

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年8月10日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	リスクコントロール世界資産分散ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

リスクコントロール世界資産分散ファンド

ただし、愛称として「マイスタート」という名称を用いる場合があります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金再投資コース」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。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%(税抜1.0%)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。

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、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。

(6) 【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「分配金再投資コース」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。

「分配金再投資コース」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。

(7) 【申込期間】

継続申込期間：2021年8月11日から2022年2月10日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、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「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、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。

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド*1を通じて投資します。*2*3

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

*2 一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

*3 有価証券指数等先物等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

また、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

2 基本資産配分によるポートフォリオの変動リスク*1を年率2%程度*2に抑えた安定的な運用をめざします。

●各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産の収益率のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度となるよう最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は原則月次で見直しますが、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。

●通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

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

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

3 基準価額の下落を一定水準(下値目安値*1)までに抑えることをめざします。

- 基本配分比率をもとに分散投資を行いつつ、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目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率*2を機動的に変更します。

下値目安値は、過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

- *1 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。)
- *2 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

4 年1回決算を行います。

- 毎年11月11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、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には、分配を行わないことがあります。

運用プロセス

基本配分比率の決定

資産価格に影響を与える「変動要因」および各資産の「トレンド」を勘案し、基本配分比率を決定します。
基本配分比率は月次で見直します。
※基本配分比率の決定にあたっては、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。



合計資産比率の機動的な変更

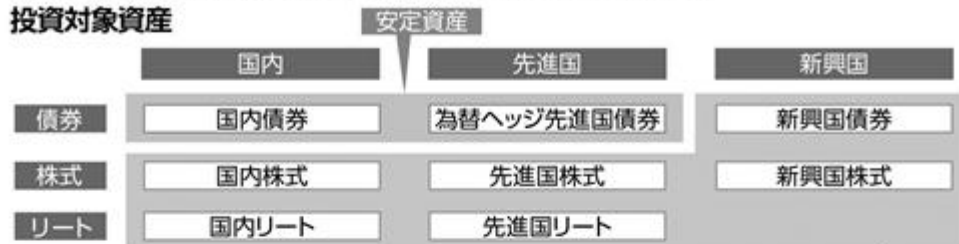
基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に機動的に合計資産比率を変更します。
下値目安値は毎営業日決定します。

リスクを抑えるための2つの運用手法により、安定的なリターンをめざします。



当ファンドでは、投資対象資産である国内外の8資産に対して、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目した分散投資を行うことで、特定の要因で大きく基準価額が変動するリスクを回避し、変動を抑えて運用を行うことをめざします。

投資対象資産

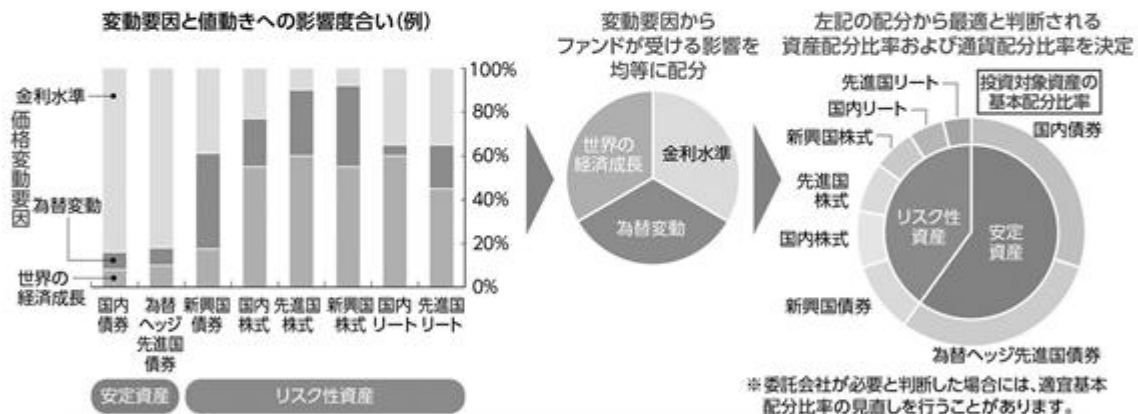


※当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。

当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

資産価格に影響を与える変動要因を判定し、変動要因の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産のトレンドを勘案した上で、基準価額の変動が小さくなるように最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。

通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。



価格変動要因が変化した場合

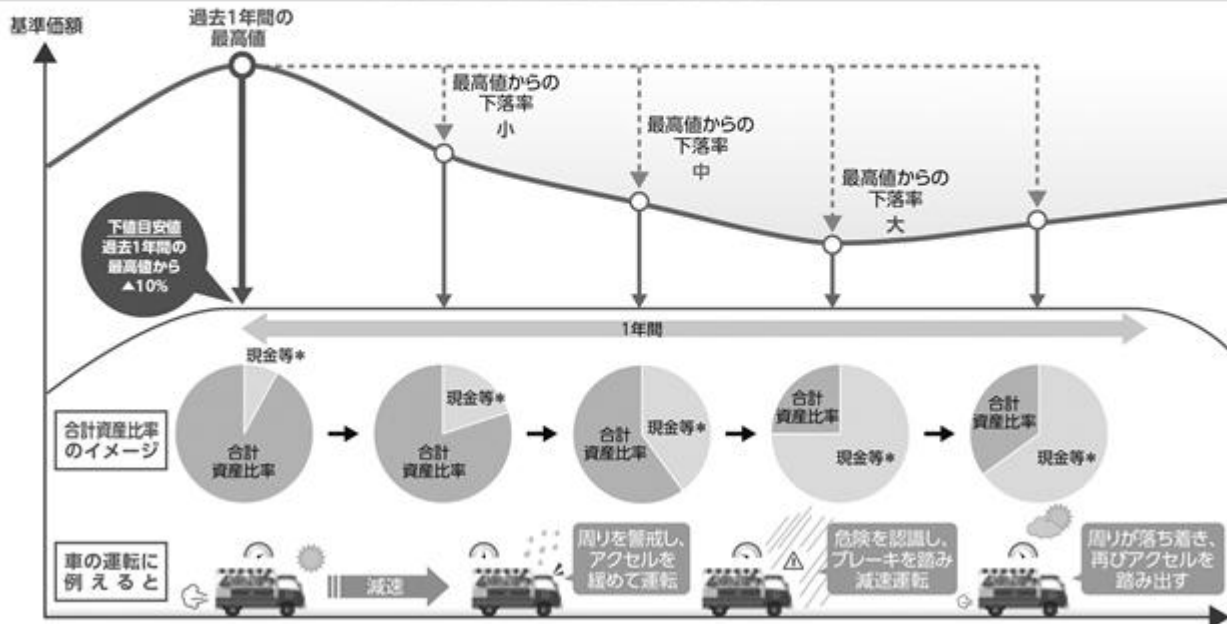


※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



当ファンドでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等には、現金等の比率を増やすことで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。

下値目安値と合計資産比率変更イメージ



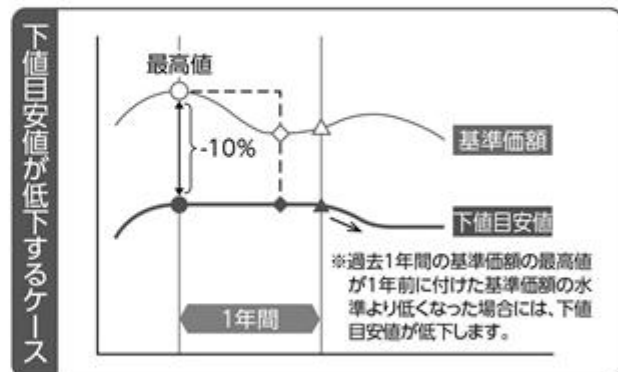
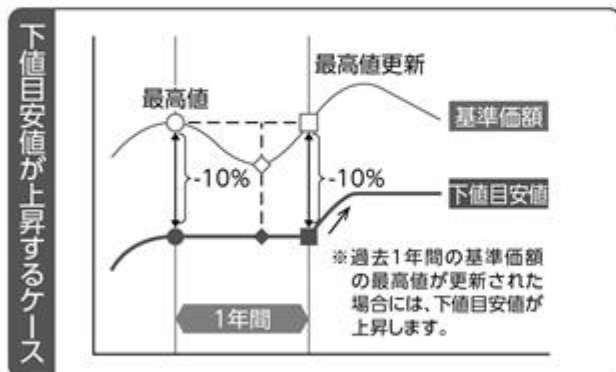
*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

*合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

下値目安値について

下値目安値は過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

*設定後1年に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。



*下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去1年間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去1年間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

*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。

■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

< 商品分類 >

・ 商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・ 商品分類定義

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

< 属性区分 >

・ 属性区分表

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
不動産投信 その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (債券、 株式、不動産投信) 資産配分変更型))	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

(注2) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年 1 回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいう。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジまたは一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。

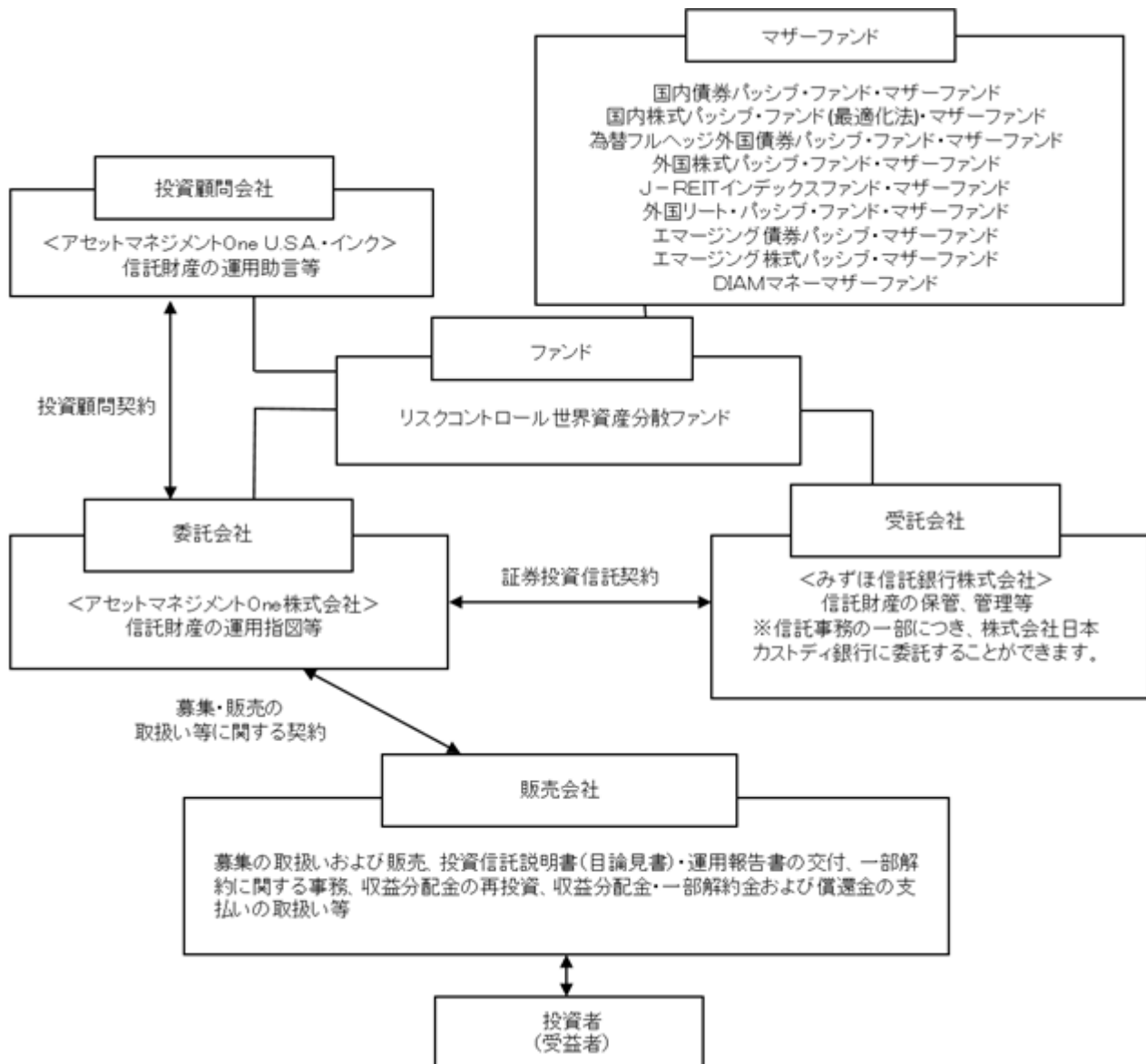
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（注3）当ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（2）【ファンドの沿革】

2018年5月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

委託会社と販売会社との間においては、募集・販売の取扱い等に関する契約を締結しております。当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、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

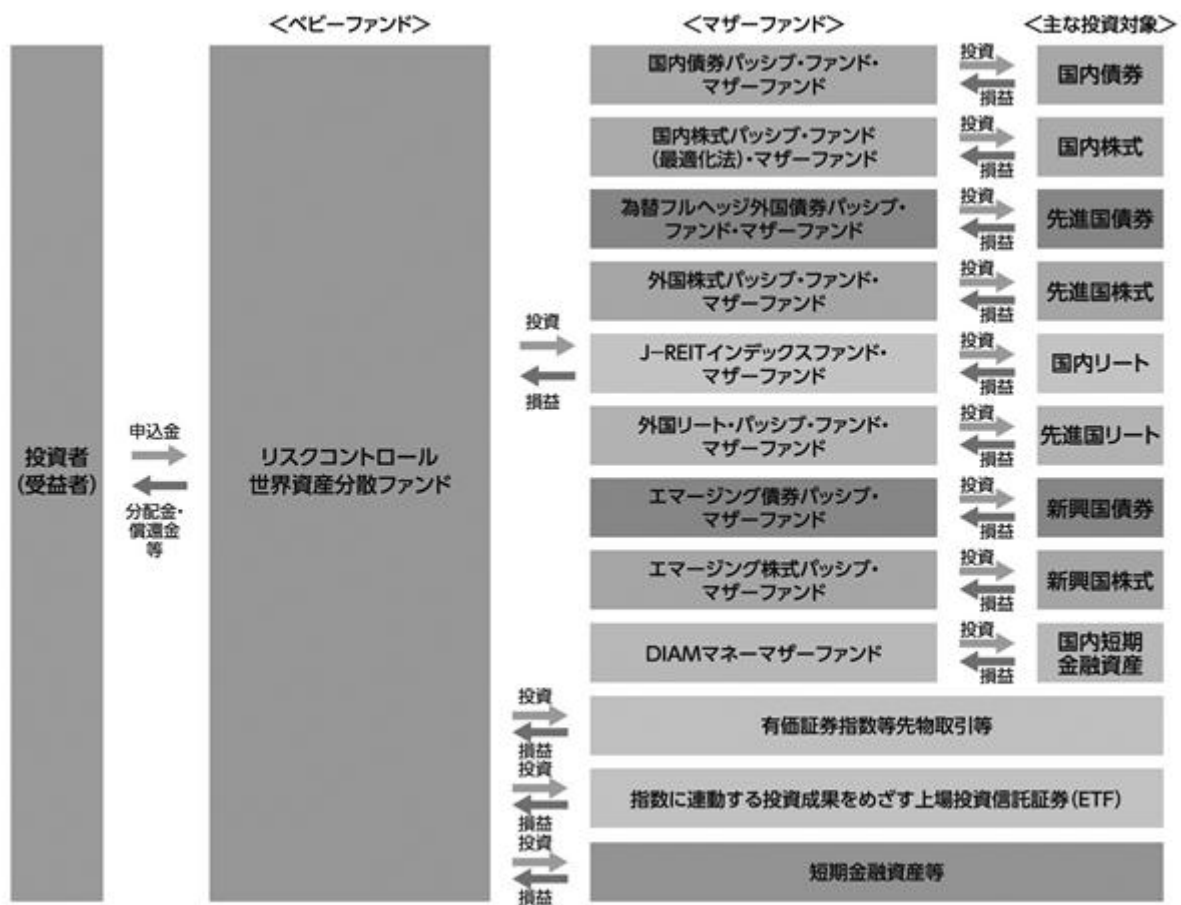
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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5月31日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

(2021年5月31日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

<投資対象>

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ETF）に投資する場合があります。また、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や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、有価証券指数等先物取引、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）等への投資を通じて、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（以下「各資産」ということがあります。）に実質的に分散投資を行います。

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

（上記マザーファンドおよびDIAMマネーマザーファンドを以下「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。）

上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度¹となるよう最終的に基本配分比率を決定します²。基本配分比率は原則月次で見直しますが、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、適宜見直しを行うことがあります。

- 1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。
- 2 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

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目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

（*）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。）。

（**）合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。

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

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項に定めるものをいいます。以下同じ。)
 - イ. 有価証券
 - ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第24条、第25条および第26条に定めるものに限りません。)
 - ハ. 金銭債権
 - ニ. 約束手形
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）
 15. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
 18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<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"> 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。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	---

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

投資態度

- 1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
- 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。
- 3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。
- 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。
- 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。

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。

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。

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。

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。

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

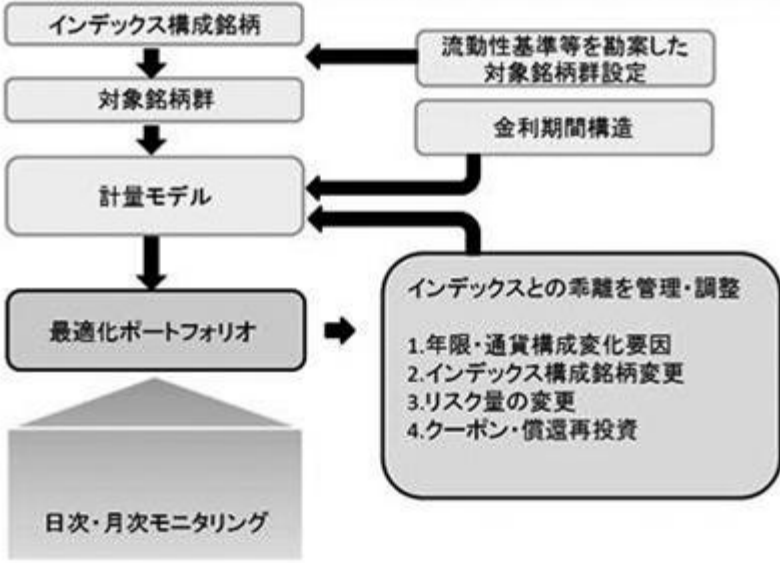
株東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

株東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(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。

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

運用プロセス	<p>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。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・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
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	------------------------------

基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <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>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日々・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1. 年限・通貨構成変化要因] H2[2. インデックス構成銘柄変更] H3[3. リスク量の変更] H4[4. クーボン・償還再投資] end </pre>

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

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

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

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

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

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

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

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

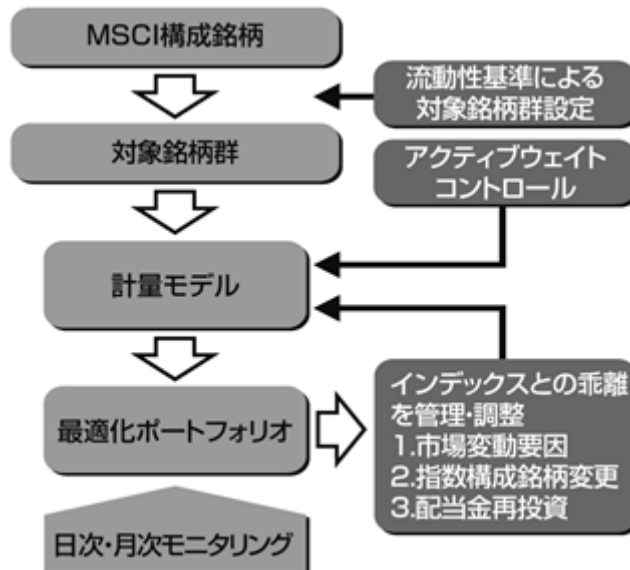
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

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

投資態度

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

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

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

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

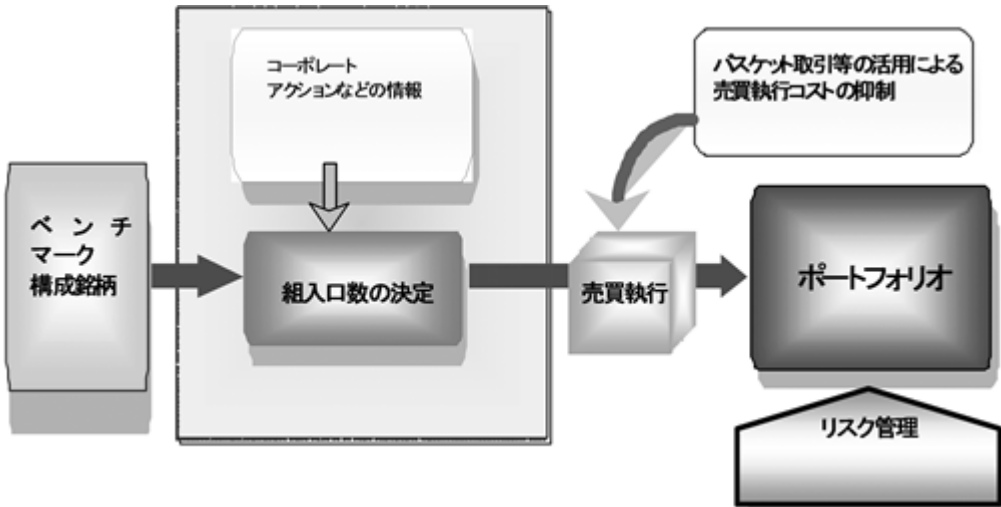
株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、株東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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

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

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

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

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

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

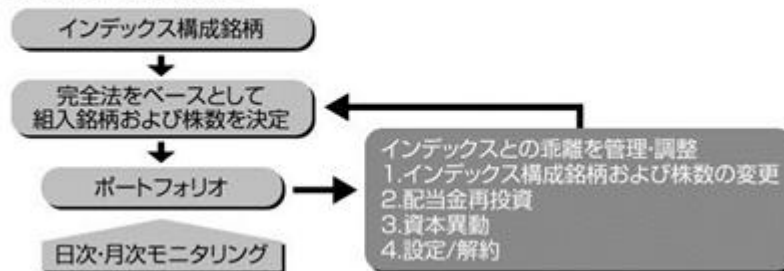
S & P 先進国 REITインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC(「Dow Jones」)の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、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

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

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

運用プロセス

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

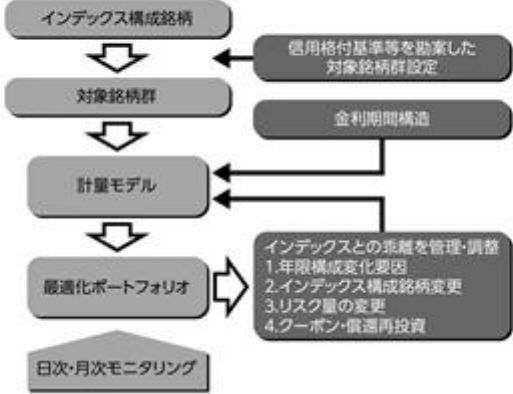


主な投資制限

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

ファンド名

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 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。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。 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。 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。 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。
--------	--

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^(*)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">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。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
------	---

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

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

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

	る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	<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] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> 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] --> C F --> 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"] --> D </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 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。 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。 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。 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。

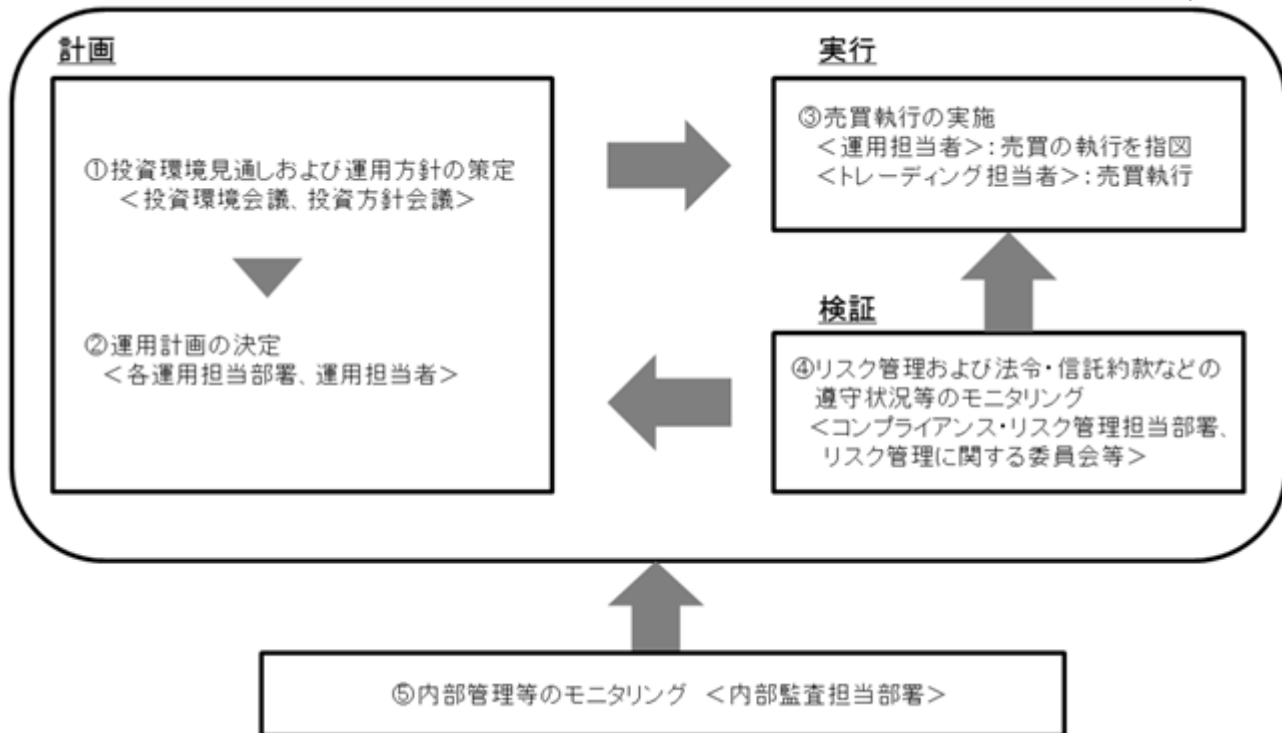
ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	<p>国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付(複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付)がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CPを主要投資対象とします。</p> <p>(*)主要格付機関とは、R&I、JCR、Moody's、S&Pとします。</p> <p>国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	<p>マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡張等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します(トップダウンアプローチ)。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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。

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2021年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年11月11日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

- (1) 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。
- (2) 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。
- (3) 留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

収益の分配方式

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

- 1) 信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

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せん。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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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。

「分配金再投資コース」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）

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

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

同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、信託財産の純資産総額の10%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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

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

投資する株式等の範囲（約款第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23条)

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

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

- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
- 2.株式分割により取得する株券
- 3.有償増資により取得する株券
- 4.売出しにより取得する株券
- 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
- 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(上記5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

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

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
- 3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

スワップ取引の運用指図（約款第25条）

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

じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第26条)

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

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

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

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

8)委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、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27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28条)

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産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、担保の受入れの指図を行うものとします。

公社債の空売りの指図および範囲(約款第29条)

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

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

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

公社債の借入れの指図および範囲(約款第30条)

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第31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32条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2)上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3)上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4)上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ(約款第38条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- 2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内であ

る場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4) 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

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

投資に際して資産配分を行う場合には、一般に当該資産への資産配分の比率に応じて、投資全体の成果に影響をおよぼします。当ファンドは、公社債、株式およびリートに資産配分を行いますが、配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等には、基準価額が下落する要因となります。

また、当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が、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追従できない場合があります。

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リーートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向、関係法令・規制等の変更等の影響を受けます。また、老朽化・災害等の発生による保有不動産の滅失・損壊等が発生する可能性があります。当ファンドが実質的に投資するリーートの市場価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

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

為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、当ファンドは投資環境によっては、為替予約取引の売建を実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があるため、為替相場の影響

を受けます。なお、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

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

流動性リスク

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

有価証券等を売却または取得する際に市場規模や取引量、取引規制等により、その取引価格が影響を受ける場合があります。一般に市場規模が小さい場合や取引量が少ない場合には、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないことや、値動きが大きくなることがあり、基準価額に影響をおよぼす要因となります。

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受け、基準価額が下落する要因となります。当ファンドが実質的に投資を行う株式・債券や通貨の発行者が属する新興国の経済状況は、先進国経済と比較して一般的に脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化等が株式・債券市場や為替市場におよぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制や課徴的な税制、海外への送金規制等の種々な規制の導入や政策の変更等の要因も株式・債券市場や為替市場に著しい影響をおよぼす可能性があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

- ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。
- ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

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

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

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

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

当ファンドは過去1年間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に10%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、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。

基準価額の水準が下値目安値に近づいた場合等では、下値目安値を意識した資産配分(組入比率)をめざすため、投資対象資産の合計資産比率の引上げについては機動的に行えない場合があります。

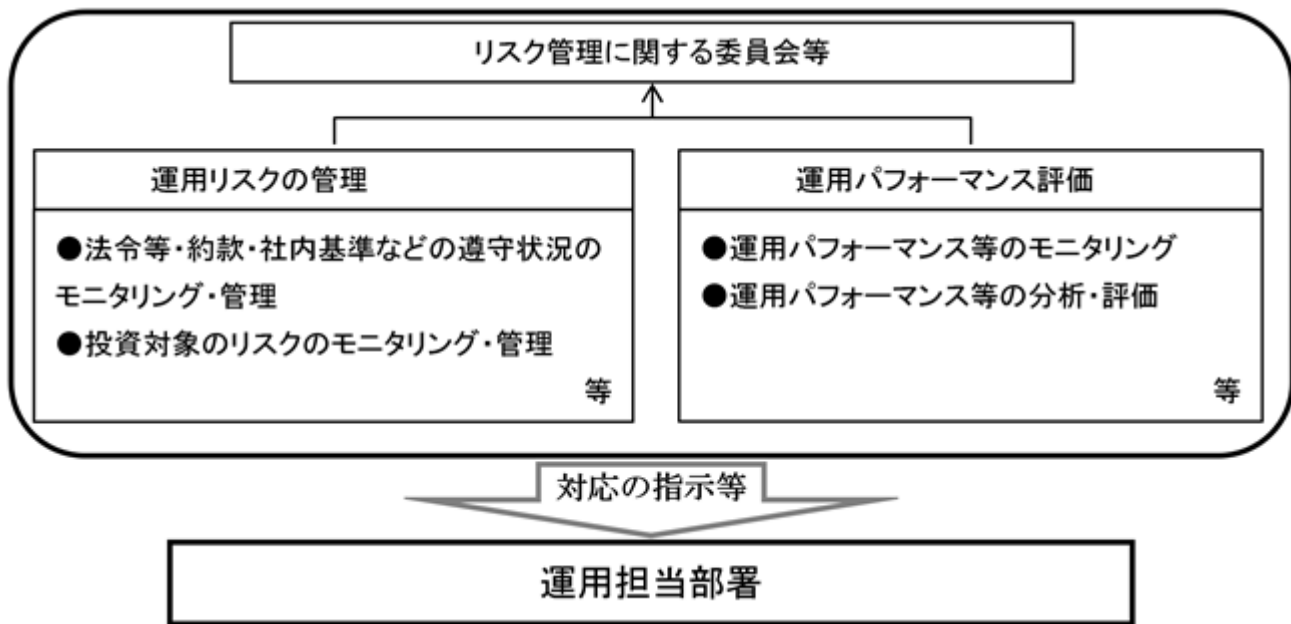
注意事項

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

< リスク管理体制 >

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

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



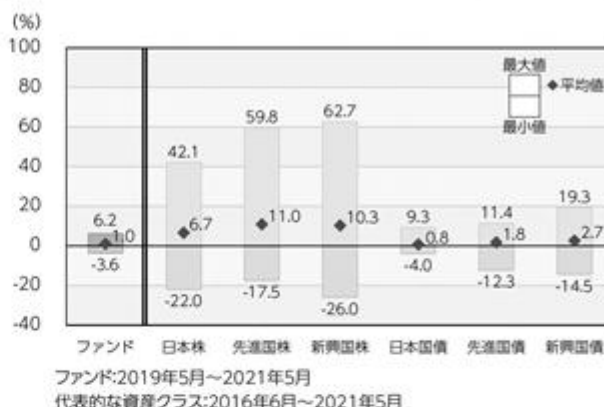
リスク管理体制は2021年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に1.1%(税抜1.0%)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。

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、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】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.089%(税抜0.99%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.48%	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0.48%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)に対する投資顧問報酬(当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.216%)が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

- ・ 信託財産留保額

ありません。

- ・ その他の費用

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

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

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

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

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

上記の「その他の費用」については、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならび

に上場株式等の配当所得および利子所得の金額（配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、）との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座（源泉徴収口座）をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います（確定申告不要）。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合には販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」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】

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94,195,763,831	95.98
内 日本	94,195,763,831	95.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,946,634,059	4.02
純資産総額	98,142,397,890	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5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	300,544,994,500	85.53
内 日本	300,544,994,500	85.53
地方債証券	18,944,008,700	5.39
内 日本	18,944,008,700	5.39
特殊債券	18,350,074,648	5.22
内 日本	18,350,074,648	5.22
社債券	13,288,124,750	3.78
内 日本	12,884,086,750	3.67
内 フランス	404,038,000	0.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	281,111,955	0.08
純資産総額	351,408,314,553	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5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	344,410,376,370	96.65
内 日本	344,410,376,370	96.65
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,950,801,476	3.35
純資産総額	356,361,177,846	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	12,245,975,000	3.44
内 日本	12,245,975,000	3.44

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

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

国債証券		559,577,673,485	98.62
内 アメリカ		246,909,765,621	43.51
内 フランス		58,717,335,287	10.35
内 イタリア		54,111,570,237	9.54
内 ドイツ		42,678,691,942	7.52
内 イギリス		36,932,219,362	6.51
内 スペイン		34,236,682,451	6.03
内 ベルギー		13,635,355,294	2.40
内 オーストラリア		12,326,148,310	2.17
内 カナダ		11,584,450,229	2.04
内 オランダ		10,788,261,198	1.90
内 オーストリア		8,056,434,811	1.42
内 アイルランド		4,687,713,046	0.83
内 メキシコ		4,443,923,505	0.78
内 ポーランド		3,536,731,000	0.62
内 フィンランド		3,427,311,842	0.60
内 デンマーク		2,691,029,106	0.47
内 マレーシア		2,660,813,125	0.47
内 イスラエル		2,504,984,156	0.44
内 シンガポール		2,316,359,213	0.41
内 スウェーデン		1,938,940,192	0.34
内 ノルウェー		1,392,953,558	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,846,278,796	1.38
純資産総額		567,423,952,281	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5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	510,307,502,257	95.82
内 アメリカ	349,113,888,500	65.55
内 イギリス	23,184,146,146	4.35
内 カナダ	19,364,872,685	3.64
内 フランス	17,982,697,222	3.38
内 スイス	17,519,016,505	3.29
内 ドイツ	15,784,850,395	2.96
内 オーストラリア	11,090,373,377	2.08
内 オランダ	10,207,777,895	1.92
内 アイルランド	9,638,476,563	1.81
内 スウェーデン	6,005,301,435	1.13
内 スペイン	4,464,295,152	0.84
内 デンマーク	4,252,622,333	0.80
内 香港	4,198,598,666	0.79
内 イタリア	3,181,305,802	0.60
内 ジャージー	2,148,790,330	0.40
内 フィンランド	2,095,831,249	0.39
内 シンガポール	1,572,786,911	0.30
内 ベルギー	1,468,185,226	0.28
内 バミューダ	1,276,035,848	0.24

