPOL LTD	20,946	24.570	514,643.220	
	COMPUTERSHARE LT	36,593	14.870	544,137.910	
	CSL LIMITED	38,626	263.400	10,174,088.400	
	REA GROUP LTD	4,278	154.990	663,047.220	
	TRANSURBAN GROUP	227,413	13.670	3,108,735.710	
	COCA-COLA AMATIL LTD	38,083	13.470	512,978.010	
	COCHLEAR LTD	5,743	216.520	1,243,474.360	
	ORIGIN ENERGY LTD	128,224	4.740	607,781.760	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	151,013	87.130	13,157,762.690	
	RIO TINTO LIMITED	33,859	115.500	3,910,714.500	
	APA GROUP	118,205	10.190	1,204,508.950	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	36.790	1,902,668.430	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	4.890	1,101,130.200	
	TPG TELECOM LTD	28,719	6.350	182,365.650	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,293	42.850	1,512,305.050	
	ORICA LTD	41,311	14.570	601,901.270	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	17.740	154,497.660	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	13.380	831,112.080	
	BLUESCOPE STEEL LTD	35,840	20.270	726,476.800	
SYDNEY AIRPORT	116,056	6.100	707,941.600		
MACQUARIE GROUP LTD	28,655	154.800	4,435,794.000		
SUNCORP GROUP LTD	90,403	10.340	934,767.020		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	277,215	26.720	7,407,184.800		
NEWCREST MINING LTD	73,202	26.700	1,954,493.400		
OIL SEARCH LTD	148,835	4.110	611,711.850		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	5.450	339,436.900		

	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,924	9.780	1,153,296.720	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	10.900	1,018,103.600	
	SANTOS LTD	159,618	7.070	1,128,499.260	
	SONIC HEALTHCARE	40,148	35.480	1,424,451.040	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	32.850	276,137.100	
	TABCORP HOLDINGS LTD	156,971	4.940	775,436.740	
	WESFARMERS LTD	94,366	54.170	5,111,806.220	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	24.320	2,096,286.720	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	106,308	41.230	4,383,078.840	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	47.980	479,560.100	
	SEEK LTD	28,713	31.390	901,301.070	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.880	310,324.080	
	AGL ENERGY LTD	49,076	9.640	473,092.640	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.660	1,355,589.560	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.200	400,904.200	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.580	645,615.120	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.970	596,095.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	10.270	592,240.090	
	XERO LTD	10,498	138.900	1,458,172.200	
	AFTERPAY LTD	18,322	121.470	2,225,573.340	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	2.870	812,651.980	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.920	1,204,047.400	
	COLES GROUP LTD	121,032	15.850	1,918,357.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	31.010	421,860.040	
	オーストラリア・ドル 小計	6,210,951		123,416,980.300 (10,321,362,062)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,375	76.130	1,627,278.750	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	71,520	41.370	2,958,782.400	
	BARRICK GOLD CORP	156,423	26.570	4,156,159.110	
	ATCO LTD	7,193	42.150	303,184.950	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	29.220	621,567.840	
	BANK OF MONTREAL	54,077	114.890	6,212,906.530	
	BANK OF NOVA SCOTIA	102,409	78.320	8,020,672.880	
	NATIONAL BANK OF CANADA	27,716	86.000	2,383,576.000	
	BCE INC	14,959	57.900	866,126.100	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	107,955	57.070	6,160,991.850	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	38.590	1,087,929.280	
	SAPUTO INC	25,395	38.920	988,373.400	
	BLACKBERRY LTD	46,671	11.420	532,982.820	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	40,180	20.580	826,904.400	



CGI INC	19,859	105.360	2,092,344.240	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	70.200	1,078,131.600	
CAE INC	25,006	39.070	976,984.420	
CAMECO CORP	32,627	21.580	704,090.660	
ROGERS COMM-CL B	31,543	60.470	1,907,405.210	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,526	123.910	4,649,846.660	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	99,187	38.570	3,825,642.590	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	183.450	891,933.900	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	34.130	311,231.470	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,280	147.220	8,874,421.600	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.830	491,568.110	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	41.630	662,374.930	
OPEN TEXT CORP	20,344	61.870	1,258,683.280	
EMPIRE CO LTD	15,093	40.590	612,624.870	
KINROSS GOLD CORP	90,273	9.270	836,830.710	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	78.220	779,305.860	
FORTIS INC	39,632	54.790	2,171,437.280	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	27.810	1,381,990.140	
TELUS CORP	31,890	25.820	823,399.800	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	34.410	868,852.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	30.930	666,294.060	
ENBRIDGE INC	171,712	46.220	7,936,528.640	
IGM FINANCIAL INC	6,069	39.330	238,693.770	
MANULIFE FINANCIAL CORP	169,194	27.020	4,571,621.880	
LOBLAW CO LTD	15,136	70.200	1,062,547.200	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,626	112.000	2,646,112.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	50,646	64.360	3,259,576.560	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	570.420	1,367,867.160	
METRO INC	21,394	58.780	1,257,539.320	
EMERA INC	22,433	56.440	1,266,118.520	
ONEX CORP	6,646	79.640	529,287.440	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	42.000	788,172.000	
POWER CORP OF CANADA	42,216	33.930	1,432,388.880	
QUEBECOR INC-B	16,042	34.580	554,732.360	
ROYAL BANK OF CANADA	121,556	117.110	14,235,423.160	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,276	471.080	5,311,898.080	
SHAW COMM INC-B	39,427	33.570	1,323,564.390	
SUNCOR ENERGY INC	126,506	26.130	3,305,601.780	
LUNDIN MINING CORP	64,310	13.840	890,050.400	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	24.820	1,018,017.120	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	114.050	1,716,338.450	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	97.640	724,195.880	

TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	154,065	82.880	12,768,907.200	
TC ENERGY CORP	79,381	58.680	4,658,077.080	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	101.000	727,200.000	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	111.820	691,494.880	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	158.960	1,989,384.400	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	35,022	52.640	1,843,558.080	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,665	1,879.110	3,128,718.150	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	15,847	169.270	2,682,421.690	
B2GOLD CORP	101,675	5.930	602,932.750	
KEYERA CORP	16,668	26.110	435,201.480	
PARKLAND CORP	14,497	38.800	562,483.600	
ALTAGAS LTD	23,944	21.400	512,401.600	
PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	36.580	1,843,997.800	
DOLLARAMA INC	26,906	56.630	1,523,686.780	
CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	9.510	1,138,432.590	
NORTHLAND POWER INC	17,568	46.640	819,371.520	
TMX GROUP LTD	5,058	135.630	686,016.540	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	46.180	1,008,571.200	
INTER PIPELINE LTD	41,863	18.050	755,627.150	
NUTRIEN LTD	47,599	68.750	3,272,431.250	
SSR MINING INC	18,000	19.640	353,520.000	
WSP GLOBAL INC	10,194	124.540	1,269,560.760	
IA FINANCIAL CORP INC	8,771	69.730	611,601.830	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	45.590	751,551.150	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	59.310	643,216.950	
AIR CANADA	10,722	26.840	287,778.480	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	83.690	2,106,979.440	
SHOPIFY INC	9,338	1,537.030	14,352,786.140	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	196.480	688,269.440	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	36.290	676,227.860	
HYDRO ONE LTD	27,340	29.840	815,825.600	
カナダ・ドル 小計	3,416,072		192,257,338.580 (16,834,052,566)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.990	498,750.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	150,900	28.650	4,323,285.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	8.120	295,568.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	10.040	691,756.000	
CAPITALAND LTD	232,915	3.790	882,747.850	
GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.925	394,790.000	
KEPPEL CORP LTD	134,900	5.500	741,950.000	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	279,453	11.790	3,294,750.870	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	664,422	2.430	1,614,545.460	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	100,150	5.720	572,858.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	26.070	2,669,568.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.810	316,305.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	20.630	433,230.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	5.460	990,444.000	
	シンガポール・ドル 小計	2,565,140		17,720,548.180 (1,449,540,841)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	215,578	9.796	2,111,802.080	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	100.650	1,452,278.850	
	NESTLE SA-REGISTERED	245,879	108.800	26,751,635.200	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,915	93.220	4,093,756.300	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	59,276	309.650	18,354,813.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	279.100	967,639.700	
	SIKA INHABER	11,672	275.500	3,215,636.000	
	SGS SA-REG	540	2,756.000	1,488,240.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	189,186	80.900	15,305,147.400	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	161.700	688,680.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	2,174.000	576,110.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.070	380,999.530	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	485.000	1,207,165.000	
	ABB LTD	155,294	29.530	4,585,831.820	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,600	66.420	903,312.000	
	GEBERIT AG	3,214	622.800	2,001,679.200	
	LONZA GROUP AG-REG	6,226	548.400	3,414,338.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8,730.000	829,350.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	91,000.000	819,000.000	
	GIVAUDAN-REG	758	3,803.000	2,882,674.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,752	385.500	4,915,896.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,336	325.600	1,086,201.600	
	LAFARGEHOLCIM LTD	42,570	57.080	2,429,895.600	
	TEMENOS GROUP	5,723	144.400	826,401.200	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	260.900	1,225,708.200	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,816	275.900	1,328,734.400	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,246.000	1,145,074.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	277.700	677,865.700	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	54.100	248,427.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	270.800	450,340.400	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,395	475.900	1,139,780.500	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	94.900	237,250.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,392	130.400	442,316.800	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	841.000	473,483.000	
	SWISS PRIME SITE AG	6,341	90.400	573,226.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,658	1,301.000	2,157,058.000	

	JULIUS BAER GROUP LTD	20,118	61.320	1,233,635.760	
	SWISS RE LTD	23,484	93.340	2,191,996.560	
	ALCON INC	40,955	67.600	2,768,558.000	
	UBS GROUP AG	305,128	14.935	4,557,086.680	
スイス・フラン	小計	1,480,174		122,139,025.180 (14,486,909,777)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,787	553.000	29,744,211.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	474.200	17,095,384.200	
	ERICSSON LM-B SHS	244,979	119.860	29,363,182.940	
	LUNDBERGS B	7,382	491.200	3,626,038.400	
	SKF AB-B SHS	34,849	255.300	8,896,949.700	
	SANDVIK AB	103,400	242.800	25,105,520.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,990	108.450	15,724,165.500	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	227.300	7,194,726.900	
	SWEDBANK AB	79,825	157.360	12,561,262.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	157.850	8,357,368.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	96.460	13,430,125.800	
	VOLVO AB-B SHS	115,902	211.700	24,536,453.400	
	SWEDISH MATCH AB	13,845	717.200	9,929,634.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	119.850	5,639,541.750	
	INDUSTRIVARDEN A	3,372	331.800	1,118,829.600	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	314.100	3,581,682.300	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	247.300	4,745,934.300	
	SECURITAS AB-B SHS	23,986	150.000	3,597,900.000	
	INVESTOR AB-B SHS	36,107	714.700	25,805,672.900	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	200.050	14,182,744.800	
	ASSA ABLOY AB-B	88,119	258.400	22,769,949.600	
	TELIA CO AB	223,567	38.370	8,578,265.790	
	LUNDIN ENERGY AB	14,739	267.600	3,944,156.400	
	BOLIDEN AB	23,180	326.200	7,561,316.000	
	ALFA LAVAL AB	28,392	271.300	7,702,749.600	
	KINNEVIK AB-B	21,722	455.800	9,900,887.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	464.000	4,160,688.000	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	426.900	3,845,942.100	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	129.850	4,374,906.200	
	NIBE INDUSTRIER AB	24,131	296.300	7,150,015.300	
	HEXAGON AB	24,690	841.000	20,764,290.000	
	EPIROC AB-A	60,750	206.900	12,569,175.000	
	EPIROC AB-B	30,899	185.450	5,730,219.550	
	ESSITY AB-B	47,066	278.000	13,084,348.000	
	EQT AB	20,934	294.900	6,173,436.600	
	EVOLUTION GAMING GROUP AB	13,641	1,354.600	18,478,098.600	
	NORDEA BANK ABP	269,020	87.420	23,517,728.400	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	235.000	3,512,075.000	

スウェーデン・クローナ 小計		2,228,311		448,055,575.480 (5,757,514,145)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	8,494	1,050.500	8,922,947.000	
	A P MOLLER A/S	568	15,210.000	8,639,280.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	14,160.000	3,610,800.000	
	DANSKE BANK A/S	59,305	122.200	7,247,071.000	
	GENMAB A/S	5,825	2,130.000	12,407,250.000	
	NOVOZYMES-B SHS	17,740	413.600	7,337,264.000	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,653.000	2,156,889.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	146,516	438.100	64,188,659.600	
	GN STORE NORD A/S	9,971	525.200	5,236,769.200	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,550	1,254.800	20,766,940.000	
	COLOPLAST-B	10,734	965.600	10,364,750.400	
	DSV PANALPINA A S	17,375	1,269.000	22,048,875.000	
	DEMANT A/S	10,739	289.800	3,112,162.200	
	H LUNDBECK A/S	4,840	223.300	1,080,772.000	
	TRYG A/S	26,079	151.400	3,948,360.600	
	PANDORA A/S	8,251	688.000	5,676,688.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	609.600	5,691,225.600	
	AMBU A/S B	14,156	312.300	4,420,918.800	
ORSTED A/S	15,885	1,050.000	16,679,250.000		
デンマーク・クローネ 小計		383,432		213,536,872.400 (3,749,707,479)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.610	838,819.860	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	15.100	451,399.400	
	A2 MILK CO LTD	62,165	8.600	534,619.000	
	FISHER & PAYKEL	49,044	33.420	1,639,050.480	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.415	704,735.540	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.550	404,357.700	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.450	676,682.900	
ニュージーランド・ドル 小計		596,848		5,249,664.880 (405,221,632)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	33,955	212.000	7,198,460.000	
	DNB ASA	80,709	180.950	14,604,293.550	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	53.300	6,877,618.800	
	TELENOR ASA	63,038	153.150	9,654,269.700	
	SCHIBSTED ASA	7,537	383.600	2,891,193.200	
	ORKLA ASA	65,283	86.560	5,650,896.480	
	EQUINOR ASA	81,088	161.900	13,128,147.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	426.700	6,482,853.100	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	201.500	3,361,624.500	
	ADEVINTA ASA	22,265	129.550	2,884,430.750	
	SCHIBSTED ASA	7,445	334.000	2,486,630.000	

ノルウェー・クローネ 小計		522,232		75,220,417.280 (971,095,587)	
ユーロ	CRH PLC	65,860	40.850	2,690,381.000	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,738	176.700	2,427,504.600	
	KERRY GROUP PLC-A	12,987	112.350	1,459,089.450	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	73.160	984,148.320	
	UMICORE	17,654	46.080	813,496.320	
	AIR LIQUIDE	40,044	140.840	5,639,796.960	
	AIRBUS SE	49,789	101.100	5,033,667.900	
	AXA SA	162,514	23.500	3,819,079.000	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,468	22.570	981,072.760	
	ADIDAS AG	16,057	280.000	4,495,960.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	16.965	1,655,258.080	
	DASSAULT AVIATION SA	295	971.500	286,592.500	
	DANONE	54,305	59.590	3,236,034.950	
	SAFRAN SA	26,945	119.120	3,209,688.400	
	INTESA SANPAOLO	1,385,148	2.253	3,120,738.440	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,325	88.000	2,492,600.000	
	ACCOR SA	17,380	33.040	574,235.200	
	BOUYGUES	21,417	34.580	740,599.860	
	BNP PARIBAS	94,980	51.460	4,887,670.800	
	THALES SA	8,486	85.960	729,456.560	
	CAPGEMINI SA	13,343	151.000	2,014,793.000	
	UNICREDIT SPA	174,050	8.557	1,489,345.850	
	NATIXIS	70,166	4.032	282,909.310	
	KONINKLIJKE DSM NV	15,326	149.500	2,291,237.000	
	COMMERZBANK AG	83,118	5.057	420,327.720	
	EIFFAGE	6,848	88.280	604,541.440	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	33,773	38.630	1,304,650.990	
	UNITED INTERNET	9,882	33.710	333,122.220	
	FUCHS PETROLUB SE PEF	5,546	43.480	241,140.080	
	PUBLICIS GROUPE	17,550	51.600	905,580.000	
	FAURECIA	6,117	46.540	284,685.180	
	IBERDROLA SA	522,617	11.510	6,015,321.670	
	ENI SPA	208,703	10.200	2,128,770.600	
	JERONIMO MARTINS	19,517	14.295	278,995.510	
KESKO OYJ-B	24,085	25.560	615,612.600		
KBC GROUPE	21,995	62.200	1,368,089.000		
HANNOVER RUECK SE	4,868	155.900	758,921.200		
WARTSILA OYJ	34,935	9.042	315,882.270		
L'OREAL	21,478	338.450	7,269,229.100		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,694	588.300	13,939,180.200		
GEA GROUP AG	13,284	35.960	477,692.640		
BOLLORE	71,347	4.162	296,946.210		
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.334	536,163.620		
MICHELIN(CGDE) -B	14,568	124.550	1,814,444.400		

CONTINENTAL AG	10,336	110.940	1,146,675.840	
DEUTSCHE POST AG-REG	83,790	48.050	4,026,109.500	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	30.940	656,113.640	
OMV AG	12,817	41.870	536,647.790	
VERBUND AG	4,559	61.950	282,430.050	
PERNOD-RICARD	17,720	168.550	2,986,706.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	13,577	95.420	1,295,517.340	
RENAULT SA	19,019	35.815	681,165.480	
REPSOL SA	135,990	10.134	1,378,122.660	
REMY COINTREAU	1,860	163.900	304,854.000	
MERCK KGAA	10,776	148.250	1,597,542.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	42,549	51.860	2,206,591.140	
RWE AG	53,103	34.520	1,833,115.560	
SEB SA	2,439	150.600	367,313.400	
SOCIETE GENERALE-A	72,362	21.895	1,584,365.990	
VINCI S.A.	43,325	90.250	3,910,081.250	
SODEXO	7,429	83.620	621,212.980	
SOFINA	1,382	301.400	416,534.800	
SOLVAY SA	7,183	106.000	761,398.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,393	135.460	6,148,935.780	
VIVENDI SA	73,354	28.250	2,072,250.500	
SAP SE	88,701	112.300	9,961,122.300	
TELEFONICA S.A	455,887	3.800	1,732,370.600	
TOTAL SE	213,962	37.845	8,097,391.890	
VALEO	19,653	27.620	542,815.860	
E.ON SE	188,683	9.901	1,868,150.380	
VOEST-ALPINE AG	9,875	36.100	356,487.500	
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	85.750	737,621.500	
SIEMENS AG-REG	64,942	140.400	9,117,856.800	
UPM-KYMMENE OYJ	46,882	31.380	1,471,157.160	
ING GROEP NV-CVA	328,387	10.446	3,430,330.600	
PUMA AG	7,506	92.300	692,803.800	
BAYER AG	82,998	53.340	4,427,113.320	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,484	16.550	703,110.200	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	13,730	98.600	1,353,778.000	
DAIMLER AG	72,141	74.910	5,404,082.310	
BASF SE	76,860	71.490	5,494,721.400	
BEIERSDORF AG	8,371	92.060	770,634.260	
HOCHTIEF AG	1,707	78.320	133,692.240	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,238	77.460	1,025,415.480	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,223	63.440	1,092,627.120	
ASM INTERNATIONAL NV	3,895	269.500	1,049,702.500	
ORANGE	184,093	10.474	1,928,190.080	
SAMPO OYJ-A SHS	41,326	40.370	1,668,330.620	

RANDSTAD NV	8,588	63.500	545,338.000	
ALLIANZ SE	34,938	218.750	7,642,687.500	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	5.178	1,235,791.830	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,072	23.825	2,193,615.400	
HERMES INTL	2,681	989.600	2,653,117.600	
ENDESA S.A.	27,736	22.630	627,665.680	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	11.100	310,689.000	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	29.180	706,272.720	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,768	264.000	3,106,752.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	24.480	1,507,821.120	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,068	191.250	2,116,755.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	27.610	600,075.740	
HEINEKEN NV	22,683	91.760	2,081,392.080	
AKZO NOBEL	15,546	98.640	1,533,457.440	
ASML HOLDING NV	36,255	535.500	19,414,552.500	
AEGON NV	150,349	3.985	599,140.760	
VOLKSWAGEN AG	2,758	298.000	821,884.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,672	237.150	3,716,614.800	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	562,809	4.431	2,493,806.670	
KERING	6,410	611.900	3,922,279.000	
CNP ASSURANCES	13,987	16.520	231,065.240	
FORTUM OYJ	39,409	22.310	879,214.790	
AGEAS	14,365	51.160	734,913.400	
UCB SA	10,571	80.940	855,616.740	
NEMETSCHEK SE	5,095	57.980	295,408.100	
CARREFOUR SA	53,060	14.880	789,532.800	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	20.900	493,490.800	
ATOS SE	8,972	60.200	540,114.400	
NOKIA OYJ	472,892	3.483	1,647,082.830	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,128	50.830	3,920,416.240	
WOLTERS KLUWER-CVA	23,736	76.120	1,806,784.320	
SANOFI	96,494	85.060	8,207,779.640	
STMICROELECTRONICS NV	53,224	33.310	1,772,891.440	
ELISA OYJ	13,642	49.380	673,641.960	
BANCO SANTANDER SA	1,468,250	2.903	4,262,329.750	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	15.085	715,828.500	
QIAGEN N.V.	20,763	43.220	897,376.860	
DEUTSCHE BANK AG-REG	171,364	10.340	1,771,903.760	
BMW VORZUG	4,116	68.550	282,151.800	
ENEL SPA	691,437	8.594	5,942,209.570	
COLRUYT NV	4,673	50.180	234,491.140	
VOPAK (KON.)	5,364	41.730	223,839.720	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	281,548	16.452	4,632,027.690	
SARTORIUS AG	3,044	459.000	1,397,196.000	



UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	67.840	521,418.240	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	109,410	35.600	3,894,996.000	
RATIONAL AG	479	672.200	321,983.800	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	139.650	526,620.150	
BECHTLE AG	2,511	166.800	418,834.800	
KONINKLIJKE KPN NV	288,984	2.857	825,627.280	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	86.340	978,232.200	
TELEPERFORMANCE	4,828	320.300	1,546,408.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	16,538	147.850	2,445,143.300	
EURAZEO	3,007	66.200	199,063.400	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	91.400	905,225.600	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	78.900	789,315.600	
INDITEX	92,169	27.720	2,554,924.680	
ESSILORLUXOTTICA	24,115	137.100	3,306,166.500	
SNAM SPA	171,294	4.673	800,456.860	
CREDIT AGRICOLE SA	95,281	12.532	1,194,061.490	
ORPEA	4,932	104.700	516,380.400	
ENAGAS	23,477	18.635	437,493.890	
WENDEL	2,220	109.800	243,756.000	
TENARIS SA	36,959	9.180	339,283.620	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.433	330,238.270	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.466	231,879.730	
ATLANTIA SPA	45,299	16.390	742,450.610	
ILIAD SA	1,046	159.250	166,575.500	
PROXIMUS	13,739	18.775	257,949.720	
SES FDR	28,847	6.854	197,717.330	
TERNA SPA	101,350	6.136	621,883.600	
BIOMERIEUX	3,248	111.250	361,340.000	
GRIFOLS SA	23,518	23.440	551,261.920	
FERROVIAL SA	38,400	22.260	854,784.000	
LANXESS AG	6,856	61.800	423,700.800	
NESTE OYJ	36,796	45.590	1,677,529.640	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	18.470	330,816.170	
RECORDATI SPA	10,303	45.460	468,374.380	
GALAPAGOS NV	3,426	65.550	224,574.300	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.750	539,214.000	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	202.500	986,782.500	
KONE OYJ	29,890	71.140	2,126,374.600	
ELIA GROUP	2,862	91.500	261,873.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	365.400	872,209.800	
ENGIE	153,403	12.326	1,890,845.370	
ALSTOM	21,741	44.670	971,170.470	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	11.960	655,144.880	
IPSEN SA	3,646	75.500	275,273.000	
DEUTSCHE WOHNEN	29,812	41.500	1,237,198.000	
ARKEMA SA	6,393	104.300	666,789.900	

LEGRAND SA	23,806	82.300	1,959,233.800	
AMPLIFON SPA	11,372	33.070	376,072.040	
ADP	2,313	105.100	243,096.300	
ORION OYJ	8,051	35.190	283,314.690	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.720	389,655.360	
SYMRISE AG	11,308	108.050	1,221,829.400	
SCOR SE	15,667	29.180	457,163.060	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	20,870	39.990	834,591.300	
PRYSMIAN SPA	22,328	26.700	596,157.600	
DIASORIN SPA	2,223	139.600	310,330.800	
CAIXABANK	307,331	2.587	795,065.290	
BUREAU VERITAS SA	29,810	24.830	740,182.300	
GETLINK	37,646	13.040	490,903.840	
SUEZ SA	26,620	18.440	490,872.800	
AMADEUS IT GROUP SA	37,851	58.780	2,224,881.780	
BRENTAG SE	14,044	73.620	1,033,919.280	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	30.010	513,651.160	
EDENRED	21,488	45.290	973,191.520	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.457	241,731.940	
LEG IMMOBILIEN SE	5,133	115.650	593,631.450	
KION GROUP AG	5,903	83.560	493,254.680	
VONOVIA SE	46,966	57.740	2,711,816.840	
KNORR-BREMSE AG	6,860	106.350	729,561.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,805	47.250	1,124,786.250	
FERRARI NV	10,525	174.000	1,831,350.000	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	13.020	1,163,701.560	
AROUNDTOWN SA	83,054	6.336	526,230.140	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	40.580	328,373.360	
MONCLER SPA	17,567	50.360	884,674.120	
NEXI SPA	34,862	15.375	536,003.250	
TEAMVIEWER AG	13,668	37.490	512,413.320	
PROSUS NV	41,250	94.490	3,897,712.500	
JDE PEET'S BV	7,308	31.770	232,175.160	
CELLNEX TELECOM SA-RTS	28,154	2.215	62,361.110	
SIEMENS ENERGY AG	35,831	30.390	1,088,904.090	
WORLDLINE SA	19,384	73.970	1,433,834.480	
SCOUT24 AG-RTS	9,670	0.052	502.840	
NN GROUP NV	24,900	42.220	1,051,278.000	
FINECOBANK SPA	53,818	13.970	751,837.460	
ARGENX SE	3,705	233.300	864,376.500	
ZALANDO SE	13,525	87.540	1,183,978.500	
STELLANTIS NV	172,385	14.800	2,551,298.000	
AENA SME SA	6,256	138.300	865,204.800	
CELLNEX TELECOM SAU	32,154	41.990	1,350,146.460	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	83.450	904,264.200	
ABN AMRO BANK NV	34,251	10.544	361,142.540	

	EXOR NV	9,966	71.780	715,359.480	
	SCOUT24 AG	9,670	69.220	669,357.400	
	COVESTRO AG	16,337	55.880	912,911.560	
	HELLOFRESH SE	12,838	70.420	904,051.960	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	64,255	54.830	3,523,101.650	
	POSTE ITALIANE SPA	38,953	10.795	420,497.630	
	AMUNDI SA	5,924	74.500	441,338.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.454	220,694.170	
	ADYEN NV	1,533	1,989.200	3,049,443.600	
	UNIPER SE	18,203	31.230	568,479.690	
	DELIVERY HERO SE	11,565	119.800	1,385,487.000	
ユーロ	小計	15,970,839		389,885,581.570 (50,919,056,953)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	104.800	3,447,920.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.800	3,411,200.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	16.480	1,711,612.800	
	CLP HOLDINGS LTD	135,000	74.750	10,091,250.000	
	PCCW LTD	331,000	4.480	1,482,880.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	46.550	2,304,225.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	101,940	462.800	47,177,832.000	
	MTR CORP	126,000	44.000	5,544,000.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	153.700	10,098,090.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	34.650	4,000,342.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	103,500	45.750	4,735,125.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	914,292	12.280	11,227,505.760	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	197,000	69.850	13,760,450.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	27.200	8,636,000.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	120,066	41.100	4,934,712.600	
	SINO LAND CO	255,400	11.100	2,834,940.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	118.400	14,267,200.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	62.100	3,073,950.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	111,500	139.000	15,498,500.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	25.550	4,241,300.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	10.200	1,591,200.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	15.440	1,920,736.000	
	AIA GROUP LTD	1,029,027	97.800	100,638,840.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	262,000	11.100	2,908,200.000	
	SANDS CHINA LTD	211,200	37.100	7,835,520.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.600	2,459,120.000	

WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	43.400	6,499,150.000	
ESR CAYMAN LTD	147,400	25.700	3,788,180.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.720	1,775,600.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	24.600	3,704,760.000	
WH GROUP LTD	897,000	6.920	6,207,240.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	222,832	63.250	14,094,124.000	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	47.750	10,735,728.000	
香港・ドル 小計	7,489,849		336,637,434.260 (4,749,954,197)	
合計	93,248,663		471,489,789,591 (471,489,789,591)	