内 ケイマン諸島	1,061,985,985	0.20
内 ノルウェー	1,052,456,674	0.20
内 イスラエル	971,103,300	0.18
内 ルクセンブルグ	518,099,941	0.10
内 ニュージーランド	514,944,210	0.10
内 オランダ領キュラソー	425,755,450	0.08
内 オーストリア	333,580,439	0.06
内 ポルトガル	249,059,896	0.05
内 パナマ	245,933,524	0.05
内 リベリア	210,550,861	0.04
内 マン島	127,350,650	0.02
内 パプアニューギニア	46,829,087	0.01
投資信託受益証券	935,939,506	0.18
内 オーストラリア	725,174,307	0.14
内 シンガポール	210,765,199	0.04
投資証券	10,719,274,933	2.01
内 アメリカ	9,887,285,456	1.86
内 フランス	291,885,038	0.05
内 イギリス	279,181,665	0.05
内 香港	193,683,357	0.04
内 カナダ	67,239,417	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,628,071,604	2.00
純資産総額	532,590,788,300	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	11,699,107,627	2.20
内 アメリカ	8,602,413,657	1.62
内 ドイツ	1,876,064,598	0.35
内 イギリス	546,428,300	0.10
内 カナダ	431,456,472	0.08
内 オーストラリア	242,744,600	0.05

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

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

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	84,719,897,830	97.74
内 日本	84,719,897,830	97.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,959,591,740	2.26
純資産総額	86,679,489,570	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	1,938,722,500	2.24
内 日本	1,938,722,500	2.24

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	7,784,239,357	10.69
内 オーストラリア	5,093,804,410	7.00
内 シンガポール	2,690,434,947	3.70
投資証券	64,799,499,086	89.01
内 アメリカ	53,862,780,794	73.99
内 イギリス	4,108,108,644	5.64
内 フランス	1,803,293,930	2.48
内 カナダ	1,439,452,126	1.98
内 香港	1,150,087,279	1.58
内 ベルギー	980,237,783	1.35
内 スペイン	352,022,752	0.48
内 ニューージーランド	302,793,796	0.42
内 ドイツ	200,744,314	0.28
内 ガーンジィ	192,979,552	0.27
内 オランダ	153,490,803	0.21
内 韓国	103,534,434	0.14
内 アイルランド	88,607,585	0.12
内 イスラエル	47,634,848	0.07
内 イタリア	13,730,446	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	216,871,013	0.30
純資産総額	72,800,609,456	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	152,797,453,437	98.15
内 メキシコ	23,385,445,556	15.02
内 インドネシア	20,900,941,775	13.43
内 ロシア	20,020,200,264	12.86
内 ブラジル	16,429,421,920	10.55
内 コロンビア	14,310,444,204	9.19
内 フィリピン	14,037,609,699	9.02
内 南アフリカ	10,129,564,944	6.51
内 パナマ	9,665,525,251	6.21
内 ペルー	8,539,598,447	5.49
内 ハンガリー	6,124,184,243	3.93
内 ルーマニア	5,962,410,247	3.83
内 クロアチア	3,292,106,887	2.11
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	2,879,824,411	1.85
純資産総額	155,677,277,848	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5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	54,352,595,394	89.29
内 ケイマン諸島	13,266,543,159	21.79
内 台湾	7,362,445,581	12.09
内 韓国	7,155,182,330	11.75
内 中国	6,221,118,882	10.22
内 インド	5,487,988,609	9.02
内 ブラジル	2,626,540,969	4.31
内 南アフリカ	2,027,772,554	3.33
内 サウジアラビア	1,538,370,369	2.53
内 ロシア	1,457,546,144	2.39
内 タイ	908,753,240	1.49
内 マレーシア	719,413,253	1.18
内 メキシコ	686,201,782	1.13
内 香港	664,822,651	1.09
内 インドネシア	650,311,534	1.07
内 パミュダ	402,249,678	0.66
内 アラブ首長国連邦	400,509,558	0.66
内 カタール	368,020,438	0.60
内 ポーランド	359,050,792	0.59
内 フィリピン	328,805,005	0.54
内 クエート	277,202,684	0.46
内 チリ	236,970,556	0.39
内 アメリカ	217,975,522	0.36
内 オランダ	160,388,332	0.26
内 トルコ	139,860,580	0.23
内 ハンガリー	128,404,063	0.21
内 ルクセンブルグ	121,710,221	0.20
内 キプロス	78,910,980	0.13
内 コロンビア	74,954,193	0.12
内 ギリシャ	71,440,253	0.12
内 ジョージア	60,466,205	0.10
内 チェコ	59,013,959	0.10
内 エジプト	27,546,537	0.05
内 イギリス領バージン諸島	17,345,392	0.03
内 マン島	16,912,191	0.03
内 ペルー	11,250,944	0.02
内 シンガポール	10,575,730	0.02
内 パキスタン	7,829,100	0.01
内 アルゼンチン	2,191,424	0.00
新株予約権証券	207,349	0.00
内 タイ	207,349	0.00
投資信託受益証券	377,134,828	0.62
内 メキシコ	252,279,449	0.41
内 ブラジル	124,855,379	0.21
投資証券	49,636,626	0.08

	内 南アフリカ	27,325,670	0.04
	内 メキシコ	22,310,956	0.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		6,093,559,787	10.01
純資産総額		60,873,133,984	100.00

その他資産の投資状況

2021年5月31日現在

資産の種類		時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)		6,452,886,988	10.60
	内 アメリカ	6,452,886,988	10.60

(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】

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	29,560,411,330	1.4558 43,035,532,833	1.4277 42,203,399,255	- -	43.00
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,902,398,398	1.3064 19,469,971,217	1.3054 19,453,590,868	- -	19.82
3	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,295,004,511	2.1042 9,037,600,716	2.1419 9,199,470,162	- -	9.37
4	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	2,882,124,480	3.1206 8,994,024,697	3.1493 9,076,674,624	- -	9.25
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,021,029,364	2.1982 4,442,664,599	2.4284 4,907,867,707	- -	5.00
6	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,543,332,803	1.2696 3,229,041,648	1.4756 3,752,941,884	- -	3.82
7	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	587,412,634	4.6504 2,731,706,899	5.2709 3,096,193,252	- -	3.15
8	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	1,654,424,615	1.3621 2,253,594,511	1.5145 2,505,626,079	- -	2.55

(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。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.98
合計	95.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	325回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,800,000,000	101.31 4,863,040,000	101.20 4,857,984,000	0.8 2022/9/20	1.38
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	100.37 4,316,039,000	0.1 2023/1/1	1.23
3	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,800,000,000	100.99 3,837,826,000	101.05 3,840,166,000	0.1 2028/3/20	1.09
4	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	102.24 3,732,088,500	0.4 2025/9/20	1.06
5	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	102.06 3,725,372,500	0.6 2024/3/20	1.06
6	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,670,000,000	101.05 3,708,549,000	101.01 3,707,397,300	0.1 2027/3/20	1.06
7	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	101.92 3,638,686,800	0.8 2023/6/20	1.04
8	330回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,550,000,000	102.28 3,631,016,500	102.16 3,626,715,500	0.8 2023/9/20	1.03
9	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,480,000,000	102.37 3,562,644,000	102.23 3,557,812,800	0.6 2024/6/20	1.01
10	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,430,000,000	102.01 3,499,202,000	102.00 3,498,737,200	0.4 2025/3/20	1.00
11	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	102.13 3,411,409,200	0.4 2025/6/20	0.97
12	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	101.87 3,372,095,600	0.3 2025/12/20	0.96

13	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,280,000,000	100.98 3,312,177,000	100.96 3,311,619,200	0.1 2026/3/20	0.94
14	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	100.96 3,311,619,200	0.1 2026/6/20	0.94
15	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	102.07 3,205,092,200	0.5 2024/9/20	0.91
16	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,190,000,000	100.19 3,196,073,700	100.46 3,204,769,700	0.1 2030/9/20	0.91
17	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,160,000,000	100.38 3,172,300,000	100.54 3,177,095,600	0.1 2030/6/20	0.90
18	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	101.00 3,141,224,400	0.1 2026/12/20	0.89
19	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,060,000,000	100.95 3,089,114,000	101.02 3,091,365,000	0.1 2028/6/20	0.88
20	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	100.91 3,077,938,000	0.1 2025/6/20	0.88
21	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,020,000,000	100.89 3,047,033,000	100.98 3,049,837,600	0.1 2028/9/20	0.87
22	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,010,000,000	101.04 3,041,392,200	101.03 3,041,093,300	0.1 2027/6/20	0.87
23	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.89 3,026,794,000	100.96 3,028,830,000	0.1 2025/12/20	0.86
24	423回 利付国庫債券 (2年) 日本	国債証券	3,000,000,000	100.26 3,007,990,000	100.25 3,007,710,000	0.005 2023/4/1	0.86
25	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,960,000,000	100.98 2,989,029,000	101.05 2,991,139,200	0.1 2027/12/20	0.85
26	141回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,960,000,000	100.79 2,983,433,800	100.74 2,982,081,600	0.1 2024/9/20	0.85
27	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	2,940,000,000	100.87 2,965,743,000	100.94 2,967,783,000	0.1 2028/12/20	0.84
28	139回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	2,920,000,000	100.70 2,940,725,600	100.66 2,939,272,000	0.1 2024/3/20	0.84
29	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	100.95 2,927,579,000	0.1 2025/9/20	0.83

30	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	101.87 2,913,482,000	0.6 2023/12/20	0.83
----	----------------------------	------	---------------	-------------------------	-------------------------	-------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	85.53
地方債証券	5.39
特殊債券	5.22
社債券	3.78
合計	99.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,322,600	8,189.03 10,830,818,210	9,115.00 12,055,499,000	- -	3.38
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	817,700	11,860.35 9,698,211,775	10,785.00 8,818,894,500	- -	2.47
3	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,016,400	9,473.89 9,629,267,579	8,256.00 8,391,398,400	- -	2.35
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	128,100	55,226.12 7,074,466,164	53,870.00 6,900,747,000	- -	1.94
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,807,600	550.81 4,851,375,606	620.00 5,460,712,000	- -	1.53
6	任天堂 日本	株式 その他製品	74,700	63,191.68 4,720,419,045	67,700.00 5,057,190,000	- -	1.42
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	893,600	5,049.35 4,512,100,763	5,555.00 4,963,948,000	- -	1.39
8	信越化学工業 日本	株式 化学	236,400	18,243.13 4,312,677,523	18,855.00 4,457,322,000	- -	1.25
9	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,498,400	2,813.35 4,215,532,545	2,931.50 4,392,559,600	- -	1.23
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,086,000	3,730.57 4,051,401,692	3,719.00 4,038,834,000	- -	1.13

11	日本電産 日本	株式 電気機器	314,300	13,816.57 4,342,549,449	12,530.00 3,938,179,000	- -	1.11
12	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,027,400	3,416.21 3,509,820,411	3,717.00 3,818,845,800	- -	1.07
13	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	76,500	42,787.18 3,273,219,400	48,660.00 3,722,490,000	- -	1.04
14	HOYA 日本	株式 精密機器	256,900	13,253.24 3,404,757,828	14,350.00 3,686,515,000	- -	1.03
15	日立製作所 日本	株式 電気機器	627,400	5,065.80 3,178,287,051	5,736.00 3,598,766,400	- -	1.01
16	ダイキン工業 日本	株式 機械	166,200	22,894.43 3,805,055,863	21,605.00 3,590,751,000	- -	1.01
17	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	891,100	3,715.74 3,311,098,913	3,951.00 3,520,736,100	- -	0.99
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	1,027,700	3,106.24 3,192,283,640	3,353.00 3,445,878,100	- -	0.97
19	村田製作所 日本	株式 電気機器	383,700	9,236.79 3,544,158,123	8,279.00 3,176,652,300	- -	0.89
20	ファナック 日本	株式 電気機器	114,600	27,706.29 3,175,141,542	26,300.00 3,013,980,000	- -	0.85
21	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,749,500	1,569.18 2,745,282,853	1,673.00 2,926,913,500	- -	0.82
22	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	899,500	3,204.13 2,882,121,940	3,249.00 2,922,475,500	- -	0.82
23	第一三共 日本	株式 医薬品	1,025,500	3,138.32 3,218,356,057	2,530.00 2,594,515,000	- -	0.73
24	SMC 日本	株式 機械	38,100	64,680.05 2,464,310,178	65,520.00 2,496,312,000	- -	0.70
25	三井物産 日本	株式 卸売業	1,025,300	2,123.03 2,176,747,426	2,414.00 2,475,074,200	- -	0.69
26	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	503,000	4,378.81 2,202,541,857	4,736.00 2,382,208,000	- -	0.67
27	三菱商事 日本	株式 卸売業	782,600	2,907.85 2,275,684,605	2,984.00 2,335,278,400	- -	0.66
28	三菱電機 日本	株式 電気機器	1,305,600	1,712.68 2,236,083,202	1,692.00 2,209,075,200	- -	0.62
29	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	423,900	5,507.70 2,334,715,468	5,179.00 2,195,378,100	- -	0.62
30	オリエンタルランド 日本	株式 サービス 業	132,700	17,318.30 2,298,139,088	16,310.00 2,164,337,000	- -	0.61

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率（%）
----	---------

株式	96.65
合計	96.65

（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5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.19
情報・通信業		8.72
輸送用機器		7.39
化学		7.13
機械		5.44
サービス業		5.42
銀行業		5.01
医薬品		4.91
卸売業		4.56
小売業		4.37
食料品		3.28
陸運業		3.21
精密機器		2.62
その他製品		2.48
建設業		2.25
不動産業		1.93
保険業		1.88
電気・ガス業		1.18
その他金融業		1.09
鉄鋼		0.81
証券、商品先物取引業		0.79
ガラス・土石製品		0.76
非鉄金属		0.74
ゴム製品		0.64
金属製品		0.60
繊維製品		0.47
空運業		0.46
石油・石炭製品		0.40
海運業		0.27
パルプ・紙		0.23
倉庫・運輸関連業		0.17
鉱業		0.16
水産・農林業		0.09
合計		96.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	3,570,492,800	94.09 3,359,525,965	94.08 3,359,331,603	0.875 2030/11/15	0.59

2	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	3,275,238,400	91.85 3,008,499,911	92.22 3,020,511,841	0.625 2030/8/15	0.53
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	2,675,948,800	95.84 2,564,767,487	95.96 2,568,074,614	1.125 2031/2/15	0.45
4	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	1,394,908,200	179.36 2,501,988,284	172.52 2,406,593,270	4.5 2041/4/25	0.42
5	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	2,143,612,800	106.25 2,277,781,525	106.25 2,277,756,058	2.75 2023/11/15	0.40
6	US T N/B 0.125 02/28/23 アメリカ	国債証 券	2,251,177,600	99.96 2,250,457,432	100.01 2,251,441,390	0.125 2023/2/28	0.40
7	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	2,232,518,400	100.25 2,238,249,145	100.29 2,239,146,188	0.375 2024/4/15	0.39
8	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証 券	2,223,737,600	99.99 2,223,581,938	100.01 2,224,171,918	0.25 2024/3/15	0.39
9	FRANCE OAT 1.75 05/25/23 フランス	国債証 券	2,011,449,600	105.12 2,114,440,065	104.79 2,107,932,802	1.75 2023/5/25	0.37
10	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	1,884,579,200	114.58 2,159,519,040	110.96 2,091,146,737	2.875 2028/5/15	0.37
11	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証 券	1,710,534,600	121.13 2,072,062,551	119.60 2,045,960,171	2.75 2027/10/25	0.36
12	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証 券	2,221,542,400	90.83 2,017,976,367	91.44 2,031,496,377	1.875 2051/2/15	0.36
13	US T N/B 1.375 11/15/40 アメリカ	国債証 券	2,254,470,400	86.96 1,960,680,776	87.07 1,963,062,468	1.375 2040/11/15	0.35
14	FRANCE OAT 1.0 11/25/25 フランス	国債証 券	1,833,575,400	106.84 1,959,071,935	106.64 1,955,407,317	1 2025/11/25	0.34
15	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	1,807,747,200	106.79 1,930,637,854	106.78 1,930,335,056	2.75 2024/2/15	0.34
16	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	1,688,108,800	115.57 1,950,963,901	112.92 1,906,310,045	3.125 2028/11/15	0.34
17	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	1,544,697,000	125.74 1,942,314,293	122.44 1,891,445,948	2.5 2030/5/25	0.33
18	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証 券	1,745,184,000	108.80 1,898,895,377	107.83 1,881,867,349	2.375 2027/5/15	0.33
19	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証 券	1,760,018,400	107.17 1,886,379,156	106.65 1,877,119,464	0.75 2028/5/25	0.33
20	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	1,858,236,800	99.95 1,857,363,428	99.98 1,858,019,032	0.75 2026/3/31	0.33
21	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証 券	1,836,284,800	100.26 1,841,150,954	100.20 1,840,086,478	1.5 2030/2/15	0.32
22	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証 券	1,858,236,800	98.85 1,837,052,900	98.90 1,837,912,334	0.5 2026/2/28	0.32
23	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	1,646,400,000	113.46 1,868,137,180	110.19 1,814,319,924	2.75 2028/2/15	0.32
24	US T N/B 1.625 11/15/50 アメリカ	国債証 券	2,098,611,200	88.05 1,847,964,932	85.95 1,803,903,877	1.625 2050/11/15	0.32
25	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証 券	1,794,576,000	99.46 1,785,000,981	99.71 1,789,528,754	0.125 2024/2/15	0.32
26	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	1,679,328,000	107.26 1,801,386,268	106.53 1,789,009,110	2.5 2024/5/15	0.32

27	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,669,449,600	107.47 1,794,221,993	106.48 1,777,768,178	2.375 2024/8/15	0.31
28	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,657,376,000	108.58 1,799,583,078	107.00 1,773,392,320	2.25 2025/11/15	0.31
29	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,081,956,600	169.97 1,839,056,041	163.02 1,763,816,468	5.75 2032/10/25	0.31
30	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,594,812,800	114.31 1,823,121,937	109.36 1,744,139,601	2.625 2029/2/15	0.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.62
合計	98.62

(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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,500,929	14,764.43 22,160,365,331	13,677.19 20,528,496,512	- -	3.85
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	640,513	26,880.77 17,217,486,575	27,404.87 17,553,179,853	- -	3.30
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	38,272	358,878.55 13,734,999,867	353,764.16 13,539,262,053	- -	2.54
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	215,091	29,955.97 6,443,260,784	36,081.40 7,760,785,439	- -	1.46

5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,315	231,843.77 6,100,968,857	264,692.82 6,965,391,705	- -	1.31
6	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,922	230,693.65 6,210,734,700	258,687.85 6,964,394,459	- -	1.31
7	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	273,052	15,677.17 4,280,683,905	18,026.98 4,922,303,598	- -	0.92
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	68,661	87,673.88 6,019,776,938	68,624.14 4,711,802,570	- -	0.88
9	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	235,044	18,238.14 4,286,767,712	18,576.87 4,366,384,182	- -	0.82
10	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	55,352	65,307.32 3,614,891,009	71,319.85 3,947,696,492	- -	0.74
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	122,504	26,886.38 3,293,690,039	31,768.93 3,891,821,539	- -	0.73
12	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	84,781	36,517.42 3,095,983,705	45,212.33 3,833,147,329	- -	0.72
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	151,655	23,190.03 3,516,884,980	24,948.44 3,783,556,881	- -	0.71
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	257,321	12,317.65 3,169,591,732	13,546.63 3,485,834,745	- -	0.65
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	96,206	30,654.57 2,949,153,978	35,003.56 3,367,552,647	- -	0.63
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	220,223	14,047.53 3,093,589,200	14,801.13 3,259,550,573	- -	0.61
17	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	695,277	3,725.60 2,590,325,903	4,652.72 3,234,933,653	- -	0.61
18	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	162,376	20,618.47 3,347,945,936	19,608.62 3,183,969,930	- -	0.60

19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	79,307	37,780.16 2,996,231,297	39,577.26 3,138,753,822	- -	0.59
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	99,587	32,306.05 3,217,263,316	28,539.79 2,842,192,584	- -	0.53
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	37,580	66,031.38 2,481,459,372	73,864.60 2,775,831,743	- -	0.52
22	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	409,180	5,874.21 2,403,612,188	6,293.63 2,575,230,960	- -	0.48
23	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	379,256	5,642.70 2,140,029,967	6,406.69 2,429,776,077	- -	0.46
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	63,104	38,109.74 2,404,877,647	38,474.79 2,427,913,526	- -	0.46
25	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	42,874	54,467.11 2,335,223,253	55,382.70 2,374,477,914	- -	0.45
26	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	369,913	5,970.60 2,208,604,193	6,200.34 2,293,587,258	- -	0.43
27	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	363,630	6,791.70 2,469,668,668	6,269.49 2,279,775,085	- -	0.43
28	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	365,880	5,583.28 2,042,812,930	6,068.63 2,220,390,490	- -	0.42
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	378,673	5,226.52 1,979,143,755	5,806.30 2,198,690,554	- -	0.41
30	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	39,668	60,715.40 2,408,458,644	55,188.42 2,189,214,466	- -	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5月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.82
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.01
合計	98.00

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年5月31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	6.41
インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.54
医薬品	4.47
情報技術サービス	4.44
半導体・半導体製造装置	4.39
コンピュータ・周辺機器	4.16
資本市場	3.22
保険	3.18
石油・ガス・消耗燃料	3.08
インターネット販売・通信販売	3.05
ヘルスケア機器・用品	2.90
化学	2.18
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.01
ホテル・レストラン・レジャー	1.90
機械	1.79
電力	1.76
バイオテクノロジー	1.73
専門小売り	1.70
金属・鉱業	1.67
飲料	1.66
自動車	1.64
食品	1.62
航空宇宙・防衛	1.54
繊維・アパレル・贅沢品	1.52
娯楽	1.46
各種電気通信サービス	1.44
食品・生活必需品小売り	1.33
コングロマリット	1.20
メディア	1.12
陸運・鉄道	1.11
家庭用品	1.10
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.04
各種金融サービス	0.98
電気設備	0.88
総合公益事業	0.84
専門サービス	0.78
航空貨物・物流サービス	0.74
通信機器	0.67
タバコ	0.67
パーソナル用品	0.66
建設関連製品	0.61
電子装置・機器・部品	0.53
複合小売り	0.50
消費者金融	0.50
不動産管理・開発	0.43
商業サービス・用品	0.42
家庭用耐久財	0.39
商社・流通業	0.33
無線通信サービス	0.30
容器・包装	0.29

自動車部品	0.29
建設資材	0.27
建設・土木	0.23
エネルギー設備・サービス	0.16
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
ガス	0.15
運送インフラ	0.14
紙製品・林産品	0.11
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	0.08
レジャー用品	0.07
旅客航空輸送業	0.06
合計	95.82

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	8,523	660,077.78 5,625,842,945	694,000.00 5,914,962,000	- -	6.82
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	7,573	629,176.22 4,764,751,525	660,000.00 4,998,180,000	- -	5.77
3	G L P 投資法人 日本	投資証券	23,663	167,867.88 3,972,257,756	186,900.00 4,422,614,700	- -	5.10
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	24,489	159,469.22 3,905,241,855	173,400.00 4,246,392,600	- -	4.90
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	37,719	97,580.13 3,680,625,277	110,800.00 4,179,265,200	- -	4.82
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	11,972	329,465.57 3,944,361,866	339,500.00 4,064,494,000	- -	4.69
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	10,805	280,577.93 3,031,644,637	306,000.00 3,306,330,000	- -	3.81
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	15,089	179,695.10 2,711,419,501	203,500.00 3,070,611,500	- -	3.54
9	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	16,195	144,360.05 2,337,911,054	157,000.00 2,542,615,000	- -	2.93
10	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	7,193	329,011.53 2,366,579,994	352,000.00 2,531,936,000	- -	2.92
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	10,704	183,621.81 1,965,487,947	196,000.00 2,097,984,000	- -	2.42

12	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	4,715	383,099.54 1,806,314,374	430,500.00 2,029,807,500	- -	2.34
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	22,273	82,387.50 1,835,016,818	90,600.00 2,017,933,800	- -	2.33
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	2,343	718,838.57 1,684,238,785	812,000.00 1,902,516,000	- -	2.19
15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	3,795	456,819.00 1,733,628,117	498,500.00 1,891,807,500	- -	2.18
16	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	2,610	617,608.21 1,611,957,429	634,000.00 1,654,740,000	- -	1.91
17	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	24,396	59,212.01 1,444,536,258	67,200.00 1,639,411,200	- -	1.89
18	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	9,160	167,521.62 1,534,498,080	178,500.00 1,635,060,000	- -	1.89
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	4,948	301,116.36 1,489,923,762	309,000.00 1,528,932,000	- -	1.76
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	2,643	518,328.14 1,369,941,282	562,000.00 1,485,366,000	- -	1.71
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	31,664	38,554.92 1,220,803,107	44,600.00 1,412,214,400	- -	1.63
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	8,895	148,903.10 1,324,493,084	157,800.00 1,403,631,000	- -	1.62
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	2,513	432,845.41 1,087,740,536	504,000.00 1,266,552,000	- -	1.46
24	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	1,613	705,464.38 1,137,914,052	778,000.00 1,254,914,000	- -	1.45
25	イオンリート投資法人 日本	投資証券	7,681	137,624.54 1,057,094,127	154,100.00 1,183,642,100	- -	1.37
26	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	5,161	199,676.92 1,030,532,588	225,200.00 1,162,257,200	- -	1.34
27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	3,405	322,297.79 1,097,423,986	339,000.00 1,154,295,000	- -	1.33
28	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	9,889	104,625.38 1,034,640,455	112,000.00 1,107,568,000	- -	1.28
29	ジャパンエクセレント投資法人 日本	投資証券	7,027	139,995.70 983,749,815	157,200.00 1,104,644,400	- -	1.27
30	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	6,278	162,094.38 1,017,628,524	174,900.00 1,098,022,200	- -	1.27

（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5月31日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	97.74
合計	97.74

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	336,380	11,418.17 3,840,844,451	12,934.11 4,350,778,747	- -	5.98
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	40,568	77,749.28 3,154,132,950	80,862.38 3,280,425,323	- -	4.51
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	69,112	26,187.90 1,809,898,538	31,005.00 2,142,817,891	- -	2.94
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	127,766	15,618.49 1,995,512,517	16,635.22 2,125,416,234	- -	2.92
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	149,302	11,065.66 1,652,126,039	14,103.06 2,105,615,422	- -	2.89
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	189,753	7,291.31 1,383,549,252	8,206.75 1,557,256,419	- -	2.14
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	63,440	19,558.95 1,240,819,810	22,713.73 1,440,959,310	- -	1.98
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	155,903	7,350.88 1,146,024,484	8,500.91 1,325,317,683	- -	1.82
9	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	169,794	6,905.02 1,172,431,484	7,507.58 1,274,742,717	- -	1.75
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	764,516	1,492.78 1,141,257,601	1,634.93 1,249,931,214	- -	1.72
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	57,820	18,389.08 1,063,256,907	19,565.81 1,131,295,573	- -	1.55
12	VENTAS INC アメリカ	投資証券	170,428	5,427.24 924,953,969	6,086.19 1,037,257,530	- -	1.42
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	258,029	3,403.70 878,255,355	3,980.99 1,027,212,210	- -	1.41
14	LINK REIT 香港	投資証券	944,420	993.84 938,606,626	1,058.37 999,554,295	- -	1.37
15	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	60,068	13,616.17 817,896,103	16,443.14 987,706,869	- -	1.36
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,609	28,917.91 856,230,678	32,411.03 959,658,199	- -	1.32

17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	50,783	16,598.07 842,900,295	18,376.01 933,189,383	- -	1.28
18	MID AMERICA アメリカ	投資証券	52,047	15,040.04 782,789,029	17,638.43 918,027,470	- -	1.26
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	245,111	3,346.88 820,357,766	3,663.78 898,034,936	- -	1.23
20	SEGRO PLC イギリス	投資証券	542,212	1,479.68 802,302,493	1,623.68 880,382,033	- -	1.21
21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	170,302	4,484.54 763,726,326	5,099.44 868,446,465	- -	1.19
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	244,544	2,997.23 732,955,310	3,416.82 835,564,982	- -	1.15
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	64,608	11,016.68 711,766,088	12,903.38 833,661,936	- -	1.15
24	UDR INC アメリカ	投資証券	135,309	4,603.10 622,841,961	5,227.86 707,377,699	- -	0.97
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	79,364	7,707.91 611,730,627	8,281.39 657,244,394	- -	0.90
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	130,721	3,787.44 495,098,762	4,778.95 624,709,175	- -	0.86
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	262,880	2,275.64 598,221,843	2,323.61 610,833,015	- -	0.84
28	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD フランス	投資証券	63,071	8,384.95 528,847,535	9,652.01 608,762,288	- -	0.84
29	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	44,221	11,723.21 518,412,160	13,761.70 608,556,524	- -	0.84
30	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	319,741	1,670.41 534,100,599	1,884.57 602,577,237	- -	0.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.69
投資証券	89.01
合計	99.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	3,073,280,000	124.10 3,814,134,316	124.40 3,823,393,889	5.25 2047/6/23	2.46

2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,524,480,000	117.98 2,978,456,140	118.49 2,991,357,331	5.1 2035/3/28	1.92
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,304,960,000	109.28 2,518,865,776	104.06 2,398,587,475	5 2045/6/15	1.54
4	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	2,019,584,000	112.65 2,275,191,990	113.55 2,293,328,513	4.75 2026/5/27	1.47
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,756,160,000	126.74 2,225,915,238	126.89 2,228,431,815	5.625 2042/4/4	1.43
6	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,635,424,000	123.09 2,013,169,186	124.61 2,037,975,440	6.05 2040/1/11	1.31
7	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,756,160,000	112.64 1,978,258,262	113.21 1,988,262,886	4.5 2029/4/22	1.28
8	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,800,064,000	109.14 1,964,661,852	108.87 1,959,758,477	4.875 2023/9/16	1.26
9	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,690,304,000	111.49 1,884,605,542	112.43 1,900,540,630	4.375 2029/3/21	1.22
10	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,415,904,000	135.40 1,917,275,606	134.11 1,899,010,444	6.7 2036/1/26	1.22
11	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,690,304,000	110.87 1,874,207,758	111.45 1,883,843,808	4.25 2027/6/23	1.21
12	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,262,240,000	149.53 1,887,485,469	149.02 1,881,039,401	7.75 2038/1/17	1.21
13	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,865,920,000	100.82 1,881,332,499	100.36 1,872,786,585	2.783 2031/1/23	1.20
14	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,580,544,000	114.38 1,807,897,900	114.18 1,804,677,783	6 2024/1/26	1.16
15	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,756,160,000	99.30 1,744,020,544	101.21 1,777,532,467	3.875 2030/6/12	1.14
16	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,624,448,000	107.56 1,747,354,174	109.09 1,772,150,934	4.625 2028/1/13	1.14
17	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,558,592,000	111.97 1,745,200,244	113.13 1,763,266,301	5.875 2025/9/16	1.13
18	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,536,640,000	113.19 1,739,390,867	114.20 1,754,842,880	4.75 2032/4/27	1.13
19	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,734,208,000	98.71 1,711,882,267	100.90 1,749,911,253	5 2045/1/27	1.12
20	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,317,120,000	135.66 1,786,826,395	131.63 1,733,725,056	5.625 2050/11/18	1.11
21	ROMANIA 6.125 01/22/44 ルーマニア	国債証券	1,251,264,000	130.28 1,630,163,247	134.05 1,677,419,493	6.125 2044/1/22	1.08

22	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,468,588,800	113.62 1,668,735,128	113.48 1,666,620,656	5.375 2024/3/25	1.07
23	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,361,024,000	117.75 1,602,701,031	119.38 1,624,804,061	5.55 2045/1/21	1.04
24	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,426,880,000	113.18 1,615,056,934	112.99 1,612,251,688	5.75 2023/11/22	1.04
25	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	987,840,000	162.88 1,609,043,842	162.90 1,609,285,204	7.625 2041/3/29	1.03
26	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,361,024,000	112.08 1,525,551,386	113.76 1,548,389,368	4.15 2027/3/28	0.99
27	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	1,097,600,000	139.72 1,533,580,988	141.04 1,548,074,544	6.375 2034/10/23	0.99
28	BRAZIL 8.25 01/20/34 ブラジル	国債証券	1,119,552,000	136.60 1,529,326,691	137.25 1,536,585,120	8.25 2034/1/20	0.99
29	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,317,120,000	121.75 1,603,640,796	116.45 1,533,786,240	6.125 2041/1/18	0.99
30	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	1,295,168,000	116.31 1,506,528,441	117.22 1,518,254,212	6 2026/4/7	0.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.15
合計	98.15

(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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,441,083	2,394.92 3,451,279,368	2,336.98 3,367,796,560	- -	5.53
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	337,000	8,875.04 2,990,890,384	8,505.21 2,866,255,770	- -	4.71

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	110,946	25,585.21 2,838,577,224	23,484.24 2,605,483,556	- -	4.28
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	279,951	8,175.98 2,288,876,342	7,881.83 2,206,528,989	- -	3.62
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	212,000	4,064.43 861,659,313	3,749.92 794,984,736	- -	1.31
6	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	25,534	27,441.06 700,680,044	24,134.37 616,247,041	- -	1.01
7	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	230,721	2,274.96 524,881,098	2,344.33 540,888,126	- -	0.89
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	166,403	2,947.19 490,422,016	3,184.09 529,843,126	- -	0.87
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,603,530	91.68 513,778,468	90.49 507,097,050	- -	0.83
10	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	363,500	1,250.84 454,683,025	1,199.77 436,119,666	- -	0.72
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	199,050	2,060.81 410,204,402	2,135.67 425,106,307	- -	0.70
12	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	50,835	8,360.04 424,983,090	8,115.65 412,559,291	- -	0.68
13	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	32,124	13,234.20 425,135,754	12,300.00 395,125,200	- -	0.65
14	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	100,287	3,900.12 391,131,946	3,862.85 387,393,838	- -	0.64

15	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	25,812	14,552.92 375,640,070	13,706.82 353,800,664	- -	0.58
16	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	845,400	373.58 315,831,476	404.40 341,883,141	- -	0.56
17	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	15,867	22,957.92 364,273,423	21,542.59 341,816,358	- -	0.56
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	88,507	3,843.83 340,205,905	3,806.52 336,903,754	- -	0.55
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	47,221	7,361.77 347,630,404	7,104.47 335,480,650	- -	0.55
20	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	199,000	1,523.28 303,132,988	1,627.51 323,875,286	- -	0.53
21	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	76,062	3,960.80 301,266,784	4,238.93 322,421,584	- -	0.53
22	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	729,225	480.23 350,197,363	439.67 320,619,084	- -	0.53
23	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	23,636	11,877.74 280,742,292	12,943.99 305,944,308	- -	0.50
24	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	160,668	1,700.27 273,180,148	1,852.19 297,589,269	- -	0.49
25	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	299,985	888.49 266,534,359	977.43 293,216,138	- -	0.48
26	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	351,271	694.91 244,102,999	779.73 273,898,306	- -	0.45

27	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	53,622	4,836.30 259,332,451	4,778.27 256,220,501	- -	0.42
28	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	7,239	37,850.08 273,996,785	35,227.19 255,009,700	- -	0.42
29	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,276,235	76.12 249,400,213	72.11 236,262,410	- -	0.39
30	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD 中国	株式 銀行	226,970	868.12 197,037,882	1,013.83 230,110,810	- -	0.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年5月31日現在

種類	投資比率（％）
株式	89.29
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.62
投資証券	0.08
合計	89.99

（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5月31日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
銀行	外国	11.29
インターネット販売・通信販売		8.45
半導体・半導体製造装置		8.04
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.59
コンピュータ・周辺機器		5.45
石油・ガス・消耗燃料		4.32
金属・鉱業		4.10
保険		2.57
自動車		2.53
化学		2.49
電子装置・機器・部品		2.37
不動産管理・開発		1.90
情報技術サービス		1.82
食品		1.62
医薬品		1.32
無線通信サービス		1.30
娯楽		1.16
飲料		1.10
繊維・アパレル・贅沢品		1.02