## (2) 株式以外の有価証券

2021年4月12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	81,526.000	811,998.960	
		GOODMAN GROUP	148,357.000	2,787,628.030	
		GPT GROUP	158,232.000	750,019.680	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	813,662.460	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,392,667.500	
		STOCKLAND	194,018.000	892,482.800	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	631,908.700	
	オーストラリア・ドル 小計		1,768,512.000	8,080,368.130 (675,761,187)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	904,152.540	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	369,636.000	805,806.480	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	411,522.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	526,695.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	309,281.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,316,742.000	2,957,457.020 (241,919,984)	
投資信託受益証券 合計		3,085,254	917,681,171 (917,681,171)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	785,237.680	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,124.000	1,873,281.600	
		AMERICAN TOWER CORP	37,826.000	9,092,992.140	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,104,660.940	

	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,329.000	2,292,454.260	
	BOSTON PROPERTIES INC	12,947.000	1,356,068.780	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,417.000	720,821.610	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	36,765.000	6,442,698.600	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	23,841.000	3,367,779.660	
	DUKE REALTY TRUST	31,929.000	1,376,459.190	
	EQUINIX INC	7,584.000	5,213,696.640	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,512.000	814,531.200	
	EQUITY RESIDENTIAL	32,922.000	2,360,178.180	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,750.000	1,629,147.500	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	11,470.000	1,587,218.600	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	46,799.000	1,515,819.610	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,108,927.680	
	INVITATION HOMES INC	44,698.000	1,446,874.260	
	IRON MOUNTAIN INC	24,591.000	926,097.060	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,166,094.930	
	MID AMERICA	8,862.000	1,301,384.700	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	751,612.050	
	PROLOGIS INC	62,693.000	6,865,510.430	
	PUBLIC STORAGE	13,279.000	3,424,388.520	
	REALTY INCOME CORP	30,906.000	2,014,762.140	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	846,161.640	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838.000	2,712,238.220	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	27,532.000	3,191,234.120	
	SUN COMMUNITIES INC	9,670.000	1,476,995.800	
	UDR INC	22,623.000	996,769.380	
	VENTAS INC	30,905.000	1,691,739.700	
	VEREIT INC	16,005.000	646,121.850	
	VICI PROPERTIES INC	42,448.000	1,217,833.120	
	VORNADO REALTY TRUST	13,610.000	620,616.000	
	WELLTOWER INC	34,670.000	2,604,063.700	
	WEYERHAEUSER CO	62,330.000	2,339,868.200	
	WP CAREY INC	15,529.000	1,095,881.530	
アメリカ・ドル	小計	1,086,348.000	79,978,221.220 (8,777,609,779)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	357,752.550	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	400,170.930	
	SEGRO PLC	100,188.000	974,428.480	
イギリス・ポンド	小計	225,850.000	1,732,351.960 (260,701,646)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	3,883.000	218,069.280	

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	271,898.730	
	カナダ・ドル 小計		17,350.000	489,968.010 (42,901,599)	
	ユーロ	COVIVIO	4,663.000	347,859.800	
		GECINA SA	3,670.000	439,482.500	
		KLEPIERRE	17,099.000	351,726.430	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	901,299.200	
	ユーロ 小計		38,352.000	2,040,367.930 (266,472,052)	
	香港・ドル	LINK REIT	183,000.000	12,901,500.000	
	香港・ドル 小計		183,000.000	12,901,500.000 (182,040,165)	
投資証券 合計			1,550,900	9,529,725,241 (9,529,725,241)	
合計				10,447,406,412 (10,447,406,412)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 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 593銘柄	67.40	-	-	72.23
	投資証券 37銘柄	-	-	1.74	
イギリス・ポンド	株式 85銘柄	4.37	-	-	4.62
	投資証券 3銘柄	-	-	0.05	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.10	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 58銘柄	2.05	-	-	2.28
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 87銘柄	3.34	-	-	3.50
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 14銘柄	0.29	-	-	0.35
	投資信託受益証券 5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 40銘柄	2.88	-	-	3.01
スウェーデン・クローナ	株式 38銘柄	1.14	-	-	1.19
デンマーク・クローネ	株式 19銘柄	0.74	-	-	0.78
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.08	-	-	0.08
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.19	-	-	0.20
ユーロ	株式 235銘柄	10.11	-	-	10.62
	投資証券 4銘柄	-	-	0.05	
香港・ドル	株式 33銘柄	0.94	-	-	1.02
	投資証券 1銘柄	-	-	0.04	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,049,613,723
コール・ローン	159,061,441
国債証券	149,705,420,842
未収利息	920,580,080
前払費用	547,496,100
流動資産合計	155,382,172,186
資産合計	155,382,172,186
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	27,273
未払金	2,926,125,416
未払解約金	2,746,000
流動負債合計	2,928,898,689
負債合計	2,928,898,689
純資産の部	
元本等	
元本	72,336,650,576
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	80,116,622,921
元本等合計	152,453,273,497
純資産合計	152,453,273,497
負債純資産合計	155,382,172,186



## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	68,793,586,315円
同期中追加設定元本額	75,729,738,047円
同期中一部解約元本額	72,186,673,786円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	109,169,616円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,010,216,278円
たわらノーロード バランス（堅実型）	74,288,117円
たわらノーロード バランス（標準型）	197,426,791円
たわらノーロード バランス（積極型）	78,882,376円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	723,775円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,424,065円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,877,368円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	911,236円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,265,757円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,470,886円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	202,138,086円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	251,403,543円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	509,610,640円
投資のソムリエ	16,688,882,825円
クルーズコントロール	597,642,781円
投資のソムリエ<DC年金>	925,912,069円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	183,350,267円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	4,082,914円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	8,384,279円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	628,571,902円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,883,910,522円
ワールドアセットバランス（基本コース）	676,555,652円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,191,812,586円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,945,206円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,574,916円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,133,507円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	36,427,074円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,339,044,090円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	192,436,271円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,032,836円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,530,434円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,655,642円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	24,501,127,196円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	387,668,845円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,950,327,719円
高度リスク分散・安定型戦略ファンド2(適格機関投資家限定)	1,054,444,736円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	11,621,387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)	217,423,294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)	111,607,401円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,343,676,386円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	854,059,305円
計	72,336,650,576円
2. 受益権の総数	72,336,650,576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 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種類	2021年4月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	5,397,367,705	
合計	5,397,367,705	

(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(2020年4月21日から2021年4月12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	2021年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	410,000,000	-	410,027,273	27,273
	410,000,000	-	410,027,273	27,273
合計	410,000,000	-	410,027,273	27,273

## (注)時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

## 3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.1076円
(1万口当たり純資産額)	(21,076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

2021年4月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	9,133,560.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	16,000,000.000	15,621,440.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	11,000,000.000	11,431,200.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	13,800,000.000	14,649,597.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	13,000,000.000	11,961,820.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	14,800,000.000	14,258,542.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	12,100,000.000	12,733,314.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	11,600,000.000	11,976,246.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	10,800,000.000	12,438,198.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	10,314,783.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	9,200,000.000	12,366,640.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	5,800,000.000	7,080,930.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	8,921,205.000	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	15,000,000.000	14,859,150.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	9,100,000.000	9,713,385.500	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	7,000,000.000	6,789,650.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	9,000,000.000	9,958,365.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	10,000,000.000	10,985,700.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	18,000,000.000	19,497,060.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	8,000,000.000	8,928,000.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	11,000,000.000	12,712,260.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	13,000,000.000	15,634,450.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	8,400,000.000	11,247,600.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	12,400,000.000	13,590,251.200	
		CROATIA 6.0 01/26/24	13,400,000.000	15,332,976.800	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	10,358,000.000	11,297,543.100	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	16,380,000.000	18,597,573.540	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	10,000,000.000	11,317,400.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	9,000,000.000	14,635,215.000	
		INDONESIA 2.85 02/14/30	6,000,000.000	6,178,260.000	
INDONESIA 3.375 04/15/23	6,700,000.000	7,050,711.500			

INDONESIA 3.4 09/18/29	6,000,000.000	6,416,430.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	7,200,000.000	7,788,060.000	
INDONESIA 3.7 10/30/49	4,000,000.000	4,159,443.320	
INDONESIA 3.85 07/18/27	5,600,000.000	6,167,280.000	
INDONESIA 3.85 10/15/30	8,000,000.000	8,868,482.160	
INDONESIA 4.1 04/24/28	5,000,000.000	5,582,000.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	10,800,000.000	11,870,820.000	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	7,830,333.910	
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,632,849.000	
INDONESIA 4.35 01/11/48	7,000,000.000	7,810,798.730	
INDONESIA 4.45 04/15/70	5,000,000.000	5,582,078.600	
INDONESIA 4.75 01/08/26	11,800,000.000	13,414,063.000	
INDONESIA 4.75 02/11/29	7,000,000.000	8,130,220.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	9,400,000.000	11,348,764.760	
INDONESIA 5.25 01/17/42	10,300,000.000	12,544,826.490	
INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,066,543.240	
INDONESIA 5.875 01/15/24	9,200,000.000	10,435,792.390	
INDONESIA 5.95 01/08/46	6,200,000.000	8,298,684.620	
INDONESIA 6.75 01/15/44	8,500,000.000	12,221,828.020	
INDONESIA 7.75 01/17/38	10,500,000.000	15,635,898.600	
PANAMA 3.16 01/23/30	9,000,000.000	9,446,400.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	7,200,000.000	7,857,324.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	8,100,000.000	8,892,706.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	12,104,840.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	10,300,000.000	11,440,519.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	12,900,000.000	17,373,720.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	6,800,000.000	8,447,776.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	4,900,000.000	7,185,948.000	
PERU 2.392 01/23/26	9,000,000.000	9,307,080.000	
PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	17,146,370.000	
PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,109,850.000	
PERU 4.125 08/25/27	6,300,000.000	7,088,130.000	
PERU 5.625 11/18/50	13,000,000.000	17,496,245.000	
PERU 6.55 03/14/37	8,000,000.000	10,915,200.000	
PERU 7.35 07/21/25	9,300,000.000	11,522,700.000	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	8,000,000.000	8,156,086.400	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	6,000,000.000	5,705,802.660	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	10,652,300.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	9,000,000.000	9,551,215.800	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	10,000,000.000	11,183,715.600	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	8,800,000.000	9,599,092.180	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,566,077.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	6,800,000.000	8,456,724.320	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	7,600,000.000	9,186,520.520	

PHILIPPINES 6.375 01/15/32	5,600,000.000	7,562,626.400	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	9,000,000.000	12,443,035.320	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	11,856,743.380	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	7,800,000.000	12,181,377.000	
ROMANIA 3.0 02/14/31	13,000,000.000	13,224,250.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	10,000,000.000	9,983,000.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	5,600,000.000	6,229,725.600	
ROMANIA 5.125 06/15/48	8,600,000.000	9,979,956.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	8,400,000.000	10,913,330.400	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	9,765,000.000	11,262,951.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	13,400,000.000	14,663,566.400	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	16,400,000.000	17,979,697.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	5,800,000.000	5,997,536.400	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	16,400,000.000	18,303,318.400	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	18,400,000.000	20,020,248.800	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	22,000,000.000	25,237,432.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	29,000,000.000	34,582,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	16,000,000.000	19,603,024.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	8,200,000.000	10,401,454.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	11,200,000.000	11,242,358.400	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	11,000,000.000	11,313,412.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	11,400,000.000	12,134,958.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	7,200,000.000	6,891,552.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	11,000,000.000	10,501,700.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,170,400.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	8,400,000.000	9,204,426.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	16,200,000.000	18,077,709.600	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,068,800.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	11,000,000.000	11,165,550.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	10,067,284.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	9,200,000.000	9,902,466.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	7,000,000.000	7,730,730.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	12,500,000.000	13,549,062.500	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	10,000,000.000	11,182,300.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	13,843,918.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	10,000,000.000	10,225,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	17,000,000.000	18,965,455.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	11,000,000.000	11,355,685.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	10,400,000.000	10,770,292.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	14,000,000.000	15,680,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	10,000,000.000	10,957,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	14,400,000.000	16,706,016.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	11,067,875.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	16,900,000.000	20,479,335.500	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	10,200,000.000	12,968,280.000	
	アメリカ・ドル 小計	1,206,303,000.000 (132,391,754,250)	1,364,058,504.260 (149,705,420,842)	
国債証券	合計	132,391,754,250 (132,391,754,250)	149,705,420,842 (149,705,420,842)	
合計			149,705,420,842 (149,705,420,842)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	国債証券 120銘柄	98.20	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。



## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,180,828,394
コール・ローン	2,639,741,121
株式	53,981,706,088
新株予約権証券	28,986
投資信託受益証券	361,438,063
投資証券	49,157,698
派生商品評価勘定	20,319,115
未収配当金	177,668,844
差入委託証拠金	2,085,892,367
流動資産合計	60,496,780,676
資産合計	
60,496,780,676	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	18,254,457
未払金	6,069
未払解約金	2,525,619,000
流動負債合計	2,543,879,526
負債合計	
2,543,879,526	
純資産の部	
元本等	
元本	39,218,738,833
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,734,162,317
元本等合計	57,952,901,150
純資産合計	
57,952,901,150	
負債純資産合計	
60,496,780,676	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,475,042,418円
同期中追加設定元本額	40,547,040,016円
同期中一部解約元本額	44,803,343,601円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C年金>	7,302,513,941円
D I A M新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファン ドラップ)	185,862,738円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,697,665円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,179,516円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	8,468,656円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,146,870円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,278,421円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,743,774円
たわらノーロード 新興国株式	7,175,894,201円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,917,544,978円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,444,292,087円
たわらノーロード バランス(堅実型)	13,218,963円
たわらノーロード バランス(標準型)	47,765,417円
たわらノーロード バランス(積極型)	75,926,200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)	755,699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)	86,137,964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)	179,790,789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)	115,850,841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)	193,082,816円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	239,056円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	1,831,734円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	968,756円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,392,236円
たわらノーロード 全世界株式	51,874,503円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	158,107,286円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	394,963,051円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	329,145,943円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	368,217,240円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	724,778,950円
投資のソムリエ	6,706,917,260円
クルーズコントロール	877,058,760円
投資のソムリエ< D C年金>	369,227,316円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C年金>	320,081,299円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	15,005,870円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	30,829,163円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制型	267,256,800円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,945,535,376円
ワールドアセットバランス(基本コース)	935,425,857円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	3,075,512,899円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	9,076,129円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,313,884円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	2,628,076円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	22,165,824円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,870,907,574円
9資産分散投資・スタンダード< D C年金>	276,471,463円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	5,081,464円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	2,544,584円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	2,648,931円
エマージング株式パッシブファンドV A(適格機関投資家専用)	16,310,910円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	158,553,968円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A ( 適格機関投資家限定 )	302,772,542円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A ( 適格機関投資家限定 )	156,742,593円
計	39,218,738,833円
2. 受益権の総数	39,218,738,833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 2020年10月13日 至 2021年4月12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	2021年4月12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る場合、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	2021年4月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	9,080,926,347	
新株予約権証券	44,796	
投資信託受益証券	76,038,009	
投資証券	6,307,044	
合計	9,163,226,604	

(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(2020年4月21日から2021年4月12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	2021年4月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建 アメリカ・ドル	507,547,500	-	507,581,262	33,762	
	507,547,500	-	507,581,262	33,762	
合計	507,547,500	-	507,581,262	33,762	

## (注)時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 株式関連

種類	2021年4月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	3,037,382,832	-	3,039,481,252	2,098,420	
合計	3,037,382,832	-	3,039,481,252	2,098,420	

## (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)

	2021年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4777円 (14,777円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

2021年4月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	29,420	37.210	1,094,718.200	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	15,493	10.650	165,000.450	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.450	131,944.500	
	CREDICORP LTD	4,346	150.000	651,900.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	31,680	8.130	257,558.400	
	NETEASE INC-ADR	25,446	103.940	2,644,857.240	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,518	70.980	320,687.640	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	3,789	5.250	19,892.250	
	YPF SA ADR	4,248	4.020	17,076.960	
	LUKOIL SPON ADR	26,136	76.780	2,006,722.080	
	GAZPROM PAO ADR	368,681	5.700	2,101,481.700	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	89,351	3.380	302,006.380	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.923	88,966.120	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	55,084	4.346	239,395.060	
	51JOB INC ADR	2,130	63.110	134,424.300	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	7,085	30.900	218,926.500	
	NOVATEK PJSC GDR	5,875	184.250	1,082,468.750	
	BAIDU INC -SPON ADR	16,507	219.670	3,626,092.690	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	7,350	31.660	232,701.000		
MMC NORILSK NICKEL ADR	41,090	31.500	1,294,335.000		

ROSNEFT OIL CO GDR	67,841	6.924	469,731.080	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	94,765	14.710	1,393,993.150	
SEVERSTAL GDR	16,771	19.860	333,072.060	
TATNEFT ADR	15,761	43.980	693,168.780	
VTB BANK OJSC GDR	112,000	1.096	122,752.000	
MAGNIT PJSC GDR	23,051	14.000	322,714.000	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	27,429	28.470	780,903.630	
21VIANET GROUP INC ADR	4,106	30.670	125,931.020	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	23,470	58.510	1,373,229.700	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	6,853	22.160	151,862.480	
YANDEX NV	19,065	62.020	1,182,411.300	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,716	42.830	73,496.280	
SBERBANK ADR	168,888	14.465	2,442,964.920	
PHOSAGRO PJSC GDR	8,308	17.930	148,962.440	
HUAZHU GROUP LTD ADR	8,828	54.990	485,451.720	
JOYY INC-ADR	3,617	100.010	361,736.170	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	3,501	69.290	242,584.290	
GDS HOLDINGS LTD ADR	5,826	78.320	456,292.320	
ZAI LAB LTD ADR	4,444	132.630	589,407.720	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	7,999	58.780	470,181.220	
HUYA INC ADR	4,204	18.430	77,479.720	
BILIBILI INC ADR	9,816	105.800	1,038,532.800	
NIO INC ADR	78,509	38.120	2,992,763.080	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	23,557	19.220	452,765.540	
AUTOHOME INC ADR	3,789	94.130	356,658.570	
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	7,360	10.300	75,808.000	
GSX TECHEDU INC ADR	4,275	27.160	116,109.000	
WEIBO CORP ADR	3,003	49.380	148,288.140	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	44.260	128,840.860	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	8,000	9.320	74,560.000	
KE HOLDINGS INC ADR	6,869	55.950	384,320.550	
JD.COM INC ADR	52,821	80.410	4,247,336.610	
LI AUTO INC ADR	12,120	22.760	275,851.200	
XPENG INC ADR	9,372	34.490	323,240.280	
LUFAX HOLDING LTD ADR	11,272	14.620	164,796.640	
GLOBANT SA	2,145	221.020	474,087.900	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	115,410	223.310	25,772,207.100	
MOMO INC SPON ADR	7,793	15.800	123,129.400	
BAOZUN INC-SPN ADR	4,112	35.150	144,536.800	
PINDUODUO INC ADR	24,048	137.620	3,309,485.760	
YUM CHINA HOLDINGS INC	24,485	59.850	1,465,427.250	

	IQIYI INC ADR	15,440	16.800	259,392.000	
	POLYUS PJSC GDR	3,946	92.850	366,386.100	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	3,761	29.240	109,971.640	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	25,608	28.200	722,145.600	
	BEIGENE LTD ADR	2,831	308.270	872,712.370	
アメリカ・ドル	小計	1,950,523		73,328,834.410 (8,047,839,576)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	5.120	585,057.280	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	94,296	4.600	433,761.600	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	107,147	21.760	2,331,518.720	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	176,404	6.080	1,072,536.320	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	168,085	14.400	2,420,424.000	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	187,397	3.730	698,990.810	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	224,384	3.640	816,757.760	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	138,597	11.650	1,614,655.050	
	EMAAR MALLS PJSC	267,919	1.790	479,575.010	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,478,498		10,453,276.550 (312,866,567)	
イギリス・ポ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,667	14.585	228,503.190	
イギリス・ポ ンド	小計	15,667		228,503.190 (34,387,445)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	174,243	1,982.050	345,358,338.150	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	37,350	425.600	15,896,160.000	
	ASIAN PAINTS LTD	24,286	2,630.800	63,891,608.800	
	EICHER MOTORS LTD	8,739	2,521.600	22,036,262.400	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	16,636	1,440.000	23,955,840.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	51,785	791.150	40,969,702.750	
	SHREE CEMENT LTD	581	31,748.750	18,446,023.750	
	ICICI BANK LTD	314,249	566.200	177,927,783.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	37,298	234.050	8,729,596.900	
	STATE BANK OF INDIA LTD	113,674	353.000	40,126,922.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	20,608	587.350	12,104,108.800	
	TATA STEEL LTD	47,387	899.500	42,624,606.500	
	TATA MOTORS LTD	92,953	318.200	29,577,644.600	
	JSW STEEL LTD	51,994	621.000	32,288,274.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	37,048	679.800	25,185,230.400	



BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,036	3,797.700	26,720,617.200	
NESTLE INDIA LTD	1,849	17,592.400	32,528,347.600	
GAIL INDIA LTD	83,449	138.800	11,582,721.200	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	34,509	1,799.250	62,090,318.250	
VEDANTA LTD	117,659	231.350	27,220,409.650	
AXIS BANK LTD	141,099	668.200	94,282,351.800	
TITAN COMPANY LTD	22,871	1,592.000	36,410,632.000	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	139,196	103.800	14,448,544.800	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	6,531	1,601.150	10,457,110.650	
LUPIN LTD	12,780	1,079.450	13,795,371.000	
ACC LTD	3,592	1,960.750	7,043,014.000	
BAJAJ FINANCE LTD	16,757	4,872.300	81,645,131.100	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	104,663	2,513.900	263,112,315.700	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	46,543	206.050	9,590,185.150	
INFOSYS LTD	207,900	1,441.050	299,594,295.000	
WIPRO LTD	63,191	450.100	28,442,269.100	
MRF LTD	96	81,888.150	7,861,262.400	
INDIAN OIL CORP LTD	143,083	91.700	13,120,711.100	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	50,439	2,476.000	124,886,964.000	
TRENT LTD	9,385	729.200	6,843,542.000	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	4,770	3,132.150	14,940,355.500	
HCL TECHNOLOGIES LTD	67,721	1,045.400	70,795,533.400	
DABUR INDIA LTD	34,349	560.500	19,252,614.500	
HERO MOTOCORP LTD	7,701	2,912.900	22,432,242.900	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	7,063	1,651.800	11,666,663.400	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,527	4,760.300	35,830,778.100	
IPCA LABORATORIES LTD	5,743	2,086.000	11,979,898.000	
BHARTI AIRTEL LTD	152,471	545.250	83,134,812.750	
UNITED SPIRITS LTD	15,017	537.200	8,067,132.400	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	54,274	636.750	34,558,969.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	7,241	3,752.350	27,170,766.350	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,624	6,827.100	58,876,910.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	17,868	943.700	16,862,031.600	
HAVELLS INDIA LTD	11,619	1,062.250	12,342,282.750	
INDRAPRASTHA GAS LTD	24,603	542.500	13,347,127.500	
BIOCON LTD	21,917	420.300	9,211,715.100	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	67,610	211.900	14,326,559.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	9,353	1,469.600	13,745,168.800	

PETRONET LNG LTD	56,937	228.150	12,990,176.550	
CIPLA LTD/INDIA	27,724	883.050	24,481,678.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	44,607	1,404.100	62,632,688.700	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,311	6,825.850	49,903,789.350	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	57,248	3,322.250	190,192,168.000	
NTPC LTD	276,629	102.800	28,437,461.200	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,327	1,809.200	9,637,608.400	
YES BANK LTD	714,850	15.450	11,044,432.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	34,517	316.350	10,919,452.950	
BHARAT FORGE LTD	15,849	610.250	9,671,852.250	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	96,713	361.050	34,918,228.650	
ITC LTD	187,466	213.100	39,949,004.600	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,676	1,919.800	16,656,184.800	
UNITED PHOSPHORUS LTD	29,792	634.900	18,914,940.800	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,521	2,574.750	6,490,944.750	
SIEMENS INDIA LTD	3,637	1,849.000	6,724,813.000	
INFO EDGE INDIA LTD	4,216	4,791.400	20,200,542.400	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	25,769	739.100	19,045,867.900	
TECH MAHINDRA LTD	40,660	1,053.000	42,814,980.000	
MARICO LTD	26,696	420.600	11,228,337.600	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	29,501.150	11,151,434.700	
DLF LTD	33,709	279.550	9,423,350.950	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	140,337	208.300	29,232,197.100	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,746	823.600	26,146,005.600	
REC LTD	45,037	132.100	5,949,387.700	
BAJAJ FINSERV LTD	2,428	9,629.050	23,379,333.400	
BAJAJ AUTO LTD	4,388	3,651.300	16,021,904.400	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,744	2,881.350	16,550,474.400	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,965	1,233.850	6,126,065.250	
COAL INDIA LTD	99,458	129.500	12,879,811.000	
INDUS TOWERS LTD	37,374	256.750	9,595,774.500	
PI INDUSTRIES LTD	4,133	2,558.650	10,574,900.450	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	2,748	4,378.600	12,032,392.800	
ADANI GREEN ENERGY LTD	25,335	1,142.750	28,951,571.250	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	44,536	694.850	30,945,839.600	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,425	2,951.950	7,158,478.750	
BANDHAN BANK LTD	38,990	358.950	13,995,460.500	
BERGER PAINTS INDIA LTD	12,556	752.600	9,449,645.600	
AVENUE SUPERMARTS LTD	8,810	2,947.750	25,969,677.500	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	11,517	1,419.600	16,349,533.200	

	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	19,044	455.500	8,674,542.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	4,893	1,646.950	8,058,526.350	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	24,046	910.100	21,884,264.600	
インド・ルピー	小計	5,038,672		3,536,691,502.700 (5,234,303,424)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,340.000	1,337,778,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,470,900	990.000	1,456,191,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	84,801	22,725.000	1,927,102,725.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,600.000	2,329,140,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	480,500	6,475.000	3,111,237,500.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,306,700	5,275.000	6,892,842,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,139,900	3,360.000	10,550,064,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	386,800	6,925.000	2,678,590,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	38,050.000	1,232,820,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	67,800	12,450.000	844,110,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	10,075.000	1,922,310,000.000	
	BANK MANDIRI	1,183,100	6,475.000	7,660,572,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,422,100	4,350.000	14,886,135,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	822,200	1,320.000	1,085,304,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	344,300	6,000.000	2,065,800,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,005,700	1,550.000	1,558,835,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	149,800	10,375.000	1,554,175,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	602,800	31,000.000	18,686,800,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,205.000	1,125,590,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,875.000	1,464,375,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,105.000	1,898,721,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	425,600	2,180.000	927,808,000.000	
インドネシア・ルピア	小計	18,858,201		87,196,302,225.000 (662,691,897)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	9,032	71.290	643,891.280	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	16.580	89,532.000	

ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	5,800	22.100	128,180.000	
BEIJING THUNISOFT CORP LTD	6,400	18.780	120,192.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	45.830	137,490.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	12.400	148,800.000	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	1,800	97.610	175,698.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	7,540	19.490	146,954.600	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	7.500	122,250.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	16.750	319,925.000	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	27.470	109,880.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	141.850	170,220.000	
JOYOUNG CO LTD	5,100	33.400	170,340.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,400	18.690	306,516.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	20.750	155,625.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	900	450.650	405,585.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	21.750	224,677.500	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	19.240	126,984.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	62.590	331,727.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	19.350	114,165.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	18.630	355,833.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	4.000	95,200.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	35.150	231,990.000	
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	6,650	52.150	346,797.500	
GEM CO LTD	29,100	8.580	249,678.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	4,400	127.040	558,976.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	42.900	296,010.000	

ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	7.200	133,920.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	2,400	68.360	164,064.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	6,120	35.240	215,668.800	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	36.800	217,267.200	
ZHEJIANG NHU CO LTD	5,800	38.250	221,850.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	1,900	25.090	47,671.000	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	75.270	203,229.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	25.000	165,000.000	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	3,900	41.830	163,137.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	41.020	139,468.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	44.050	224,655.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	16.050	24,075.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	17.020	44,252.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	78.100	359,260.000	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD	12,400	34.720	430,528.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	10.270	112,970.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	25.090	210,756.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	12,000	102.450	1,229,400.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	4,800	185.750	891,600.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	17.740	180,948.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	13.460	150,752.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	6.480	203,472.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	14.520	81,312.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	7.050	100,815.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	17.650	48,184.500	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	21.130	54,938.000	

HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	41.710	325,338.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	25,900	27.390	709,401.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	24.080	144,480.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	109.350	349,920.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	26.030	92,927.100	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	15.700	233,930.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.700	135,890.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	8.790	75,594.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	50,000	5.890	294,500.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	12,480	61.300	765,024.000	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	13,900	43.210	600,619.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	4,800	111.100	533,280.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	27.830	192,027.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	7.480	285,736.000	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,300	29.590	38,467.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	36.870	180,663.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	9.930	151,929.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	10.250	215,250.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	35.690	267,675.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	33.450	167,250.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	22.110	145,926.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	4,800	223.870	1,074,576.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	7,400	81.450	602,730.000	

BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.090	120,945.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.610	152,397.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	17,800	28.600	509,080.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	22.520	133,768.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,800	30.230	114,874.000	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	6.470	103,520.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	121.900	255,990.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	10.440	380,851.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	11.590	165,737.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	29,154	33.450	975,201.300	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	7.050	193,875.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	9.490	422,305.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	18.650	371,135.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.460	28,348.000	
IFLYTEK CO LTD	11,300	46.470	525,111.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.620	274,314.000	
GOERTEK INC	8,700	28.040	243,948.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.760	165,288.000	
BEIJING ORIGINWATER TECHNOLOGY CO LTD	57,500	7.640	439,300.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	19,100	38.800	741,080.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	25.360	370,256.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	9.350	443,190.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.240	204,892.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	10.490	394,424.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	12,400	14.480	179,552.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.870	201,349.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	8,200	39.710	325,622.000	

YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	115.170	437,646.000	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP	10,700	24.510	262,257.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	27,840	27.680	770,611.200	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	4,800	155.920	748,416.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,600	265.300	3,873,380.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	7.320	152,256.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	7.180	170,166.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,600	6.610	830,216.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	49,900	12.100	603,790.000	
MIDEA GROUP CO LTD	13,600	80.450	1,094,120.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	11.310	192,270.000	
PING AN BANK CO LTD	61,400	21.300	1,307,820.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	30,280	16.090	487,205.200	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	128,700	4.640	597,168.000	
CHINA VANKE CO LTD	37,400	28.860	1,079,364.000	
ZTE CORP	21,600	28.310	611,496.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	12.860	366,510.000	
WEICHAI POWER CO LTD	17,000	18.950	322,150.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	43.780	183,876.000	
GF SECURITIES CO LTD	39,100	15.710	614,261.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	13.590	286,749.000	
BYD CO LTD	7,100	166.720	1,183,712.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	8.450	288,145.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	3,900	87.910	342,849.000	
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	11,000	28.510	313,610.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	9.260	119,454.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	48.300	140,070.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	28.010	224,080.000	



NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,500	159.500	239,250.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	15.050	54,180.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	49,400	8.270	408,538.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	20.790	115,384.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	222.500	267,000.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	14.550	226,980.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	32.920	217,272.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	73.880	44,328.000	
NINESTAR CORP	5,700	24.450	139,365.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	13.320	93,506.400	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.380	114,244.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	14.840	178,080.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	4,200	82.050	344,610.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	102.310	163,696.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	299.750	149,875.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	11.980	180,898.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	19.280	102,184.000	
SF HOLDING CO LTD	15,000	72.720	1,090,800.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	7.800	184,080.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	44.350	288,275.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	8.570	546,680.300	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	31.360	426,496.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	5,000	64.740	323,700.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,100	99.880	209,748.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	16,400	29.050	476,420.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	73.090	226,579.000	

ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.590	283,275.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,300	84.810	110,253.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	40.830	212,316.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	67.830	213,664.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	115.170	380,061.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	133.500	360,450.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	76.210	236,251.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	170.400	357,840.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	7.250	171,100.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	71.070	307,022.400	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	15.410	146,395.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	35.840	107,520.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	27.880	217,464.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	90.680	76,171.200	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	60.980	164,646.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	1,600	76.510	122,416.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	88.380	117,545.400	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	128.960	167,648.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	68.280	204,840.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	135.080	270,160.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	11.090	140,843.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	11.030	297,810.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	129.300	245,670.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	10.090	98,882.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	14.060	202,464.000	

SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	3,600	402.600	1,449,360.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	27.920	147,976.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	10.040	155,620.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	266.170	319,404.000	
OVCTEK CHINA INC	2,900	99.020	287,158.000	
SG MICRO CORP	600	255.240	153,144.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	7,700	312.000	2,402,400.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	2,440	182.000	444,080.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	5,560	139.590	776,120.400	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,500	97.400	340,900.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,000	708.010	708,010.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,700	293.120	1,084,544.000	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	96,700	5.070	490,269.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.340	191,178.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	162.750	146,475.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	60,900	6.000	365,400.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.580	600,966.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	79.240	483,364.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	800	176.440	141,152.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	221.860	133,116.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.270	473,543.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	5.420	1,147,956.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.360	921,984.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.310	278,040.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.390	184,819.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	31.250	312,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	19.510	302,405.000	

CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	73,600	50.250	3,698,400.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	37,700	77.160	2,908,932.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	68,800	23.240	1,598,912.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	97,800	10.590	1,035,702.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	4.940	682,708.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	23,900	20.030	478,717.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,600	2,020.000	9,292,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.910	621,115.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	46,600	23.600	1,099,760.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	32,500	35.560	1,155,700.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	4.700	180,010.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	75,800	20.850	1,580,430.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	97,700	6.890	673,153.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	109,700	3.960	434,412.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	66,100	11.070	731,727.000	
HUAXIA BANK CO LTD	112,900	6.340	715,786.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	16,300	39.800	648,740.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.760	418,404.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	70,500	8.660	610,530.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	50.660	709,240.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	19.550	654,925.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	4.200	32,760.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	16,500	31.620	521,730.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	13.990	630,949.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	19,660	91.200	1,792,992.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	46,100	16.790	774,019.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	12,000	47.240	566,880.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	31,700	32.020	1,015,034.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	27,000	33.400	901,800.000	

CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	76,600	7.180	549,988.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	40.770	322,083.000	
GEMDALE CORP	10,600	11.770	124,762.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	24.500	541,450.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	10,300	106.900	1,101,070.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	93,500	10.290	962,115.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	58,000	8.760	508,080.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	9.780	309,048.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	24,300	31.810	772,983.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.400	131,120.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	6,700	301.600	2,020,720.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	600	86.000	51,600.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	25,000	4.000	100,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	95,100	4.250	404,175.000	
AIR CHINA LTD	28,400	8.850	251,340.000	
TBEA CO LTD	26,700	11.150	297,705.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	31,400	6.720	211,008.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	3.990	336,357.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	57.420	189,486.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	27.670	190,923.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.740	162,582.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	26.580	220,614.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	12.760	188,848.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	14.430	69,264.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	11.940	282,978.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	9.770	284,307.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	17.640	134,064.000	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	2,200	16.640	36,608.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	60,200	5.580	335,916.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	8.680	283,836.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	8.660	244,212.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	21.350	203,252.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	35.010	266,076.000	
BBMG CORP	54,200	2.870	155,554.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	6.740	198,156.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	13.580	252,588.000	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO LTD	12,500	14.170	177,125.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	5.550	214,230.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	21.540	34,464.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	13.010	195,397.190	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	6.310	48,587.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	5,640	82.840	467,217.600	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	36.280	589,550.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.800	222,360.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.980	175,820.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	12,600	44.360	558,936.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	8.440	159,516.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	7.960	203,776.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	51.550	237,130.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	9.290	156,072.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	14,700	32.000	470,400.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.690	224,186.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	9.190	180,124.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	325.070	585,126.000	

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	12.100	108,900.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	26,600	4.850	129,010.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	2,700	348.000	939,600.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	18.860	22,632.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	26,300	4.970	130,711.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.840	271,000.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	7.320	189,588.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	52.380	162,378.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	8.950	202,270.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.730	97,726.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	33.460	180,684.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	12,900	7.690	99,201.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	11.010	138,726.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.630	198,900.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	53.060	222,852.000	
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD	19,900	9.950	198,005.000	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	6,400	19.470	124,608.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	19.760	115,200.800	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,900	13.030	155,057.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	13.110	154,698.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	23.880	107,460.000	
TONGWEI CO LTD	10,300	32.190	331,557.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,100	58.610	64,471.000	

CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	116.290	290,725.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	57.240	303,372.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	23.230	130,088.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	9,300	35.480	329,964.000	
CHINA JUSHI CO LTD	23,400	19.000	444,600.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	2,224	86.950	193,376.800	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	4,000	12.050	48,200.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	20.370	319,809.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	118.880	202,096.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	57.690	282,681.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	12,800	83.770	1,072,256.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	178.000	320,400.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,800	19.940	135,592.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	11.400	368,801.400	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	10,280	171.790	1,766,001.200	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	47.430	237,150.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	18.920	22,704.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	48.970	284,026.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	11.090	146,388.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	50,600	16.320	825,792.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	5.280	315,216.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	58.870	200,158.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	6.400	105,600.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	117,300	6.220	729,606.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	16.140	380,904.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	9,000	49.650	446,850.000	



	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,100	118.490	130,339.000	
	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	22.290	44,580.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	112.000	134,400.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	84.070	126,105.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.310	404,152.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	43,300	12.820	555,106.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	274.700	219,760.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,800	82.530	396,144.000	
	TOLY BREAD CO LTD	3,600	49.010	176,436.000	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,200	88.210	194,062.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	90.120	264,952.800	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	8.810	170,914.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	4,200	59.380	249,396.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.050	256,800.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,300	86.880	547,344.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	5.560	162,352.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	47.750	510,925.000	
	オフショア・人民元 小計	7,699,414		144,943,913.570 (2,423,389,763)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	272,804	17.900	4,883,191.600	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	90,299	4.950	446,980.050	
	OOREDOO QSC	40,049	7.271	291,196.270	
	QATAR FUEL QSC	28,478	17.470	497,510.660	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24,605	16.800	413,364.000	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	8.580	437,820.240	
	INDUSTRIES QATAR QSC	123,312	12.650	1,559,896.800	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,819	16.650	1,262,386.350	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	138,961	3.210	446,064.810	
	MASRAF AL RAYAN	242,381	4.273	1,035,694.010	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.220	445,805.780	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	251,921	1.856	467,565.370	

カタール・リアル 小計		1,478,106		12,187,475.940 (363,308,658)	
クウェート・ ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	254,684	0.737	187,702.100	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	126,248	0.606	76,506.280	
	GULF BANK KSCP	142,660	0.215	30,671.900	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	418,385	0.832	348,096.320	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	53,237	0.757	40,300.400	
	MABANEE CO KPSC	53,293	0.720	38,370.960	
	BOUBYAN BANK KSCP	83,909	0.630	52,862.670	
クウェート・ディナール 小計		1,132,416		774,510.630 (282,115,497)	
コロンビア・ ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	23,125	22,570.000	521,931,250.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,260.000	635,579,800.000	
	BANCOLOMBIA SA	12,950	30,700.000	397,565,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	30,957	30,600.000	947,284,200.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	22,820	21,260.000	485,153,200.000	
コロンビア・ペソ 小計		371,082		2,987,513,450.000 (89,765,817)	
サウジアラビ ア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	15,478	69.500	1,075,721.000	
	JARIR MARKETING CO	4,004	185.200	741,540.800	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	79.800	331,569.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	18,500	30.450	563,325.000	
	SAUDI BRITISH BANK	44,520	27.550	1,226,526.000	
	AL RAJHI BANK	74,613	93.400	6,968,854.200	
	ARAB NATIONAL BANK	34,464	21.380	736,840.320	
	BANK ALBILAD	26,491	35.100	929,834.100	
	BANK AL-JAZIRA	35,440	16.480	584,051.200	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,102	35.500	1,317,121.000	
	RIYAD BANK	73,924	24.020	1,775,654.480	
	SAUDI TELECOM CO	36,286	123.000	4,463,178.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	12,050	100.200	1,207,410.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	55,148	115.600	6,375,108.800	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	64.500	417,766.500	
	SAUDI ELECTRICITY CO	45,963	24.900	1,144,478.700	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	18,628	33.500	624,038.000	
	SAVOLA GROUP	14,538	41.900	609,142.200	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	16.280	366,755.840	
ALMARAI CO JSC	16,575	53.000	878,475.000		

	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	10.480	296,699.280	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,278	23.100	376,021.800	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	76.300	640,538.500	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	39,276	16.380	643,340.880	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	9.630	298,635.930	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	17.700	189,690.900	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	21,818	15.020	327,706.360	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,968	118.000	350,224.000	
	ALINMA BANK	61,501	17.760	1,092,257.760	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	127.200	447,235.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,062	57.000	1,542,534.000	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	3,088	75.400	232,835.200	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	131,238	35.550	4,665,510.900	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,712	132.000	357,984.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	135,829	54.800	7,443,429.200	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,120,604		51,242,034.050 (1,501,904,018)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	125.500	3,476,350.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	101,100	37.250	3,765,975.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	103,600	11.700	1,212,120.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	34,200	50.250	1,718,550.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	43,200	109.500	4,730,400.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	509,355	3.300	1,680,871.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	26,700	143.000	3,818,100.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	12,400	179.000	2,219,600.000	
	SHIN CORP PCL	136,600	57.500	7,854,500.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	249,700	29.500	7,366,150.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	66,400	169.500	11,254,800.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	430,820	14.400	6,203,808.000	

DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	20,800	375.000	7,800,000.000	
PTT PCL	705,600	39.250	27,694,800.000	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	147,100	14.500	2,132,950.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	65,600	78.500	5,149,600.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	651,100	8.400	5,469,240.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	48,950	408.000	19,971,600.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	234,500	66.750	15,652,875.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	68,600	143.500	9,844,100.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	132,800	54.250	7,204,400.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	510,600	22.300	11,386,380.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	41,500	142.500	5,913,750.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	169,510	30.750	5,212,432.500	
THAI OIL PCL NVDR	85,800	55.500	4,761,900.000	
CP ALL PCL NVDR	370,400	64.750	23,983,400.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	356,100	9.200	3,276,120.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	70,645	111.500	7,876,917.500	
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	29,200	31.500	919,800.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	123,422	44.750	5,523,134.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	145,208	62.000	9,002,896.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	76,000	59.750	4,541,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	613,600	8.200	5,031,520.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	44.250	2,504,550.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	207,700	33.250	6,906,025.000	
OSOTSPA PCL NVDR	23,700	34.000	805,800.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	21.000	2,211,300.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	4.920	1,739,712.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	91,933	34.500	3,171,688.500	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	56,800	85.500	4,856,400.000	