資本市場	1.01
食品・生活必需品小売り	1.01
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.98
バイオテクノロジー	0.96
各種電気通信サービス	0.93
コングロマリット	0.85
建設資材	0.81
ホテル・レストラン・レジャー	0.73
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.65
貯蓄・抵当・不動産金融	0.64
電力	0.63
パーソナル用品	0.56
専門小売り	0.55
各種金融サービス	0.54
ガス	0.53
運送インフラ	0.52
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.52
自動車部品	0.49
機械	0.47
海運業	0.45
消費者金融	0.45
電気設備	0.44
建設・土木	0.43
ソフトウェア	0.43
各種消費者サービス	0.41
家庭用耐久財	0.41
複合小売り	0.39
ヘルスケア機器・用品	0.36
家庭用品	0.36
タバコ	0.30
商業サービス・用品	0.28
航空貨物・物流サービス	0.25
陸運・鉄道	0.23
紙製品・林産品	0.19
通信機器	0.17
ヘルスケア・テクノロジー	0.16
メディア	0.13
旅客航空輸送業	0.12
航空宇宙・防衛	0.12
水道	0.09
商社・流通業	0.08
レジャー用品	0.06
エネルギー設備・サービス	0.06
容器・包装	0.04
専門サービス	0.03
建設関連製品	0.03
総合公益事業	0.02
販売	0.00
合計	89.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0306月	買建	635	12,280,504,550	12,245,975,000	3.44

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun21	買建	373	8,487,069,892	8,602,413,657	1.62
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun21	買建	345	1,848,669,296	1,876,064,598	0.35
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun21	買建	50	545,405,230	546,428,300	0.10
	モン トリ オ ール 取 引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun21	買建	20	424,978,086	431,456,472	0.08
	シ ド ニ ー 先 物 取 引 所	SPI 200 FUTURES Jun21	買建	16	238,234,371	242,744,600	0.05

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

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

J - R E I T インデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	T R E I T 先物 0 3 0 6 月	買建	935	1,801,652,980	1,938,722,500	2.24

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Jun21	買建	864	6,308,956,505	6,452,886,988	10.60

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2021年5月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年11月12日)	16,055	16,055	0.9834	0.9834

第2計算期間末 (2019年11月11日)	63,143	63,143	1.0389	1.0389
第3計算期間末 (2020年11月11日)	116,766	116,766	1.0188	1.0188
2020年5月末日	132,031	-	1.0140	-
6月末日	128,305	-	1.0157	-
7月末日	125,826	-	1.0190	-
8月末日	122,679	-	1.0128	-
9月末日	119,903	-	1.0161	-
10月末日	116,705	-	1.0118	-
11月末日	115,197	-	1.0264	-
12月末日	111,662	-	1.0288	-
2021年1月末日	108,737	-	1.0271	-
2月末日	104,347	-	1.0080	-
3月末日	102,975	-	1.0147	-
4月末日	99,831	-	1.0138	-
5月末日	98,142	-	1.0174	-

【分配の推移】

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
2020年11月12日～2021年5月11日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.6
第3計算期間	1.9
2020年11月12日～2021年5月11日	0.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
第2計算期間	48,308,726,995	3,853,963,676
第3計算期間	84,183,367,871	30,357,847,700
2020年11月12日～ 2021年5月11日	3,553,382,076	20,099,358,729

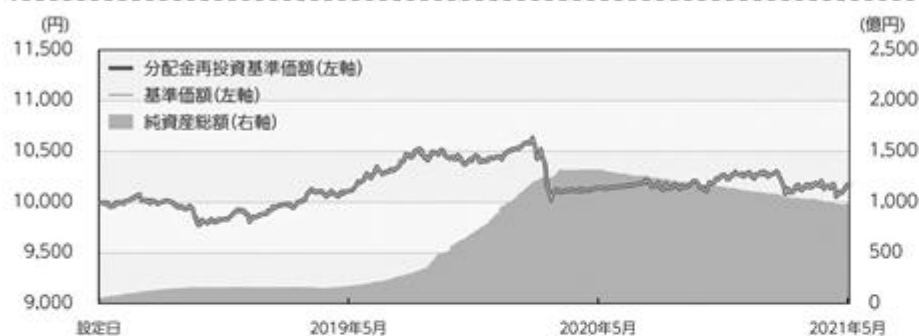
(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021年5月31日

基準価額・純資産の推移 (2018年5月25日~2021年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2018年5月25日)

分配の推移(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	43.00
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.82
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.37
4	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.25
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.00
6	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.82
7	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.15
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.55

■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	325回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.38
2	420回 利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	1.23
3	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.09
4	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	1.06
5	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.06

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

■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	3.38
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.47
3	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	2.35
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.94
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.53

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.59
2	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.53
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.45
4	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	フランス	4.5	2041/4/25	0.42
5	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.40

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	3.85
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.30
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.54
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 C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.31

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.82
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.77
3	GLP投資法人	投資証券	日本	5.10
4	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.90
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.82

○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。

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	5.98
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.51
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	2.94
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.92
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.89

■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	2.46
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.92
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.54
4	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	ロシア	4.75	2026/5/27	1.47
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.43

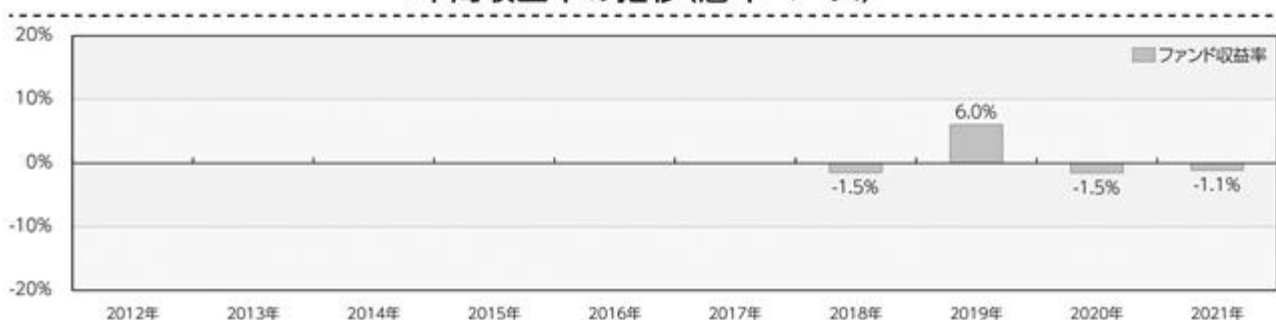
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

※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	5.53
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	4.71
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	4.28
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.62
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.31

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドは、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「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合、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。

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

「分配金再投資コース」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。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）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。

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、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「分配金再投資コース」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。

「分配金再投資コース」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經由して受託会社の指定するファンド口座（受託会社が信託事務の一部について委託を行っている場合は当該委託先の口座）に払込まれます。

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
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
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
不動産投資信託 証券	計算日における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の 円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の 円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2018年5月25日（設定日）から原則として2028年5月11日までです。

下記(5)その他イ．償還規定の場合には、信託終了前に信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。また、委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年11月12日から翌年11月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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き継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社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、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a. の事項(上記a. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

八. 関係法人との契約の更改

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

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

二. 公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ. 運用報告書

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

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1) 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、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委託会社または販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

なお、「分配金再投資コース」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。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2019年11月12日から2020年11月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第2期 2019年11月11日現在	第3期 2020年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,113,628,953	18,273,460,105
親投資信託受益証券	58,252,140,080	99,842,511,510
派生商品評価勘定	9,623,458	-
未収入金	-	367,255
流動資産合計	63,375,392,491	118,116,338,870
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	39,748,904	258,720,946
未払金	-	6,570,489
未払解約金	19,841,342	400,632,183
未払受託者報酬	5,217,685	20,689,253
未払委託者報酬	166,967,475	662,057,689
その他未払費用	530,613	1,442,256
流動負債合計	232,306,019	1,350,112,816
負債合計	232,306,019	1,350,112,816
純資産の部		
元本等		
元本	60,780,949,246	114,606,469,417
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,362,137,226	2,159,756,637
(分配準備積立金)	493,757,030	759,677,574
元本等合計	63,143,086,472	116,766,226,054
純資産合計	63,143,086,472	116,766,226,054
負債純資産合計	63,375,392,491	118,116,338,870

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第2期		第3期	
	自	2018年11月13日 至 2019年11月11日	自	2019年11月12日 至 2020年11月11日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,160,142,885		2,272,678,570
為替差損益		109,795,130		624,324,395
営業収益合計		1,050,347,755		1,648,354,175
営業費用				
支払利息		1,045,273		11,451,495
受託者報酬		7,801,834		38,167,490
委託者報酬		249,661,605		1,221,362,628
その他費用		868,656		2,714,590
営業費用合計		259,377,368		1,273,696,203
営業利益又は営業損失()		790,970,387		2,922,050,378
経常利益又は経常損失()		790,970,387		2,922,050,378
当期純利益又は当期純損失()		790,970,387		2,922,050,378
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()		85,405,717		595,913,363
期首剰余金又は期首欠損金()		270,434,510		2,362,137,226
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,927,007,066		3,344,005,014
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		33,858,916		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,893,148,150		3,344,005,014
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,220,248,588
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,220,248,588
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()		2,362,137,226		2,159,756,637

(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3期	
	自 2019年11月12日	至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
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。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期	第3期
	2019年11月11日現在	2020年11月11日現在
1. 期首元本額	16,326,185,927円	60,780,949,246円
期中追加設定元本額	48,308,726,995円	84,183,367,871円
期中一部解約元本額	3,853,963,676円	30,357,847,700円
2. 受益権の総数	60,780,949,246口	114,606,469,417口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 2018年11月13日 至 2019年11月11日	自 2019年11月12日 至 2020年11月11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(406,155,537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(7,612,501円)、信託約款に規定される収益調整金(1,868,380,196円)及び分配準備積立金(79,988,992円)より分配対象収益は2,362,137,226円(1万口当たり388.63円)ですが、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(377,413,635円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,400,079,063円)及び分配準備積立金(382,263,939円)より分配対象収益は2,159,756,637円(1万口当たり188.44円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第2期	第3期
	自 2018年11月13日 至 2019年11月11日	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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。	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2期 2019年11月11日現在	第3期 2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第2期 2019年11月11日現在	第3期 2020年11月11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	806,595,991	1,243,751,253
合計	806,595,991	1,243,751,253

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第2期 2019年11月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	10,765,210,454	-	10,795,335,900	30,125,446
アメリカ・ドル	1,536,188,475	-	1,553,250,000	17,061,525
イギリス・ポンド	1,848,219,456	-	1,844,718,800	3,500,656
オーストラリア・ドル	1,844,219,097	-	1,854,547,500	10,328,403
カナダ・ドル	1,843,289,024	-	1,855,648,000	12,358,976
ユーロ	3,693,294,402	-	3,687,171,600	6,122,802
合計	10,765,210,454	-	10,795,335,900	30,125,446

種類	第3期 2020年11月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	8,826,652,554	-	9,085,373,500	258,720,946
アメリカ・ドル	520,245,221	-	522,396,700	2,151,479
イギリス・ポンド	3,639,645,429	-	3,748,466,000	108,820,571
オーストラリア・ドル	2,072,185,044	-	2,161,972,500	89,787,456

カナダ・ドル	1,037,547,982	-	1,066,470,300	28,922,318
ユーロ	1,557,028,878	-	1,586,068,000	29,039,122
合計	8,826,652,554	-	9,085,373,500	258,720,946

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第2期 2019年11月11日現在	第3期 2020年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0389円 (10,389円)	1.0188円 (10,188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

2020年11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	2,111,986,489	5,913,984,566	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,590,852,978	2,077,813,074	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	1,108,509,845	2,203,717,571	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	541,145,646	2,263,449,893	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	2,866,762,131	3,389,086,191	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	47,679,821,346	70,070,265,450	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	5,163,738,631	6,465,517,139	

	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	3,538,104,277	7,458,677,626	
親投資信託受益証券	合計	64,600,921,343	99,842,511,510	
合計			99,842,511,510	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,961,110,807
国債証券	221,776,259,200
地方債証券	15,972,707,500
特殊債券	15,230,391,852
社債券	9,564,817,890
未収入金	2,753,728,400
未収利息	391,466,150
前払費用	86,361,822
流動資産合計	282,736,843,621
資産合計	282,736,843,621
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,561,504,000
流動負債合計	16,561,504,000
負債合計	16,561,504,000
純資産の部	
元本等	
元本	203,797,769,973
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,377,569,648
元本等合計	266,175,339,621
純資産合計	266,175,339,621
負債純資産合計	282,736,843,621

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	176,800,196,123円
同期中追加設定元本額	154,046,994,575円
同期中一部解約元本額	127,049,420,725円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	19,847,265,216円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	75,892,362円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	64,436,830円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	13,603,582円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	744,896,932円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	199,069,454円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	20,593,246円
たわらノーロード 国内債券	12,544,644,992円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,097,280,314円
たわらノーロード バランス(堅実型)	379,343,552円
たわらノーロード バランス(標準型)	606,633,260円
たわらノーロード バランス(積極型)	72,349,703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)	27,735,872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)	695,365,827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)	680,148,728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)	179,536,096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)	32,701,447円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	10,601,684円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	6,797,903円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	12,132,651円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,866,110円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	822,433円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,079,252,876円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	7,463,728,208円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	9,987,355,120円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,937,656,997円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	1,874,791,101円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,021,929,770円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	313,798,716円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	73,537,492円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,228,326,474円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,343,546円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,677,153,786円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,105,769,279円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	218,537,205円
投資のソムリエ	24,495,196,253円
クルーズコントロール	1,068,484,211円
投資のソムリエ<DC年金>	1,731,723,539円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,377,986,897円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	410,971,738円
クルーズコントロール<DC年金>	228,777円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	4,056,278円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	10,583,000円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,990,935,282円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	21,603,584,595円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	9,997,435円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,232,036円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	20,141,762円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	28,426,486円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	508,734,074円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,590,852,978円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,989,350,813円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,705,832円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,329,406円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,227,250円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	8,514,544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)	451,853,966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)	554,132,890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)	1,504,663,833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)	279,234,347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)	7,799,029,233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)	998,498,401円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	310,183,372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)	4,723,842,538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)	4,709,385,624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)	4,690,260,605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)	4,673,933,265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)	4,680,767,426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)	851,529,479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)	195,757,882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)	124,733,202円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	53,571,711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)	115,498,503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)	60,938,555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)	17,031,247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)	75,154,623円

D I A M世界バランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	153,832,395円
D I A Mバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	4,123,416,830円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A（適格機関投資家限定）	2,378,755,174円
D I A Mバランスファンド5 0 V A（適格機関投資家限定）	4,500,487,053円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A（適格機関投資家限定）	482,650,630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）	215,844,284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）	2,479,466,601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）	243,710,940円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A（適格機関投資家限定）	12,988,701円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A（適格機関投資家限定）	2,813,360,212円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A（適格機関投資家限定）	56,474,355円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A（適格機関投資家限定）	432,380,924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）	688,515,275円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A（適格機関投資家限定）	1,317,075,200円
D I A M世界バランス2 5 V A（適格機関投資家限定）	331,664,774円
D I A M国内バランス3 0 V A（適格機関投資家限定）	104,547,002円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,034,577,783円
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	203,797,769,973円
2. 受益権の総数	203,797,769,973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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<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 該当事項はありません。</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。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2020年11月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,586,232,200	
地方債証券	106,930,500	
特殊債券	146,935,656	
社債券	65,876,740	
合計	2,905,975,096	

(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2月15日から2020年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

		2020年11月11日現在
1口当たり純資産額		1.3061円
(1万口当たり純資産額)		(13,061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

2020年11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	408回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	802,232,000	
	409回 利付国庫債券(2年)	1,000,000,000	1,002,990,000	

410回 利付国庫債券(2年)	600,000,000	602,106,000	
411回 利付国庫債券(2年)	900,000,000	903,177,000	
412回 利付国庫債券(2年)	300,000,000	301,167,000	
413回 利付国庫債券(2年)	400,000,000	401,616,000	
414回 利付国庫債券(2年)	800,000,000	803,336,000	
415回 利付国庫債券(2年)	200,000,000	200,860,000	
416回 利付国庫債券(2年)	1,270,000,000	1,275,727,700	
第417回 利付国債2年	1,400,000,000	1,406,482,000	
131回 利付国庫債券(5年)	1,820,000,000	1,825,660,200	
132回 利付国庫債券(5年)	2,500,000,000	2,509,425,000	
133回 利付国庫債券(5年)	1,980,000,000	1,989,009,000	
134回 利付国庫債券(5年)	1,280,000,000	1,286,617,600	
135回 利付国庫債券(5年)	1,840,000,000	1,850,414,400	
136回 利付国庫債券(5年)	1,250,000,000	1,257,662,500	
137回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,208,076,000	
138回 利付国庫債券(5年)	1,450,000,000	1,460,382,000	
139回 利付国庫債券(5年)	2,320,000,000	2,337,562,400	
140回 利付国庫債券(5年)	1,490,000,000	1,502,128,600	
141回 利付国庫債券(5年)	1,210,000,000	1,220,539,100	
142回 利付国庫債券(5年)	1,920,000,000	1,937,414,400	
143回 利付国庫債券(5年)	1,500,000,000	1,514,100,000	
144回 利付国庫債券(5年)	2,550,000,000	2,574,174,000	
145回 利付国庫債券(5年)	1,200,000,000	1,211,412,000	
2回 利付国庫債券(40年)	280,000,000	395,738,000	
3回 利付国庫債券(40年)	290,000,000	411,962,400	
4回 利付国庫債券(40年)	550,000,000	785,009,500	
5回 利付国庫債券(40年)	500,000,000	691,090,000	
6回 利付国庫債券(40年)	570,000,000	777,063,900	
7回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	827,177,400	

8回 利付国庫債券(40年)	620,000,000	761,260,800	
9回 利付国庫債券(40年)	1,020,000,000	935,931,600	
10回 利付国庫債券(40年)	900,000,000	967,572,000	
11回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	782,632,500	
12回 利付国庫債券(40年)	750,000,000	706,785,000	
13回 利付国庫債券(40年)	460,000,000	432,947,400	
321回 利付国庫債券(10年)	1,300,000,000	1,319,864,000	
322回 利付国庫債券(10年)	1,600,000,000	1,622,288,000	
323回 利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	1,982,409,000	
324回 利付国庫債券(10年)	1,050,000,000	1,065,760,500	
325回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,424,332,000	
326回 利付国庫債券(10年)	500,000,000	508,805,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,200,000,000	1,223,664,000	
328回 利付国庫債券(10年)	1,790,000,000	1,820,805,900	
329回 利付国庫債券(10年)	1,770,000,000	1,812,975,600	
330回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,488,628,000	
331回 利付国庫債券(10年)	650,000,000	663,591,500	
332回 利付国庫債券(10年)	2,860,000,000	2,924,607,400	
333回 利付国庫債券(10年)	1,950,000,000	1,997,229,000	
334回 利付国庫債券(10年)	2,880,000,000	2,955,024,000	
335回 利付国庫債券(10年)	1,940,000,000	1,986,579,400	
336回 利付国庫債券(10年)	760,000,000	779,266,000	
337回 利付国庫債券(10年)	1,340,000,000	1,362,927,400	
338回 利付国庫債券(10年)	1,930,000,000	1,973,444,300	
339回 利付国庫債券(10年)	2,840,000,000	2,906,314,000	
340回 利付国庫債券(10年)	2,350,000,000	2,406,729,000	

341回 利付国庫債券(10年)	2,710,000,000	2,764,877,500	
342回 利付国庫債券(10年)	2,580,000,000	2,606,341,800	
343回 利付国庫債券(10年)	2,880,000,000	2,910,787,200	
344回 利付国庫債券(10年)	2,280,000,000	2,305,490,400	
345回 利付国庫債券(10年)	2,910,000,000	2,943,930,600	
346回 利付国庫債券(10年)	2,470,000,000	2,499,961,100	
347回 利付国庫債券(10年)	2,510,000,000	2,540,822,800	
348回 利付国庫債券(10年)	1,980,000,000	2,004,552,000	
349回 利付国庫債券(10年)	2,460,000,000	2,490,725,400	
350回 利付国庫債券(10年)	3,100,000,000	3,138,936,000	
351回 利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,389,736,000	
352回 利付国庫債券(10年)	2,220,000,000	2,247,128,400	
353回 利付国庫債券(10年)	1,840,000,000	1,861,693,600	
354回 利付国庫債券(10年)	1,870,000,000	1,891,131,000	
355回 利付国庫債券(10年)	1,920,000,000	1,939,852,800	
356回 利付国庫債券(10年)	1,880,000,000	1,898,311,200	
357回 利付国庫債券(10年)	2,060,000,000	2,078,746,000	
358回 利付国庫債券(10年)	1,800,000,000	1,815,120,000	
359回 利付国庫債券(10年)	2,360,000,000	2,376,944,800	
360回 利付国庫債券(10年)	900,000,000	905,742,000	
1回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	124,793,000	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	122,200,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	257,096,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	250,694,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	239,836,000	
11回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,490,000	
12回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	249,184,000	
13回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	123,616,000	

14回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	374,421,900	
15回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	261,782,000	
16回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	196,908,000	
17回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,534,000	
18回 利付国庫債券(30年)	320,000,000	413,456,000	
19回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	259,038,000	
20回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	265,594,000	
21回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	260,430,000	
22回 利付国庫債券(30年)	220,000,000	293,827,600	
23回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	267,776,000	
24回 利付国庫債券(30年)	190,000,000	255,194,700	
25回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	263,064,000	
26回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	533,832,000	
27回 利付国庫債券(30年)	420,000,000	570,070,200	
28回 利付国庫債券(30年)	480,000,000	655,238,400	
29回 利付国庫債券(30年)	560,000,000	758,010,400	
30回 利付国庫債券(30年)	570,000,000	764,951,400	
31回 利付国庫債券(30年)	460,000,000	611,602,200	
32回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	825,574,000	
33回 利付国庫債券(30年)	930,000,000	1,212,617,700	
34回 利付国庫債券(30年)	820,000,000	1,103,990,600	
35回 利付国庫債券(30年)	980,000,000	1,285,534,600	
36回 利付国庫債券(30年)	950,000,000	1,250,219,000	
37回 利付国庫債券(30年)	990,000,000	1,285,861,500	
38回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	756,362,300	

39回 利付国庫債券(30年)	510,000,000	665,126,700	
40回 利付国庫債券(30年)	450,000,000	577,687,500	
41回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	632,120,000	
42回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	898,476,600	
43回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	658,684,000	
44回 利付国庫債券(30年)	590,000,000	748,066,900	
45回 利付国庫債券(30年)	580,000,000	710,111,400	
46回 利付国庫債券(30年)	750,000,000	918,787,500	
47回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	886,924,900	
48回 利付国庫債券(30年)	710,000,000	854,094,500	
49回 利付国庫債券(30年)	800,000,000	962,736,000	
50回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	647,527,200	
51回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	583,903,600	
52回 利付国庫債券(30年)	780,000,000	770,296,800	
53回 利付国庫債券(30年)	750,000,000	757,695,000	
54回 利付国庫債券(30年)	600,000,000	634,518,000	
55回 利付国庫債券(30年)	700,000,000	739,753,000	
56回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	654,732,400	
57回 利付国庫債券(30年)	690,000,000	728,108,700	
58回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	811,903,400	
59回 利付国庫債券(30年)	680,000,000	698,584,400	
60回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	710,641,800	
61回 利付国庫債券(30年)	660,000,000	675,866,400	
62回 利付国庫債券(30年)	500,000,000	485,530,000	
63回 利付国庫債券(30年)	670,000,000	631,883,700	

64回 利付国庫債券(30年)	640,000,000	602,585,600	
65回 利付国庫債券(30年)	610,000,000	573,375,600	
66回 利付国庫債券(30年)	520,000,000	487,952,400	
67回 利付国庫債券(30年)	690,000,000	682,278,900	
68回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	197,498,000	
72回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	380,016,000	
73回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	369,573,200	
75回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	153,525,400	
78回 利付国庫債券(20年)	190,000,000	207,571,200	
81回 利付国庫債券(20年)	240,000,000	264,458,400	
85回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	491,805,600	
88回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	397,103,000	
90回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	340,434,000	
92回 利付国庫債券(20年)	870,000,000	986,936,700	
93回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	283,372,500	
94回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	512,941,500	
95回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	405,289,500	
97回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	578,575,000	
99回 利付国庫債券(20年)	450,000,000	519,714,000	
100回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	700,374,000	
102回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	427,636,800	
105回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	467,816,000	
106回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	412,097,000	
107回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	469,784,000	
108回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	463,280,000	

109回 利付国庫債券(20年)	220,000,000	255,651,000	
110回 利付国庫債券(20年)	330,000,000	389,004,000	
111回 利付国庫債券(20年)	290,000,000	345,477,000	
112回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	650,479,500	
113回 利付国庫債券(20年)	770,000,000	913,990,000	
114回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	655,149,000	
115回 利付国庫債券(20年)	200,000,000	240,058,000	
116回 利付国庫債券(20年)	320,000,000	385,465,600	
117回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	776,906,000	
118回 利付国庫債券(20年)	310,000,000	368,648,900	
119回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	351,012,000	
120回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	460,352,000	
121回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	638,906,400	
122回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	410,665,500	
123回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	905,017,500	
124回 利付国庫債券(20年)	390,000,000	466,689,600	
125回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	805,701,600	
126回 利付国庫債券(20年)	340,000,000	408,061,200	
127回 利付国庫債券(20年)	420,000,000	499,749,600	
128回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,097,762,400	
129回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	697,787,100	
130回 利付国庫債券(20年)	680,000,000	806,296,400	
131回 利付国庫債券(20年)	300,000,000	352,488,000	
132回 利付国庫債券(20年)	420,000,000	494,613,000	
133回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	677,530,500	

134回 利付国庫債券(20年)	630,000,000	750,619,800	
135回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	413,080,500	
136回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	701,400,000	
137回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	413,990,500	
138回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	440,765,800	
139回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	409,979,500	
140回 利付国庫債券(20年)	1,090,000,000	1,292,053,300	
141回 利付国庫債券(20年)	650,000,000	772,063,500	
142回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	479,888,000	
143回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	895,257,200	
144回 利付国庫債券(20年)	430,000,000	501,302,600	
145回 利付国庫債券(20年)	1,010,000,000	1,204,374,500	
146回 利付国庫債券(20年)	1,250,000,000	1,493,400,000	
147回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,160,378,800	
148回 利付国庫債券(20年)	990,000,000	1,161,121,500	
149回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,327,162,400	
150回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,429,936,500	
151回 利付国庫債券(20年)	1,310,000,000	1,488,670,900	
152回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,216,718,400	
153回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,232,618,600	
154回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,172,665,300	
155回 利付国庫債券(20年)	1,230,000,000	1,365,250,800	
156回 利付国庫債券(20年)	1,040,000,000	1,060,706,400	
157回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,037,442,000	
158回 利付国庫債券(20年)	980,000,000	1,012,722,200	

159回 利付国庫債券(20年)	1,150,000,000	1,205,775,000	
160回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,138,480,000	
161回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	890,324,000	
162回 利付国庫債券(20年)	1,020,000,000	1,067,379,000	
163回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,118,578,000	
164回 利付国庫債券(20年)	1,210,000,000	1,243,746,900	
165回 利付国庫債券(20年)	890,000,000	913,647,300	
166回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,112,685,000	
167回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	870,221,500	
168回 利付国庫債券(20年)	850,000,000	854,377,500	
169回 利付国庫債券(20年)	950,000,000	936,795,000	
170回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	807,741,000	
171回 利付国庫債券(20年)	960,000,000	943,795,200	
172回 利付国庫債券(20年)	960,000,000	960,000,000	
173回 利付国庫債券(20年)	1,120,000,000	1,118,980,800	
174回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	399,632,000	
国債証券 合計	206,660,000,000	221,776,259,200	
地方債証券			
708回 東京都公募公債	500,000,000	506,940,000	
720回 東京都公募公債	300,000,000	306,591,000	
726回 東京都公募公債	400,000,000	408,752,000	
5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	109,058,000	
9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	226,586,000	
10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	339,723,000	
30年度14回 北海道公募公債	300,000,000	302,052,000	
194回 神奈川県公募公債	300,000,000	304,839,000	
208回 神奈川県公募公債	300,000,000	305,682,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	117,883,000	
356回 大阪府公募公債	200,000,000	202,330,000	
364回 大阪府公募公債	300,000,000	304,275,000	
374回 大阪府公募公債	300,000,000	307,368,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	234,562,000	

26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	356,471,500	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,680,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	311,613,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	213,398,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	110,419,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	352,638,000	
23年度20回 愛知県公募公債	500,000,000	507,280,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	306,342,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,240,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	101,101,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	408,692,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	349,587,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	204,402,000	
24年度2回 福岡県公募公債(20年)	300,000,000	349,068,000	
24年度7回 千葉県公募公債	300,000,000	304,527,000	
25年度5回 千葉県公募公債	200,000,000	204,534,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,822,000	
106回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,429,000	
109回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,440,000	
111回 共同発行市場公募地方債	700,000,000	709,779,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	508,860,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,670,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,775,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,705,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	407,740,000	
146回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	409,472,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	512,255,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,705,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,160,000	

	488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	459,936,000	
	4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	114,291,000	
	30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	304,074,000	
	25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	409,204,000	
	25年度4回 札幌市公募公債	200,000,000	204,030,000	
	第91回 川崎市公募公債	200,000,000	201,638,000	
	17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	116,065,000	
	30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	209,024,000	
地方債証券 合計		15,400,000,000	15,972,707,500	
特殊債券	78回 日本政策投資銀行債券	200,000,000	201,400,000	
	19回 高速道路機構債	150,000,000	222,651,000	
	26回 高速道路機構債	200,000,000	272,752,000	
	96回 高速道路機構債	700,000,000	710,150,000	
	116回 高速道路機構債	100,000,000	101,959,000	
	172回 高速道路機構債	200,000,000	196,276,000	
	121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	583,625,000	
	149回政保日本高速道路保有・債務返済機構	400,000,000	404,356,000	
	189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,770,000	
	193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	511,730,000	
	195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	330,000,000	338,253,300	
	239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,525,000	
	241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	509,605,000	
	260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	235,314,000	
	309回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,672,000	
	319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	208,514,000	
	28回 日本道路・機構承継債	400,000,000	528,620,000	
	1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	231,038,000	
	19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	235,178,000	
	36回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,248,000	
	24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	233,772,000	
	44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	407,396,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	512,285,000		

56回 政保地方公共団体金融 機構債券	542,000,000	554,731,580	
64回 政保地方公共団体金融 機構債券	300,000,000	306,147,000	
44回 地方公共団体金融機構 債券 20年	200,000,000	226,224,000	
83回 地方公共団体金融機構 債券 10年	400,000,000	400,108,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	234,120,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	214,140,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	235,062,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	417,917,500	
222回 住宅金融支援機構債 券	300,000,000	301,668,000	
230回 住宅金融支援機構債 券	300,000,000	302,589,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融 公庫債券	34,812,000	35,631,474	
8回貸付債権担保S種住宅金融 公庫債券	24,400,000	25,117,116	
9回貸付債権担保S種住宅金融 公庫債券	36,519,000	37,597,406	
2回貸付債権担保S種住宅金融 支援機構債券	38,781,000	40,206,589	
13回貸付債権担保S種住宅金 融支援機構債券	10,324,000	10,390,796	
14回貸付債権担保S種住宅金 融支援機構債券	51,955,000	52,238,154	
43回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	12,887,000	13,401,577	
44回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	49,932,000	51,566,773	
51回貸付債権担保住宅金融公 庫債券	37,512,000	38,778,030	
1回貸付債権担保住宅金融支援 機構債券	61,195,000	63,176,494	
29回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	129,915,000	139,584,573	
36回貸付債権担保住宅金融支 援機構債券	207,904,000	220,228,549	
114回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	247,020,000	248,042,662	
126回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	260,007,000	262,549,868	
128回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	260,751,000	263,116,011	
131回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	265,368,000	267,390,104	
132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	265,200,000	267,218,172	

	137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	273,039,000	276,572,124	
	い第828号 利付商工債	100,000,000	100,229,000	
	325回 利附信金中金債	400,000,000	400,112,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	116,963,000	
	55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	509,485,000	
特殊債券 合計		14,339,521,000	15,230,391,852	
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	199,436,000	
	6回 クレディ・アグリコル・ エス・エー円貨社債	200,000,000	203,244,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,548,000	
	19回 三菱ケミカルホール ディングス社債	100,000,000	100,668,000	
	6回 J Xホールディングス社 債	100,000,000	102,522,000	
	14回 プリヂストン社債	200,000,000	200,278,000	
	23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	100,000,000	99,878,000	
	13回 パナソニック社債	100,000,000	100,624,000	
	14回 トヨタ自動車社債	200,000,000	204,172,000	
	16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	203,606,000	
	94回 丸紅社債	100,000,000	101,940,000	
	45回 住友商事社債	100,000,000	101,439,000	
	47回 住友商事社債	100,000,000	102,048,000	
	48回 クレディセゾン社債	100,000,000	102,539,000	
	57回 東京三菱銀行社債	200,000,000	208,146,000	
	10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	203,098,000	
	10回 セブン銀行社債	100,000,000	101,602,000	
	47回 日立キャピタル社債	200,000,000	203,490,000	
	56回 三菱UFJリース社債	200,000,000	201,924,000	
	72回 三菱地所社債	100,000,000	108,082,000	
	108回 住友不動産社債	200,000,000	200,220,000	
	80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	107,577,000	
	43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	99,922,000	
	19回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,007,000	
	21回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	103,685,000	
	39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	326,658,000	
	42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	219,202,000	
	9回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	206,150,000	
	10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	316,986,000	
	6回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,982,000	
	11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	307,008,000	
	13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	212,092,000	
	14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,120,000	
	4回 東京地下鉄社債	120,000,000	134,983,200	
	518回 中部電力社債	200,000,000	200,572,000	
	377回 中国電力社債	400,000,000	411,512,000	
	301回 北陸電力社債	100,000,000	102,544,000	
	307回 北陸電力社債	100,000,000	104,693,000	

471回	東北電力社債	400,000,000	413,224,000	
253回	四国電力社債	200,000,000	204,820,000	
424回	九州電力社債	200,000,000	206,794,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	412,352,000	
320回	北海道電力社債	200,000,000	201,162,000	
321回	北海道電力社債	161,000,000	165,715,690	
340回	北海道電力社債	300,000,000	303,798,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	217,130,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	308,061,000	
23回	東京瓦斯社債	300,000,000	307,401,000	
18回	大阪ガス社債	100,000,000	103,010,000	
27回	NTTデータ社債	100,000,000	101,943,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,210,000	
社債券 合計		9,281,000,000	9,564,817,890	
合計			262,544,176,442	

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)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,429,022,556
株式	261,976,122,560
派生商品評価勘定	396,597,420
未収入金	15,485,600
未収配当金	2,107,366,137
流動資産合計	268,924,594,273
資産合計	268,924,594,273
負債の部	
流動負債	
前受金	301,245,000
未払解約金	958,082,000
流動負債合計	1,259,327,000
負債合計	1,259,327,000
純資産の部	
元本等	
元本	95,587,668,609
剰余金	
剰余金又は欠損金()	172,077,598,664
元本等合計	267,665,267,273
純資産合計	267,665,267,273
負債純資産合計	268,924,594,273

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,335,804,545円
同期中追加設定元本額	59,934,453,427円
同期中一部解約元本額	60,682,589,363円
元本の内訳	
ファンド名	
One DC 国内株式インデックスファンド	15,678,695,748円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	3,153,425,905円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,925,045円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,660,716円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,814,010円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,741,190円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,474,259円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,587,488円
たわらノーロード TOPIX	766,122,461円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	563,551,625円
たわらノーロード バランス(堅実型)	20,937,001円
たわらノーロード バランス(標準型)	124,686,935円
たわらノーロード バランス(積極型)	182,444,838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)	1,627,574円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	107,189,715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)	236,714,570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)	154,168,234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)	224,269,056円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	439,672円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,329,167円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,130,241円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,311,034円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,562,443円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	35,505,014,981円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	1,081,846,539円

DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,491,743,549円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,565,598,625円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	356,660,122円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,230,056,817円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,124,653,694円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	37,430,564円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,133,520,861円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	22,648,768円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	327,683,372円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	266,740,777円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	442,628,172円
投資のソムリエ	8,633,022,500円
クルーズコントロール	522,376,321円
投資のソムリエ<DC年金>	612,486,580円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	301,999,455円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	371,167,135円
クルーズコントロール<DC年金>	111,463円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,916,136円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	15,601,146円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	182,472,572円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,970,681,944円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	14,540,679円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,609,274円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,849,905円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	28,505,319円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	96,205,872円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,111,986,489円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	262,764,285円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	3,796,296円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,938,389円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,781,796円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,379,993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)	39,309,094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)	48,206,922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)	119,871,763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)	24,290,805円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	48,187,439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)	433,573,458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)	74,080,050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)	83,295,016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)	159,370,234円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,718,387円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	39,370,395円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	12,443,454円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,544,448円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	25,581,716円

D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	52,358,090円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	789,007,624円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	809,499,397円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,298,466,174円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	164,221,784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)	44,065,435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)	421,668,503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)	122,977,008円
D I A M世界バランスファンド5 5 V A (適格機関投資家限定)	2,209,514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)	538,671,020円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	28,841,296円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	110,339,297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)	263,647,637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)	403,554,491円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	51,455,388円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	22,868,891円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	393,007,566円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	1,221,729,553円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,617,326,889円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	64,680,554円
計	95,587,668,609円
2. 受益権の総数	95,587,668,609口
3. 差入代用有価証券 株式	1,875,750,000円

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、株価の変動によるリスクを有しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。
-------------------	---

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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)は短時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	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	2020年11月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
株式	9,203,130,698
合計	9,203,130,698

(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2月8日から2020年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2020年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	5,251,245,000	-	5,647,950,000	396,705,000
合計	5,251,245,000	-	5,647,950,000	396,705,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

す。

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2020年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.8002円 (28,002円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年11月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	5,200	2,850.00	14,820,000	
日本水産	147,000	444.00	65,268,000	
マルハニチロ	21,200	2,329.00	49,374,800	
ハウスイ	600	956.00	573,600	
雪国まいたけ	9,000	1,922.00	17,298,000	
カネコ種苗	4,500	1,608.00	7,236,000	
サカタのタネ	17,600	3,690.00	64,944,000	
ホクト	11,300	2,134.00	24,114,200	
ホクリヨウ	2,300	692.00	1,591,600	
ヒノキヤグループ	3,800	2,265.00	8,607,000	
ショーボンドホールディングス	22,800	5,440.00	124,032,000	
ミライト・ホールディングス	43,600	1,558.00	67,928,800	
タマホーム	7,800	1,444.00	11,263,200	
サンヨーホームズ	1,000	689.00	689,000	
日本アクア	5,900	633.00	3,734,700	
ファーストコーポレーション	4,500	758.00	3,411,000	
ベステラ	2,600	1,530.00	3,978,000	
T A T E R U	27,800	189.00	5,254,200	
キャンディル	2,500	621.00	1,552,500	
スペースバリューホールディングス	18,000	615.00	11,070,000	
住石ホールディングス	30,000	129.00	3,870,000	
日鉄鉱業	3,500	5,170.00	18,095,000	
三井松島ホールディングス	5,700	763.00	4,349,100	
国際石油開発帝石	540,500	563.00	304,301,500	
石油資源開発	19,300	1,843.00	35,569,900	
K & O エナジーグループ	7,200	1,507.00	10,850,400	
ダイセキ環境ソリューション	2,700	706.00	1,906,200	
第一カッター興業	1,800	2,257.00	4,062,600	
明豊ファシリティワークス	4,700	662.00	3,111,400	
安藤・間	87,500	731.00	63,962,500	
東急建設	43,100	511.00	22,024,100	
コムシスホールディングス	52,100	3,090.00	160,989,000	

ビーアールホールディングス	16,000	780.00	12,480,000	
高松コンストラクショングループ	9,300	2,251.00	20,934,300	
東建コーポレーション	4,500	8,050.00	36,225,000	
ソネック	1,700	860.00	1,462,000	
ヤマウラ	6,500	904.00	5,876,000	
大成建設	113,100	3,650.00	412,815,000	
大林組	339,600	934.00	317,186,400	
清水建設	344,600	823.00	283,605,800	
飛島建設	10,000	1,153.00	11,530,000	
長谷工コーポレーション	131,200	1,325.00	173,840,000	
松井建設	13,400	756.00	10,130,400	
銭高組	1,200	4,825.00	5,790,000	
鹿島建設	266,500	1,269.00	338,188,500	
不動テトラ	8,800	1,567.00	13,789,600	
大末建設	3,700	870.00	3,219,000	
鉄建建設	7,500	2,020.00	15,150,000	
西松建設	26,200	1,978.00	51,823,600	
三井住友建設	81,600	436.00	35,577,600	
大豊建設	7,600	3,545.00	26,942,000	
前田建設工業	85,100	843.00	71,739,300	
佐田建設	6,700	460.00	3,082,000	
ナカノフドー建設	10,200	430.00	4,386,000	
奥村組	16,000	2,557.00	40,912,000	
東鉄工業	14,500	2,980.00	43,210,000	
イチケン	2,500	1,725.00	4,312,500	
富士ピー・エス	5,100	620.00	3,162,000	
浅沼組	3,900	4,210.00	16,419,000	
戸田建設	141,200	650.00	91,780,000	
熊谷組	15,800	2,578.00	40,732,400	
北野建設	1,900	2,699.00	5,128,100	
植木組	1,600	2,889.00	4,622,400	
矢作建設工業	15,000	922.00	13,830,000	
ピーエス三菱	11,300	598.00	6,757,400	
日本ハウスホールディングス	23,600	247.00	5,829,200	
大東建託	37,000	10,310.00	381,470,000	
新日本建設	14,500	941.00	13,644,500	
N I P P O	28,300	2,930.00	82,919,000	
東亜道路工業	2,100	3,765.00	7,906,500	
前田道路	29,900	1,820.00	54,418,000	
日本道路	3,400	8,120.00	27,608,000	
東亜建設工業	10,700	2,017.00	21,581,900	
日本国土開発	33,100	589.00	19,495,900	
若築建設	6,200	1,256.00	7,787,200	
東洋建設	37,900	418.00	15,842,200	
五洋建設	134,600	756.00	101,757,600	
世紀東急工業	16,400	845.00	13,858,000	
福田組	4,100	5,310.00	21,771,000	
日本ドライケミカル	2,700	1,515.00	4,090,500	
住友林業	85,900	1,714.00	147,232,600	
日本基礎技術	11,600	470.00	5,452,000	

巴コーポレーション	15,300	391.00	5,982,300	
大和ハウス工業	335,800	3,195.00	1,072,881,000	
ライト工業	19,500	1,649.00	32,155,500	
積水ハウス	368,200	1,889.50	695,713,900	
日特建設	9,000	835.00	7,515,000	
北陸電気工事	6,000	1,215.00	7,290,000	
ユアテック	19,800	681.00	13,483,800	
日本リーテック	7,100	2,457.00	17,444,700	
四電工	1,700	2,397.00	4,074,900	
中電工	13,700	2,158.00	29,564,600	
関電工	48,600	807.00	39,220,200	
きんでん	80,800	1,720.00	138,976,000	
東京エネシス	11,500	877.00	10,085,500	
トーエネック	3,000	3,620.00	10,860,000	
住友電設	9,700	2,852.00	27,664,400	
日本電設工業	18,700	2,334.00	43,645,800	
協和エクシオ	51,400	2,666.00	137,032,400	
新日本空調	8,900	2,290.00	20,381,000	
日本工営	6,900	2,883.00	19,892,700	
九電工	23,900	3,200.00	76,480,000	
三機工業	24,100	1,213.00	29,233,300	
日揮ホールディングス	104,400	957.00	99,910,800	
中外炉工業	3,900	1,580.00	6,162,000	
ヤマト	11,100	775.00	8,602,500	
太平電業	8,200	2,391.00	19,606,200	
高砂熱学工業	28,600	1,527.00	43,672,200	
三晃金属工業	1,300	2,676.00	3,478,800	
NECネットエスアイ	30,000	1,883.00	56,490,000	
朝日工業社	2,100	3,015.00	6,331,500	
明星工業	22,000	875.00	19,250,000	
大気社	16,600	2,955.00	49,053,000	
ダイダン	8,100	2,876.00	23,295,600	
日比谷総合設備	11,100	1,819.00	20,190,900	
日本製粉	31,900	1,742.00	55,569,800	
日清製粉グループ本社	122,800	1,757.00	215,759,600	
日東富士製粉	600	6,610.00	3,966,000	
昭和産業	10,100	3,360.00	33,936,000	
鳥越製粉	10,000	1,099.00	10,990,000	
中部飼料	13,300	1,521.00	20,229,300	
フィード・ワン	14,500	899.00	13,035,500	
東洋精糖	1,700	1,231.00	2,092,700	
日本甜菜製糖	5,700	1,834.00	10,453,800	
三井製糖	9,700	1,847.00	17,915,900	
塩水港精糖	12,200	227.00	2,769,400	
日新製糖	4,400	1,909.00	8,399,600	
LIFULL	36,100	421.00	15,198,100	
ミクシィ	19,700	2,956.00	58,233,200	
ジェイエイシーリクルートメント	6,900	1,485.00	10,246,500	
日本M&Aセンター	79,100	5,980.00	473,018,000	
メンバーズ	3,000	2,114.00	6,342,000	

中広	1,200	486.00	583,200
UTグループ	16,300	3,365.00	54,849,500
アイティメディア	4,100	2,309.00	9,466,900
タケエイ	11,300	1,097.00	12,396,100
E・Jホールディングス	1,800	2,254.00	4,057,200
ビーネックスグループ	12,900	1,125.00	14,512,500
コシダカホールディングス	24,700	432.00	10,670,400
アルトナー	2,400	913.00	2,191,200
パソナグループ	11,200	1,775.00	19,880,000
CDS	2,500	1,290.00	3,225,000
リンクアンドモチベーション	19,100	459.00	8,766,900
GCA	13,300	699.00	9,296,700
エス・エム・エス	32,100	3,335.00	107,053,500
サニーサイドアップグループ	3,700	698.00	2,582,600
パーソルホールディングス	103,300	1,805.00	186,456,500
リニカル	5,100	765.00	3,901,500
クックパッド	32,400	337.00	10,918,800
エスクリ	2,900	350.00	1,015,000
アイ・ケイ・ケイ	5,200	675.00	3,510,000
森永製菓	25,500	4,320.00	110,160,000
中村屋	2,600	4,230.00	10,998,000
江崎グリコ	29,900	4,510.00	134,849,000
名糖産業	5,400	1,500.00	8,100,000
井村屋グループ	6,300	2,588.00	16,304,400
不二家	7,000	2,458.00	17,206,000
山崎製パン	81,400	1,834.00	149,287,600
第一屋製パン	1,700	1,005.00	1,708,500
モロゾフ	1,700	6,140.00	10,438,000
亀田製菓	6,300	4,975.00	31,342,500
寿スピリッツ	10,500	6,160.00	64,680,000
カルビー	49,600	3,025.00	150,040,000
森永乳業	20,200	5,070.00	102,414,000
六甲バター	7,300	1,839.00	13,424,700
ヤクルト本社	74,800	5,190.00	388,212,000
明治ホールディングス	71,800	7,510.00	539,218,000
雪印メグミルク	26,200	2,448.00	64,137,600
プリマハム	17,000	2,985.00	50,745,000
日本ハム	41,500	4,465.00	185,297,500
林兼産業	3,500	593.00	2,075,500
丸大食品	11,700	1,718.00	20,100,600
S Foods	8,700	3,335.00	29,014,500
柿安本店	3,900	2,594.00	10,116,600
伊藤ハム米久ホールディングス	70,100	698.00	48,929,800
学情	3,700	1,077.00	3,984,900
スタジオアリス	5,200	2,037.00	10,592,400
クロスキャット	2,800	1,394.00	3,903,200
シミックホールディングス	5,200	1,432.00	7,446,400
エプコ	2,500	1,029.00	2,572,500
システナ	37,900	1,979.00	75,004,100
NJS	2,100	1,955.00	4,105,500

デジタルアーツ	5,200	9,270.00	48,204,000	
日鉄ソリューションズ	15,900	3,170.00	50,403,000	
総合警備保障	41,200	5,310.00	218,772,000	
キューブシステム	5,600	1,418.00	7,940,800	
いちご	135,900	347.00	47,157,300	
エイジア	1,900	2,020.00	3,838,000	
日本駐車場開発	105,600	134.00	14,150,400	
コア	4,500	1,397.00	6,286,500	
カカクコム	76,400	3,445.00	263,198,000	
アイロムグループ	3,800	1,922.00	7,303,600	
セントケア・ホールディング	6,700	813.00	5,447,100	
サイネックス	1,800	796.00	1,432,800	
ルネサンス	5,700	909.00	5,181,300	
ディップ	14,100	2,478.00	34,939,800	
SBSホールディングス	8,000	2,447.00	19,576,000	
デジタルホールディングス	7,200	1,448.00	10,425,600	
新日本科学	11,200	690.00	7,728,000	
ツクイホールディングス	24,400	606.00	14,786,400	
キャリアデザインセンター	2,500	1,054.00	2,635,000	
ベネフィット・ワン	37,600	2,735.00	102,836,000	
エムスリー	228,100	7,601.00	1,733,788,100	
ツカダ・グローバルホールディング	8,400	285.00	2,394,000	
プラス	1,500	447.00	670,500	
アウトソーシング	59,200	1,387.00	82,110,400	
ウェルネット	10,500	540.00	5,670,000	
ワールドホールディングス	3,600	1,973.00	7,102,800	
ディー・エヌ・エー	43,800	2,061.00	90,271,800	
博報堂DYホールディングス	143,800	1,561.00	224,471,800	
ぐるなび	18,000	643.00	11,574,000	
タカミヤ	11,300	515.00	5,819,500	
ジャパンベストレスキューシステム	8,100	965.00	7,816,500	
ファンコミュニケーションズ	28,500	461.00	13,138,500	
ライク	3,500	2,234.00	7,819,000	
ビジネス・ブレークスルー	4,100	405.00	1,660,500	
エスプール	26,500	728.00	19,292,000	
WDBホールディングス	4,700	3,280.00	15,416,000	
手間いらず	600	5,990.00	3,594,000	
ティア	6,300	418.00	2,633,400	
CDG	1,300	1,543.00	2,005,900	
バリューコマース	6,900	3,215.00	22,183,500	
インフォマート	104,600	1,062.00	111,085,200	
サッポロホールディングス	37,000	2,081.00	76,997,000	
アサヒグループホールディングス	237,500	4,056.00	963,300,000	
麒麟ホールディングス	460,800	2,183.00	1,005,926,400	
宝ホールディングス	80,600	1,238.00	99,782,800	
オエノンホールディングス	31,200	440.00	13,728,000	
養命酒製造	3,600	1,841.00	6,627,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	83,300	1,665.00	138,694,500	
サントリー食品インターナショナル	72,800	3,910.00	284,648,000	

ダイドーグループホールディングス	5,500	5,770.00	31,735,000
伊藤園	33,000	7,590.00	250,470,000
キーコーヒー	10,800	2,268.00	24,494,400
ユニカフェ	2,700	1,100.00	2,970,000
ジャパンフーズ	1,500	1,249.00	1,873,500
日清オイリオグループ	13,900	3,030.00	42,117,000
不二製油グループ本社	26,500	3,110.00	82,415,000
かどや製油	1,000	3,845.00	3,845,000
J・オイルミルズ	5,600	3,885.00	21,756,000
ローソン	27,000	5,250.00	141,750,000
サンエー	8,800	4,355.00	38,324,000
カワチ薬品	8,200	3,180.00	26,076,000
エービーシー・マート	16,700	6,180.00	103,206,000
ハードオフコーポレーション	4,400	676.00	2,974,400
高千穂交易	4,300	981.00	4,218,300
アスクル	11,200	4,160.00	46,592,000
ゲオホールディングス	19,200	1,427.00	27,398,400
アダストリア	14,600	1,935.00	28,251,000
ジーフット	7,000	457.00	3,199,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,700	435.00	739,500
伊藤忠食品	2,400	5,600.00	13,440,000
くら寿司	6,300	6,510.00	41,013,000
キャンドウ	5,100	1,929.00	9,837,900
エレマテック	10,100	1,043.00	10,534,300
パルグループホールディングス	11,000	1,253.00	13,783,000
JALUX	3,000	1,468.00	4,404,000
エディオン	49,000	1,031.00	50,519,000
あらた	8,500	4,980.00	42,330,000
サーラコーポレーション	22,100	597.00	13,193,700
ワッツ	4,700	807.00	3,792,900
トーメンデバイス	1,700	3,720.00	6,324,000
ハローズ	4,100	3,555.00	14,575,500
J Pホールディングス	32,800	303.00	9,938,400
フジオフードグループ本社	9,000	1,475.00	13,275,000
あみやき亭	2,300	2,972.00	6,835,600
東京エレクトロン デバイス	4,000	3,160.00	12,640,000
ひらまつ	19,800	208.00	4,118,400
フィールズ	8,100	336.00	2,721,600
双日	588,700	244.00	143,642,800
アルフレッサ ホールディングス	118,400	2,119.00	250,889,600
大黒天物産	2,600	6,090.00	15,834,000
ハニーズホールディングス	9,400	1,027.00	9,653,800
ファーマライズホールディングス	2,500	795.00	1,987,500
キッコーマン	78,200	6,550.00	512,210,000
味の素	240,000	2,252.00	540,480,000
キューピー	60,500	2,259.00	136,669,500
ハウス食品グループ本社	40,700	3,765.00	153,235,500
カゴメ	44,500	3,910.00	173,995,000
焼津水産化学工業	4,700	1,013.00	4,761,100
アリアケジャパン	10,000	7,000.00	70,000,000

ピエトロ	1,200	1,717.00	2,060,400
エバラ食品工業	2,400	2,350.00	5,640,000
やまみ	1,000	2,236.00	2,236,000
ニチレイ	51,800	2,890.00	149,702,000
横浜冷凍	28,200	914.00	25,774,800
東洋水産	55,900	5,270.00	294,593,000
イトアンドホールディングス	4,100	1,950.00	7,995,000
大冷	1,500	2,159.00	3,238,500
ヨシムラ・フード・ホールディングス	6,000	887.00	5,322,000
日清食品ホールディングス	46,100	8,700.00	401,070,000
永谷園ホールディングス	5,400	2,450.00	13,230,000
一正蒲鉾	3,900	1,157.00	4,512,300
フジッコ	11,900	2,032.00	24,180,800
ロック・フィールド	11,800	1,550.00	18,290,000
日本たばこ産業	582,700	2,133.50	1,243,190,450
ケンコーマヨネーズ	6,200	1,847.00	11,451,400
わらべや日洋ホールディングス	7,200	1,500.00	10,800,000
なとり	6,200	2,090.00	12,958,000
イフジ産業	2,300	869.00	1,998,700
ピクルスコーポレーション	2,400	2,969.00	7,125,600
北の達人コーポレーション	37,900	483.00	18,305,700
ユーグレナ	47,000	896.00	42,112,000
スター・マイカ・ホールディングス	5,500	1,574.00	8,657,000
A Dワークスグループ	19,900	156.00	3,104,400
片倉工業	14,200	1,306.00	18,545,200
グンゼ	7,700	3,880.00	29,876,000
ヒューリック	226,400	1,071.00	242,474,400
神栄	1,600	675.00	1,080,000
ラサ商事	5,800	919.00	5,330,200
アルペン	8,200	2,412.00	19,778,400
ハブ	3,000	640.00	1,920,000
ラクーンホールディングス	5,100	1,959.00	9,990,900
クオールホールディングス	15,800	1,168.00	18,454,400
アルコニックス	11,500	1,485.00	17,077,500
神戸物産	73,500	3,000.00	220,500,000
ソリトンシステムズ	5,200	2,017.00	10,488,400
ジンズホールディングス	5,600	7,790.00	43,624,000
ビックカメラ	63,100	1,193.00	75,278,300
D C Mホールディングス	64,800	1,253.00	81,194,400
ペッパーフードサービス	9,500	284.00	2,698,000
ハイパー	1,700	578.00	982,600
Monotaro	75,800	5,550.00	420,690,000
東京一番フーズ	2,700	592.00	1,598,400
D Dホールディングス	4,200	705.00	2,961,000
あいホールディングス	15,200	1,974.00	30,004,800
ディーブイエックス	4,100	1,088.00	4,460,800
きちりホールディングス	2,900	696.00	2,018,400
アークランドサービスホールディングス	8,900	2,067.00	18,396,300
J . フロント リテイリング	127,200	898.00	114,225,600

ドトール・日レスホールディングス	15,300	1,557.00	23,822,100
マツモトキヨシホールディングス	44,000	4,400.00	193,600,000
ブロンコビリー	5,500	2,412.00	13,266,000
ZOZO	73,300	2,721.00	199,449,300
トレジャー・ファクトリー	3,200	725.00	2,320,000
物語コーポレーション	2,900	13,550.00	39,295,000
ココカラファイン	11,100	7,000.00	77,700,000
三越伊勢丹ホールディングス	186,200	604.00	112,464,800
東洋紡	41,900	1,423.00	59,623,700
ユニチカ	30,900	391.00	12,081,900
富士紡ホールディングス	5,100	3,685.00	18,793,500
日清紡ホールディングス	66,100	768.00	50,764,800
倉敷紡績	10,700	1,869.00	19,998,300
ダイワボウホールディングス	9,000	6,670.00	60,030,000
シキボウ	5,700	971.00	5,534,700
日東紡績	16,100	4,175.00	67,217,500
トヨタ紡織	31,600	1,551.00	49,011,600
マクニカ・富士エレホールディングス	25,400	2,009.00	51,028,600
Hamee	3,900	1,711.00	6,672,900
ラクト・ジャパン	4,600	3,185.00	14,651,000
ウエルシアホールディングス	63,400	4,210.00	266,914,000
クリエイトSDホールディングス	18,000	3,760.00	67,680,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,300	965.00	19,589,500
八洲電機	8,300	973.00	8,075,900
メディアスホールディングス	6,200	912.00	5,654,400
レスターホールディングス	11,200	2,342.00	26,230,400
ジュテックホールディングス	2,300	1,014.00	2,332,200
丸善CHIホールディングス	13,800	379.00	5,230,200
大光	4,200	717.00	3,011,400
OCHIホールディングス	2,800	1,393.00	3,900,400
TOKAIホールディングス	56,400	1,086.00	61,250,400
黒谷	3,300	591.00	1,950,300
ミサワ	2,000	787.00	1,574,000
ティーライフ	1,600	1,174.00	1,878,400
Cominix	1,700	720.00	1,224,000
エー・ピーホールディングス	1,900	415.00	788,500
三洋貿易	10,800	1,001.00	10,810,800
チムニー	3,200	1,355.00	4,336,000
シュッピン	7,200	895.00	6,444,000
ビューティガレージ	1,700	2,974.00	5,055,800
オイシックス・ラ・大地	10,600	3,005.00	31,853,000
ウイン・パートナーズ	7,800	1,128.00	8,798,400
ネクステージ	17,900	1,289.00	23,073,100
ジョイフル本田	31,200	1,573.00	49,077,600
鳥貴族	3,000	1,629.00	4,887,000
麒麟堂ホールディングス	4,100	3,500.00	14,350,000
ホットランド	7,900	1,270.00	10,033,000
すかいらーくホールディングス	119,400	1,666.00	198,920,400
SFPホールディングス	6,100	1,395.00	8,509,500

綿半ホールディングス	7,900	1,383.00	10,925,700
日本毛織	35,000	1,093.00	38,255,000
ダイトウボウ	17,300	106.00	1,833,800
トーア紡コーポレーション	4,000	483.00	1,932,000
ダイドーリミテッド	13,000	202.00	2,626,000
ヨシックス	1,700	1,837.00	3,122,900
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30,900	1,117.00	34,515,300
三栄建築設計	4,300	1,823.00	7,838,900
野村不動産ホールディングス	64,900	2,087.00	135,446,300
三重交通グループホールディングス	21,800	541.00	11,793,800
サムティ	15,100	1,799.00	27,164,900
ディア・ライフ	14,800	409.00	6,053,200
コーセーアールイー	3,400	568.00	1,931,200
日本商業開発	6,700	1,785.00	11,959,500
プレサンスコーポレーション	17,500	1,616.00	28,280,000
フィル・カンパニー	1,900	2,256.00	4,286,400
THEグローバル社	5,000	228.00	1,140,000
ハウスコム	1,200	1,303.00	1,563,600
日本管理センター	5,800	1,362.00	7,899,600
サンセイランディック	3,300	790.00	2,607,000
エストラスト	1,300	770.00	1,001,000
フージャースホールディングス	21,300	707.00	15,059,100
オープンハウス	33,600	4,055.00	136,248,000
東急不動産ホールディングス	290,000	522.00	151,380,000
飯田グループホールディングス	89,000	2,088.00	185,832,000
イーグランド	1,900	785.00	1,491,500
ムゲンエステート	6,800	542.00	3,685,600
帝国繊維	12,000	2,882.00	34,584,000
日本コークス工業	92,400	70.00	6,468,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,600	920.00	5,152,000
ミタチ産業	2,900	638.00	1,850,200
B E E N O S	4,900	2,324.00	11,387,600
あさひ	7,900	1,620.00	12,798,000
日本調剤	6,500	1,725.00	11,212,500
コスモス薬品	9,500	17,400.00	165,300,000
シップヘルスケアホールディングス	17,100	5,150.00	88,065,000
トーエル	5,200	810.00	4,212,000
ソフトクリエイイトホールディングス	4,600	3,665.00	16,859,000
オンリー	1,700	492.00	836,400
セブン&アイ・ホールディングス	417,200	3,454.00	1,441,008,800
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	57,300	633.00	36,270,900
明治電機工業	3,000	1,360.00	4,080,000
ツルハホールディングス	23,200	14,990.00	347,768,000
デリカフーズホールディングス	4,500	625.00	2,812,500
スターティアホールディングス	2,400	708.00	1,699,200
サンマルクホールディングス	8,500	1,575.00	13,387,500
フェリシモ	2,500	1,320.00	3,300,000
トリドールホールディングス	26,300	1,458.00	38,345,400

帝人	86,600	1,800.00	155,880,000
東レ	767,700	544.20	417,782,340
クラレ	166,900	1,114.00	185,926,600
旭化成	702,700	988.60	694,689,220
サカイオーベックス	2,900	2,136.00	6,194,400
TOKYO BASE	9,700	508.00	4,927,600
稲葉製作所	6,200	1,398.00	8,667,600
宮地エンジニアリンググループ	3,400	2,095.00	7,123,000
トーカロ	29,700	1,142.00	33,917,400
アルファ	3,500	996.00	3,486,000
SUMCO	136,900	1,629.00	223,010,100
川田テクノロジーズ	2,200	4,670.00	10,274,000
RS Technologies	3,600	3,610.00	12,996,000
信和	6,300	729.00	4,592,700
ビーロット	5,000	805.00	4,025,000
ファーストブラザーズ	2,300	997.00	2,293,100
ハウスドゥ	5,200	1,337.00	6,952,400
シーアールイー	2,800	1,339.00	3,749,200
プロパティエージェント	1,700	1,372.00	2,332,400
ケイアイスター不動産	3,400	2,586.00	8,792,400
アグレ都市デザイン	1,800	645.00	1,161,000
グッドコムアセット	5,200	1,490.00	7,748,000
ジェイ・エス・ビー	1,900	2,974.00	5,650,600
テンポイノベーション	2,400	935.00	2,244,000
グローバル・リンク・マネジメント	1,800	762.00	1,371,600
住江織物	2,100	2,148.00	4,510,800
日本フェルト	5,500	481.00	2,645,500
イチカワ	1,300	1,346.00	1,749,800
エコナックホールディングス	18,400	92.00	1,692,800
日東製網	1,300	1,453.00	1,888,900
芦森工業	2,100	944.00	1,982,400
アツギ	8,800	585.00	5,148,000
ウイルプラスホールディングス	1,600	610.00	976,000
JMホールディングス	8,000	2,386.00	19,088,000
コメダホールディングス	23,200	1,928.00	44,729,600
サツドラホールディングス	1,500	2,030.00	3,045,000
アレンザホールディングス	5,300	1,388.00	7,356,400
串カツ田中ホールディングス	2,800	1,815.00	5,082,000
パロックジャパンリミテッド	7,500	698.00	5,235,000
クスリのアオキホールディングス	9,600	8,770.00	84,192,000
ダイニック	3,500	850.00	2,975,000
共和レザー	5,100	634.00	3,233,400
ピーバンドットコム	1,000	931.00	931,000
力の源ホールディングス	4,900	649.00	3,180,100
スシローグローバルホールディングス	58,500	3,330.00	194,805,000
アセンテック	2,200	1,944.00	4,276,800
セーレン	26,100	1,691.00	44,135,100
ソトー	3,900	950.00	3,705,000
東海染工	1,300	1,145.00	1,488,500
小松マテーレ	17,600	920.00	16,192,000

ワコールホールディングス	26,400	2,151.00	56,786,400	
ホギメディカル	12,200	3,165.00	38,613,000	
クラウドシアホールディングス	2,500	305.00	762,500	
T S Iホールディングス	32,100	241.00	7,736,100	
マツオカコーポレーション	3,000	2,570.00	7,710,000	
ワールド	14,900	1,376.00	20,502,400	
T I S	106,200	2,140.00	227,268,000	
J N Sホールディングス	4,200	647.00	2,717,400	
電算システム	3,800	3,270.00	12,426,000	
グリー	65,500	582.00	38,121,000	
コーエーテックモホールディングス	21,700	4,865.00	105,570,500	
三菱総合研究所	4,500	4,390.00	19,755,000	
ボルテージ	2,500	563.00	1,407,500	
電算	1,000	2,337.00	2,337,000	
A G S	6,100	908.00	5,538,800	
ファインデックス	8,900	1,300.00	11,570,000	
ブレインパッド	2,800	4,275.00	11,970,000	
K L a b	19,300	971.00	18,740,300	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	12,800	953.00	12,198,400	
イーブックイニシアティブジャパン	1,600	2,894.00	4,630,400	
ネクソン	267,900	2,555.00	684,484,500	
アイスタイル	29,700	461.00	13,691,700	
エムアップホールディングス	3,000	2,500.00	7,500,000	
エイチーム	7,200	900.00	6,480,000	
エニグモ	10,000	1,282.00	12,820,000	
テクノスジャパン	8,200	744.00	6,100,800	
e n i s h	5,500	528.00	2,904,000	
コロプラ	34,900	965.00	33,678,500	
オルトプラス	6,400	440.00	2,816,000	
ブロードリーフ	52,600	606.00	31,875,600	
クロス・マーケティンググループ	4,700	366.00	1,720,200	
デジタルハーツホールディングス	5,600	1,129.00	6,322,400	
システム情報	7,900	1,229.00	9,709,100	
メディアドゥ	3,500	6,780.00	23,730,000	
じげん	26,200	342.00	8,960,400	
ブイキューブ	5,800	2,300.00	13,340,000	
エンカレッジ・テクノロジー	2,300	847.00	1,948,100	
サイバーリンクス	1,700	4,125.00	7,012,500	
ディー・エル・イー	8,500	374.00	3,179,000	
フィックスターズ	11,300	1,035.00	11,695,500	
C A R T A H O L D I N G S	4,500	1,382.00	6,219,000	
オブティム	5,500	3,080.00	16,940,000	
セレス	3,600	2,007.00	7,225,200	
S H I F T	4,200	13,700.00	57,540,000	
特種東海製紙	6,500	5,300.00	34,450,000	
ティーガイア	9,500	1,836.00	17,442,000	
セック	1,600	3,010.00	4,816,000	
日本アジアグループ	11,700	599.00	7,008,300	
テクマトリックス	14,900	1,900.00	28,310,000	

プロシップ	3,200	1,549.00	4,956,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25,600	2,450.00	62,720,000
GMOペイメントゲートウェイ	22,500	13,440.00	302,400,000
ザッパラス	4,300	452.00	1,943,600
システムリサーチ	2,800	1,678.00	4,698,400
インターネットイニシアティブ	15,800	5,020.00	79,316,000
さくらインターネット	11,400	759.00	8,652,600
ヴィンクス	3,000	1,244.00	3,732,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,300	10,280.00	23,644,000
SRAホールディングス	5,600	2,471.00	13,837,600
システムインテグレータ	3,300	730.00	2,409,000
朝日ネット	7,500	924.00	6,930,000
eBASE	12,600	986.00	12,423,600
アバント	10,100	1,066.00	10,766,600
アドソル日進	3,900	2,733.00	10,658,700
フリービット	5,500	898.00	4,939,000
コムチュア	12,000	2,758.00	33,096,000
サイバーコム	1,900	1,794.00	3,408,600
アステリア	6,400	807.00	5,164,800
アイル	5,900	1,349.00	7,959,100
王子ホールディングス	443,300	494.00	218,990,200
日本製紙	47,000	1,257.00	59,079,000
三菱製紙	12,600	344.00	4,334,400
北越コーポレーション	63,500	382.00	24,257,000
中越パルプ工業	4,100	1,368.00	5,608,800
巴川製紙所	3,300	971.00	3,204,300
大王製紙	48,900	1,712.00	83,716,800
阿波製紙	2,900	452.00	1,310,800
マークライNZ	4,400	2,388.00	10,507,200
メディカル・データ・ビジョン	12,200	2,460.00	30,012,000
gumi	13,500	863.00	11,650,500
ショーケース	2,400	817.00	1,960,800
モバイルファクトリー	2,400	1,062.00	2,548,800
テラスカイ	3,900	4,605.00	17,959,500
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,100	1,401.00	5,744,100
PCIホールディングス	4,100	1,160.00	4,756,000
パイブドHD	1,400	1,724.00	2,413,600
アイビーシー	1,700	1,088.00	1,849,600
ネオジャパン	2,000	2,455.00	4,910,000
PR TIMES	1,700	3,285.00	5,584,500
ランドコンピュータ	1,500	1,128.00	1,692,000
ダブルスタンダード	1,400	4,775.00	6,685,000
オープンドア	5,200	1,293.00	6,723,600
マイネット	3,600	1,197.00	4,309,200
アカツキ	3,900	4,875.00	19,012,500
ベネフィットジャパン	800	1,743.00	1,394,400
Ubicomホールディングス	2,300	2,706.00	6,223,800

LINE	24,500	5,360.00	131,320,000	
カナミックネットワーク	9,800	802.00	7,859,600	
ノムラシステムコーポレーション	4,500	426.00	1,917,000	
レンゴー	100,300	846.00	84,853,800	
トーモク	6,500	1,778.00	11,557,000	
ザ・バック	8,000	3,145.00	25,160,000	
チェンジ	7,400	9,060.00	67,044,000	
シンクロ・フード	4,200	332.00	1,394,400	
オークネット	5,800	1,397.00	8,102,600	
セグエグループ	2,700	1,422.00	3,839,400	
エイトレッド	1,700	2,680.00	4,556,000	
AOI TYO HOLDINGS	11,000	425.00	4,675,000	
マクロミル	21,500	703.00	15,114,500	
ビーグリー	2,000	2,068.00	4,136,000	
オロ	3,400	3,620.00	12,308,000	
ユーザーローカル	1,000	4,565.00	4,565,000	
テモナ	2,200	1,513.00	3,328,600	
ニーズウェル	2,000	845.00	1,690,000	
サインポスト	2,200	1,003.00	2,206,600	
昭和電工	80,500	1,970.00	158,585,000	
住友化学	778,700	391.00	304,471,700	
住友精化	4,700	3,745.00	17,601,500	
日産化学	58,500	6,070.00	355,095,000	
ラサ工業	3,800	2,161.00	8,211,800	
クレハ	9,000	5,010.00	45,090,000	
多木化学	4,100	7,360.00	30,176,000	
テイカ	7,700	1,500.00	11,550,000	
石原産業	19,000	628.00	11,932,000	
片倉コープアグリ	2,500	1,268.00	3,170,000	
日本曹達	15,800	2,819.00	44,540,200	
東ソー	164,000	1,728.00	283,392,000	
トクヤマ	30,600	2,376.00	72,705,600	
セントラル硝子	21,700	2,339.00	50,756,300	
東亜合成	66,600	1,180.00	78,588,000	
大阪ソーダ	10,900	2,608.00	28,427,200	
関東電化工業	25,100	748.00	18,774,800	
デンカ	38,700	3,300.00	127,710,000	
イビデン	66,300	4,205.00	278,791,500	
信越化学工業	182,100	15,160.00	2,760,636,000	
日本カーバイド工業	3,900	1,210.00	4,719,000	
堺化学工業	6,800	2,066.00	14,048,800	
第一稀元素化学工業	11,700	744.00	8,704,800	
エア・ウォーター	98,600	1,636.00	161,309,600	
日本酸素ホールディングス	102,000	1,807.00	184,314,000	
日本化学工業	3,400	2,588.00	8,799,200	
東邦アセチレン	1,500	1,246.00	1,869,000	
日本パーカライジング	53,500	1,136.00	60,776,000	
高压ガス工業	16,900	872.00	14,736,800	
チタン工業	1,200	1,873.00	2,247,600	
四国化成工業	15,600	1,250.00	19,500,000	