	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	90,600	45.500	4,122,300.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	31.000	6,094,600.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	67.500	4,124,250.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	73.750	3,621,125.000	
タイ・パーツ 小計		7,701,843		283,807,790.500 (987,651,111)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,250	678.000	4,237,500.000	
	CEZ	9,849	571.500	5,628,703.500	
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	77.650	2,095,695.850	
チェコ・コルナ 小計		43,088		11,961,899.350 (60,011,653)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,631,383	44.330	160,979,208.390	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,773	39,960.000	110,809,080.000	
	BANCO DE CHILE	2,769,044	85.000	235,368,740.000	
	EMPRESAS CMPC SA	60,153	2,289.000	137,690,217.000	
	EMPRESAS COPEC SA	22,418	8,850.000	198,399,300.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	6,600.000	69,834,600.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,905,981	123.000	234,435,663.000	
	COLBUN SA	580,423	137.500	79,808,162.500	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	20,026	1,880.000	37,648,880.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	7,492	38,199.000	286,186,908.000	
	FALABELLA SA	56,157	3,440.000	193,180,080.000	
	CENCOSUD SA	81,121	1,599.900	129,785,487.900	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,548.900	45,275,895.900	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA-RTS	1,138	2,536.300	2,886,309.400	
ENEL CHILE SA	1,469,615	55.900	82,151,478.500		
チリ・ペソ 小計		10,647,536		2,004,440,010.590 (309,010,485)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	4.760	1,136,864.120	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	15.140	679,755.720	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	16.310	1,568,793.660	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	187.300	874,316.400	
	KOC HOLDING AS	53,770	19.250	1,035,072.500	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	7.290	656,100.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,206	11.940	527,819.640	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	62,654	15.120	947,328.480	

	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	114,153	6.640	757,975.920	
	TURKIYE IS BANKASI	66,205	4.840	320,432.200	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFFINE	6,201	88.650	549,718.650	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	239,230	2.100	502,383.000	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	21,058	8.500	178,993.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,755	68.950	1,913,707.250	
トルコ・リラ 小計		1,109,821		11,649,260.540 (156,427,435)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	8,393	8,870.000	74,445,910.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	30,703	2,146.000	65,888,638.000	
	OTP BANK NYRT	13,782	13,300.000	183,300,600.000	
ハンガリー・フォロント 小計		52,878		323,635,148.000 (118,187,025)	
パキスタン・ルピー	MCB BANK LTD	12,400	172.680	2,141,232.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	21,868	98.410	2,152,029.880	
	HABIB BANK LTD	19,300	117.370	2,265,241.000	
パキスタン・ルピー 小計		53,568		6,558,502.880 (4,722,122)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	425,500	34.500	14,679,750.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	94,330	35.500	3,348,715.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	107,520	83.700	8,999,424.000	
	AYALA CORP	18,583	760.000	14,123,080.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,420	1,830.000	2,598,600.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	46,120	125.500	5,788,060.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	193,480	60.000	11,608,800.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	32,590	179.000	5,833,610.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	61,575	44.750	2,755,481.250	
	BDO UNIBANK INC	122,233	101.400	12,394,426.200	
	MEGAWORLD CORP	879,000	3.650	3,208,350.000	
	PLDT INC	5,260	1,255.000	6,601,300.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	636,375	35.600	22,654,950.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	54,840	142.000	7,787,280.000	
	SM INVESTMENTS CORP	16,463	965.000	15,886,795.000	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	4.050	3,652,695.000		
ABOITIZ POWER CORP	95,700	23.700	2,268,090.000		

	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	280.600	4,969,426.000	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	67,600	37.600	2,541,760.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	535.000	3,531,535.000	
フィリピン・ペソ 小計		3,784,800		155,232,127.450 (350,715,946)	
ブラジル・レアル	BRF SA	29,692	24.000	712,608.000	
	VALE SA	225,221	103.000	23,197,763.000	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	79,000	6.250	493,750.000	
	RAIA DROGASIL SA	63,500	24.150	1,533,525.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	11,250	35.960	404,550.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	35.450	698,365.000	
	BANCO DO BRASIL SA	56,400	29.190	1,646,316.000	
	ITAUSA SA	243,360	10.040	2,443,334.400	
	LOJAS AMERICANAS SA	53,174	21.910	1,165,042.340	
	GERDAU SA	67,130	31.120	2,089,085.600	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	223,010	23.500	5,240,735.000	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	39,200	21.850	856,520.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	295,812	23.650	6,995,953.800	
	CCR SA	65,320	12.600	823,032.000	
	WEG SA	52,472	75.510	3,962,160.720	
	BANCO BRADESCO SA PREF	282,085	25.200	7,108,542.000	
	BANCO BRADESCO SA	71,325	22.160	1,580,562.000	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	41,006	43.090	1,766,948.540	
	BRADESPAR SA	10,200	68.890	702,678.000	
	SUZANO SA	46,475	71.380	3,317,385.500	
	CPFL ENERGIA SA	22,200	30.000	666,000.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	299,447	26.640	7,977,268.080	
	B2W CIA DIGITAL	15,400	62.640	964,656.000	
	ENGIE BRASIL SA	17,987	41.510	746,640.370	
	ALPARGATAS SA	8,500	37.780	321,130.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	38,989	62.990	2,455,917.110	
	LOJAS RENNER SA	45,037	41.500	1,869,035.500	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	37,904	20.450	775,136.800	
	COSAN SA	14,400	89.190	1,284,336.000	
	TOTVS SA	23,600	30.570	721,452.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	68,500	24.500	1,678,250.000		
JBS SA	69,500	31.350	2,178,825.000		
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	50,869	12.580	639,932.020		

	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	17,998	42.980	773,554.040	
	HYPERA SA	18,200	33.430	608,426.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	127,116	55.220	7,019,345.520	
	MAGAZINE LUIZA SA	181,000	21.670	3,922,270.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	32,228	44.450	1,432,534.600	
	VIA VAREJO S/A	68,300	12.470	851,701.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	42,300	23.890	1,010,547.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	34,200	82.010	2,804,742.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	59,100	14.870	878,817.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	23.100	690,690.000	
	AMBEV SA	292,595	15.360	4,494,259.200	
	NATURA &CO HOLDING SA	57,100	51.020	2,913,242.000	
	TIM SA	62,200	12.510	778,122.000	
	RUMO SA	79,700	20.310	1,618,707.000	
	ブラジル・リアル 小計	3,789,602		118,814,393.140 (2,294,234,643)	
ポーランド・ ズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	9,785	192.150	1,880,187.750	
	BANK PEKAO SA	9,730	72.980	710,095.400	
	ORANGE POLSKA SA	30,783	6.935	213,480.100	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	16,447	64.620	1,062,805.140	
	LPP SA	67	8,600.000	576,200.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,600	210.900	337,440.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,292	184.380	791,358.960	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	57,812	32.220	1,862,702.640	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	88,535	6.434	569,634.190	
	CYFROWY POLSAT SA	12,239	30.200	369,617.800	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	7.334	382,776.120	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	36,309	33.220	1,206,184.980	
	DINO POLSKA SA	3,434	265.700	912,413.800	
	ALLEGRO.EU SA	22,895	58.500	1,339,357.500	
	ポーランド・ズロチ 小計	346,120		12,214,254.380 (352,232,225)	



マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	81,400	3.100	252,340.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,100	9.000	126,900.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	358,900	4.290	1,539,681.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.460	1,049,438.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	6.550	587,666.000	
	RHB BANK BHD	83,480	5.400	450,792.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	8.210	260,257.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	262,700	5.230	1,373,921.000	
	GAMUDA BHD	100,200	3.550	355,710.000	
	GENTING BHD	107,200	5.230	560,656.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	25,256	17.300	436,928.800	
	HONG LEONG BANK BHD	34,908	18.520	646,496.160	
	IOI CORP BHD	190,813	4.200	801,414.600	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	22,600	22.580	510,308.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	30.200	350,320.000	
	MALAYAN BANKING BHD	254,375	8.290	2,108,768.750	
	MISC BHD	100,880	6.980	704,142.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	136.100	558,010.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	18.540	857,660.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	19.720	439,756.000	
	PETRONAS GAS BHD	39,600	16.100	637,560.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	219,800	3.100	681,380.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	6.090	362,355.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	139,650	10.240	1,430,016.000	
	QL RESOURCES BHD	50,950	6.150	313,342.500	
	DIALOG GROUP BHD	233,944	3.070	718,208.080	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	891,450	4.200	3,744,090.000	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	3.360	278,208.000	
	SUPERMAX CORP BHD	74,571	4.570	340,789.470	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.400	334,800.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	107,200	9.890	1,060,208.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	4.110	699,111.000	
	MAXIS BHD	130,800	4.800	627,840.000	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	136,200	7.830	1,066,446.000		
IHH HEALTHCARE BHD	168,700	5.300	894,110.000		
WESTPORTS HOLDINGS BHD	35,700	4.200	149,940.000		
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	78,800	10.020	789,576.000		
SIME DARBY PLANTATION BHD	93,400	4.560	425,904.000		
マレーシア・リンギット 小計	4,930,457		28,525,050.160 (756,855,156)		

メキシコ・ペソ	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,000	42.090	3,577,650.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,615	243.810	2,588,043.150	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	16,460	158.180	2,603,642.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	57.390	2,002,911.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	162,100	116.810	18,934,901.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	53,025	53.200	2,820,930.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,635	263.620	2,012,738.700	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	86,300	34.850	3,007,555.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,040	369.900	4,453,596.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	193,952	101.570	19,699,704.640	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,116,678	14.110	29,866,326.580	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	96,600	18.700	1,806,420.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	23,100	104.580	2,415,798.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	320,000	63.940	20,460,800.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,085	220.810	5,318,208.850	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	29,200	80.720	2,357,024.000	
TELESITES SAB DE CV	77,300	20.280	1,567,644.000		
BECLÉ SAB DE CV	38,400	47.230	1,813,632.000		
メキシコ・ペソ 小計		3,387,390		127,307,525.720 (692,922,132)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,162	14.000	184,268.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	OPAP SA	11,246	12.050	135,514.300	
	JUMBO SA	8,143	16.150	131,509.450	
ユーロ 小計		35,681		451,291.750 (58,938,703)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	7,300	21,750.000	158,775,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,068	104,500.000	216,106,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,856	190,000.000	352,640,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,843	46,100.000	177,162,300.000	
	COWAY CO LTD	2,334	67,100.000	156,611,400.000	
	KT&G CORP	6,455	81,600.000	526,728,000.000	
	S-1 CORPORATION	794	82,300.000	65,346,200.000	
	KOREA GAS CORP	1,303	33,700.000	43,911,100.000	

CJ CORP	1,001	93,000.000	93,093,000.000	
KAKAO CORP	3,515	558,000.000	1,961,370,000.000	
CJ ENM CO LTD	299	142,700.000	42,667,300.000	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	28,100.000	70,165,700.000	
KMW CO LTD	1,334	61,000.000	81,374,000.000	
SK TELECOM CO LTD	2,524	276,500.000	697,886,000.000	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	21,511	10,400.000	223,714,400.000	
NCSOFT CORPORATION	1,026	925,000.000	949,050,000.000	
LG UPLUS CORP	15,681	12,700.000	199,148,700.000	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	15,261	13,300.000	202,971,300.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	562	1,566,000.000	880,092,000.000	
LG CHEM LTD	2,806	812,000.000	2,278,472,000.000	
LG CHEM LTD	499	383,500.000	191,366,500.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	203	684,000.000	138,852,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	27,394	37,150.000	1,017,687,100.000	
S-OIL CORP	2,460	78,900.000	194,094,000.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	6,526	48,150.000	314,226,900.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	4,600.000	93,159,200.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,263	41,800.000	219,993,400.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,338	161,000.000	215,418,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,044	293,000.000	305,892,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,675	85,200.000	142,710,000.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,228	128,000.000	285,184,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,129	305,500.000	1,261,409,500.000	
SK HYNIX INC	33,367	140,000.000	4,671,380,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,534	46,450.000	210,604,300.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	105,500.000	159,832,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	9,210	228,500.000	2,104,485,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,533	50,600.000	229,369,800.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,114	9,160.000	193,404,240.000	
KIA CORPORATION	16,327	84,600.000	1,381,264,200.000	
KOREA ZINC CO LTD	465	412,000.000	191,580,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	16,488	23,850.000	393,238,800.000	
HANWHA CORP	2,418	30,850.000	74,595,300.000	

KOREAN AIR CO LTD	9,724	27,000.000	262,548,000.000	
CJ LOGISTICS	451	178,000.000	80,278,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,093	254,000.000	277,622,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,020	87,500.000	89,250,000.000	
HLB INC	4,888	35,750.000	174,746,000.000	
LG ELECTRONICS INC	6,667	158,500.000	1,056,719,500.000	
LOTTE CORP	1,591	33,450.000	53,218,950.000	
LG CORP	5,251	90,700.000	476,265,700.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	12,000.000	109,956,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,763	45,450.000	216,478,350.000	
NAVER CORP	7,517	383,500.000	2,882,769,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,241	99,900.000	223,875,900.000	
OTTOGI CORP	66	571,000.000	37,686,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,001	66,600.000	133,266,600.000	
KANGWON LAND INC	8,713	24,950.000	217,389,350.000	
POSCO	4,603	328,000.000	1,509,784,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,811	13,950.000	122,913,450.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,381	663,000.000	2,241,603,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,560	192,000.000	683,520,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	291,300	83,600.000	24,352,680,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	26,770	7,520.000	201,310,400.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	49,402	75,000.000	3,705,150,000.000	
SHINSEGAE CO LTD	513	280,500.000	143,896,500.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	89,100.000	139,263,300.000	
YUHAN CORP	3,720	63,100.000	234,732,000.000	
HANON SYSTEMS	10,146	18,200.000	184,657,200.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	3,166	23,200.000	73,451,200.000	
GS HOLDINGS CORP	2,879	38,900.000	111,993,100.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,045	25,400.000	356,743,000.000	
CELLTRION INC	5,940	309,500.000	1,838,430,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	19,041	41,250.000	785,441,250.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,132	180,500.000	204,326,000.000	
CELLTRION PHARM INC	988	143,700.000	141,975,600.000	
LOTTE SHOPPING CO	538	126,500.000	68,057,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,361	76,700.000	334,488,700.000	
AMOREPACIFIC CORP	1,770	252,500.000	446,925,000.000	
SAMSUNG CARD CO	3,026	34,400.000	104,094,400.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,479	238,000.000	828,002,000.000	

	CJ CHEILJEDANG CORP	466	420,000.000	195,720,000.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	19,595	6,040.000	118,353,800.000	
	LG INNOTEK CO LTD	764	210,500.000	160,822,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	1,945	293,000.000	569,885,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	24,561	52,600.000	1,291,908,600.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,664	36,950.000	135,384,800.000	
	HANMI PHARM CO LTD	287	329,500.000	94,566,500.000	
	FILA HOLDINGS CORP	2,517	43,050.000	108,356,850.000	
	SEEGENE INC	979	169,200.000	165,646,800.000	
	E-MART CO LTD	1,007	171,000.000	172,197,000.000	
	GS RETAIL CO LTD	653	38,050.000	24,846,650.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	3,856	50,500.000	194,728,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	461	283,000.000	130,463,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	344	162,000.000	55,728,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,703	128,000.000	217,984,000.000	
	SK CHEMICALS CO LTD	409	260,000.000	106,340,000.000	
	NETMARBLE CORP	1,450	131,500.000	190,675,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	29,950	10,300.000	308,485,000.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,169	109,000.000	127,421,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,186	187,500.000	409,875,000.000	
	ALTEOGEN INC	2,329	89,000.000	207,281,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,459	129,000.000	704,211,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,033	770,000.000	795,410,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	416	327,000.000	136,032,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,922	41,850.000	122,285,700.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,850	128,100.000	493,185,000.000	
韓国・ウォン	小計	920,210		75,710,329,790.000 (7,419,612,319)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	16.520	1,106,840.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	9.370	843,300.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	5.710	925,020.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	103.000	659,200.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	78,500	50.100	3,932,850.000	
	BEIJING ENTERPRISES	21,500	26.150	562,225.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	180,000	2.680	482,400.000	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	258,000	22.350	5,766,300.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	9.750	682,500.000	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	46,000	27.500	1,265,000.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	40,500	50.900	2,061,450.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	7.300	1,036,600.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	565,600	9.490	5,367,544.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	243,620	19.880	4,843,165.600	
CHINA RESOURCES LAND LTD	198,888	36.600	7,279,300.800	
CITIC LTD	347,000	7.490	2,599,030.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	96,000	6.170	592,320.000	
LENOVO GROUP LTD	454,000	9.980	4,530,920.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,120,000	2.730	3,057,600.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	112,190	15.300	1,716,507.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,543,200	4.060	6,265,392.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	49,000	19.060	933,940.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	153,000	24.900	3,809,700.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	50,100	125.900	6,307,590.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	208,000	8.480	1,763,840.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	152,000	6.360	966,720.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	316,000	1.780	562,480.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	114,000	12.560	1,431,840.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	3.710	541,660.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	87,000	20.450	1,779,150.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	91,000	12.880	1,172,080.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	44,000	10.000	440,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	165,400	31.950	5,284,530.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	46,000	46.400	2,134,400.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	368,000	20.700	7,617,600.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	2.820	609,120.000	

CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	42.000	2,352,000.000	
BYD CO LTD	48,000	175.100	8,404,800.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	7.840	925,120.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	540,000	1.050	567,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	252,592	5.290	1,336,211.680	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	7.220	505,400.000	
CHINA YOUZAN LTD	880,000	2.480	2,182,400.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	433,788	6.970	3,023,502.360	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	5.430	733,050.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	91,200	10.080	919,296.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	179,500	23.900	4,290,050.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	460,000	15.840	7,286,400.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	339,000	10.440	3,539,160.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	152,000	15.240	2,316,480.000	
WEICHAI POWER CO LTD	135,440	19.900	2,695,256.000	
TINGYI HOLDING CORP	106,000	13.840	1,467,040.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	28,000	73.000	2,044,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	178,000	12.400	2,207,200.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	214,000	4.570	977,980.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	91,333	61.100	5,580,446.300	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	68,000	7.250	493,000.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	651,250	8.100	5,275,125.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	174,000	44.800	7,795,200.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	350,300	620.500	217,361,150.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	363,500	91.200	33,151,200.000	
LI NING CO LTD	132,500	53.950	7,148,375.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	260,000	2.980	774,800.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	1.410	971,828.400	
CHINA POWER INTERNATIONAL	500,000	1.780	890,000.000	

AIR CHINA / HONG KONG	76,000	6.700	509,200.000	
ZTE CORP	44,288	19.640	869,816.320	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	196,500	16.000	3,144,000.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	185,500	12.560	2,329,880.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	575,205	4.960	2,853,016.800	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	5.180	571,095.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,500	39.850	1,653,775.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	5,810,530	6.520	37,884,655.600	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	51,400	167.100	8,588,940.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	140,000	7.310	1,023,400.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	12.800	1,254,400.000	
MINTH GROUP LTD	46,000	31.500	1,449,000.000	
SSY GROUP LTD	132,000	4.720	623,040.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	84,000	11.880	997,920.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	238,000	12.140	2,889,320.000	
BANK OF CHINA LTD	4,804,200	2.990	14,364,558.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	67,500	23.500	1,586,250.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	9.960	597,600.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	10.140	1,005,888.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	239,970	58.850	14,122,234.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,694,235	5.500	20,318,292.500	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	49,500	7.610	376,695.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	18.300	979,050.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.530	591,628.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	33,000	31.500	1,039,500.000	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	31.350	981,255.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	494,142	9.830	4,857,415.860	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	240,000	5.150	1,236,000.000	
CHINA CITIC BANK-H	596,800	3.990	2,381,232.000	



KWG GROUP HOLDINGS LTD	65,000	13.280	863,200.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	44,800	178.100	7,978,880.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	67,000	131.000	8,777,000.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	26.200	524,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	143,028	11.360	1,624,798.080	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	3.090	927,000.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	8.230	699,550.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	3.790	613,980.000	
KINGSOFT CORP LTD	52,000	53.550	2,784,600.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	21.800	763,000.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	318,000	4.040	1,284,720.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	101,000	10.060	1,016,060.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	42,500	45.650	1,940,125.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	284,000	5.890	1,672,760.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	160,400	29.350	4,707,740.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	110,000	14.260	1,568,600.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	98,000	16.540	1,620,920.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	83,500	6.630	553,605.000	
SINOPHARM GROUP CO	76,000	19.840	1,507,840.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	112,000	8.860	992,320.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	178,527	6.760	1,206,842.520	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	129,000	11.300	1,457,700.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	3.340	661,320.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	194,000	10.780	2,091,320.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	64,200	15.540	997,668.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	164,000	32.150	5,272,600.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	61,200	11.620	711,144.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	102,000	50.000	5,100,000.000	

NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	60,300	29.450	1,775,835.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	399,656	4.270	1,706,531.120	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	125,000	3.870	483,750.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	31,000	14.840	460,040.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	79,000	18.920	1,494,680.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	3.310	827,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,547,000	3.070	4,749,290.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	30,000	54.800	1,644,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	9.200	947,600.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	46,000	50.700	2,332,200.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	130,500	18.280	2,385,540.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	118,000	9.930	1,171,740.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	93,600	6.930	648,648.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	461,000	2.530	1,166,330.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	25,500	34.550	881,025.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	226,000	7.460	1,685,960.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	106,500	4.730	503,745.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	72,000	12.020	865,440.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	537,000	5.540	2,974,980.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	26,000	75.550	1,964,300.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	78,000	15.900	1,240,200.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	12,500	17.320	216,500.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	90,000	73.400	6,606,000.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	5.330	490,360.000	

PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,300	99.900	2,827,170.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	14.100	733,200.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	15.520	582,000.000	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	20,000	10.100	202,000.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	23,750	33.300	790,875.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,706,000	1.140	3,084,840.000	
XIAOMI CORP	877,800	25.700	22,559,460.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	16,560	159.400	2,639,664.000	
WEIMOB INC	107,000	18.020	1,928,140.000	
MEITUAN	220,000	314.000	69,080,000.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	44,400	18.480	820,512.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	44,000	49.350	2,171,400.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	234,000	13.520	3,163,680.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	62,000	76.400	4,736,800.000	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD	42,000	18.720	786,240.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.590	1,057,350.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	42,000	35.400	1,486,800.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	111,000	12.640	1,403,040.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	99,500	37.200	3,701,400.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	52.600	305,080.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	78,000	17.860	1,393,080.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	27,000	16.240	438,480.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	4,000	334.800	1,339,200.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	62,000	10.980	680,760.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	66,000	36.400	2,402,400.000	
CHINA FEIHE LTD	83,000	22.650	1,879,950.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,700	148.000	1,139,600.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	49.750	1,741,250.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	44,000	29.850	1,313,400.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	13,200	276.400	3,648,480.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	122,600	33.000	4,045,800.000	

	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	38.700	967,500.000	
	NONGFU SPRING CO LTD	19,000	38.250	726,750.000	
	CHINA BOHAI BANK CO LTD	222,000	3.410	757,020.000	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	18,000	109.000	1,962,000.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,000	143.400	1,147,200.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	92,661	28.450	2,636,205.450	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	28,000	50.850	1,423,800.000	
	CGN POWER CO LTD	450,000	1.820	819,000.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	11.820	806,124.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	25,200	44.650	1,125,180.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	48,400	11.500	556,600.000	
	3SBIO INC	90,500	7.190	650,695.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	4.910	461,540.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	1.020	470,220.000	
	CHINA LITERATURE LTD	16,200	78.000	1,263,600.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.340	635,810.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	5.960	381,440.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	7.010	455,650.000	
	BOC AVIATION LTD	10,700	71.300	762,910.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	26,200	48.250	1,264,150.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	54,000	18.140	979,560.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	68,800	19.020	1,308,576.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	201,500	102.000	20,553,000.000	
	香港・ドル 小計	51,987,343		834,560,710.890 (11,775,651,633)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	32,000	279.500	8,944,000.000	
	ACER INC	206,532	32.100	6,629,677.200	
	ASUSTEK COMPUTER INC	44,554	371.500	16,551,811.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	26,616	499.000	13,281,384.000	
	ASIA CEMENT CORP	131,928	46.700	6,161,037.600	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	19,000	254.500	4,835,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	457,267	9.770	4,467,498.590	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	54,000	116.500	6,291,000.000	

MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	38,000	170.000	6,460,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	77,000	91.700	7,060,900.000	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	47,975	90.600	4,346,535.000	
QUANTA COMPUTER INC	181,858	97.900	17,803,898.200	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	80,777	43.750	3,533,993.750	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	43,760	206.000	9,014,560.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	244,761	17.400	4,258,841.400	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	84,169	48.000	4,040,112.000	
CHINA STEEL CORP	759,058	27.950	21,215,671.100	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	88,973	25.100	2,233,222.300	
ADVANTECH CO LTD	20,675	361.000	7,463,675.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	213,304	27.200	5,801,868.800	
DELTA ELECTRONICS INC	120,663	299.000	36,078,237.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	79,000	102.500	8,097,500.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	223,427	112.000	25,023,824.000	
AU OPTRONICS CORP	537,194	24.600	13,214,972.400	
TAIWAN MOBILE CO LTD	95,800	98.200	9,407,560.000	
EVERGREEN MARINE CORP	127,820	50.000	6,391,000.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	168,824	30.400	5,132,249.600	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,768	203.500	4,429,788.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	11,322	495.000	5,604,390.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	35,285	611.000	21,559,135.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	242,633	103.000	24,991,199.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	226,594	88.500	20,053,569.000	
GIANT MANUFACTURING	16,151	336.500	5,434,811.500	
MEDIATEK INC	91,507	999.000	91,415,493.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	416,936	56.400	23,515,190.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	466,944	18.550	8,661,811.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	584.000	11,096,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	89,000	65.200	5,802,800.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	600,146	23.000	13,803,358.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	488,941	47.250	23,102,462.250	

CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	727,403	10.400	7,564,991.200	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	708,448	26.150	18,525,915.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	762,225	120.000	91,467,000.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	616,495	31.550	19,450,417.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	3,020.000	18,784,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	528,058	13.300	7,023,171.400	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	791,061	9.090	7,190,744.490	
INVENTEC CO LTD	120,005	27.550	3,306,137.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	128,845	64.800	8,349,156.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	553,443	12.550	6,945,709.650	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,087,048	21.600	23,480,236.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	572,977	22.100	12,662,791.700	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,560	111.500	4,187,940.000	
NAN YA PLASTICS CORP	325,828	82.300	26,815,644.400	
WISTRON CORP	157,916	33.700	5,321,769.200	
POU CHEN CORP	178,990	34.150	6,112,508.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	305,297	72.800	22,225,621.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,392	274.500	10,264,104.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	64,480	98.000	6,319,040.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	10,658	484.000	5,158,472.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,589	49.450	2,303,826.050	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	43,588	72.000	3,138,336.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	62,899	55.000	3,459,445.000	
TAIWAN CEMENT CORP	313,171	46.700	14,625,085.700	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,499,083	610.000	914,440,630.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	728,525	53.000	38,611,825.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	180,000	34.300	6,174,000.000	
YAGEO CORP	20,160	578.000	11,652,480.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	151,000	30.900	4,665,900.000	
INNOLUX CORPORATION	512,345	24.650	12,629,304.250	
WPG HOLDINGS CO LTD	124,203	46.950	5,831,330.850	

	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	14,000	334.500	4,683,000.000	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	17,475	408.500	7,138,537.500	
	PEGATRON CORP	103,554	73.300	7,590,508.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	7,000	1,135.000	7,945,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	22,000	379.000	8,338,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	67,470	199.500	13,460,265.000	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	16,000	253.000	4,048,000.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,345.000	2,690,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	29,385	113.000	3,320,505.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	518,954	20.850	10,820,190.900	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	199,993	41.250	8,249,711.250	
	WIWYNN CORP	4,000	830.000	3,320,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	204,903	112.000	22,949,136.000	
	SILERGY CORP	5,000	2,525.000	12,625,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	12,000	820.000	9,840,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	12,000	406.500	4,878,000.000	
	台湾・ドル 小計	19,568,808		1,983,794,324.130 (7,648,320,637)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	278.220	1,992,889.860	
	BIDVEST GROUP LTD	16,200	174.150	2,821,230.000	
	CLICKS GROUP LTD	15,531	238.010	3,696,533.310	
	DISCOVERY LTD	21,137	135.610	2,866,388.570	
	GOLD FIELDS LTD	55,734	144.330	8,044,088.220	
	REMGRO LTD	26,000	107.020	2,782,520.000	
	NORTHAM PLATINUM LTD	23,602	267.710	6,318,491.420	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	28,537	69.800	1,991,882.600	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,115	174.200	2,458,833.000	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,802	1,366.820	5,196,649.640	
	MTN GROUP LTD	106,352	87.970	9,355,785.440	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,508	323.160	8,566,325.280	
	FIRSTRAND LTD	303,968	50.290	15,286,550.720	
	NASPERS LTD	26,560	3,486.000	92,588,160.000	
	NEDBANK GROUP LTD	23,474	137.750	3,233,543.500	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,967	2,162.580	6,416,374.860	
	SASOL LTD	31,258	214.000	6,689,212.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	32,594	150.650	4,910,286.100	
MR PRICE GROUP LTD	18,210	195.870	3,566,792.700		