戸田工業	2,500	2,075.00	5,187,500
ステラ ケミファ	5,800	3,170.00	18,386,000
保土谷化学工業	4,100	4,440.00	18,204,000
日本触媒	16,500	5,270.00	86,955,000
大日精化工業	9,500	2,300.00	21,850,000
カネカ	27,400	3,275.00	89,735,000
協和キリン	109,100	2,946.00	321,408,600
三菱瓦斯化学	98,600	1,854.00	182,804,400
三井化学	98,300	2,879.00	283,005,700
J S R	98,800	2,608.00	257,670,400
東京応化工業	18,200	6,120.00	111,384,000
大阪有機化学工業	9,900	2,643.00	26,165,700
三菱ケミカルホールディングス	708,800	599.40	424,854,720
K Hネオケム	17,500	2,674.00	46,795,000
ダイセル	137,800	780.00	107,484,000
住友ベークライト	16,700	3,230.00	53,941,000
積水化学工業	224,100	1,734.00	388,589,400
日本ゼオン	95,700	1,293.00	123,740,100
アイカ工業	31,800	3,825.00	121,635,000
宇部興産	53,400	1,829.00	97,668,600
積水樹脂	19,200	2,320.00	44,544,000
タキロンシーアイ	23,200	687.00	15,938,400
旭有機材	6,000	1,468.00	8,808,000
ニチバン	5,600	1,780.00	9,968,000
リケンテクノス	25,900	437.00	11,318,300
大倉工業	5,100	2,129.00	10,857,900
積水化成品工業	14,400	608.00	8,755,200
群栄化学工業	2,200	2,600.00	5,720,000
タイガースポリマー	5,100	470.00	2,397,000
ミライアル	3,900	1,224.00	4,773,600
ダイキアクシス	4,000	890.00	3,560,000
ダイキョーニシカワ	22,400	727.00	16,284,800
竹本容器	3,900	938.00	3,658,200
森六ホールディングス	5,700	2,050.00	11,685,000
日本化薬	65,600	929.00	60,942,400
カーリットホールディングス	11,700	575.00	6,727,500
E P Sホールディングス	13,900	1,010.00	14,039,000
ソルクシーズ	4,200	1,082.00	4,544,400
レグス	2,600	1,580.00	4,108,000
プレステージ・インターナショナル	38,700	918.00	35,526,600
フェイス	3,800	948.00	3,602,400
プロトコーポレーション	9,600	1,132.00	10,867,200
ハイマックス	2,600	1,199.00	3,117,400
アミューズ	5,600	2,611.00	14,621,600
野村総合研究所	150,500	3,380.00	508,690,000
ドリームインキュベータ	3,200	1,550.00	4,960,000
サイバネットシステム	7,600	842.00	6,399,200
クイック	6,400	1,144.00	7,321,600
T A C	6,400	227.00	1,452,800
C Eホールディングス	5,600	683.00	3,824,800

ケネディクス	88,900	584.00	51,917,600
日本システム技術	1,700	1,605.00	2,728,500
電通グループ	116,300	3,480.00	404,724,000
インテージホールディングス	13,300	1,065.00	14,164,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,100	608.00	2,492,800
東邦システムサイエンス	2,900	916.00	2,656,400
ぴあ	2,900	3,190.00	9,251,000
イオンファンタジー	4,100	2,402.00	9,848,200
ソースネクスト	50,200	314.00	15,762,800
シーティーエス	11,700	951.00	11,126,700
ネクシィーズグループ	3,200	1,076.00	3,443,200
インフォコム	11,700	3,640.00	42,588,000
メディカルシステムネットワーク	10,700	620.00	6,634,000
日本精化	8,600	1,524.00	13,106,400
扶桑化学工業	10,800	3,295.00	35,586,000
トリケミカル研究所	2,400	12,280.00	29,472,000
HEROZ	1,500	3,120.00	4,680,000
ラクスル	8,500	5,280.00	44,880,000
F I G	11,800	275.00	3,245,000
システムサポート	2,400	1,596.00	3,830,400
A D E K A	48,800	1,500.00	73,200,000
日油	39,900	4,335.00	172,966,500
ミヨシ油脂	4,100	1,233.00	5,055,300
新日本理化	18,400	174.00	3,201,600
ハリマ化成グループ	8,800	1,049.00	9,231,200
イーソル	5,700	1,285.00	7,324,500
アルテリア・ネットワークス	11,800	1,678.00	19,800,400
東海ソフト	700	1,118.00	782,600
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	1,900	1,529.00	2,905,100
東名	600	1,290.00	774,000
ヴィッツ	400	2,720.00	1,088,000
トピラシステムズ	1,000	1,519.00	1,519,000
L i n k - U	700	1,667.00	1,166,900
花王	259,200	8,032.00	2,081,894,400
第一工業製薬	4,100	4,420.00	18,122,000
石原ケミカル	2,900	2,230.00	6,467,000
日華化学	3,300	965.00	3,184,500
ニイタカ	2,200	3,150.00	6,930,000
三洋化成工業	6,300	4,535.00	28,570,500
武田薬品工業	900,700	3,624.00	3,264,136,800
アステラス製薬	938,700	1,632.00	1,531,958,400
大日本住友製薬	80,300	1,430.00	114,829,000
塩野義製薬	136,100	5,780.00	786,658,000
わかもと製薬	13,000	267.00	3,471,000
あすか製薬	12,200	1,616.00	19,715,200
日本新薬	28,400	7,620.00	216,408,000
ピオフェルミン製薬	1,700	2,469.00	4,197,300
中外製薬	338,600	4,671.00	1,581,600,600
科研製薬	18,600	4,105.00	76,353,000

エーザイ	129,600	7,906.00	1,024,617,600	
理研ビタミン	10,400	1,590.00	16,536,000	
ロート製薬	55,500	3,525.00	195,637,500	
小野薬品工業	248,500	3,257.00	809,364,500	
久光製薬	28,600	5,750.00	164,450,000	
有機合成薬品工業	8,200	316.00	2,591,200	
持田製薬	15,000	4,115.00	61,725,000	
参天製薬	201,700	1,735.00	349,949,500	
扶桑薬品工業	3,500	2,951.00	10,328,500	
日本ケミファ	1,200	2,536.00	3,043,200	
ツムラ	33,500	3,360.00	112,560,000	
日医工	30,700	1,130.00	34,691,000	
テルモ	306,300	4,358.00	1,334,855,400	
H.U.グループホールディングス	28,900	2,779.00	80,313,100	
キッセイ薬品工業	19,200	2,122.00	40,742,400	
生化学工業	21,000	1,074.00	22,554,000	
栄研化学	19,100	1,991.00	38,028,100	
日水製薬	4,700	1,025.00	4,817,500	
鳥居薬品	6,700	3,235.00	21,674,500	
JCRファーマ	30,500	2,918.00	88,999,000	
東和薬品	13,800	2,023.00	27,917,400	
富士製薬工業	7,300	1,266.00	9,241,800	
沢井製薬	22,200	5,050.00	112,110,000	
ゼリア新薬工業	19,700	1,967.00	38,749,900	
第一三共	929,400	3,474.00	3,228,735,600	
キョーリン製薬ホールディングス	23,900	1,917.00	45,816,300	
大幸薬品	13,300	1,899.00	25,256,700	
ダイト	6,900	4,075.00	28,117,500	
大塚ホールディングス	224,900	4,337.00	975,391,300	
大正製薬ホールディングス	22,900	6,580.00	150,682,000	
ペプチドリーム	55,000	5,120.00	281,600,000	
大日本塗料	12,200	1,028.00	12,541,600	
日本ペイントホールディングス	87,500	10,640.00	931,000,000	
関西ペイント	119,100	2,900.00	345,390,000	
神東塗料	8,700	178.00	1,548,600	
中国塗料	30,200	996.00	30,079,200	
日本特殊塗料	8,000	1,037.00	8,296,000	
藤倉化成	14,500	546.00	7,917,000	
太陽ホールディングス	7,700	5,710.00	43,967,000	
DIC	44,800	2,704.00	121,139,200	
サカタインクス	23,100	1,144.00	26,426,400	
東洋インキSCホールディングス	22,500	2,021.00	45,472,500	
T&K TOKA	8,400	900.00	7,560,000	
アルプス技研	9,100	1,995.00	18,154,500	
サニックス	18,100	272.00	4,923,200	
ダイオーズ	2,200	965.00	2,123,000	
日本空調サービス	11,000	770.00	8,470,000	
オリエンタルランド	110,000	17,215.00	1,893,650,000	
フォーカスシステムズ	6,600	935.00	6,171,000	
ダスキン	25,700	2,939.00	75,532,300	

パーク24	57,200	1,565.00	89,518,000
明光ネットワークジャパン	13,100	625.00	8,187,500
ファルコホールディングス	5,700	1,651.00	9,410,700
クレスコ	6,400	1,280.00	8,192,000
フジ・メディア・ホールディングス	102,100	1,080.00	110,268,000
秀英予備校	2,800	427.00	1,195,600
田谷	1,700	560.00	952,000
ラウンドワン	28,800	926.00	26,668,800
リゾートトラスト	47,400	1,770.00	83,898,000
オービック	36,700	20,250.00	743,175,000
ジャストシステム	17,300	6,990.00	120,927,000
TDCソフト	9,400	1,047.00	9,841,800
Zホールディングス	1,459,000	613.60	895,242,400
ビー・エム・エル	13,300	3,130.00	41,629,000
ワタベウェディング	1,700	284.00	482,800
トレンドマイクロ	56,600	6,090.00	344,694,000
りらいあコミュニケーションズ	18,000	1,179.00	21,222,000
IDホールディングス	4,100	1,309.00	5,366,900
リソー教育	47,400	330.00	15,642,000
日本オラクル	21,500	11,440.00	245,960,000
早稲田アカデミー	4,500	995.00	4,477,500
アルファシステムズ	3,400	3,340.00	11,356,000
フューチャー	12,800	1,774.00	22,707,200
CAC Holdings	6,900	1,382.00	9,535,800
SBテクノロジー	3,900	3,590.00	14,001,000
トーセ	2,900	898.00	2,604,200
ユー・エス・エス	115,800	2,226.00	257,770,800
オービックビジネスコンサルタント	10,900	6,280.00	68,452,000
伊藤忠テクノソリューションズ	48,400	3,735.00	180,774,000
アイティフォー	12,800	918.00	11,750,400
東京個別指導学院	3,800	619.00	2,352,200
東計電算	1,600	4,325.00	6,920,000
サイバーエージェント	63,600	6,170.00	392,412,000
楽天	482,200	1,111.00	535,724,200
エクスネット	1,800	1,040.00	1,872,000
クリーク・アンド・リバー社	5,400	1,070.00	5,778,000
テー・オー・ダブリュー	16,500	304.00	5,016,000
大塚商会	57,500	4,900.00	281,750,000
サイボウズ	12,300	3,060.00	37,638,000
山田コンサルティンググループ	6,700	1,100.00	7,370,000
セントラルスポーツ	4,000	2,372.00	9,488,000
パラカ	2,800	1,770.00	4,956,000
電通国際情報サービス	6,500	5,580.00	36,270,000
ACCESS	10,000	788.00	7,880,000
デジタルガレージ	19,200	4,075.00	78,240,000
イーエムシステムズ	14,900	799.00	11,905,100
ウェザーニューズ	3,700	5,740.00	21,238,000
C I J	7,200	1,026.00	7,387,200
ビジネスエンジニアリング	1,200	3,565.00	4,278,000
日本エンタープライズ	10,700	231.00	2,471,700

WOWOW	5,100	2,830.00	14,433,000	
スカラ	7,000	931.00	6,517,000	
インテリジェント ウェイブ	6,300	732.00	4,611,600	
フルキャストホールディングス	9,000	1,614.00	14,526,000	
エン・ジャパン	18,300	2,908.00	53,216,400	
富士フイルムホールディングス	207,600	5,660.00	1,175,016,000	
コニカミノルタ	236,100	311.00	73,427,100	
資生堂	215,200	7,363.00	1,584,517,600	
ライオン	140,800	2,413.00	339,750,400	
高砂香料工業	6,800	2,381.00	16,190,800	
マンダム	24,200	1,700.00	41,140,000	
ミルボン	14,500	5,800.00	84,100,000	
ファンケル	43,800	3,730.00	163,374,000	
コーセー	20,300	15,840.00	321,552,000	
コタ	6,400	1,398.00	8,947,200	
シーボン	1,300	1,950.00	2,535,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	46,100	2,233.00	102,941,300	
ノエビアホールディングス	9,100	4,725.00	42,997,500	
アジュバンコスメジャパン	2,300	1,023.00	2,352,900	
エステー	7,000	2,037.00	14,259,000	
アグロ カネショウ	4,100	1,789.00	7,334,900	
コニシ	18,000	1,624.00	29,232,000	
長谷川香料	18,700	2,141.00	40,036,700	
星光PMC	6,400	668.00	4,275,200	
小林製薬	30,300	11,150.00	337,845,000	
荒川化学工業	9,800	1,174.00	11,505,200	
メック	7,400	2,038.00	15,081,200	
日本高純度化学	2,800	2,747.00	7,691,600	
タカラバイオ	28,500	2,981.00	84,958,500	
JCU	13,100	3,340.00	43,754,000	
新田ゼラチン	7,100	730.00	5,183,000	
OATアグリオ	2,000	1,326.00	2,652,000	
デクセリアルズ	28,100	1,167.00	32,792,700	
アース製薬	7,700	6,350.00	48,895,000	
北興化学工業	10,100	1,087.00	10,978,700	
大成ラミック	3,300	2,880.00	9,504,000	
クミアイ化学工業	44,700	1,095.00	48,946,500	
日本農薬	19,300	534.00	10,306,200	
富士興産	3,300	948.00	3,128,400	
ニチレキ	12,800	1,895.00	24,256,000	
ユシロ化学工業	6,200	1,334.00	8,270,800	
ビーピー・カストロール	4,100	1,290.00	5,289,000	
富士石油	28,800	200.00	5,760,000	
MORESCO	4,100	1,030.00	4,223,000	
出光興産	120,100	2,249.00	270,104,900	
ENEOSホールディングス	1,628,400	377.10	614,069,640	
コスモエネルギーホールディングス	31,300	1,734.00	54,274,200	
横浜ゴム	62,600	1,649.00	103,227,400	
TOYO TIRE	56,900	1,686.00	95,933,400	
ブリヂストン	287,900	3,715.00	1,069,548,500	

住友ゴム工業	97,300	1,059.00	103,040,700
藤倉コンポジット	10,200	357.00	3,641,400
オカモト	6,600	4,210.00	27,786,000
アキレス	7,500	1,608.00	12,060,000
フコク	4,300	741.00	3,186,300
ニッタ	12,200	2,350.00	28,670,000
クリエートメディック	3,300	1,034.00	3,412,200
住友理工	21,100	563.00	11,879,300
三ツ星ベルト	14,200	1,780.00	25,276,000
バンドー化学	19,300	614.00	11,850,200
A G C	99,400	3,480.00	345,912,000
日本板硝子	51,700	423.00	21,869,100
石塚硝子	2,100	1,946.00	4,086,600
有沢製作所	17,200	968.00	16,649,600
日本山村硝子	4,600	864.00	3,974,400
日本電気硝子	40,200	2,257.00	90,731,400
オハラ	4,300	1,296.00	5,572,800
住友大阪セメント	20,400	3,365.00	68,646,000
太平洋セメント	68,300	2,960.00	202,168,000
リソルホールディングス	900	3,825.00	3,442,500
日本ヒューム	11,000	818.00	8,998,000
日本コンクリート工業	23,500	345.00	8,107,500
三谷セキサン	5,100	4,880.00	24,888,000
アジアパイルホールディングス	15,800	473.00	7,473,400
東海カーボン	105,900	1,210.00	128,139,000
日本カーボン	5,900	3,695.00	21,800,500
東洋炭素	6,400	1,813.00	11,603,200
ノリタケカンパニーリミテド	6,000	3,075.00	18,450,000
T O T O	77,400	5,690.00	440,406,000
日本碍子	129,900	1,696.00	220,310,400
日本特殊陶業	82,200	1,876.00	154,207,200
ダントーホールディングス	8,000	539.00	4,312,000
M A R U W A	4,100	10,630.00	43,583,000
品川リフラクトリーズ	2,900	2,266.00	6,571,400
黒崎播磨	2,100	3,015.00	6,331,500
ヨータイ	8,700	830.00	7,221,000
イソライト工業	5,600	471.00	2,637,600
東京窯業	14,300	350.00	5,005,000
ニッカトー	4,400	703.00	3,093,200
フジミインコーポレーテッド	9,700	3,475.00	33,707,500
クニミネ工業	4,400	1,130.00	4,972,000
エーアンドエーマテリアル	1,700	1,098.00	1,866,600
ニチアス	29,600	2,341.00	69,293,600
日本製鉄	479,000	1,241.00	594,439,000
神戸製鋼所	195,500	499.00	97,554,500
中山製鋼所	15,300	381.00	5,829,300
合同製鐵	5,700	1,886.00	10,750,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	288,900	897.00	259,143,300
東京製鐵	52,100	715.00	37,251,500

共英製鋼	12,200	1,436.00	17,519,200
大和工業	22,800	2,633.00	60,032,400
東京鐵鋼	4,400	2,010.00	8,844,000
大阪製鐵	5,800	1,163.00	6,745,400
淀川製鋼所	14,500	2,071.00	30,029,500
丸一鋼管	34,800	2,481.00	86,338,800
モリ工業	2,900	2,480.00	7,192,000
大同特殊鋼	17,500	4,005.00	70,087,500
日本高周波鋼業	3,900	339.00	1,322,100
日本冶金工業	8,800	1,561.00	13,736,800
山陽特殊製鋼	7,300	1,091.00	7,964,300
愛知製鋼	6,000	2,732.00	16,392,000
日立金属	115,400	1,449.00	167,214,600
日本金属	2,600	665.00	1,729,000
大平洋金属	7,200	1,782.00	12,830,400
新日本電工	68,900	249.00	17,156,100
栗本鐵工所	5,200	1,828.00	9,505,600
虹 技	1,300	1,291.00	1,678,300
日本鑄鉄管	1,100	1,293.00	1,422,300
日本製鋼所	32,500	2,662.00	86,515,000
三菱製鋼	7,900	568.00	4,487,200
日亜鋼業	16,100	315.00	5,071,500
日本精線	1,700	3,575.00	6,077,500
エンビプロ・ホールディングス	4,700	540.00	2,538,000
大紀アルミニウム工業所	17,900	684.00	12,243,600
日本軽金属ホールディングス	27,100	1,841.00	49,891,100
三井金属鉱業	28,800	2,973.00	85,622,400
東邦亜鉛	5,400	2,080.00	11,232,000
三菱マテリアル	70,600	2,078.00	146,706,800
住友金属鉱山	136,800	3,748.00	512,726,400
DOWAホールディングス	27,100	3,575.00	96,882,500
古河機械金属	19,100	1,168.00	22,308,800
エス・サイエンス	44,100	46.00	2,028,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,100	916.00	10,167,600
東邦チタニウム	19,200	700.00	13,440,000
UACJ	16,300	1,727.00	28,150,100
CKサンエツ	2,100	3,775.00	7,927,500
古河電気工業	33,200	2,482.00	82,402,400
住友電気工業	400,500	1,348.50	540,074,250
フジクラ	129,000	402.00	51,858,000
昭和電線ホールディングス	12,400	1,413.00	17,521,200
東京特殊電線	1,500	2,430.00	3,645,000
タツタ電線	21,400	594.00	12,711,600
カナレ電気	1,700	1,769.00	3,007,300
平河ヒューテック	5,300	1,105.00	5,856,500
リョービ	13,200	1,293.00	17,067,600
アーレスティ	14,200	342.00	4,856,400
アサヒホールディングス	18,800	3,545.00	66,646,000
東洋製罐グループホールディングス	68,200	1,095.00	74,679,000
ホッカフホールディングス	5,900	1,478.00	8,720,200

コロナ	6,200	978.00	6,063,600
横河ブリッジホールディングス	19,900	1,987.00	39,541,300
OSJBホールディングス	53,400	250.00	13,350,000
駒井ハルテック	1,900	1,565.00	2,973,500
高田機工	800	2,496.00	1,996,800
三和ホールディングス	100,900	1,295.00	130,665,500
文化シャッター	31,700	927.00	29,385,900
三協立山	13,800	957.00	13,206,600
アルインコ	7,900	922.00	7,283,800
東洋シャッター	2,500	744.00	1,860,000
LIXILグループ	158,100	2,389.00	377,700,900
日本ファイルコン	7,300	557.00	4,066,100
ノーリツ	22,200	1,700.00	37,740,000
長府製作所	11,000	2,140.00	23,540,000
リンナイ	20,700	11,100.00	229,770,000
ユニプレス	20,900	913.00	19,081,700
ダイニチ工業	6,200	820.00	5,084,000
日東精工	13,400	487.00	6,525,800
三洋工業	1,300	1,988.00	2,584,400
岡部	21,900	834.00	18,264,600
ジーテクト	13,300	1,374.00	18,274,200
東プレ	20,000	1,166.00	23,320,000
高周波熱錬	20,500	498.00	10,209,000
東京製綱	7,600	532.00	4,043,200
サンコール	8,300	445.00	3,693,500
モリテックスチール	8,700	310.00	2,697,000
パイオラックス	15,800	1,619.00	25,580,200
エイチワン	10,900	638.00	6,954,200
日本発条	114,800	655.00	75,194,000
中央発條	1,000	2,999.00	2,999,000
アドバネクス	1,600	1,241.00	1,985,600
三浦工業	46,300	5,400.00	250,020,000
タクマ	36,300	1,790.00	64,977,000
テクノプロ・ホールディングス	20,500	7,400.00	151,700,000
アトラ	2,600	282.00	733,200
インターワークス	1,900	332.00	630,800
アイ・アールジャパンホールディングス	4,100	13,000.00	53,300,000
Keeper 技研	7,600	1,620.00	12,312,000
ファーストロジック	2,000	801.00	1,602,000
三機サービス	2,000	988.00	1,976,000
Gunosy	6,400	796.00	5,094,400
デザインワン・ジャパン	2,900	239.00	693,100
イー・ガーディアン	4,500	3,270.00	14,715,000
リブセンス	6,200	270.00	1,674,000
ジャパンマテリアル	31,800	1,359.00	43,216,200
ベクトル	12,800	904.00	11,571,200
ウチヤマホールディングス	5,800	317.00	1,838,600
チャーム・ケア・コーポレーション	8,700	1,118.00	9,726,600
キャリアリンク	3,500	1,515.00	5,302,500

I B J	8,400	994.00	8,349,600
アサンテ	4,100	1,643.00	6,736,300
N・フィールド	7,000	795.00	5,565,000
バリューHR	4,100	1,592.00	6,527,200
M&Aキャピタルパートナーズ	8,400	5,940.00	49,896,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,100	2,171.00	8,901,100
E R Iホールディングス	2,800	678.00	1,898,400
アビスト	1,600	2,853.00	4,564,800
シグマクシス	7,000	1,575.00	11,025,000
ウィルグループ	6,700	893.00	5,983,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	15,200	320.00	4,864,000
メドピア	4,900	5,140.00	25,186,000
リクルートホールディングス	741,000	4,689.00	3,474,549,000
エラン	7,100	2,575.00	18,282,500
ツガミ	22,100	1,573.00	34,763,300
オークマ	12,400	5,880.00	72,912,000
芝浦機械	12,200	2,062.00	25,156,400
アマダ	132,700	977.00	129,647,900
アイダエンジニアリング	28,100	898.00	25,233,800
滝澤鉄工所	3,000	999.00	2,997,000
F U J I	46,000	2,374.00	109,204,000
牧野フライス製作所	12,400	4,220.00	52,328,000
オーエスジー	52,900	1,794.00	94,902,600
ダイジェット工業	1,000	1,437.00	1,437,000
旭ダイヤモンド工業	28,300	472.00	13,357,600
D M G 森精機	67,700	1,577.00	106,762,900
ソディック	23,400	813.00	19,024,200
ディスコ	14,500	29,010.00	420,645,000
日東工器	5,900	1,730.00	10,207,000
日進工具	4,200	2,450.00	10,290,000
パンチ工業	9,800	454.00	4,449,200
富士ダイス	4,300	660.00	2,838,000
土木管理総合試験所	5,200	410.00	2,132,000
ネットマーケティング	4,100	586.00	2,402,600
日本郵政	848,300	781.10	662,607,130
ベルシステム24ホールディングス	17,400	1,626.00	28,292,400
鎌倉新書	7,700	1,272.00	9,794,400
S M N	2,200	805.00	1,771,000
一蔵	1,200	390.00	468,000
L I T A L I C O	3,700	3,060.00	11,322,000
グローバルキッズCOMPANY	1,900	818.00	1,554,200
エアトリ	5,300	1,362.00	7,218,600
アトラエ	3,200	2,796.00	8,947,200
ストライク	4,000	5,820.00	23,280,000
ソラスト	28,600	1,522.00	43,529,200
セラク	3,300	1,974.00	6,514,200
インソース	4,200	3,080.00	12,936,000
豊田自動織機	87,600	7,280.00	637,728,000
豊和工業	6,000	821.00	4,926,000

OKK	4,800	392.00	1,881,600
石川製作所	2,600	1,703.00	4,427,800
東洋機械金属	8,400	415.00	3,486,000
津田駒工業	1,900	932.00	1,770,800
エンシュウ	2,500	985.00	2,462,500
島精機製作所	16,900	1,803.00	30,470,700
オプトラ	13,400	2,159.00	28,930,600
NCホールディングス	3,000	619.00	1,857,000
イワキ	6,900	853.00	5,885,700
フリー	10,600	1,168.00	12,380,800
ヤマシンフィルタ	23,200	1,034.00	23,988,800
日阪製作所	13,400	909.00	12,180,600
やまびこ	20,600	1,353.00	27,871,800
平田機工	5,100	6,830.00	34,833,000
ペガサスミシン製造	11,300	303.00	3,423,900
マルマエ	4,100	902.00	3,698,200
タツモ	4,500	1,535.00	6,907,500
ナブテスコ	63,000	4,115.00	259,245,000
三井海洋開発	11,400	1,746.00	19,904,400
レオン自動機	10,600	1,215.00	12,879,000
S M C	34,000	61,280.00	2,083,520,000
ホソカワミクロン	3,900	5,620.00	21,918,000
ユニオンツール	4,100	3,245.00	13,304,500
オイレス工業	13,800	1,599.00	22,066,200
日精エー・エス・ビー機械	3,200	4,335.00	13,872,000
サトーホールディングス	15,200	2,205.00	33,516,000
技研製作所	9,500	3,985.00	37,857,500
日本エアテック	3,600	1,644.00	5,918,400
カワタ	3,300	850.00	2,805,000
日精樹脂工業	9,100	909.00	8,271,900
オカダアイヨン	3,500	1,005.00	3,517,500
ワイエイシーホールディングス	4,500	666.00	2,997,000
小松製作所	490,500	2,555.50	1,253,472,750
住友重機械工業	61,900	2,512.00	155,492,800
日立建機	43,400	2,852.00	123,776,800
日工	14,700	694.00	10,201,800
巴工業	4,200	1,976.00	8,299,200
井関農機	11,000	1,533.00	16,863,000
T O W A	11,000	1,377.00	15,147,000
丸山製作所	2,300	1,422.00	3,270,600
北川鉄工所	5,000	1,400.00	7,000,000
シンニッタン	17,200	207.00	3,560,400
ローツェ	4,700	4,960.00	23,312,000
タカキタ	4,100	664.00	2,722,400
クボタ	574,300	2,055.50	1,180,473,650
荏原実業	2,800	3,660.00	10,248,000
東洋エンジニアリング	14,200	331.00	4,700,200
三菱化工機	3,900	2,022.00	7,885,800
月島機械	19,900	1,367.00	27,203,300
帝国電機製作所	8,900	1,242.00	11,053,800

東京機械製作所	4,200	277.00	1,163,400	
新東工業	25,900	722.00	18,699,800	
澁谷工業	9,600	3,510.00	33,696,000	
アイチコーポレーション	18,700	940.00	17,578,000	
小森コーポレーション	27,500	718.00	19,745,000	
鶴見製作所	8,300	1,826.00	15,155,800	
住友精密工業	1,700	2,023.00	3,439,100	
日本ギア工業	3,500	310.00	1,085,000	
酒井重工業	1,900	2,422.00	4,601,800	
荏原製作所	44,800	3,020.00	135,296,000	
石井鐵工所	1,200	2,771.00	3,325,200	
西島製作所	11,100	821.00	9,113,100	
北越工業	11,300	1,085.00	12,260,500	
ダイキン工業	137,900	23,225.00	3,202,727,500	
オルガノ	4,000	5,570.00	22,280,000	
トーヨーカネツ	4,700	2,248.00	10,565,600	
栗田工業	58,500	3,485.00	203,872,500	
椿本チエイン	15,500	2,607.00	40,408,500	
大同工業	4,500	729.00	3,280,500	
日機装	35,000	1,058.00	37,030,000	
木村化工機	8,900	466.00	4,147,400	
レイズネクスト	18,200	1,215.00	22,113,000	
アネスト岩田	17,000	959.00	16,303,000	
ダイフク	55,300	11,420.00	631,526,000	
サムコ	2,700	2,762.00	7,457,400	
加藤製作所	5,900	1,093.00	6,448,700	
油研工業	1,700	1,550.00	2,635,000	
タダノ	52,100	823.00	42,878,300	
フジテック	39,300	2,172.00	85,359,600	
C K D	29,700	1,913.00	56,816,100	
キトー	8,300	1,582.00	13,130,600	
平和	30,200	1,685.00	50,887,000	
理想科学工業	9,700	1,280.00	12,416,000	
SANKYO	24,000	2,729.00	65,496,000	
日本金銭機械	12,200	569.00	6,941,800	
マースグループホールディングス	6,900	1,689.00	11,654,100	
フクシマガリレイ	6,600	4,705.00	31,053,000	
オーイズミ	4,800	393.00	1,886,400	
ダイコク電機	5,000	952.00	4,760,000	
竹内製作所	18,100	2,474.00	44,779,400	
アマノ	28,500	2,604.00	74,214,000	
JUKI	15,000	491.00	7,365,000	
サンデンホールディングス	14,000	377.00	5,278,000	
蛇の目ミシン工業	9,900	680.00	6,732,000	
ブラザー工業	132,200	1,825.00	241,265,000	
マックス	16,600	1,509.00	25,049,400	
モリタホールディングス	19,000	1,999.00	37,981,000	
グローリー	27,900	2,348.00	65,509,200	
新晃工業	10,100	1,642.00	16,584,200	
大和冷機工業	17,400	1,058.00	18,409,200	

セガサミーホールディングス	107,300	1,514.00	162,452,200	
日本ピストンリング	4,100	1,090.00	4,469,000	
リケン	5,000	2,605.00	13,025,000	
T P R	14,500	1,440.00	20,880,000	
ツバキ・ナカシマ	20,500	919.00	18,839,500	
ホシザキ	34,200	10,570.00	361,494,000	
大豊工業	9,000	611.00	5,499,000	
日本精工	203,600	927.00	188,737,200	
NTN	249,300	232.00	57,837,600	
ジェイテクト	103,800	931.00	96,637,800	
不二越	10,100	4,455.00	44,995,500	
ミネベアミツミ	200,900	1,978.00	397,380,200	
日本トムソン	32,000	384.00	12,288,000	
THK	67,400	3,100.00	208,940,000	
ユーシン精機	8,400	742.00	6,232,800	
前澤給装工業	4,100	2,215.00	9,081,500	
イーグル工業	13,400	915.00	12,261,000	
前澤工業	7,500	486.00	3,645,000	
日本ピラー工業	11,000	1,577.00	17,347,000	
キッツ	43,900	603.00	26,471,700	
日立製作所	520,100	4,080.00	2,122,008,000	
三菱電機	1,082,600	1,464.00	1,584,926,400	
富士電機	65,300	3,600.00	235,080,000	
東洋電機製造	4,100	1,156.00	4,739,600	
安川電機	116,500	4,530.00	527,745,000	
シンフォニア テクノロジー	14,100	1,280.00	18,048,000	
明電舎	19,900	1,749.00	34,805,100	
オリジン	2,700	1,368.00	3,693,600	
山洋電気	5,200	4,840.00	25,168,000	
デンヨー	9,100	2,625.00	23,887,500	
ベikalレント・コンサルティング	6,300	15,500.00	97,650,000	
Orchestra Holdings	2,100	2,279.00	4,785,900	
アイモバイル	3,700	1,318.00	4,876,600	
キャリアインデックス	4,100	530.00	2,173,000	
MS - Japan	3,400	836.00	2,842,400	
船場	1,600	930.00	1,488,000	
グレイステクノロジー	4,800	5,540.00	26,592,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	11,800	4,255.00	50,209,000	
フルテック	1,300	1,435.00	1,865,500	
グリーンズ	2,500	516.00	1,290,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,700	434.00	737,800	
GAMEWITH	3,000	576.00	1,728,000	
ソウルドアウト	2,400	1,528.00	3,667,200	
MS&Consulting	1,800	660.00	1,188,000	
エル・ティー・エス	700	4,930.00	3,451,000	
ミダック	1,300	2,962.00	3,850,600	
日総工産	6,800	832.00	5,657,600	
キュービーネットホールディングス	4,200	1,699.00	7,135,800	

R P Aホールディングス	7,800	720.00	5,616,000
三櫻工業	13,600	631.00	8,581,600
マキタ	141,200	5,230.00	738,476,000
東芝テック	13,500	4,370.00	58,995,000
芝浦メカトロニクス	1,900	3,670.00	6,973,000
マブチモーター	29,900	4,465.00	133,503,500
日本電産	260,600	11,695.00	3,047,717,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,400	312.00	1,996,800
トレックス・セミコンダクター	6,300	1,330.00	8,379,000
東光高岳	6,100	1,176.00	7,173,600
ダブル・スコープ	17,100	776.00	13,269,600
宮越ホールディングス	4,100	720.00	2,952,000
ダイヘン	11,900	4,185.00	49,801,500
ヤーマン	17,700	1,795.00	31,771,500
J V Cケンウッド	88,200	159.00	14,023,800
ミマキエンジニアリング	10,000	490.00	4,900,000
I - P E X	5,100	1,919.00	9,786,900
日新電機	25,400	1,160.00	29,464,000
大崎電気工業	21,700	597.00	12,954,900
オムロン	97,100	8,100.00	786,510,000
日東工業	15,900	1,977.00	31,434,300
I D E C	15,800	1,922.00	30,367,600
正興電機製作所	2,600	1,678.00	4,362,800
不二電機工業	2,000	1,304.00	2,608,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	36,200	2,135.00	77,287,000
サクサホールディングス	2,400	1,430.00	3,432,000
メルコホールディングス	3,900	2,850.00	11,115,000
テクノメディカ	2,600	1,595.00	4,147,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	2,400	866.00	2,078,400
日本電気	131,300	5,670.00	744,471,000
富士通	104,400	13,250.00	1,383,300,000
沖電気工業	44,100	956.00	42,159,600
岩崎通信機	4,300	850.00	3,655,000
電気興業	5,200	2,830.00	14,716,000
サンケン電気	11,900	3,660.00	43,554,000
ナカヨ	1,900	1,492.00	2,834,800
アイホン	6,200	1,533.00	9,504,600
ルネサスエレクトロニクス	463,100	929.00	430,219,900
セイコーエプソン	134,300	1,359.00	182,513,700
ワコム	72,800	719.00	52,343,200
アルバック	19,900	4,210.00	83,779,000
アクセル	4,500	843.00	3,793,500
E I Z O	8,400	3,820.00	32,088,000
ジャパンディスプレイ	313,000	54.00	16,902,000
日本信号	27,500	945.00	25,987,500
京三製作所	25,300	448.00	11,334,400
能美防災	14,300	2,519.00	36,021,700
ホーチキ	7,800	1,300.00	10,140,000
星和電機	5,500	640.00	3,520,000

エレコム	12,200	4,700.00	57,340,000
パナソニック	1,237,000	1,063.50	1,315,549,500
シャープ	125,300	1,187.00	148,731,100
アンリツ	69,600	2,301.00	160,149,600
富士通ゼネラル	29,400	3,195.00	93,933,000
ソニー	678,200	9,040.00	6,130,928,000
T D K	52,200	13,380.00	698,436,000
帝国通信工業	4,300	1,185.00	5,095,500
タムラ製作所	36,100	534.00	19,277,400
アルプスアルパイン	95,800	1,532.00	146,765,600
池上通信機	3,200	819.00	2,620,800
日本電波工業	10,000	458.00	4,580,000
鈴木	5,500	861.00	4,735,500
日本トリム	1,500	3,730.00	5,595,000
ローランド ディー・ジー	6,400	1,461.00	9,350,400
フォスター電機	11,400	1,225.00	13,965,000
S M K	2,800	2,910.00	8,148,000
ヨコオ	7,000	2,706.00	18,942,000
ティアック	7,300	119.00	868,700
ホシデン	29,700	881.00	26,165,700
ヒロセ電機	16,700	14,520.00	242,484,000
日本航空電子工業	24,800	1,479.00	36,679,200
T O A	11,700	935.00	10,939,500
マクセルホールディングス	23,300	1,169.00	27,237,700
古野電気	14,000	1,185.00	16,590,000
ユニデンホールディングス	3,000	2,024.00	6,072,000
スミダコーポレーション	9,300	1,011.00	9,402,300
アイコム	6,000	3,015.00	18,090,000
リオン	4,600	2,567.00	11,808,200
本多通信工業	9,500	491.00	4,664,500
船井電機	11,100	442.00	4,906,200
横河電機	99,400	1,821.00	181,007,400
新電元工業	3,900	2,474.00	9,648,600
アズビル	68,300	4,440.00	303,252,000
東亜ディーケーケー	5,400	879.00	4,746,600
日本光電工業	44,700	3,555.00	158,908,500
チノー	3,500	1,419.00	4,966,500
共和電業	10,300	440.00	4,532,000
日本電子材料	4,200	1,606.00	6,745,200
堀場製作所	21,400	5,840.00	124,976,000
アドバンテスト	80,500	6,630.00	533,715,000
小野測器	4,200	528.00	2,217,600
エスベック	9,700	1,814.00	17,595,800
キーエンス	98,100	53,000.00	5,199,300,000
日置電機	5,200	3,935.00	20,462,000
シスメックス	77,400	10,390.00	804,186,000
日本マイクロニクス	18,900	1,046.00	19,769,400
メガチップス	10,100	2,652.00	26,785,200
O B A R A G R O U P	6,300	3,415.00	21,514,500
I M A G I C A G R O U P	9,500	405.00	3,847,500

澤藤電機	1,300	1,850.00	2,405,000	
デンソー	238,500	5,207.00	1,241,869,500	
原田工業	4,600	890.00	4,094,000	
コーセル	14,400	1,073.00	15,451,200	
イリソ電子工業	9,000	4,780.00	43,020,000	
オブテックスグループ	17,800	1,765.00	31,417,000	
千代田インテグレ	4,600	1,633.00	7,511,800	
アイ・オー・データ機器	3,600	1,072.00	3,859,200	
レーザーテック	47,500	9,640.00	457,900,000	
スタンレー電気	75,900	3,060.00	232,254,000	
岩崎電気	4,200	1,378.00	5,787,600	
ウシオ電機	59,800	1,344.00	80,371,200	
岡谷電機産業	8,800	350.00	3,080,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	10,200	322.00	3,284,400	
エノモト	3,400	1,200.00	4,080,000	
日本セラミック	11,100	2,869.00	31,845,900	
遠藤照明	4,700	588.00	2,763,600	
古河電池	7,600	1,320.00	10,032,000	
双信電機	5,300	418.00	2,215,400	
山一電機	7,700	1,367.00	10,525,900	
図研	7,000	2,717.00	19,019,000	
日本電子	21,300	3,695.00	78,703,500	
カシオ計算機	95,800	2,030.00	194,474,000	
ファナック	101,800	23,935.00	2,436,583,000	
日本シイエムケイ	25,400	480.00	12,192,000	
エンプラス	5,500	2,274.00	12,507,000	
大真空	4,100	2,116.00	8,675,600	
ローム	44,900	8,450.00	379,405,000	
浜松ホトニクス	77,600	5,690.00	441,544,000	
三井ハイテック	12,000	2,344.00	28,128,000	
新光電気工業	36,400	1,837.00	66,866,800	
京セラ	152,300	6,177.00	940,757,100	
協栄産業	1,000	1,339.00	1,339,000	
太陽誘電	48,200	4,015.00	193,523,000	
村田製作所	318,000	7,792.00	2,477,856,000	
双葉電子工業	17,100	912.00	15,595,200	
日東電工	74,700	7,810.00	583,407,000	
北陸電気工業	4,100	937.00	3,841,700	
東海理化電機製作所	28,500	1,723.00	49,105,500	
ニチコン	36,700	958.00	35,158,600	
日本ケミコン	8,200	1,511.00	12,390,200	
K O A	16,400	1,384.00	22,697,600	
三井E & Sホールディングス	38,900	386.00	15,015,400	
日立造船	85,900	437.00	37,538,300	
三菱重工業	181,400	2,518.50	456,855,900	
川崎重工業	84,200	1,597.00	134,467,400	
I H I	77,900	1,478.00	115,136,200	
名村造船所	34,900	153.00	5,339,700	
サノヤスホールディングス	12,100	161.00	1,948,100	
スプリックス	2,800	949.00	2,657,200	

マネジメントソリューションズ	5,000	1,420.00	7,100,000	
プロレド・パートナーズ	1,400	4,870.00	6,818,000	
and factory	1,000	904.00	904,000	
ピアラ	600	2,387.00	1,432,200	
ギークス	1,000	1,197.00	1,197,000	
カーブスホールディングス	28,500	747.00	21,289,500	
フォーラムエンジニアリング	5,300	888.00	4,706,400	
日本車輛製造	4,100	2,542.00	10,422,200	
三菱ロジスネクスト	14,400	1,034.00	14,889,600	
近畿車輛	1,600	1,331.00	2,129,600	
F P G	32,700	530.00	17,331,000	
島根銀行	2,900	640.00	1,856,000	
じもとホールディングス	7,100	1,076.00	7,639,600	
全国保証	30,000	4,725.00	141,750,000	
めぶきフィナンシャルグループ	554,300	238.00	131,923,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14,400	1,192.00	17,164,800	
九州フィナンシャルグループ	233,800	545.00	127,421,000	
かんぼ生命保険	37,800	1,761.00	66,565,800	
ゆうちょ銀行	302,800	902.00	273,125,600	
富山第一銀行	26,000	303.00	7,878,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	609,200	395.00	240,634,000	
ジェイリース	2,900	765.00	2,218,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	71,000	721.00	51,191,000	
マーキュリアインベストメント	4,300	657.00	2,825,100	
イントラスト	3,900	890.00	3,471,000	
日本モーゲージサービス	4,300	1,120.00	4,816,000	
C A S A	3,800	1,311.00	4,981,800	
アルヒ	17,000	2,150.00	36,550,000	
プレミアグループ	5,800	2,120.00	12,296,000	
日産自動車	1,276,600	421.20	537,703,920	
いすゞ自動車	313,600	995.00	312,032,000	
トヨタ自動車	1,208,000	7,503.00	9,063,624,000	代用有価証券 250,000株
日野自動車	135,000	938.00	126,630,000	
三菱自動車工業	399,700	200.00	79,940,000	
エフテック	7,600	595.00	4,522,000	
レシップホールディングス	4,500	569.00	2,560,500	
G M B	1,700	620.00	1,054,000	
ファルテック	1,700	647.00	1,099,900	
武蔵精密工業	24,100	1,432.00	34,511,200	
日産車体	21,100	994.00	20,973,400	
新明和工業	29,200	852.00	24,878,400	
極東開発工業	20,100	1,447.00	29,084,700	
トピー工業	8,900	1,209.00	10,760,100	
ティラド	4,100	1,399.00	5,735,900	
曙ブレーキ工業	59,500	150.00	8,925,000	
タチエス	17,800	1,163.00	20,701,400	
N O K	58,100	1,352.00	78,551,200	

フタバ産業	30,100	524.00	15,772,400
K Y B	12,200	2,547.00	31,073,400
市光工業	16,300	479.00	7,807,700
大同メタル工業	21,100	567.00	11,963,700
プレス工業	53,700	306.00	16,432,200
ミクニ	14,600	290.00	4,234,000
太平洋工業	22,700	1,100.00	24,970,000
河西工業	14,800	390.00	5,772,000
アイシン精機	89,100	3,320.00	295,812,000
マツダ	318,300	645.00	205,303,500
今仙電機製作所	10,500	839.00	8,809,500
本田技研工業	852,300	2,994.50	2,552,212,350
スズキ	214,600	5,135.00	1,101,971,000
S U B A R U	336,100	2,220.50	746,310,050
安永	5,200	1,173.00	6,099,600
ヤマハ発動機	152,800	1,925.00	294,140,000
小糸製作所	64,900	5,800.00	376,420,000
T B K	11,700	470.00	5,499,000
エクセディ	14,600	1,346.00	19,651,600
ミツバ	20,000	484.00	9,680,000
豊田合成	35,000	2,880.00	100,800,000
愛三工業	17,200	500.00	8,600,000
盟和産業	1,600	910.00	1,456,000
日本プラスト	8,800	473.00	4,162,400
ヨロズ	10,200	1,249.00	12,739,800
エフ・シー・シー	17,700	2,113.00	37,400,100
新家工業	2,700	1,178.00	3,180,600
シマノ	40,500	22,585.00	914,692,500
テイ・エス テック	25,100	3,100.00	77,810,000
関西みらいフィナンシャルグループ	62,600	550.00	34,430,000
三十三フィナンシャルグループ	10,000	1,428.00	14,280,000
第四北越フィナンシャルグループ	18,600	2,153.00	40,045,800
ひろぎんホールディングス	157,600	606.00	95,505,600
ジャムコ	5,400	668.00	3,607,200
小野建	10,000	1,290.00	12,900,000
はるやまホールディングス	4,300	712.00	3,061,600
南陽	2,100	1,775.00	3,727,500
ノジマ	19,000	3,035.00	57,665,000
佐鳥電機	7,500	850.00	6,375,000
カッパ・クリエイト	14,900	1,535.00	22,871,500
エコートレーディング	2,700	628.00	1,695,600
伯東	6,500	1,173.00	7,624,500
コンドーテック	8,300	1,100.00	9,130,000
中山福	5,200	514.00	2,672,800
ライトオン	8,000	678.00	5,424,000
ナガイレーベン	14,100	2,805.00	39,550,500
ジーンズメイト	3,900	313.00	1,220,700
三菱食品	11,800	2,905.00	34,279,000
良品計画	141,600	2,324.00	329,078,400
三城ホールディングス	10,300	278.00	2,863,400

松田産業	7,800	1,589.00	12,394,200
第一興商	15,800	3,750.00	59,250,000
メディパルホールディングス	115,100	1,938.00	223,063,800
アドヴァン	16,300	1,434.00	23,374,200
S P K	4,200	1,319.00	5,539,800
萩原電気ホールディングス	4,100	2,482.00	10,176,200
アルピス	4,100	2,718.00	11,143,800
アズワン	6,900	14,920.00	102,948,000
スズデン	3,400	1,238.00	4,209,200
尾家産業	2,900	1,411.00	4,091,900
シモジマ	6,500	1,429.00	9,288,500
ドウシシャ	10,100	1,882.00	19,008,200
小津産業	2,300	1,889.00	4,344,700
コナカ	12,900	250.00	3,225,000
高速	6,400	1,592.00	10,188,800
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,680.00	2,016,000
G - 7ホールディングス	6,300	2,228.00	14,036,400
たけびし	3,400	1,515.00	5,151,000
イオン北海道	14,100	900.00	12,690,000
コジマ	18,400	687.00	12,640,800
ヒマラヤ	4,100	943.00	3,866,300
コーナン商事	15,100	3,425.00	51,717,500
ネットワンシステムズ	40,500	3,540.00	143,370,000
エコス	4,100	2,349.00	9,630,900
ワタミ	12,500	1,055.00	13,187,500
マルシェ	2,900	576.00	1,670,400
リックス	2,200	1,650.00	3,630,000
システムソフト	24,300	96.00	2,332,800
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	234,400	2,487.00	582,952,800
丸文	9,700	489.00	4,743,300
西松屋チェーン	23,400	1,650.00	38,610,000
ゼンショーホールディングス	51,100	2,646.00	135,210,600
ハビネット	8,900	1,530.00	13,617,000
幸楽苑ホールディングス	6,700	1,886.00	12,636,200
ハークスレイ	2,000	925.00	1,850,000
橋本総業ホールディングス	2,000	2,400.00	4,800,000
日本ライフライン	31,600	1,409.00	44,524,400
サイゼリヤ	15,800	1,940.00	30,652,000
タカショー	7,000	708.00	4,956,000
V Tホールディングス	44,400	384.00	17,049,600
マルカ	3,600	2,280.00	8,208,000
アルゴグラフィックス	9,000	3,305.00	29,745,000
魚力	3,000	1,721.00	5,163,000
I D O M	28,700	574.00	16,473,800
日本エム・ディ・エム	6,200	2,265.00	14,043,000
ポブラ	3,200	429.00	1,372,800
フジ・コーポレーション	2,900	2,284.00	6,623,600
ユナイテッドアローズ	11,100	1,575.00	17,482,500
進和	6,400	2,057.00	13,164,800

エスケイジャパン	2,600	524.00	1,362,400
ダイトロン	4,500	1,435.00	6,457,500
ハイデイ日高	15,300	1,796.00	27,478,800
シークス	13,500	1,482.00	20,007,000
京都きもの友禅	6,400	234.00	1,497,600
コロワイド	35,500	1,727.00	61,308,500
ピーシーデポコーポレーション	14,000	669.00	9,366,000
田中商事	3,000	724.00	2,172,000
オーハシテクニカ	5,500	1,452.00	7,986,000
壱番屋	7,500	5,540.00	41,550,000
白銅	3,500	1,350.00	4,725,000
トップカルチャー	4,100	365.00	1,496,500
P L A N T	2,700	809.00	2,184,300
スギホールディングス	21,200	7,020.00	148,824,000
ダイコー通産	600	1,397.00	838,200
薬王堂ホールディングス	4,600	2,524.00	11,610,400
島津製作所	129,400	3,545.00	458,723,000
J M S	9,300	840.00	7,812,000
クボテック	2,700	323.00	872,100
長野計器	7,900	817.00	6,454,300
ブイ・テクノロジー	5,100	5,480.00	27,948,000
スター精密	16,700	1,500.00	25,050,000
東京計器	7,000	916.00	6,412,000
愛知時計電機	1,200	4,485.00	5,382,000
インターアクション	5,800	1,811.00	10,503,800
オーバル	11,300	238.00	2,689,400
東京精密	19,600	3,850.00	75,460,000
マニー	43,200	2,888.00	124,761,600
ニコン	165,200	739.00	122,082,800
トプコン	54,400	1,292.00	70,284,800
オリンパス	599,000	2,284.00	1,368,116,000
理研計器	9,700	3,000.00	29,100,000
S C R E E Nホールディングス	18,800	6,030.00	113,364,000
キヤノン電子	10,000	1,488.00	14,880,000
タムロン	8,700	1,681.00	14,624,700
H O Y A	214,800	12,490.00	2,682,852,000
シード	4,800	645.00	3,096,000
ノーリツ鋼機	7,300	1,956.00	14,278,800
エー・アンド・デイ	10,000	815.00	8,150,000
朝日インテック	122,700	3,405.00	417,793,500
キヤノン	537,800	1,906.00	1,025,046,800
リコー	275,400	701.00	193,055,400
シチズン時計	126,600	307.00	38,866,200
リズム	3,000	654.00	1,962,000
大研医器	7,800	544.00	4,243,200
メニコン	15,300	7,610.00	116,433,000
シンシア	1,200	399.00	478,800
中本パックス	2,600	1,565.00	4,069,000
スノーピーク	6,400	1,851.00	11,846,400
パラマウントベッドホールディングス	11,500	4,535.00	52,152,500

トランザクション	5,900	955.00	5,634,500
粧美堂	2,900	370.00	1,073,000
ニホンフラッシュ	10,100	1,335.00	13,483,500
前田工織	12,000	2,895.00	34,740,000
永大産業	14,500	308.00	4,466,000
アートネイチャー	11,700	678.00	7,932,600
パンダイナムコホールディングス	111,900	8,427.00	942,981,300
アイフィスジャパン	2,900	757.00	2,195,300
共立印刷	16,000	131.00	2,096,000
SHOEI	9,500	3,150.00	29,925,000
フランスベッドホールディングス	15,600	903.00	14,086,800
マーベラス	16,300	739.00	12,045,700
パイロットコーポレーション	19,200	3,220.00	61,824,000
萩原工業	6,000	1,612.00	9,672,000
エイベックス	18,200	1,036.00	18,855,200
トップパン・フォームズ	23,200	1,006.00	23,339,200
フジシールインターナショナル	24,300	2,062.00	50,106,600
タカラトミー	48,500	999.00	48,451,500
廣済堂	7,600	662.00	5,031,200
エステールホールディングス	3,900	617.00	2,406,300
レック	11,600	1,482.00	17,191,200
タカノ	4,400	617.00	2,714,800
三光合成	12,800	306.00	3,916,800
プロネクサス	9,500	1,164.00	11,058,000
ホクシン	6,400	118.00	755,200
ウッドワン	3,300	1,199.00	3,956,700
大建工業	7,400	2,066.00	15,288,400
きもと	18,900	183.00	3,458,700
凸版印刷	152,800	1,437.00	219,573,600
大日本印刷	141,800	2,094.00	296,929,200
共同印刷	2,900	2,840.00	8,236,000
NISSHA	22,200	1,287.00	28,571,400
光村印刷	800	1,659.00	1,327,200
藤森工業	9,800	4,500.00	44,100,000
ヴィア・ホールディングス	12,900	283.00	3,650,700
TAKARA & COMPANY	5,200	2,013.00	10,467,600
前澤化成工業	7,000	999.00	6,993,000
未来工業	5,900	1,980.00	11,682,000
アシックス	95,700	1,775.00	169,867,500
ツツミ	3,500	2,350.00	8,225,000
ウェーブロックホールディングス	3,900	732.00	2,854,800
JSP	6,400	1,534.00	9,817,600
ニチハ	15,000	3,185.00	47,775,000
エフピコ	22,800	4,275.00	97,470,000
小松ウオール工業	3,500	1,781.00	6,233,500
ヤマハ	64,400	5,680.00	365,792,000
河合楽器製作所	3,400	2,894.00	9,839,600
クリナップ	10,400	471.00	4,898,400
ビジョン	69,400	4,635.00	321,669,000
天馬	7,200	1,918.00	13,809,600

オリバー	2,100	2,480.00	5,208,000
兼松サステック	600	1,614.00	968,400
キングジム	9,100	919.00	8,362,900
象印マホービン	29,300	2,004.00	58,717,200
リンテック	25,800	2,327.00	60,036,600
信越ポリマー	19,400	957.00	18,565,800
東リ	27,800	276.00	7,672,800
イトーキ	21,500	348.00	7,482,000
任天堂	66,400	51,680.00	3,431,552,000
三菱鉛筆	17,900	1,528.00	27,351,200
松風	5,000	1,639.00	8,195,000
タカラスタンダード	22,500	1,500.00	33,750,000
コクヨ	51,900	1,452.00	75,358,800
ナカバヤシ	11,100	629.00	6,981,900
ニフコ	39,700	3,515.00	139,545,500
立川ブラインド工業	4,800	1,344.00	6,451,200
グロープライド	4,800	3,800.00	18,240,000
オカムラ	37,800	882.00	33,339,600
バルカー	8,800	1,891.00	16,640,800
MUTOHホールディングス	1,200	1,499.00	1,798,800
伊藤忠商事	745,700	2,725.00	2,032,032,500
丸紅	1,109,800	630.80	700,061,840
スクロール	16,400	721.00	11,824,400
高島	1,600	1,864.00	2,982,400
ヨンドシーホールディングス	10,900	1,979.00	21,571,100
三陽商会	5,400	544.00	2,937,600
長瀬産業	60,100	1,446.00	86,904,600
ナイガイ	3,700	368.00	1,361,600
蝶理	6,800	1,736.00	11,804,800
豊田通商	118,900	3,435.00	408,421,500
オンワードホールディングス	63,100	220.00	13,882,000
三共生興	16,500	458.00	7,557,000
兼松	39,700	1,293.00	51,332,100
美津濃	10,000	1,905.00	19,050,000
ツカモトコーポレーション	1,700	1,266.00	2,152,200
ルックホールディングス	3,800	1,056.00	4,012,800
三井物産	923,200	1,829.00	1,688,532,800
日本紙パルプ商事	6,100	3,880.00	23,668,000
東京エレクトロン	68,700	29,840.00	2,050,008,000
カメイ	13,900	1,193.00	16,582,700
東都水産	1,100	4,545.00	4,999,500
OUGホールディングス	1,800	2,905.00	5,229,000
スターゼン	4,100	4,370.00	17,917,000
セイコーホールディングス	15,200	1,507.00	22,906,400
山善	41,700	1,091.00	45,494,700
椿本興業	1,700	3,780.00	6,426,000
住友商事	672,600	1,321.50	888,840,900
日本ユニシス	33,200	3,580.00	118,856,000
内田洋行	4,100	5,400.00	22,140,000
三菱商事	699,100	2,547.50	1,780,957,250

第一実業	5,200	4,005.00	20,826,000
キヤノンマーケティングジャパン	26,400	2,274.00	60,033,600
西華産業	6,200	1,283.00	7,954,600
佐藤商事	8,900	1,045.00	9,300,500
菱洋エレクトロ	10,900	2,999.00	32,689,100
東京産業	10,000	563.00	5,630,000
ユアサ商事	10,200	3,135.00	31,977,000
神鋼商事	2,800	1,913.00	5,356,400
トルク	5,800	302.00	1,751,600
阪和興業	19,900	2,399.00	47,740,100
正栄食品工業	6,900	3,885.00	26,806,500
カナデン	8,700	1,298.00	11,292,600
菱電商事	7,700	1,586.00	12,212,200
ニプロ	75,200	1,182.00	88,886,400
フルサト工業	6,100	1,382.00	8,430,200
岩谷産業	24,100	5,040.00	121,464,000
ナイス	4,600	1,507.00	6,932,200
昭光通商	3,300	610.00	2,013,000
ニチモウ	1,600	1,905.00	3,048,000
極東貿易	2,900	1,475.00	4,277,500
イワキ	14,100	545.00	7,684,500
兼松エレクトロニクス	5,800	4,355.00	25,259,000
三愛石油	26,200	1,231.00	32,252,200
稲畑産業	23,600	1,370.00	32,332,000
G S Iクレオス	2,600	1,762.00	4,581,200
明和産業	10,000	422.00	4,220,000
クワザワホールディングス	3,500	588.00	2,058,000
キムラタン	52,300	26.00	1,359,800
ヤマエ久野	7,800	1,268.00	9,890,400
ゴールドウイン	19,300	7,210.00	139,153,000
ユニ・チャーム	229,500	5,253.00	1,205,563,500
デサント	20,600	1,887.00	38,872,200
キング	4,500	589.00	2,650,500
ワキタ	22,800	1,141.00	26,014,800
ヤマトインターナショナル	9,500	341.00	3,239,500
東邦ホールディングス	34,300	2,074.00	71,138,200
サンゲツ	28,800	1,619.00	46,627,200
ミツウロコグループホールディングス	15,800	1,302.00	20,571,600
シナネンホールディングス	4,400	3,145.00	13,838,000
伊藤忠エネクス	23,700	987.00	23,391,900
サンリオ	29,900	1,954.00	58,424,600
サンワテクノス	7,600	960.00	7,296,000
リョーサン	11,900	2,013.00	23,954,700
新光商事	16,200	901.00	14,596,200
トーヨー	4,900	1,991.00	9,755,900
三信電気	5,800	2,174.00	12,609,200
東陽テクニカ	11,400	1,121.00	12,779,400
モスフードサービス	14,000	2,923.00	40,922,000
加賀電子	10,700	2,083.00	22,288,100
三益半導体工業	8,400	2,536.00	21,302,400

都築電気	3,500	1,565.00	5,477,500
ソーダニッカ	11,200	583.00	6,529,600
立花エレテック	8,000	1,811.00	14,488,000
木曽路	13,800	2,570.00	35,466,000
S R Sホールディングス	12,500	945.00	11,812,500
千趣会	19,300	327.00	6,311,100
タカキュー	9,600	145.00	1,392,000
リテールパートナーズ	14,100	1,422.00	20,050,200
ケーヨー	21,900	760.00	16,644,000
上新電機	12,500	2,644.00	33,050,000
日本瓦斯	16,900	4,940.00	83,486,000
ロイヤルホールディングス	18,600	2,035.00	37,851,000
東天紅	600	966.00	579,600
いなげや	13,200	1,900.00	25,080,000
島忠	20,100	5,490.00	110,349,000
チヨダ	11,400	987.00	11,251,800
ライフコーポレーション	8,100	3,550.00	28,755,000
リンガーハット	13,100	2,316.00	30,339,600
MrMaxHD	14,600	825.00	12,045,000
テナアライド	10,300	376.00	3,872,800
AOKIホールディングス	21,000	465.00	9,765,000
オークワ	16,800	1,438.00	24,158,400
コメリ	16,500	2,856.00	47,124,000
青山商事	21,700	549.00	11,913,300
しまむら	12,300	11,230.00	138,129,000
はせがわ	5,200	306.00	1,591,200
高島屋	77,500	909.00	70,447,500
松屋	21,400	769.00	16,456,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	50,400	710.00	35,784,000
近鉄百貨店	4,100	3,540.00	14,514,000
丸井グループ	97,700	2,164.00	211,422,800
クレディセゾン	74,700	1,320.00	98,604,000
アクシアル リテイリング	8,800	4,715.00	41,492,000
井筒屋	5,500	184.00	1,012,000
イオン	410,300	2,957.50	1,213,462,250
イズミ	21,500	3,735.00	80,302,500
フォーバル	4,800	999.00	4,795,200
平和堂	21,500	2,153.00	46,289,500
フジ	12,800	2,008.00	25,702,400
ヤオコー	12,200	7,200.00	87,840,000
ゼビオホールディングス	12,900	799.00	10,307,100
ケーズホールディングス	102,800	1,313.00	134,976,400
PALTAC	17,100	5,820.00	99,522,000
三谷産業	14,300	439.00	6,277,700
Olympicグループ	5,500	947.00	5,208,500
日産東京販売ホールディングス	14,300	255.00	3,646,500
新生銀行	78,300	1,435.00	112,360,500
あおぞら銀行	63,400	1,845.00	116,973,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,303,900	459.00	3,352,490,100
りそなホールディングス	1,160,700	385.50	447,449,850

三井住友トラスト・ホールディングス	201,800	3,164.00	638,495,200
三井住友フィナンシャルグループ	738,300	3,165.00	2,336,719,500
千葉銀行	355,900	609.00	216,743,100
群馬銀行	204,700	353.00	72,259,100
武蔵野銀行	15,800	1,597.00	25,232,600
千葉興業銀行	29,300	265.00	7,764,500
筑波銀行	44,400	196.00	8,702,400
七十七銀行	36,100	1,623.00	58,590,300
青森銀行	8,300	2,507.00	20,808,100
秋田銀行	6,800	1,561.00	10,614,800
山形銀行	12,200	1,346.00	16,421,200
岩手銀行	7,000	2,446.00	17,122,000
東邦銀行	96,000	244.00	23,424,000
東北銀行	5,300	1,110.00	5,883,000
みちのく銀行	6,900	1,221.00	8,424,900
ふくおかフィナンシャルグループ	89,900	1,931.00	173,596,900
静岡銀行	259,800	766.00	199,006,800
十六銀行	13,400	2,097.00	28,099,800
スルガ銀行	108,700	369.00	40,110,300
八十二銀行	257,400	402.00	103,474,800
山梨中央銀行	12,300	893.00	10,983,900
大垣共立銀行	21,000	2,538.00	53,298,000
福井銀行	9,100	1,966.00	17,890,600
北國銀行	10,700	3,035.00	32,474,500
清水銀行	4,400	1,879.00	8,267,600
富山銀行	1,900	3,195.00	6,070,500
滋賀銀行	21,400	2,441.00	52,237,400
南都銀行	17,900	1,958.00	35,048,200
百五銀行	96,400	337.00	32,486,800
京都銀行	38,100	5,180.00	197,358,000
紀陽銀行	37,900	1,701.00	64,467,900
ほくほくフィナンシャルグループ	71,000	1,055.00	74,905,000
山陰合同銀行	63,300	563.00	35,637,900
中国銀行	92,000	995.00	91,540,000
鳥取銀行	4,000	1,200.00	4,800,000
伊予銀行	152,300	706.00	107,523,800
百十四銀行	11,400	1,713.00	19,528,200
四国銀行	16,300	773.00	12,599,900
阿波銀行	17,500	2,751.00	48,142,500
大分銀行	6,200	2,560.00	15,872,000
宮崎銀行	7,100	2,435.00	17,288,500
佐賀銀行	6,400	1,420.00	9,088,000
沖縄銀行	9,900	3,160.00	31,284,000
琉球銀行	24,500	927.00	22,711,500
セブン銀行	356,400	247.00	88,030,800
みずほフィナンシャルグループ	1,450,700	1,444.50	2,095,536,150
高知銀行	4,100	790.00	3,239,000
山口フィナンシャルグループ	133,300	748.00	99,708,400
芙蓉総合リース	11,200	6,480.00	72,576,000
みずほリース	16,500	2,760.00	45,540,000

東京センチュリー	21,500	6,400.00	137,600,000
SBIホールディングス	120,700	2,757.00	332,769,900
日本証券金融	47,100	523.00	24,633,300
アイフル	162,400	321.00	52,130,400
日本アジア投資	9,000	226.00	2,034,000
長野銀行	3,800	1,494.00	5,677,200
名古屋銀行	7,900	2,832.00	22,372,800
北洋銀行	160,700	240.00	38,568,000
愛知銀行	4,000	3,190.00	12,760,000
中京銀行	4,500	2,258.00	10,161,000
大光銀行	3,400	1,398.00	4,753,200
愛媛銀行	15,000	1,152.00	17,280,000
トマト銀行	4,400	1,114.00	4,901,600
京葉銀行	45,700	493.00	22,530,100
栃木銀行	51,200	190.00	9,728,000
北日本銀行	3,400	2,082.00	7,078,800
東和銀行	18,900	720.00	13,608,000
福島銀行	10,100	238.00	2,403,800
大東銀行	5,700	636.00	3,625,200
リコーリース	8,400	3,030.00	25,452,000
イオンフィナンシャルサービス	65,300	1,190.00	77,707,000
アコム	214,800	509.00	109,333,200
ジャックス	11,900	1,884.00	22,419,600
オリエントコーポレーション	288,200	118.00	34,007,600
日立キャピタル	25,100	2,468.00	61,946,800
オリックス	662,200	1,575.00	1,042,965,000
三菱UFJリース	270,700	495.00	133,996,500
ジャフコグループ	16,400	4,845.00	79,458,000
九州リースサービス	6,000	631.00	3,786,000
トモニホールディングス	82,700	344.00	28,448,800
大和証券グループ本社	857,000	456.60	391,306,200
野村ホールディングス	1,879,000	535.70	1,006,580,300
岡三証券グループ	90,600	362.00	32,797,200
丸三証券	31,600	487.00	15,389,200
東洋証券	37,900	128.00	4,851,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	122,000	297.00	36,234,000
光世証券	2,300	709.00	1,630,700
水戸証券	30,900	228.00	7,045,200
いちよし証券	19,700	442.00	8,707,400
松井証券	61,000	903.00	55,083,000
SOMPOホールディングス	200,800	4,177.00	838,741,600
日本取引所グループ	306,400	2,471.50	757,267,600
マネックスグループ	78,500	277.00	21,744,500
極東証券	14,200	726.00	10,309,200
岩井コスモホールディングス	10,100	1,283.00	12,958,300
藍澤証券	19,300	703.00	13,567,900
フィデアホールディングス	103,800	113.00	11,729,400
池田泉州ホールディングス	122,200	165.00	20,163,000
アニコムホールディングス	35,500	1,173.00	41,641,500

MS & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	279,300	3,223.00	900,183,900	
マネーパートナーズグループ	12,200	209.00	2,549,800	
スパークス・グループ	49,600	245.00	12,152,000	
小林洋行	2,900	269.00	780,100	
第一生命ホールディングス	604,200	1,778.50	1,074,569,700	
東京海上ホールディングス	377,500	5,520.00	2,083,800,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,200	696.00	3,619,200	
イー・ギャランティ	12,200	2,115.00	25,803,000	
アサックス	5,800	763.00	4,425,400	
NECキャピタルソリューション	4,400	1,892.00	8,324,800	
T & Dホールディングス	319,000	1,184.00	377,696,000	
アドバンスクリエイト	2,300	2,063.00	4,744,900	
三井不動産	519,000	2,167.50	1,124,932,500	
三菱地所	748,100	1,863.00	1,393,710,300	
平和不動産	19,600	3,310.00	64,876,000	
東京建物	105,400	1,380.00	145,452,000	
ダイビル	27,500	1,326.00	36,465,000	
京阪神ビルディング	17,200	2,200.00	37,840,000	
住友不動産	240,000	3,464.00	831,360,000	
太平洋興発	4,000	646.00	2,584,000	
テオーシー	21,000	689.00	14,469,000	
東京楽天地	1,600	4,495.00	7,192,000	
レオパレス21	140,000	173.00	24,220,000	
スターツコーポレーション	14,500	2,700.00	39,150,000	
フジ住宅	12,600	615.00	7,749,000	
空港施設	11,100	501.00	5,561,100	
明和地所	6,000	554.00	3,324,000	
ゴールドクレスト	8,400	1,461.00	12,272,400	
リログループ	56,600	2,718.00	153,838,800	
エスリード	4,100	1,378.00	5,649,800	
日神グループホールディングス	16,200	415.00	6,723,000	
日本エスコン	19,300	897.00	17,312,100	
タカラレーベン	48,700	301.00	14,658,700	
A V A N T I A	6,000	912.00	5,472,000	
イオンモール	53,500	1,807.00	96,674,500	
毎日コムネット	2,500	749.00	1,872,500	
ファースト住建	4,600	1,027.00	4,724,200	
ランド	528,900	9.00	4,760,100	
カチタス	26,400	3,155.00	83,292,000	
東祥	6,400	1,402.00	8,972,800	
トーセイ	14,500	1,157.00	16,776,500	
穴吹興産	2,200	1,713.00	3,768,600	
サンフロンティア不動産	14,600	994.00	14,512,400	
エフ・ジェー・ネクスト	9,400	1,011.00	9,503,400	
インテリックス	2,800	554.00	1,551,200	
ランドビジネス	3,600	386.00	1,389,600	
サンネクスタグループ	3,500	997.00	3,489,500	
グランディハウス	8,300	380.00	3,154,000	
東武鉄道	112,800	3,515.00	396,492,000	