STANDARD BANK GROUP LTD	84,271	123.300	10,390,614.300	
SPAR GROUP LTD/THE	9,414	191.720	1,804,852.080	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	54,219	49.320	2,674,081.080	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	24,112	149.460	3,603,779.520	
ABSA GROUP LTD	39,186	123.700	4,847,308.200	
TIGER BRANDS LTD	11,803	206.180	2,433,542.540	
SANLAM LTD	119,561	56.600	6,767,152.600	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	48,966	282.620	13,838,770.920	
KUMBA IRON ORE LTD	3,173	612.870	1,944,636.510	
RMI HOLDINGS	35,836	30.210	1,082,605.560	
VODACOM GROUP PTY LTD	43,218	126.390	5,462,323.020	
NEPI ROCKCASTLE PLC	22,185	94.220	2,090,270.700	
OLD MUTUAL LTD	292,973	13.420	3,931,697.660	
REINET INVESTMENTS SCA	7,743	285.120	2,207,684.160	
MULTICHOICE GROUP LTD	27,258	123.050	3,354,096.900	
SIBANYE STILLWATER LTD	175,533	66.280	11,634,327.240	
BID CORP LTD	18,086	291.510	5,272,249.860	
南アフリカ・ランド 小計	1,801,249		272,122,530.070 (2,043,640,201)	
合計	149,303,577		53,981,706,088 (53,981,706,088)	

## (2) 株式以外の有価証券

2021年4月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
新株予約権証券	タイ・パーツ	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	9,465.000	8,329.200		
	タイ・パーツ 小計		9,465.000	8,329.200 (28,986)		
新株予約権証券	合計		9,465	28,986 (28,986)		
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	12,800.000	1,261,440.000		
		BANCO INTER SA	6,700.000	1,171,495.000		
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,700.000	821,996.000		
		ENERGISA SA	17,500.000	751,450.000		
		KLABIN SA	48,700.000	1,433,728.000		
		SUL AMERICA SA	15,356.000	521,182.640		
	ブラジル・リアル 小計		122,756.000	5,961,291.640 (115,108,965)		
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV		948,675.000	13,679,893.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		41,500.000	4,021,765.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV		121,800.000	19,842,438.000	
GRUPO TELEVISIA SAB			141,900.000	5,644,782.000		



		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	28,000.000	2,068,080.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,281,875.000	45,256,958.500 (246,329,098)	
投資信託受益証券 合計			1,404,631	361,438,063 (361,438,063)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	173,900.000	4,197,946.000	
	メキシコ・ペソ	小計	173,900.000	4,197,946.000 (22,849,000)	
	南アフリカ・ラ ンド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	259,878.000	3,503,155.440	
	南アフリカ・ランド	小計	259,878.000	3,503,155.440 (26,308,698)	
投資証券 合計			433,778	49,157,698 (49,157,698)	
合計				410,624,747 (410,624,747)	

(注) 新株予約権証券、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 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比 率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比 率 (%)	組入 投資証 券 時価比 率 (%)	有価証券の合計金 額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 66銘柄	13.89	-	-	-	14.80
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 9銘柄	0.54	-	-	-	0.58
イギリス・債券	株式 1銘柄	0.06	-	-	-	0.06
インド・ルピー	株式 96銘柄	9.03	-	-	-	9.62
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.14	-	-	-	1.22
オフショア・人民元	株式 358銘 柄	4.18	-	-	-	4.46
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.63	-	-	-	0.67
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.49	-	-	-	0.52
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.15	-	-	-	0.17
サウジアラビア・リアル	株式 35銘柄	2.59	-	-	-	2.76
タイ・パーツ	株式 44銘柄	1.70	-	-	-	1.82
	新株予約権証 券 1銘柄	-	0.00	-	-	
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.10	-	-	-	0.11
チリ・ペソ	株式 15銘柄	0.53	-	-	-	0.57
トルコ・リラ	株式 14銘柄	0.27	-	-	-	0.29
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.20	-	-	-	0.22
パキスタン・ルピー	株式 3銘柄	0.01	-	-	-	0.01
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.61	-	-	-	0.64

ブラジル・リアル	株式	47銘柄	3.96	-	-	-	4.43
	投資信託受益証券	6銘柄	-	-	0.20	-	
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.61	-	-	-	0.65
マレーシア・リングgit	株式	38銘柄	1.31	-	-	-	1.39
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.20	-	-	-	1.77
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.43	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	
ユーロ	株式	4銘柄	0.10	-	-	-	0.11
韓国・ウォン	株式	106銘柄	12.80	-	-	-	13.64
香港・ドル	株式	202銘柄	20.32	-	-	-	21.65
台湾・ドル	株式	87銘柄	13.20	-	-	-	14.06
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.53	-	-	-	3.81
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.05	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

2021年4月30日現在

資産総額	107,648,887円
負債総額	61,361円
純資産総額（ - ）	107,587,526円
発行済数量	92,078,114口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1684円

## D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

2021年4月30日現在

資産総額	196,664,997円
負債総額	117,020円
純資産総額（ - ）	196,547,977円
発行済数量	162,518,884口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2094円

（参考）

## 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	312,246,627,377円
負債総額	1,429,661,000円
純資産総額（ - ）	310,816,966,377円
発行済数量	238,183,336,735口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3049円

## 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	353,066,896,353円
負債総額	1,150,911,883円
純資産総額（ - ）	351,915,984,470円
発行済数量	113,274,466,274口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1068円

## 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	138,745,986,713円
負債総額	253,675,792円
純資産総額（ - ）	138,492,310,921円
発行済数量	68,538,664,991口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0206円

## 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	516,108,348,882円
負債総額	232,756,097円
純資産総額（ - ）	515,875,592,785円
発行済数量	99,304,079,087口
1口当たり純資産額（ / ）	5.1949円

## エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	155,894,704,679円
負債総額	1,465,150,219円
純資産総額( - )	154,429,554,460円
発行済数量	73,468,522,416口
1口当たり純資産額( / )	2.1020円

## エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年4月30日現在

資産総額	59,414,349,526円
負債総額	4,025,107円
純資産総額( - )	59,410,324,419円
発行済数量	39,392,955,775口
1口当たり純資産額( / )	1.5081円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### (1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

### (2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

### (3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

### (4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

### (5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

### (6) 受益権の再分割

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

### (7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

## 第二部【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(2021年4月30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(2021年4月30日現在)

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

###### 1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

## 2.運用計画、売買計画の決定

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年4月30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	1,470,877,769,130
追加型株式投資信託	843	15,735,956,827,061
単位型公社債投資信託	30	64,520,748,527
単位型株式投資信託	207	1,285,603,401,803
合計	1,106	18,556,958,746,521



### 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36期事業年度(自2020年4月1日至2021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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	32,932,013	36,734,502
金銭の信託	28,548,165	25,670,526
有価証券	996	-
未収委託者報酬	11,487,393	16,804,456
未収運用受託報酬	4,674,225	5,814,654
未収投資助言報酬	331,543	317,567
未収収益	11,674	7,412
前払費用	480,129	724,591
その他	2,815,351	2,419,487
流動資産計	81,281,494	88,493,198
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 1,006,793	1 915,815
器具備品	1 270,768	1 202,902
建設仮勘定	894	609
無形固定資産		
ソフトウェア	3,299,065	2,878,179
ソフトウェア仮勘定	221,784	1,109,723
電話加入権	3,931	3,931
投資その他の資産		
投資有価証券	261,361	261,360
関係会社株式	5,299,196	5,299,196
長期差入保証金	1,302,402	1,324,203
繰延税金資産	2,508,004	3,676,823
その他	111,162	591,970
固定資産計	14,285,364	16,264,717
資産合計	95,566,859	104,757,915

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(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	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	84,426,075		89,905,293	
運用受託報酬	16,912,305		17,640,234	
投資助言報酬	1,208,954		1,103,477	
その他営業収益	68,156		781,735	
営業収益計		102,615,492		109,430,741
営業費用				
支払手数料	34,980,736		37,003,102	
広告宣伝費	340,791		424,598	
公告費	375		400	
調査費	25,132,268		30,794,092	
調査費	10,586,542		11,302,420	
委託調査費	14,545,725		19,491,671	
委託計算費	698,723		543,135	
営業雑経費	990,002		938,891	
通信費	44,209		46,358	
印刷費	738,330		680,272	
協会費	71,386		71,361	
諸会費	22,790		23,936	
支払販売手数料	113,286		116,962	
営業費用計		62,142,897		69,704,220
一般管理費				
給料	10,817,861		10,586,117	
役員報酬	174,795		163,394	
給料・手当	9,087,800		9,030,562	
賞与	1,555,264		1,392,160	
交際費	40,436		8,168	
寄付金	8,906		7,757	
旅費交通費	320,037		50,081	
租税公課	651,265		912,570	
不動産賃借料	1,479,503		1,499,753	
退職給付費用	505,189		524,845	
固定資産減価償却費	882,526		1,078,185	
福利厚生費	44,352		44,004	
修繕費	1,843		777	
賞与引当金繰入額	1,373,328		1,789,597	
役員賞与引当金繰入額	65,290		76,410	
機器リース料	233		208	
事務委託費	3,625,424		3,793,883	
事務用消耗品費	104,627		68,534	
器具備品費	1,620		548	
諸経費	197,094		152,830	
一般管理費計		20,119,543		20,594,276
営業利益		20,353,050		19,132,244

(単位:千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)		第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	4,440		27,079	
受取配当金	11,185		2,356	
時効成立分配金・償還金	49,164		362	
投資信託償還益	5,528		-	
為替差益	-		7,314	
金銭の信託運用益	-		1,229,697	
受取負担金	297,886		-	
雑収入	7,394		13,505	
時効後支払損引当金戻入額	3,473		13,011	
営業外収益計		379,073		1,293,326
営業外費用				
為替差損	19,750		-	
投資信託償還損	1		3	
金銭の信託運用損	169,505		-	
システム解約料	31,680		-	
早期割増退職金	-		48,755	
雑損失	104		5	
営業外費用計		221,042		48,764
経常利益		20,511,082		20,376,806
特別利益				
投資有価証券売却益	1,169,758		-	
特別利益計		1,169,758		-
特別損失				
固定資産除却損	1 16,085		1 1,511	
特別損失計		16,085		1,511
税引前当期純利益		21,664,754		20,375,294
法人税、住民税及び事業税		7,045,579		7,418,311
法人税等調整額		385,835		1,168,820
法人税等合計		6,659,743		6,249,491
当期純利益		15,005,011		14,125,803

## (3) 【株主資本等変動計算書】

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								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 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			
						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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	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	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

## 重要な会計方針

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



(未適用の会計基準等)

## 1. 収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、2014年5月に「顧客との契約から生じる収益」(IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic 606)を公表しており、IFRS第15号は2018年1月1日以後開始する事業年度から、Topic 606は2017年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

## 2. 時価の算定に関する会計基準等

- ・「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日 企業会計基準委員会)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日 企業会計基準委員会)

### (1) 概要

国際会計基準審議会(IASB)及び米国財務会計基準審議会(FASB)が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス(国際財務報告基準(IFRS)においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」)を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定めることとされています。

### (2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2021年4月1日に開始する会計年度の期首から適用する予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

**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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
建物	320,020	407,133
器具備品	949,984	978,763

(損益計算書関係)

## 1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

	第35期 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)
建物	-	944
器具備品	9,609	566
ソフトウエア	6,475	-

(株主資本等変動計算書関係)

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

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					

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18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  
2021年6月16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
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17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

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021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	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(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、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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非上場株式	259,369	259,369
関係会社株式	5,299,196	5,299,196

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

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

## (注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

## 第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 其他有価証券(投資信託)	996	994	997	-

## 第36期(2021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	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

## (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35期の貸借対照表計上額5,299,196千円、第36期の貸借対照表計上額5,299,196千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。

## 2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計			
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1,990	2,000	9
小計	1,990	2,000	9
合計	1,990	2,000	9

(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

## 第36期(自 2020年4月1日 至 2021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)
投資信託	996	-	3

(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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,289,044	2,422,901
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の発生額	18,448	4,319
退職給付の支払額	187,749	245,143
過去勤務費用の発生額	-	1,567
その他	1,476	1,567
退職給付債務の期末残高	2,422,901	2,479,619

## (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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未積立退職給付債務	2,422,901	2,479,619
未認識数理計算上の差異	130,155	84,264
未認識過去勤務費用	173,798	102,868
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,118,947	2,292,486



## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	302,546	303,999
利息費用	2,087	2,180
数理計算上の差異の費用処理額	38,861	41,571
過去勤務費用の費用処理額	69,519	69,362
その他	11,303	7,720
確定給付制度に係る退職給付費用	401,711	409,394

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、当事業年度において48,755千円を営業外費用に計上しております。

## (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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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% ~ 3.76%

## 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103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

## (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35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
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	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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

## （企業結合等関係）

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

## 1. 結合当事企業

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

## 2. 企業結合日

2016年10月1日

## 3. 企業結合の方法

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

## 4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

## 5. 企業結合の主な目的

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

## 6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（\*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

## 7. 交付した株式数

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

## 8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

## 9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

## 10. 会計処理

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

## 11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

## (1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

## (2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

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

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

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

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

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

## 12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

## (1) 貸借対照表項目

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円

(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	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

## (2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85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	5,149,555千円	5,016,672千円

(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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)及び第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

## ( 関連当事者情報 )

## 1. 関連当事者との取引

## ( 1 ) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

## ( 3 ) 兄弟会社等

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	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	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

## 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) 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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08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35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
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通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
信金中央金庫	( ) 690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
GMOクリック証券株式会社	4,346	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

( ) 出資の総額

#### (3) 投資顧問会社

##### a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

##### b. 資本金の額

2020年3月末日現在 200百万円

##### c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社は委託会社との投資顧問契約に基づき、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

### 3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年1月12日	有価証券報告書
2021年1月12日	有価証券届出書

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

アセットマネジメントOne株式会社  
取締役会 御中EY新日本有限責任監査法人  
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容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) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド(堅実型)の2020年10月13日から2021年4月12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。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)の2021年4月12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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。



## 独立監査人の監査報告書

2021年5月28日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本正彦 印  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド(積極型)の2020年10月13日から2021年4月12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。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMコア資産設計ファンド(積極型)の2021年4月12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、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

## 利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。