相鉄ホールディングス	34,700	2,848.00	98,825,600
東急	272,900	1,423.00	388,336,700
京浜急行電鉄	139,000	1,777.00	247,003,000
小田急電鉄	161,000	3,050.00	491,050,000
京王電鉄	56,200	7,460.00	419,252,000
京成電鉄	75,300	3,725.00	280,492,500
富士急行	14,700	5,250.00	77,175,000
新京成電鉄	2,900	2,382.00	6,907,800
東日本旅客鉄道	190,600	6,489.00	1,236,803,400
西日本旅客鉄道	96,400	5,238.00	504,943,200
東海旅客鉄道	90,100	14,985.00	1,350,148,500
西武ホールディングス	141,300	1,265.00	178,744,500
鴻池運輸	17,400	1,161.00	20,201,400
西日本鉄道	30,000	3,210.00	96,300,000
ハマキョウレックス	8,300	3,185.00	26,435,500
サカイ引越センター	5,700	5,200.00	29,640,000
近鉄グループホールディングス	102,500	4,955.00	507,887,500
阪急阪神ホールディングス	136,700	3,710.00	507,157,000
南海電気鉄道	48,600	2,719.00	132,143,400
京阪ホールディングス	45,600	4,570.00	208,392,000
神戸電鉄	2,500	3,785.00	9,462,500
名古屋鉄道	84,500	3,050.00	257,725,000
山陽電気鉄道	7,400	2,218.00	16,413,200
トランコム	2,900	7,950.00	23,055,000
日本通運	35,600	7,100.00	252,760,000
ヤマトホールディングス	179,700	2,557.00	459,492,900
山九	28,500	4,135.00	117,847,500
日新	8,800	1,510.00	13,288,000
丸運	7,000	258.00	1,806,000
丸全昭和運輸	8,300	3,330.00	27,639,000
センコーグループホールディングス	56,600	1,000.00	56,600,000
トナミホールディングス	2,300	6,440.00	14,812,000
ニッコンホールディングス	36,700	2,137.00	78,427,900
日本石油輸送	900	2,632.00	2,368,800
福山通運	13,100	5,000.00	65,500,000
セイノーホールディングス	76,700	1,437.00	110,217,900
エスライン	2,900	1,008.00	2,923,200
神奈川中央交通	2,600	4,035.00	10,491,000
日立物流	18,900	3,505.00	66,244,500
丸和運輸機関	10,900	4,320.00	47,088,000
C & F ロジホールディングス	10,400	1,977.00	20,560,800
日本郵船	85,700	2,097.00	179,712,900
商船三井	64,800	2,590.00	167,832,000
川崎汽船	31,500	1,508.00	47,502,000
NSユニテッド海運	5,700	1,445.00	8,236,500
明治海運	10,100	442.00	4,464,200
飯野海運	49,000	391.00	19,159,000
共栄タンカー	1,800	800.00	1,440,000
九州旅客鉄道	89,800	2,422.00	217,495,600
S Gホールディングス	215,300	2,568.00	552,890,400

日本航空	181,200	1,947.00	352,796,400	
A N Aホールディングス	187,300	2,630.00	492,599,000	
パスコ	2,000	1,305.00	2,610,000	
西本W i s m e t t a cホールディングス	2,500	1,961.00	4,902,500	
シルバーライフ	1,500	2,055.00	3,082,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	800	1,425.00	1,140,000	
一家ダイニングプロジェクト	1,100	563.00	619,300	
Genky Drug Stores	4,700	4,335.00	20,374,500	
コア商事ホールディングス	2,000	1,341.00	2,682,000	
国際紙パルプ商事	25,600	268.00	6,860,800	
ナルミヤ・インターナショナル	2,400	845.00	2,028,000	
ブックオフグループホールディングス	6,300	928.00	5,846,400	
三菱倉庫	32,500	3,190.00	103,675,000	
三井倉庫ホールディングス	11,800	2,063.00	24,343,400	
住友倉庫	36,900	1,415.00	52,213,500	
澁澤倉庫	5,600	2,329.00	13,042,400	
ヤマタネ	5,400	1,434.00	7,743,600	
東陽倉庫	16,700	355.00	5,928,500	
乾汽船	6,000	936.00	5,616,000	
日本トランスシティ	22,900	596.00	13,648,400	
ケイヒン	1,700	1,393.00	2,368,100	
中央倉庫	6,400	1,212.00	7,756,800	
川西倉庫	2,100	1,114.00	2,339,400	
安田倉庫	8,700	990.00	8,613,000	
ファイズホールディングス	2,200	1,082.00	2,380,400	
東洋埠頭	2,900	1,460.00	4,234,000	
宇徳	7,700	513.00	3,950,100	
上組	57,100	1,976.00	112,829,600	
サンリツ	2,300	663.00	1,524,900	
キムラユニティー	3,200	1,058.00	3,385,600	
キューソー流通システム	2,700	1,790.00	4,833,000	
近鉄エクスプレス	21,800	2,459.00	53,606,200	
東海運	6,800	312.00	2,121,600	
エーアイテイー	7,300	1,054.00	7,694,200	
内外トランスライン	3,700	1,270.00	4,699,000	
ショーエイコーポレーション	1,700	1,163.00	1,977,100	
日本コンセプト	3,400	1,619.00	5,504,600	
T B Sホールディングス	64,600	1,822.00	117,701,200	
日本テレビホールディングス	88,500	1,218.00	107,793,000	
朝日放送グループホールディングス	10,800	717.00	7,743,600	
テレビ朝日ホールディングス	29,200	1,765.00	51,538,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	69,700	486.00	33,874,200	
テレビ東京ホールディングス	8,700	2,491.00	21,671,700	
日本B S放送	3,800	1,080.00	4,104,000	
ビジョン	13,100	1,096.00	14,357,600	
スマートバリュー	2,800	1,199.00	3,357,200	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	4,100	1,277.00	5,235,700	
ワイヤレスゲート	4,600	648.00	2,980,800	

コネクシオ	6,000	1,213.00	7,278,000
日本通信	82,500	210.00	17,325,000
クロップス	2,000	828.00	1,656,000
日本電信電話	1,420,000	2,468.50	3,505,270,000
KDDI	774,400	3,092.00	2,394,444,800
ソフトバンク	965,500	1,250.00	1,206,875,000
光通信	11,000	26,020.00	286,220,000
NTTドコモ	759,700	3,883.00	2,949,915,100
エムティーアイ	10,400	855.00	8,892,000
GMOインターネット	38,000	2,877.00	109,326,000
ファイバーゲート	3,500	1,979.00	6,926,500
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	412.00	1,194,800
KADOKAWA	28,600	3,210.00	91,806,000
学研ホールディングス	14,200	1,487.00	21,115,400
ゼンリン	21,100	1,312.00	27,683,200
昭文社ホールディングス	4,300	500.00	2,150,000
インプレスホールディングス	9,000	177.00	1,593,000
東京電力ホールディングス	863,700	303.00	261,701,100
中部電力	331,300	1,291.50	427,873,950
関西電力	410,200	1,021.50	419,019,300
中国電力	156,100	1,415.00	220,881,500
北陸電力	99,000	810.00	80,190,000
東北電力	270,500	966.00	261,303,000
四国電力	97,400	810.00	78,894,000
九州電力	223,200	928.00	207,129,600
北海道電力	101,100	428.00	43,270,800
沖縄電力	21,000	1,614.00	33,894,000
電源開発	85,900	1,543.00	132,543,700
エフオン	5,800	922.00	5,347,600
イーレックス	15,500	1,348.00	20,894,000
レノバ	18,100	1,941.00	35,132,100
東京瓦斯	208,200	2,579.00	536,947,800
大阪瓦斯	210,000	2,167.00	455,070,000
東邦瓦斯	53,200	6,080.00	323,456,000
北海道瓦斯	6,000	1,577.00	9,462,000
広島ガス	23,100	387.00	8,939,700
西部瓦斯	12,200	2,999.00	36,587,800
静岡ガス	30,700	1,012.00	31,068,400
メタウォーター	10,500	2,424.00	25,452,000
アイネット	5,400	1,538.00	8,305,200
松竹	7,000	13,940.00	97,580,000
東宝	62,600	4,575.00	286,395,000
エイチ・アイ・エス	16,100	1,684.00	27,112,400
東映	4,100	17,860.00	73,226,000
ラックランド	2,900	2,336.00	6,774,400
エヌ・ティ・ティ・データ	282,900	1,393.00	394,079,700
共立メンテナンス	17,100	4,055.00	69,340,500
イチネンホールディングス	11,700	1,326.00	15,514,200
建設技術研究所	6,600	2,255.00	14,883,000

スペース	6,900	834.00	5,754,600	
長 大	4,100	1,309.00	5,366,900	
アインホールディングス	13,100	8,040.00	105,324,000	
燦ホールディングス	4,600	1,311.00	6,030,600	
ピー・シー・エー	1,800	4,795.00	8,631,000	
スバル興業	500	8,020.00	4,010,000	
東京テアトル	4,300	1,300.00	5,590,000	
タナベ経営	2,200	1,403.00	3,086,600	
ビジネスブレイン太田昭和	3,800	1,478.00	5,616,400	
ナガワ	3,400	8,800.00	29,920,000	
よみうりランド	2,300	6,120.00	14,076,000	
東京都競馬	6,700	4,910.00	32,897,000	
常盤興産	4,200	1,528.00	6,417,600	
カナモト	18,200	2,266.00	41,241,200	
東京ドーム	41,900	971.00	40,684,900	
D T S	23,700	2,332.00	55,268,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	45,200	5,270.00	238,204,000	
シーイーシー	11,400	1,543.00	17,590,200	
カブコン	50,100	4,950.00	247,995,000	
西尾レントオール	9,600	2,203.00	21,148,800	
アイ・エス・ピー	2,400	2,648.00	6,355,200	
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	62,700	26.00	1,630,200	
日本空港ビルデング	34,100	5,690.00	194,029,000	
トランス・コスモス	9,900	2,880.00	28,512,000	
乃村工藝社	44,300	802.00	35,528,600	
ジャステック	6,700	1,488.00	9,969,600	
S C S K	24,500	6,020.00	147,490,000	
藤田観光	4,100	1,571.00	6,441,100	
K N T - C Tホールディングス	6,400	975.00	6,240,000	
日本管財	11,200	2,132.00	23,878,400	
トーカイ	10,000	2,050.00	20,500,000	
白洋舎	1,000	2,462.00	2,462,000	
セコム	109,800	9,716.00	1,066,816,800	
日本システムウエア	3,600	2,148.00	7,732,800	
セントラル警備保障	5,000	3,475.00	17,375,000	
アイネス	10,500	1,472.00	15,456,000	
丹青社	19,400	803.00	15,578,200	
メイテック	12,600	4,990.00	62,874,000	
T K C	8,900	6,730.00	59,897,000	
富士ソフト	11,300	6,090.00	68,817,000	
応用地質	12,200	1,279.00	15,603,800	
船井総研ホールディングス	21,300	2,531.00	53,910,300	
N S D	34,200	1,996.00	68,263,200	
進学会ホールディングス	3,900	431.00	1,680,900	
丸紅建材リース	900	1,738.00	1,564,200	
オオバ	7,400	805.00	5,957,000	
コナミホールディングス	38,500	5,130.00	197,505,000	
いであ	2,500	1,770.00	4,425,000	

学究社	3,200	1,244.00	3,980,800
ベネッセホールディングス	34,500	2,600.00	89,700,000
イオンディライト	12,700	2,842.00	36,093,400
ナック	5,900	958.00	5,652,200
福井コンピュータホールディングス	4,100	3,455.00	14,165,500
ダイセキ	17,300	2,875.00	49,737,500
ステップ	4,100	1,616.00	6,625,600
日鉄物産	7,600	3,265.00	24,814,000
泉州電業	3,000	2,974.00	8,922,000
元気寿司	2,700	2,423.00	6,542,100
トラスコ中山	24,400	2,910.00	71,004,000
ヤマダホールディングス	324,900	497.00	161,475,300
オートバックスセブン	39,500	1,347.00	53,206,500
モリト	8,000	642.00	5,136,000
アークランドサカモト	16,800	1,892.00	31,785,600
ニトリホールディングス	46,000	20,955.00	963,930,000
グルメ杵屋	7,600	1,021.00	7,759,600
愛眼	7,700	236.00	1,817,200
ケーユーホールディングス	6,000	823.00	4,938,000
吉野家ホールディングス	35,100	2,027.00	71,147,700
加藤産業	15,500	3,655.00	56,652,500
北恵	2,900	1,002.00	2,905,800
イノテック	5,600	948.00	5,308,800
イエローハット	20,200	1,637.00	33,067,400
松屋フーズホールディングス	5,200	3,615.00	18,798,000
J B C Cホールディングス	7,100	1,549.00	10,997,900
J Kホールディングス	9,900	850.00	8,415,000
サガミホールディングス	14,200	1,363.00	19,354,600
日伝	9,800	2,366.00	23,186,800
関西スーパーマーケット	8,800	1,304.00	11,475,200
ミロク情報サービス	9,500	2,291.00	21,764,500
北沢産業	7,300	291.00	2,124,300
杉本商事	5,800	2,222.00	12,887,600
因幡電機産業	30,300	2,621.00	79,416,300
王将フードサービス	7,800	6,190.00	48,282,000
プレナス	12,100	1,742.00	21,078,200
ミニストップ	7,900	1,444.00	11,407,600
アークス	21,700	2,262.00	49,085,400
パローホールディングス	23,600	2,613.00	61,666,800
東テク	3,700	2,620.00	9,694,000
ミスミグループ本社	133,700	3,470.00	463,939,000
藤久	2,300	1,041.00	2,394,300
アルテック	8,100	309.00	2,502,900
ベルク	5,200	6,430.00	33,436,000
大 庄	5,600	1,168.00	6,540,800
タキヒヨー	3,300	1,845.00	6,088,500
ファーストリテイリング	14,200	79,150.00	1,123,930,000
ソフトバンクグループ	842,900	6,581.00	5,547,124,900
蔵王産業	1,900	1,375.00	2,612,500
スズケン	45,000	3,880.00	174,600,000

サンドラッグ	40,200	4,190.00	168,438,000	
サックスパー ホールディングス	9,000	576.00	5,184,000	
ジェコス	7,500	990.00	7,425,000	
ヤマザワ	2,700	1,749.00	4,722,300	
やまや	2,300	2,204.00	5,069,200	
グローセル	9,600	425.00	4,080,000	
ベルーナ	22,800	881.00	20,086,800	
合計	115,283,000		261,976,122,560	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,267,020,277
コール・ローン	3,723,793,874
国債証券	448,246,978,044
派生商品評価勘定	1,326,784
未収入金	78,335,004,632
未収利息	2,377,776,090
前払費用	843,124,795
流動資産合計	536,795,024,496
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,239,196,072
未払金	3,109,945,705
未払解約金	78,412,145,000
流動負債合計	89,761,286,777
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	304,195,161,058
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	142,838,576,661
元本等合計	447,033,737,719
純資産合計	447,033,737,719
負債純資産合計	536,795,024,496

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	296,277,231,415円
同期中追加設定元本額	453,995,201,486円
同期中一部解約元本額	446,077,271,843円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	5,904,494,362円
たわらノーロード バランス(堅実型)	311,250,853円
たわらノーロード バランス(標準型)	744,682,084円
たわらノーロード バランス(積極型)	332,782,896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)	19,667,663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)	624,523,291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)	618,718,250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)	167,485,830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)	38,499,391円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	3,949,897円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,903,757円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	16,200,165円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,254,880円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,320,652円
投資のソムリエ	110,093,092,153円
投資のソムリエ<DC年金>	7,783,367,022円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,779,716,883円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	73,559,972,019円
ワールドアセットバランス(基本コース)	3,118,492,596円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	5,992,994,918円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	68,737,082円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	35,979,375円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	68,590,190円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	166,560,253円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	47,679,821,346円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,516,378,593円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	18,827,395円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,165,478円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,431,636円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,960,004,194円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	6,281,976,529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)	619,634,722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)	49,813,569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)	381,412,317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)	759,072,832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)	1,160,737,687円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,096,645,135円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,183,735,880円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,887,293,805円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	115,973,478円
計	304,195,161,058円
2. 受益権の総数	304,195,161,058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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、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	2020年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	3,196,305,078	
合計	3,196,305,078	

(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6月23日から2020年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年11月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	526,615,624,018	-	534,852,387,083	8,236,763,065	
アメリカ・ドル	229,928,717,916	-	231,668,305,343	1,739,587,427	
イギリス・ポンド	34,629,157,363	-	35,673,437,022	1,044,279,659	
イスラエル・シケル	2,253,958,583	-	2,283,581,857	29,623,274	
オーストラリア・ドル	13,837,843,592	-	14,342,866,647	505,023,055	
カナダ・ドル	10,528,834,412	-	10,788,666,819	259,832,407	
シンガポール・ドル	2,329,637,217	-	2,372,611,344	42,974,127	
スウェーデン・クローナ	1,720,133,776	-	1,779,794,676	59,660,900	
デンマーク・クローネ	3,011,746,306	-	3,067,176,316	55,430,010	
ノルウェー・クローネ	1,110,198,697	-	1,175,291,519	65,092,822	
ポーランド・ズロチ	3,275,900,623	-	3,408,484,917	132,584,294	
マレーシア・リンギット	2,379,547,405	-	2,418,506,763	38,959,358	

メキシコ・ペソ	4,189,972,344	-	4,387,582,096	197,609,752
ユーロ	217,419,975,784	-	221,486,081,764	4,066,105,980
買建	2,000,000,000	-	1,998,893,777	1,106,223
アメリカ・ドル	989,296,000	-	988,690,599	605,401
イギリス・ポンド	159,171,000	-	159,209,943	38,943
オーストラリア・ドル	54,617,000	-	54,630,848	13,848
カナダ・ドル	46,969,000	-	46,837,278	131,722
ユーロ	749,947,000	-	749,525,109	421,891
合計	528,615,624,018	-	536,851,280,860	8,237,869,288

(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)

	2020年11月11日現在
1口当たり純資産額	1.4696円
(1万口当たり純資産額)	(14,696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

2020年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 04/30/22	5,670,000.000	5,667,120.710	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,609,099.170	
		US T N/B 0.125 05/31/22	8,000,000.000	7,994,062.480	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,972,226.540	
		US T N/B 0.125 07/31/22	11,110,000.000	11,099,150.300	
		US T N/B 0.125 08/15/23	3,000,000.000	2,990,273.430	
		US T N/B 0.125 08/31/22	17,610,000.000	17,591,426.900	
		US T N/B 0.125 09/15/23	13,000,000.000	12,951,757.780	
		US T N/B 0.125 09/30/22	18,620,000.000	18,598,906.890	
		US T N/B 0.125 10/15/23	18,530,000.000	18,461,236.280	

US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,136,669.030	
US T N/B 0.25 05/31/25	8,500,000.000	8,436,250.000	
US T N/B 0.25 06/15/23	11,000,000.000	11,003,007.730	
US T N/B 0.25 06/30/25	12,230,000.000	12,130,631.250	
US T N/B 0.25 07/31/25	13,440,000.000	13,324,500.000	
US T N/B 0.25 08/31/25	10,000,000.000	9,907,812.500	
US T N/B 0.25 09/30/25	5,750,000.000	5,693,847.620	
US T N/B 0.375 03/31/22	14,270,000.000	14,311,805.390	
US T N/B 0.375 04/30/25	8,230,000.000	8,218,426.560	
US T N/B 0.375 07/31/27	10,850,000.000	10,624,523.430	
US T N/B 0.375 09/30/27	10,000,000.000	9,771,875.000	
US T N/B 0.5 03/15/23	7,000,000.000	7,047,304.600	
US T N/B 0.5 03/31/25	3,000,000.000	3,013,300.500	
US T N/B 0.5 04/30/27	7,500,000.000	7,422,802.720	
US T N/B 0.5 05/31/27	7,960,000.000	7,872,937.500	
US T N/B 0.5 06/30/27	11,130,000.000	10,996,961.660	
US T N/B 0.5 08/31/27	9,000,000.000	8,876,953.080	
US T N/B 0.625 03/31/27	6,720,000.000	6,709,762.470	
US T N/B 0.625 05/15/30	11,860,000.000	11,511,612.500	
US T N/B 0.625 08/15/30	18,970,000.000	18,360,885.040	
US T N/B 1.125 02/28/22	10,000,000.000	10,125,390.000	
US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	8,034,654.680	
US T N/B 1.125 02/28/27	4,000,000.000	4,119,687.200	
US T N/B 1.125 05/15/40	12,070,000.000	11,276,020.310	
US T N/B 1.125 08/15/40	7,170,000.000	6,676,502.300	
US T N/B 1.25 05/15/50	16,750,000.000	14,783,183.500	
US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,632,312.500	
US T N/B 1.25 08/31/24	8,000,000.000	8,275,624.960	
US T N/B 1.375 01/31/25	9,960,000.000	10,373,962.500	
US T N/B 1.375 02/15/23	9,870,000.000	10,126,388.640	
US T N/B 1.375 06/30/23	5,390,000.000	5,552,963.250	
US T N/B 1.375 08/15/50	17,000,000.000	15,492,578.040	
US T N/B 1.375 08/31/23	9,500,000.000	9,804,296.870	
US T N/B 1.375 08/31/26	6,000,000.000	6,274,687.500	
US T N/B 1.375 09/30/23	9,000,000.000	9,293,906.250	
US T N/B 1.375 10/15/22	5,500,000.000	5,625,253.860	
US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,225,937.440	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,790,000.000	6,098,498.430	
US T N/B 1.5 02/15/30	14,550,000.000	15,296,824.130	
US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,843,837.500	
US T N/B 1.5 03/31/23	9,390,000.000	9,676,101.550	
US T N/B 1.5 08/15/22	11,300,000.000	11,562,636.630	
US T N/B 1.5 08/15/26	1,290,000.000	1,358,833.580	
US T N/B 1.5 09/15/22	8,410,000.000	8,613,351.100	
US T N/B 1.5 09/30/24	8,000,000.000	8,358,124.960	
US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,361,874.960	
US T N/B 1.5 11/30/21	2,460,000.000	2,495,266.380	
US T N/B 1.5 11/30/24	10,920,000.000	11,419,931.230	
US T N/B 1.625 02/15/26	10,850,000.000	11,484,046.870	

US T N/B 1.625 05/15/26	5,590,000.000	5,921,032.810	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,655,365.620	
US T N/B 1.625 08/15/22	8,000,000.000	8,203,124.960	
US T N/B 1.625 08/15/29	9,900,000.000	10,525,710.880	
US T N/B 1.625 08/31/22	10,660,000.000	10,928,998.380	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	4,050,990.620	
US T N/B 1.625 10/31/23	5,780,000.000	6,017,521.870	
US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,407,992.160	
US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,632,333.560	
US T N/B 1.625 12/15/22	8,600,000.000	8,857,663.990	
US T N/B 1.625 12/31/21	3,070,000.000	3,121,566.170	
US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,460,548.390	
US T N/B 1.75 02/28/22	10,500,000.000	10,715,742.130	
US T N/B 1.75 03/31/22	5,290,000.000	5,404,892.180	
US T N/B 1.75 05/15/22	1,250,000.000	1,279,736.320	
US T N/B 1.75 05/15/23	10,000,000.000	10,382,031.200	
US T N/B 1.75 05/31/22	9,490,000.000	9,722,060.100	
US T N/B 1.75 06/15/22	3,700,000.000	3,792,355.440	
US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,292,628.090	
US T N/B 1.75 06/30/24	7,510,000.000	7,899,581.250	
US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	3,017,060.130	
US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,420,624.960	
US T N/B 1.75 09/30/22	10,390,000.000	10,696,017.910	
US T N/B 1.75 11/15/29	9,240,000.000	9,926,503.070	
US T N/B 1.75 11/30/21	1,380,000.000	1,403,341.400	
US T N/B 1.75 12/31/24	9,000,000.000	9,510,468.750	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,332,282.810	
US T N/B 1.875 01/31/22	6,840,000.000	6,984,281.250	
US T N/B 1.875 02/28/22	2,440,000.000	2,493,946.860	
US T N/B 1.875 04/30/22	10,390,000.000	10,652,185.100	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,000,000.000	4,296,562.480	
US T N/B 1.875 07/31/22	10,290,000.000	10,587,445.310	
US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,369,140.600	
US T N/B 1.875 08/31/22	8,000,000.000	8,241,874.960	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,320,000.000	7,743,759.330	
US T N/B 1.875 09/30/22	8,860,000.000	9,140,335.890	
US T N/B 1.875 10/31/22	4,000,000.000	4,132,500.000	
US T N/B 2.0 02/15/22	10,000,000.000	10,233,593.700	
US T N/B 2.0 02/15/25	11,340,000.000	12,111,651.500	
US T N/B 2.0 02/15/50	11,160,000.000	11,836,575.000	
US T N/B 2.0 04/30/24	4,560,000.000	4,828,256.220	
US T N/B 2.0 05/31/24	12,440,000.000	13,186,400.000	
US T N/B 2.0 06/30/24	7,540,000.000	7,999,468.740	
US T N/B 2.0 08/15/25	13,590,000.000	14,589,077.260	
US T N/B 2.0 10/31/22	2,720,000.000	2,816,900.000	
US T N/B 2.0 11/15/21	7,900,000.000	8,048,433.570	
US T N/B 2.0 11/15/26	13,900,000.000	15,055,437.500	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,465,115.620	
US T N/B 2.125 02/29/24	6,950,000.000	7,371,343.750	

US T N/B 2.125 03/31/24	11,900,000.000	12,638,171.870	
US T N/B 2.125 05/15/22	4,150,000.000	4,272,068.340	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,190,000.000	10,978,132.810	
US T N/B 2.125 05/31/26	6,070,000.000	6,599,228.120	
US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,941,165.620	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,810,000.000	7,265,950.740	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,650,000.000	7,107,187.500	
US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,458,750.000	
US T N/B 2.125 11/30/24	3,970,000.000	4,251,621.870	
US T N/B 2.125 12/31/21	7,000,000.000	7,156,953.090	
US T N/B 2.125 12/31/22	13,500,000.000	14,053,710.870	
US T N/B 2.25 01/31/24	3,780,000.000	4,020,679.660	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,660,000.000	9,525,323.390	
US T N/B 2.25 03/31/26	1,920,000.000	2,098,200.000	
US T N/B 2.25 04/15/22	8,560,000.000	8,814,459.350	
US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,538,750.000	
US T N/B 2.25 08/15/27	15,850,000.000	17,485,769.440	
US T N/B 2.25 08/15/46	5,910,000.000	6,615,967.930	
US T N/B 2.25 08/15/49	10,830,000.000	12,113,524.140	
US T N/B 2.25 10/31/24	4,560,000.000	4,900,931.220	
US T N/B 2.25 11/15/25	13,320,000.000	14,493,825.000	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,060,000.000	13,322,531.250	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,498,750.000	
US T N/B 2.25 12/31/24	4,530,000.000	4,880,013.250	
US T N/B 2.375 01/31/23	10,760,000.000	11,276,984.320	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,200,109.340	
US T N/B 2.375 03/15/22	3,000,000.000	3,088,945.290	
US T N/B 2.375 04/30/26	6,620,000.000	7,280,965.620	
US T N/B 2.375 05/15/27	11,540,000.000	12,810,301.500	
US T N/B 2.375 05/15/29	10,760,000.000	12,094,071.820	
US T N/B 2.375 08/15/24	13,790,000.000	14,851,183.520	
US T N/B 2.375 11/15/49	9,480,000.000	10,888,668.740	
US T N/B 2.5 01/15/22	6,320,000.000	6,494,540.570	
US T N/B 2.5 01/31/25	5,160,000.000	5,617,950.000	
US T N/B 2.5 02/15/22	7,160,000.000	7,371,164.000	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,690,000.000	9,000,904.680	
US T N/B 2.5 02/15/46	6,550,000.000	7,676,804.670	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	6,100,031.220	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	7,085,400.000	
US T N/B 2.5 05/15/24	3,690,000.000	3,971,939.060	
US T N/B 2.5 05/15/46	6,590,000.000	7,723,170.920	
US T N/B 2.625 01/31/26	7,260,000.000	8,058,600.000	
US T N/B 2.625 02/15/29	14,760,000.000	16,858,687.500	
US T N/B 2.625 02/28/23	5,370,000.000	5,665,769.500	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,859,502.320	
US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,330,807.760	
US T N/B 2.625 12/15/21	11,320,000.000	11,626,435.900	
US T N/B 2.625 12/31/23	9,670,000.000	10,381,651.560	
US T N/B 2.625 12/31/25	7,300,000.000	8,093,875.000	

US T N/B 2.75 02/15/24	11,930,000.000	12,891,856.250	
US T N/B 2.75 02/15/28	17,590,000.000	20,085,581.250	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,922,439.810	
US T N/B 2.75 04/30/23	10,670,000.000	11,332,706.970	
US T N/B 2.75 05/31/23	10,880,000.000	11,577,849.940	
US T N/B 2.75 06/30/25	3,100,000.000	3,431,312.500	
US T N/B 2.75 08/15/42	4,000,000.000	4,879,374.990	
US T N/B 2.75 08/15/47	7,980,000.000	9,814,153.120	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,521,001.560	
US T N/B 2.75 11/15/23	13,330,000.000	14,333,915.620	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,920,000.000	2,340,300.000	
US T N/B 2.75 11/15/47	7,810,000.000	9,607,520.300	
US T N/B 2.875 04/30/25	4,220,000.000	4,681,562.500	
US T N/B 2.875 05/15/28	10,450,000.000	12,055,871.040	
US T N/B 2.875 05/15/43	7,510,000.000	9,343,496.050	
US T N/B 2.875 05/15/49	8,970,000.000	11,329,530.410	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	5,054,410.130	
US T N/B 2.875 07/31/25	7,720,000.000	8,601,768.740	
US T N/B 2.875 08/15/28	14,270,000.000	16,503,031.950	
US T N/B 2.875 08/15/45	6,380,000.000	7,968,021.870	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,400,631.250	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,290,000.000	10,012,152.290	
US T N/B 2.875 11/15/21	8,440,000.000	8,673,088.990	
US T N/B 2.875 11/15/46	5,750,000.000	7,211,308.560	
US T N/B 2.875 11/30/23	3,810,000.000	4,114,502.320	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,780,000.000	7,594,129.650	
US T N/B 3.0 02/15/47	6,460,000.000	8,292,015.620	
US T N/B 3.0 02/15/48	9,100,000.000	11,708,429.640	
US T N/B 3.0 02/15/49	8,880,000.000	11,466,993.680	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,710,000.000	4,700,975.740	
US T N/B 3.0 05/15/45	6,980,000.000	8,887,503.120	
US T N/B 3.0 05/15/47	5,000,000.000	6,422,656.250	
US T N/B 3.0 08/15/48	10,530,000.000	13,578,764.060	
US T N/B 3.0 09/30/25	7,430,000.000	8,345,979.680	
US T N/B 3.0 10/31/25	6,560,000.000	7,376,925.000	
US T N/B 3.0 11/15/44	6,810,000.000	8,661,468.750	
US T N/B 3.0 11/15/45	2,210,000.000	2,822,239.060	
US T N/B 3.125 02/15/42	3,960,000.000	5,116,443.750	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	6,152,671.830	
US T N/B 3.125 05/15/48	7,640,000.000	10,055,553.070	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,430,000.000	9,629,976.550	
US T N/B 3.125 11/15/28	13,770,000.000	16,232,463.210	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,770,000.000	4,860,943.750	
US T N/B 3.375 05/15/44	5,110,000.000	6,876,143.750	
US T N/B 3.375 11/15/48	8,640,000.000	11,896,200.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	1,670,000.000	2,246,150.000	
US T N/B 3.625 02/15/44	4,670,000.000	6,510,271.870	
US T N/B 3.625 08/15/43	6,050,000.000	8,415,171.870	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,590,000.000	5,034,414.050	

	US T N/B 3.75 11/15/43	5,190,000.000	7,355,203.120	
	US T N/B 3.875 08/15/40	3,700,000.000	5,236,656.250	
	US T N/B 4.25 05/15/39	700,000.000	1,029,546.870	
	US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	4,932,015.600	
	US T N/B 4.375 02/15/38	1,210,000.000	1,786,640.620	
	US T N/B 4.375 05/15/40	3,670,000.000	5,515,035.130	
	US T N/B 4.375 05/15/41	3,150,000.000	4,770,527.320	
	US T N/B 4.375 11/15/39	3,650,000.000	5,463,308.560	
	US T N/B 4.5 02/15/36	2,320,000.000	3,377,774.990	
	US T N/B 4.5 05/15/38	1,250,000.000	1,874,121.080	
	US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,804,414.810	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	4,304,010.930	
	US T N/B 4.75 02/15/41	450,000.000	710,367.180	
	US T N/B 5.0 05/15/37	2,810,000.000	4,372,842.940	
	US T N/B 5.25 02/15/29	830,000.000	1,125,298.420	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,290,750.000	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,200,000.000	3,155,796.860	
	US T N/B 5.5 08/15/28	930,000.000	1,262,257.010	
	US T N/B 6.0 02/15/26	800,000.000	1,028,687.490	
	US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,814,105.440	
	US T N/B 6.25 05/15/30	1,210,000.000	1,802,805.430	
	US T N/B 6.25 08/15/23	1,200,000.000	1,398,984.360	
	US T N/B 8.0 11/15/21	2,100,000.000	2,266,523.390	
アメリカ・ドル	小計	1,708,290,000.000 (179,626,693,500)	1,847,021,942.400 (194,214,357,245)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,640,000.000	1,640,820.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	11,440,000.000	11,477,637.600	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	990,000.000	994,554.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	3,330,000.000	3,324,971.700	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	6,270,000.000	6,314,893.200	
	UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,280,000.000	5,327,731.200	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,400,000.000	2,148,960.000	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	5,790,000.000	5,964,163.200	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,810,000.000	2,806,909.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	3,410,000.000	3,199,262.000	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,400,000.000	1,429,647.800	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,740,000.000	3,915,780.000	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	5,750,000.000	5,961,772.500	

UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,860,000.000	4,161,813.400	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	3,180,000.000	3,453,162.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,090,000.000	3,355,276.500	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	4,290,000.000	4,949,373.000	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	3,740,000.000	4,148,019.040	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	2,800,000.000	3,326,071.830	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,420,000.000	1,884,766.000	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,170,000.000	2,658,901.000	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	4,060,000.000	5,242,678.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,000,000.000	5,163,000.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	5,850,000.000	6,832,215.000	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,530,000.000	2,769,990.740	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	3,830,000.000	4,076,596.070	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,280,000.000	5,175,413.600	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,500,000.000	2,763,412.980	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,610,000.000	5,452,183.000	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	5,320,000.000	8,417,304.000	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	3,270,000.000	6,791,790.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,140,000.000	5,683,714.000	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,380,000.000	4,926,362.000	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	3,720,000.000	5,704,992.000	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	4,230,000.000	6,073,011.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,730,000.000	4,428,606.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,550,000.000	3,301,536.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,530,000.000	5,825,912.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,170,000.000	5,692,052.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,040,000.000	5,707,600.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,450,000.000	7,022,820.000	
UK TREASURY 4.5 09/07/34	860,000.000	1,316,574.000	

	UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,110,000.000	7,192,089.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	2,460,000.000	3,553,224.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,780,000.000	6,399,540.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,780,000.000	4,608,046.800	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,126,990.500	
イギリス・ポンド	小計	166,430,000.000 (23,203,670,600)	214,692,137.660 (29,932,377,833)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	3,000,000.000	2,992,569.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	2,000,000.000	2,011,510.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,710,000.000	2,742,406.180	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	6,000,000.000	6,134,748.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,840,000.000	1,825,462.160	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	1,160,000.000	1,204,066.080	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	4,020,000.000	4,277,119.200	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	6,700,000.000	7,316,105.200	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,770,000.000	5,335,955.730	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	4,020,000.000	4,486,726.020	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	3,980,000.000	5,473,578.580	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	6,660,000.000	7,299,393.300	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	3,810,000.000	6,439,829.640	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,300,000.000	3,081,020.200	
イスラエル・シュケル	小計	52,970,000.000 (1,647,367,000)	60,620,489.290 (1,885,297,217)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	6,110,000.000	6,123,439.550	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	6,000,000.000	5,983,110.120	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	5,350,000.000	5,378,296.680	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	6,600,000.000	6,605,565.770	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	6,000,000.000	6,047,256.000	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	3,900,000.000	3,994,293.030	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	50,000.000	52,760.490	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	3,000,000.000	2,850,000.000	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,360,000.000	4,871,864.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	7,410,000.000	7,731,964.500	

	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	8,010,000.000	9,208,106.950	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	6,060,000.000	6,605,844.190	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	2,050,000.000	2,426,199.180	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,820,000.000	2,185,981.790	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	7,870,000.000	9,045,778.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	6,590,000.000	7,651,646.350	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	7,320,000.000	8,530,728.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,770,000.000	3,435,150.120	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	6,880,000.000	7,794,892.080	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	8,220,000.000	9,907,050.600	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,270,000.000	2,880,381.860	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	3,020,000.000	4,054,675.850	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,130,000.000	2,578,029.730	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,690,000.000	5,169,589.960	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	6,540,000.000	8,314,623.760	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	9,140,000.000	10,340,516.140	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	6,040,000.000	6,613,098.750	
	オーストラリア・ドル 小計	139,200,000.000 (10,654,368,000)	156,380,843.450 (11,969,389,758)	
カナダ・ドル	CANADA 8.0 06/01/27	920,000.000	1,358,895.200	
	CANADA 0.25 03/01/26	600,000.000	592,194.000	
	CANADA 0.25 04/01/24	2,300,000.000	2,294,549.000	
	CANADA 0.25 08/01/22	5,500,000.000	5,499,945.000	
	CANADA 0.25 11/01/22	4,150,000.000	4,150,581.000	
	CANADA 0.5 03/01/22	4,170,000.000	4,186,846.800	
	CANADA 0.5 09/01/25	8,740,000.000	8,743,933.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	3,000,000.000	2,905,620.000	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,320,000.000	2,384,913.600	
	CANADA 1.0 09/01/22	5,080,000.000	5,150,307.200	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,060,000.000	2,133,830.400	
	CANADA 1.25 06/01/30	6,780,000.000	7,072,353.600	
	CANADA 1.25 11/01/21	600,000.000	606,360.000	
	CANADA 1.5 02/01/22	2,450,000.000	2,489,518.500	
	CANADA 1.5 05/01/22	1,920,000.000	1,956,518.400	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,130,000.000	3,228,250.700	
	CANADA 1.5 06/01/26	2,350,000.000	2,476,712.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	1,810,000.000	1,887,884.300	
	CANADA 1.75 03/01/23	5,070,000.000	5,243,698.200	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,360,000.000	2,600,602.000	
	CANADA 2.0 09/01/23	4,680,000.000	4,905,108.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	5,090,000.000	5,972,046.100	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,040,000.000	3,288,672.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,980,000.000	2,236,370.400	
	CANADA 2.5 06/01/24	3,210,000.000	3,455,340.300	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,950,000.000	3,066,348.000	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,840,000.000	3,812,529.600	
	CANADA 2.75 12/01/64	970,000.000	1,431,186.500	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,010,000.000	4,465,666.100	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,960,000.000	2,985,707.200	

	CANADA 5.0 06/01/37	1,950,000.000	3,133,728.000	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,930,000.000	2,738,438.400	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,260,000.000	3,556,336.000	
カナダ・ドル 小計		101,180,000.000 (8,157,131,600)	112,010,989.500 (9,030,325,973)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,800,000.000	1,859,400.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	1,030,000.000	1,262,167.150	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	580,000.000	611,204.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	340,000.000	369,240.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,110,000.000	1,292,556.150	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,470,000.000	1,598,184.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	250,000.000	301,835.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,020,000.000	1,157,190.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,180,000.000	1,598,900.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,300,000.000	1,690,000.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	670,000.000	713,416.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,930,000.000	2,256,170.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,420,000.000	1,692,512.200	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,970,000.000	2,166,015.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	2,220,000.000	2,334,796.200	
SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,520,000.000	1,950,160.000		
SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,630,000.000	1,916,065.000		
シンガポール・ドル 小計		21,440,000.000 (1,673,177,600)	24,769,810.700 (1,933,036,027)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	7,390,000.000	7,423,763.430	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	11,710,000.000	12,472,003.630	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	10,200,000.000	10,913,490.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	16,970,000.000	18,204,390.980	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	19,860,000.000	20,971,405.320	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	17,950,000.000	20,242,057.010	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	8,720,000.000	13,283,088.800	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	15,310,000.000	16,240,710.210	
スウェーデン・クローナ 小計		108,110,000.000 (1,320,023,100)	119,750,909.380 (1,462,158,604)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.25 11/15/22	20,700,000.000	21,053,970.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,400,000.000	4,579,960.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	14,060,000.000	15,029,366.700	
	DENMARK 0.5 11/15/29	27,880,000.000	30,129,358.400	
	DENMARK 1.5 11/15/23	13,600,000.000	14,480,083.200	
	DENMARK 1.75 11/15/25	14,670,000.000	16,395,315.200	
	DENMARK 4.5 11/15/39	25,490,000.000	48,107,231.070	
デンマーク・クローネ 小計		120,800,000.000 (2,016,152,000)	149,775,284.570 (2,499,749,499)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	9,410,000.000	9,887,181.100	
	NORWAY 1.5 02/19/26	8,270,000.000	8,693,920.200	

	NORWAY 1.75 02/17/27	10,110,000.000	10,815,342.340	
	NORWAY 1.75 03/13/25	7,570,000.000	7,989,680.800	
	NORWAY 1.75 09/06/29	7,030,000.000	7,608,639.300	
	NORWAY 2.0 04/26/28	9,010,000.000	9,872,257.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	18,110,000.000	18,894,887.400	
	NORWAY 3.0 03/14/24	8,580,000.000	9,332,380.200	
ノルウェー・クローネ 小計		78,090,000.000 (912,091,200)	83,094,288.340 (970,541,288)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.75 04/25/25	3,140,000.000	3,183,934.250	
	POLAND 07/25/22	4,910,000.000	4,908,343.990	
	POLAND 1.25 10/25/30	5,800,000.000	5,791,893.150	
	POLAND 2.25 04/25/22	8,340,000.000	8,611,288.520	
	POLAND 2.25 10/25/24	6,880,000.000	7,423,164.290	
	POLAND 2.5 01/25/23	8,340,000.000	8,788,214.090	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,030,000.000	2,194,165.490	
	POLAND 2.5 07/25/26	10,320,000.000	11,406,039.640	
	POLAND 2.5 07/25/27	6,630,000.000	7,358,542.840	
	POLAND 2.75 04/25/28	9,190,000.000	10,374,662.680	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,960,766.560	
	POLAND 3.25 07/25/25	10,150,000.000	11,472,852.530	
	POLAND 4.0 10/25/23	7,010,000.000	7,823,510.500	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,800,000.000	2,504,970.000	
POLAND 5.75 09/23/22	4,750,000.000	5,257,062.500		
ポーランド・ズロチ 小計		93,650,000.000 (2,587,549,500)	102,059,411.030 (2,819,901,527)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 3.418 08/15/22	5,000,000.000	5,148,080.500	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	2,000,000.000	2,101,104.800	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	3,910,000.000	4,058,593.280	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	4,580,000.000	4,894,309.820	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	4,000,000.000	4,344,752.000	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	2,000,000.000	2,115,969.200	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	2,900,000.000	3,050,804.640	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	4,150,000.000	4,544,607.730	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	3,840,000.000	4,139,088.380	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	2,000,000.000	2,147,820.800	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	5,270,000.000	5,788,538.480	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,489,987.750	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	2,000,000.000	2,186,986.800	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,500,000.000	1,635,682.950	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	2,000,000.000	2,171,001.000	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	4,400,000.000	4,775,980.880	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	2,960,000.000	3,180,822.210	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	500,000.000	524,323.350	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,190,000.000	2,355,908.040	
MALAYSIA 4.232 06/30/31	2,000,000.000	2,255,867.600		
MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,200,000.000	2,450,773.820		
MALAYSIA 4.392 04/15/26	2,830,000.000	3,137,391.480		

	MALAYSIA 4.498 04/15/30	2,820,000.000	3,244,375.310	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,540,000.000	2,973,890.160	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	2,300,000.000	2,595,646.830	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	2,000,000.000	2,380,775.600	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,900,000.000	2,187,168.280	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	3,470,000.000	4,010,218.260	
マレーシア・リンギット 小計		78,630,000.000 (2,006,637,600)	85,890,469.950 (2,191,924,793)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	13,690,000.000	14,397,088.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,613,000.000	24,825,461.010	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,913,000.000	70,114,717.820	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	38,064,000.000	39,065,083.200	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	76,079,000.000	78,532,494.480	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	80,425,000.000	89,454,314.750	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	14,915,000.000	16,866,926.050	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	46,168,000.000	50,460,700.640	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	20,241,000.000	22,743,799.650	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	61,170,000.000	68,094,444.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,646,000.000	21,912,755.480	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	60,173,000.000	66,098,837.040	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	71,661,000.000	84,884,604.330	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	40,503,000.000	47,735,620.710	
	メキシコ・ペソ 小計		620,261,000.000 (3,206,749,370)	695,186,847.660 (3,594,116,002)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,200,000.000	1,239,093.600	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	1,800,000.000	1,830,713.400	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	540,000.000	531,684.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	2,640,000.000	2,846,313.360	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	3,000,000.000	3,205,977.000	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	2,470,000.000	2,695,775.290	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	1,260,000.000	1,461,909.960	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,150,000.000	3,401,259.750	
	AUSTRIA 07/15/23	1,710,000.000	1,742,319.000	
	AUSTRIA 07/15/24	1,970,000.000	2,018,383.200	
	AUSTRIA 09/20/22	1,430,000.000	1,449,225.770	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,490,000.000	2,719,333.980	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	2,090,000.000	2,822,532.460	

AUSTRIA 1.5 11/02/86	500,000.000	794,800.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,640,000.000	1,791,786.920	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	1,580,000.000	1,695,099.840	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,280,000.000	2,682,376.960	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,890,000.000	2,552,889.150	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	840,000.000	1,449,844.610	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	3,380,000.000	3,664,494.600	
AUSTRIA 3.65 04/20/22	700,000.000	743,890.000	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	450,000.000	1,065,546.450	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,400,000.000	5,753,820.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,200,000.000	2,856,145.600	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	1,160,000.000	1,695,142.800	
BELGIUM 0.0 10/22/27	3,110,000.000	3,209,862.100	
BELGIUM 0.1 06/22/30	2,690,000.000	2,790,606.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	2,030,000.000	2,083,389.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	750,000.000	776,698.500	
BELGIUM 0.5 10/22/24	3,420,000.000	3,576,807.000	
BELGIUM 0.8 06/22/25	3,730,000.000	3,977,101.310	
BELGIUM 0.8 06/22/27	2,630,000.000	2,856,916.400	
BELGIUM 0.8 06/22/28	3,360,000.000	3,678,528.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	3,270,000.000	3,629,212.770	
BELGIUM 1.0 06/22/26	3,770,000.000	4,104,046.880	
BELGIUM 1.0 06/22/31	4,130,000.000	4,674,139.890	
BELGIUM 1.25 04/22/33	1,850,000.000	2,177,007.850	
BELGIUM 1.45 06/22/37	1,000,000.000	1,226,305.290	
BELGIUM 1.6 06/22/47	2,530,000.000	3,301,963.720	
BELGIUM 1.7 06/22/50	1,850,000.000	2,502,051.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	1,560,000.000	2,045,334.720	
BELGIUM 2.15 06/22/66	1,190,000.000	1,949,934.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	3,800,000.000	4,094,891.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	1,400,000.000	2,224,917.800	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,130,000.000	1,264,792.050	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,420,000.000	2,018,189.200	
BELGIUM 3.75 06/22/45	1,560,000.000	2,819,185.200	
BELGIUM 4.0 03/28/22	3,190,000.000	3,396,989.530	
BELGIUM 4.0 03/28/32	2,350,000.000	3,486,565.750	
BELGIUM 4.25 03/28/41	3,690,000.000	6,639,675.300	
BELGIUM 4.25 09/28/22	3,880,000.000	4,244,294.730	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,460,000.000	3,141,048.540	
BELGIUM 5.0 03/28/35	4,750,000.000	8,220,848.750	
BELGIUM 5.5 03/28/28	210,000.000	303,793.450	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	5,300,000.000	5,469,838.500	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	5,300,000.000	5,485,871.000	
BUNDESOBL 04/05/24	5,380,000.000	5,517,206.140	
BUNDESOBL 04/08/22	3,300,000.000	3,333,033.000	
BUNDESOBL 10/07/22	6,150,000.000	6,235,521.900	
BUNDESOBL 10/13/23	4,800,000.000	4,906,752.000	
BUNDESOBL 10/18/24	4,740,000.000	4,876,967.040	
BUNDESSCHAT 0.0 03/11/22	3,000,000.000	3,028,410.000	

BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	5,230,000.000	5,300,082.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	5,290,000.000	5,549,157.100	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	3,370,000.000	3,511,809.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	5,810,000.000	6,091,087.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,500,000.000	1,575,645.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	3,510,000.000	3,567,893.940	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	6,280,000.000	6,559,208.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	6,970,000.000	7,383,599.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	7,800,000.000	8,351,467.800	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	7,500,000.000	8,010,450.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	7,250,000.000	7,721,467.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	6,940,000.000	7,523,168.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	5,410,000.000	5,843,497.890	
DEUTSCHLAND 08/15/26	6,690,000.000	6,963,404.890	
DEUTSCHLAND 08/15/29	5,620,000.000	5,901,157.360	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	5,400,000.000	5,759,235.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,240,000.000	6,760,790.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	5,030,000.000	6,911,528.330	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,309,630.600	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	8,090,000.000	8,551,251.350	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	5,000,000.000	5,400,172.500	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	4,600,000.000	4,787,760.040	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	6,640,000.000	7,189,652.560	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	7,280,000.000	7,578,239.760	
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	3,730,000.000	3,847,383.100	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	6,580,000.000	7,085,896.720	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	5,860,000.000	9,622,237.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	7,010,000.000	11,821,631.030	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,130,000.000	7,297,379.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	6,150,000.000	10,561,702.500	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	4,150,000.000	7,736,803.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	630,000.000	896,080.500	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,320,000.000	9,165,455.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	3,950,000.000	7,931,995.000	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,270,000.000	8,573,341.400	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	300,000.000	438,135.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,444,001.400	

DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,297,946.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,486,479.700	
FINLAND 0.0 09/15/24	1,150,000.000	1,179,344.550	
FINLAND 0.0 09/15/30	520,000.000	536,256.760	
FINLAND 0.125 04/15/36	890,000.000	916,090.350	
FINLAND 0.25 09/15/40	730,000.000	760,341.720	
FINLAND 0.5 04/15/26	1,260,000.000	1,336,096.440	
FINLAND 0.5 09/15/27	1,960,000.000	2,097,352.880	
FINLAND 0.5 09/15/28	890,000.000	957,423.730	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,660,000.000	1,791,939.940	
FINLAND 0.75 04/15/31	300,000.000	333,169.500	
FINLAND 0.875 09/15/25	1,190,000.000	1,277,769.640	
FINLAND 04/15/22	1,010,000.000	1,020,074.750	
FINLAND 1.125 04/15/34	230,000.000	269,610.140	
FINLAND 1.375 04/15/47	870,000.000	1,160,937.810	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,190,000.000	1,254,438.500	
FINLAND 1.625 09/15/22	1,010,000.000	1,054,172.350	
FINLAND 2.0 04/15/24	1,620,000.000	1,770,985.620	
FINLAND 2.625 07/04/42	1,080,000.000	1,688,265.720	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,180,000.000	1,476,106.840	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,440,000.000	1,755,577.720	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,816,780.210	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	6,300,000.000	6,395,130.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	4,460,000.000	4,592,720.680	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	9,100,000.000	9,367,995.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	6,840,000.000	7,010,548.560	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	7,960,000.000	8,340,257.160	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	6,400,000.000	6,730,291.200	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,020,000.000	9,556,690.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	9,390,000.000	10,096,221.900	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	2,500,000.000	2,654,625.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,970,000.000	5,421,057.320	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,790,000.000	4,119,896.760	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	11,340,000.000	12,408,658.920	
FRANCE OAT 02/25/22	810,000.000	817,011.360	
FRANCE OAT 03/25/23	9,930,000.000	10,090,358.570	
FRANCE OAT 03/25/24	9,300,000.000	9,509,038.880	
FRANCE OAT 03/25/25	9,980,000.000	10,249,499.920	
FRANCE OAT 05/25/22	5,500,000.000	5,557,255.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,120,000.000	8,931,220.480	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	7,920,000.000	8,564,410.800	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	6,020,000.000	7,105,707.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	7,440,000.000	8,852,856.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,300,000.000	14,577,714.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	5,050,000.000	6,585,957.500	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	10,570,000.000	11,228,669.550	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,870,000.000	4,284,140.840	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	5,810,000.000	7,565,142.900	

FRANCE OAT 1.75 11/25/24	8,470,000.000	9,300,017.650	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	5,880,000.000	8,414,868.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	8,220,000.000	9,077,403.540	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	9,150,000.000	9,678,110.550	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	10,610,000.000	13,492,079.180	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	8,510,000.000	10,462,398.240	
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	13,130,000.000	13,834,109.380	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	4,690,000.000	7,979,612.900	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	9,840,000.000	12,063,840.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,610,000.000	7,661,503.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	4,220,000.000	9,505,516.240	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,670,000.000	9,658,346.040	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	5,420,000.000	6,218,225.080	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	6,990,000.000	13,096,799.520	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,630,000.000	9,585,356.500	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,440,000.000	12,721,502.280	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	6,830,000.000	11,752,107.800	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,959,264.440	
IRISH 0.2 05/15/27	1,860,000.000	1,933,894.080	
IRISH 0.2 10/18/30	1,900,000.000	1,969,720.500	
IRISH 0.4 05/15/35	1,860,000.000	1,950,602.830	
IRISH 0.8 03/15/22	620,000.000	632,016.590	
IRISH 0.9 05/15/28	1,970,000.000	2,155,810.780	
IRISH 1.0 05/15/26	3,150,000.000	3,412,552.500	
IRISH 1.1 05/15/29	1,670,000.000	1,867,527.600	
IRISH 1.35 03/18/31	1,180,000.000	1,365,429.920	
IRISH 1.5 05/15/50	770,000.000	990,400.950	
IRISH 1.7 05/15/37	710,000.000	891,995.720	
IRISH 10/18/22	1,080,000.000	1,093,237.340	
IRISH 2.0 02/18/45	2,260,000.000	3,142,575.200	
IRISH 2.4 05/15/30	2,420,000.000	3,028,934.920	
IRISH 3.4 03/18/24	1,340,000.000	1,520,950.920	
IRISH 3.9 03/20/23	1,750,000.000	1,937,918.500	
IRISH 5.4 03/13/25	2,080,000.000	2,624,279.840	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,290,000.000	1,296,708.000	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	500,000.000	504,073.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	4,400,000.000	4,466,000.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	4,500,000.000	4,568,535.000	
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	3,800,000.000	3,830,128.300	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	2,560,000.000	2,603,304.440	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	4,500,000.000	4,603,950.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	5,110,000.000	5,242,858.970	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	4,000,000.000	4,129,000.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,560,000.000	1,582,318.920	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	2,500,000.000	2,554,350.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	5,000,000.000	5,144,230.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	4,210,000.000	4,332,090.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	5,220,000.000	5,355,720.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	4,100,000.000	4,250,060.000	

ITALY BTPS 1.0 07/15/22	3,050,000.000	3,120,756.340	
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	2,700,000.000	2,761,047.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	4,200,000.000	4,447,993.200	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,220,000.000	5,554,126.980	
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	3,000,000.000	3,075,000.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	3,070,000.000	3,216,132.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	3,600,000.000	3,827,372.400	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,279,907.160	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,730,000.000	5,017,321.480	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,550,000.000	4,851,455.700	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	4,790,000.000	5,155,477.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	5,620,000.000	6,121,085.940	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	6,820,000.000	7,432,292.780	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,700,000.000	1,721,542.400	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,140,000.000	4,418,626.140	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	2,300,000.000	2,450,650.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,940,000.000	3,143,154.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,380,000.000	4,738,284.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	5,650,000.000	6,278,556.280	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	4,400,000.000	4,818,237.600	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,000,000.000	5,557,300.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	3,720,000.000	4,111,743.150	
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	2,010,000.000	2,067,747.300	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	3,200,000.000	3,715,520.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,000,000.000	1,178,250.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	4,270,000.000	5,106,066.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	3,030,000.000	3,266,006.700	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	4,770,000.000	5,338,994.220	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,290,000.000	5,834,690.140	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	3,340,000.000	4,167,986.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	2,100,000.000	2,682,960.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	4,550,000.000	5,367,680.500	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	4,130,000.000	5,236,014.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,900,000.000	5,907,391.000	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	3,330,000.000	4,314,714.300	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,850,000.000	5,252,632.000	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	3,370,000.000	4,390,674.250	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	3,450,000.000	4,887,804.750	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,860,000.000	7,374,944.780	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	5,380,000.000	6,163,489.400	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,360,000.000	2,066,994.640	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	6,390,000.000	9,009,261.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,300,000.000	1,596,010.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	6,130,000.000	6,860,377.240	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	120,000.000	136,512.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	7,310,000.000	9,680,099.370	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,530,000.000	7,476,074.620	
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	2,810,000.000	3,009,538.100	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	5,750,000.000	6,987,630.000	

ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,610,000.000	5,442,436.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	2,880,000.000	4,644,000.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	4,640,000.000	7,556,704.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	7,850,000.000	11,032,390.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,273,908.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	6,610,000.000	7,373,521.100	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	4,920,000.000	7,657,980.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,558,360.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,815,420.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	3,038,595.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,167,500.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	170,000.000	176,179.670	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,400,000.000	1,388,035.600	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,700,000.000	3,846,024.200	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	3,360,000.000	3,504,984.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	3,250,000.000	3,455,166.630	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,430,000.000	1,601,934.620	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	3,640,000.000	3,875,144.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,370,000.000	3,672,946.150	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	3,100,000.000	3,408,853.000	
NETHERLANDS 01/15/22	2,190,000.000	2,208,053.680	
NETHERLANDS 01/15/24	4,260,000.000	4,355,019.300	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	2,030,000.000	2,165,122.890	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,690,000.000	4,059,243.540	
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	3,780,000.000	3,968,880.160	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,330,000.000	4,496,660.830	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,010,000.000	5,242,866.160	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	1,670,000.000	1,834,161.000	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,540,000.000	6,491,701.560	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	3,360,000.000	5,686,128.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	3,220,000.000	4,644,206.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	696,613.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	4,800,000.000	4,876,080.000	
SPAIN 0.05 10/31/21	2,380,000.000	2,394,018.200	
SPAIN 0.25 07/30/24	3,450,000.000	3,541,242.150	
SPAIN 0.35 07/30/23	5,300,000.000	5,424,152.500	
SPAIN 0.4 04/30/22	3,300,000.000	3,346,464.000	
SPAIN 0.45 10/31/22	4,540,000.000	4,631,376.580	
SPAIN 0.5 04/30/30	5,240,000.000	5,425,511.720	
SPAIN 0.6 10/31/29	5,420,000.000	5,674,534.040	

SPAIN 0.8 07/30/27	3,200,000.000	3,396,640.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	3,290,000.000	3,286,196.760	
SPAIN 1.2 10/31/40	2,200,000.000	2,383,781.400	
SPAIN 1.25 10/31/30	6,770,000.000	7,468,664.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	6,610,000.000	7,226,118.100	
SPAIN 1.4 04/30/28	6,750,000.000	7,492,648.500	
SPAIN 1.4 07/30/28	6,500,000.000	7,221,500.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	6,120,000.000	6,853,267.800	
SPAIN 1.45 10/31/27	3,230,000.000	3,582,725.690	
SPAIN 1.5 04/30/27	3,000,000.000	3,328,050.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	5,810,000.000	6,328,497.750	
SPAIN 1.85 07/30/35	4,270,000.000	5,091,590.700	
SPAIN 1.95 04/30/26	4,990,000.000	5,607,437.650	
SPAIN 1.95 07/30/30	5,130,000.000	6,026,282.820	
SPAIN 2.15 10/31/25	3,690,000.000	4,149,903.150	
SPAIN 2.35 07/30/33	260,000.000	323,388.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	2,930,000.000	4,183,448.140	
SPAIN 2.75 10/31/24	5,130,000.000	5,782,924.850	
SPAIN 2.9 10/31/46	3,690,000.000	5,391,566.010	
SPAIN 3.45 07/30/66	3,200,000.000	5,629,584.000	
SPAIN 3.8 04/30/24	5,600,000.000	6,437,547.200	
SPAIN 4.2 01/31/37	4,460,000.000	7,004,898.300	
SPAIN 4.4 10/31/23	4,580,000.000	5,253,718.000	
SPAIN 4.65 07/30/25	4,820,000.000	5,968,813.260	
SPAIN 4.7 07/30/41	4,600,000.000	8,096,805.000	
SPAIN 4.8 01/31/24	4,950,000.000	5,798,712.150	
SPAIN 4.9 07/30/40	5,110,000.000	9,063,607.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	4,410,000.000	6,222,510.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,940,000.000	3,753,731.220	
SPAIN 5.4 01/31/23	6,060,000.000	6,865,611.540	
SPAIN 5.75 07/30/32	4,820,000.000	7,868,100.520	
SPAIN 5.85 01/31/22	4,160,000.000	4,486,331.200	
SPAIN 5.9 07/30/26	4,440,000.000	6,018,092.320	
SPAIN 6.0 01/31/29	3,500,000.000	5,224,971.500	
ユーロ 小計	1,245,040,000.000 (154,746,021,600)	1,494,438,830.780 (185,743,802,278)	
国債証券 合計	391,757,632,670 (391,757,632,670)	448,246,978,044 (448,246,978,044)	
合計		448,246,978,044 (448,246,978,044)	

(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 229銘柄	43.45	43.33

イギリス・ポンド	国債証券	47銘柄	6.70	6.68
イスラエル・シケル	国債証券	14銘柄	0.42	0.42
オーストラリア・ドル	国債証券	27銘柄	2.68	2.67
カナダ・ドル	国債証券	33銘柄	2.02	2.01
シンガポール・ドル	国債証券	17銘柄	0.43	0.43
スウェーデン・クローナ	国債証券	8銘柄	0.33	0.33
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.56	0.56
ノルウェー・クローネ	国債証券	8銘柄	0.22	0.22
ポーランド・ズロチ	国債証券	15銘柄	0.63	0.63
マレーシア・リングギット	国債証券	28銘柄	0.49	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.80	0.80
ユーロ	国債証券	319銘柄	41.55	41.44

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,923,982,402
コール・ローン	146,734,457
株式	378,867,658,216
投資信託受益証券	768,346,452
投資証券	8,300,728,699
派生商品評価勘定	259,680,736
未収入金	713,054
未収配当金	350,342,900
差入委託証拠金	2,700,027,120
流動資産合計	394,318,214,036
資産合計	
394,318,214,036	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,137,431
未払金	516,717
未払解約金	242,863,500
流動負債合計	245,517,648
負債合計	
245,517,648	
純資産の部	
元本等	
元本	94,213,969,059
剰余金	
剰余金又は欠損金()	299,858,727,329
元本等合計	394,072,696,388
純資産合計	
394,072,696,388	
負債純資産合計	
394,318,214,036	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	90,492,519,767円
同期中追加設定元本額	40,338,770,536円
同期中一部解約元本額	36,617,321,244円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	4,008,019,318円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,048,404円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	8,637,376円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,676,095円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	30,000,548円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	27,118,086円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	13,388,336円
たわらノーロード 先進国株式	17,549,531,602円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	193,348,667円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,257,079,376円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	380,082,279円
たわらノーロード バランス(堅実型)	42,529,745円
たわらノーロード バランス(標準型)	323,430,338円
たわらノーロード バランス(積極型)	377,452,597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)	846,925円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	119,302,270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)	279,734,645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)	211,942,981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)	329,624,772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)	393,690円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,002,988円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,643,709円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,450,682円
たわらノーロード 全世界株式	74,902,023円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	46,264,044,188円
One DC 先進国株式インデックスファンド	345,890,584円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	188,607,939円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	938,680,812円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,124,613,927円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	118,122,685円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	352,785,234円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	299,159,963円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	27,542,402円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	830,919,038円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	172,199,979円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	212,083,487円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	177,658,677円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	292,628,279円
投資のソムリエ	1,061,009,581円
クルーズコントロール	170,056,706円
投資のソムリエ<DC年金>	75,336,271円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	197,413,366円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	120,659,262円
クルーズコントロール<DC年金>	36,668円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,294,396円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,372,634円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	45,214,690円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	487,906,056円
ワールドアセットバランス(基本コース)	385,507,556円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	743,463,299円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	5,948,317円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,112,860円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	458,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	4,046,745円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	32,064,381円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	541,145,646円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	176,916,359円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,609,706円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	794,038円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	729,359円
4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,152,803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)	5,618,737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)	6,890,512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)	3,472,382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)	264,894,732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)	69,171,414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)	1,577,957,651円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,158,716,067円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	862,947,752円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	13,754,582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)	10,588,299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)	55,520,525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)	106,236,180円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,811,330円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	39,362,925円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,145,203円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,898,630円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,051,750円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	52,380,637円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	350,377,786円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	472,101,034円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,532,145,076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)	546,300,464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)	87,521,839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)	562,565,288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)	27,351,260円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	6,597,531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)	239,355,469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)	19,224,505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)	73,539,942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)	117,130,246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)	268,963,871円
計	94,213,969,059円
2. 受益権の総数	94,213,969,059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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引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	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	16,596,683,003

投資信託受益証券	117,973,106
投資証券	1,011,519,001
合計	15,467,190,896

（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2月18日から2020年11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2020年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建				
アメリカ・ドル	185,515,564	-	185,463,540	52,024
イギリス・ポンド	141,715,310	-	141,623,580	91,730
オーストラリア・ドル	8,588,128	-	8,643,420	55,292
カナダ・ドル	4,593,588	-	4,591,800	1,788
ユーロ	6,385,459	-	6,368,190	17,269
ユーロ	24,233,079	-	24,236,550	3,471
買建	6,145,071,083	-	6,145,116,120	45,037
アメリカ・ドル	4,499,150,880	-	4,499,150,880	-
イギリス・ポンド	279,947,328	-	279,935,280	12,048
オーストラリア・ドル	133,029,996	-	133,009,140	20,856
カナダ・ドル	204,061,875	-	204,023,910	37,965
ユーロ	1,028,881,004	-	1,028,996,910	115,906
合計	6,330,586,647	-	6,330,579,660	97,061

（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	2020年11月11日現在			
	契約額等（円）	うち		時価（円）
		1年超		
市場取引				
先物取引				
買建	11,848,739,108	-	12,106,185,352	257,446,244
合計	11,848,739,108	-	12,106,185,352	257,446,244

(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)

	2020年11月11日現在
1口当たり純資産額	4,1827円
(1万口当たり純資産額)	(41,827円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	35,588	3,035.020	108,010,291.760	
	ABBOTT LABORATORIES	148,295	110.810	16,432,568.950	
	AES CORP	56,735	20.820	1,181,222.700	
	ABIOMED INC	3,574	268.840	960,834.160	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	74,508	117.910	8,785,238.280	
	ADVANCED MICRO DEVICES	98,091	77.990	7,650,117.090	
	ADOBE INC	40,386	452.000	18,254,472.000	
	CHUBB LTD	37,740	151.500	5,717,610.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	18,422	309.970	5,710,267.340	
	ALLEGHANY CORP	1,263	643.940	813,296.220	
	SAREPTA THERAPEUTICS INC	6,052	128.380	776,955.760	
	RALPH LAUREN CORP	3,422	81.350	278,379.700	
	ALLSTATE CORP	26,342	94.440	2,487,738.480	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,840	201.980	11,884,503.200	
	AMGEN INC	49,267	241.600	11,902,907.200	
	HESS CORP	21,951	44.790	983,185.290	
	AMERICAN EXPRESS CO	57,244	115.950	6,637,441.800	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	41,980	90.790	3,811,364.200	
	AFLAC INC	58,283	41.850	2,439,143.550	
	AMERICAN INTL GROUP	72,425	38.230	2,768,807.750	
AMERCO	929	402.000	373,458.000		
ANALOG DEVICES	30,783	134.780	4,148,932.740		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	18,098	127.090	2,300,074.820		

JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	62,634	44.420	2,782,202.280	
JONES LANG LASALLE INC	4,087	133.650	546,227.550	
VALERO ENERGY CORP	34,554	49.960	1,726,317.840	
ANSYS INC	7,234	319.430	2,310,756.620	
APPLE INC	1,455,365	115.970	168,778,679.050	
APPLIED MATERIALS INC	78,202	69.390	5,426,436.780	
ALBEMARLE CORP	9,536	117.930	1,124,580.480	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47,360	50.150	2,375,104.000	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	9,278	90.900	843,370.200	
AMEREN CORP	19,499	82.460	1,607,887.540	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	85.150	566,332.650	
AUTOLIV INC	7,570	85.640	648,294.800	
AUTODESK INC	18,325	247.220	4,530,306.500	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	35,986	171.070	6,156,125.020	
AUTOZONE INC	1,972	1,170.410	2,308,048.520	
AVERY DENNISON CORP	6,549	150.700	986,934.300	
BALL CORP	27,293	94.980	2,592,289.140	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	116,704	228.480	26,664,529.920	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66,597	39.220	2,611,934.340	
BAXTER INTERNATIONAL INC	42,746	81.550	3,485,936.300	
BECTON DICKINSON & CO	24,739	240.300	5,944,781.700	
AMETEK INC	18,524	116.450	2,157,119.800	
VERIZON COMM INC	347,473	61.100	21,230,600.300	
WR BERKLEY CORP	12,511	70.590	883,151.490	
BEST BUY CO INC	19,639	112.630	2,211,940.570	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,859	555.780	1,033,195.020	
YUM! BRANDS INC	25,420	102.990	2,618,005.800	
FIRSTENERGY CORP	47,800	29.310	1,401,018.000	
BOEING CO	45,095	188.690	8,508,975.550	
ROBERT HALF INTL INC	11,111	64.030	711,437.330	
BORGWARNER INC	21,938	38.800	851,194.400	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	119,401	38.200	4,561,118.200	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	93.890	1,100,296.910	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	9,642	154.890	1,493,449.380	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,015	1,125.460	2,267,801.900	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	189,828	64.520	12,247,702.560	
INGREDION INC	5,305	74.580	395,646.900	
ONEOK INC	36,226	32.540	1,178,794.040	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	5,900	86.960	513,064.000	
UNITED RENTALS INC	6,181	209.270	1,293,497.870	
SEMPRA ENERGY	24,590	135.960	3,343,256.400	
FEDEX CORP	20,793	267.270	5,557,345.110	
VERISIGN INC	8,762	199.980	1,752,224.760	
AMPHENOL CORP	24,857	121.850	3,028,825.450	
BROWN-FORMAN CORP	26,085	78.650	2,051,585.250	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	5.990	581,844.640	
CSX CORP	64,187	91.400	5,866,691.800	
CABOT OIL & GAS CORP	31,416	17.190	540,041.040	
CAMPBELL SOUP CO	14,050	47.290	664,424.500	
SEAGATE TECHNOLOGY	19,641	54.720	1,074,755.520	
CONSTELLATION BRANDS INC	14,036	200.560	2,815,060.160	
CARDINAL HEALTH INC	24,718	57.370	1,418,071.660	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	40,534	16.730	678,133.820	
CATERPILLAR INC	45,357	172.300	7,815,011.100	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	116.580	1,150,061.700	
CITRIX SYSTEMS INC	9,933	114.140	1,133,752.620	
CENTURYLINK INC	80,424	9.790	787,350.960	
CERNER CORP	25,177	74.720	1,881,225.440	
JPMORGAN CHASE & CO	255,443	116.520	29,764,218.360	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,287	86.320	1,837,493.840	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	12,872	86.640	1,115,230.080	
CINTAS CORP	7,465	358.680	2,677,546.200	
CISCO SYSTEMS INC	354,537	38.720	13,727,672.640	
CLOROX COMPANY	10,683	198.120	2,116,515.960	
COCA-COLA CO/THE	342,348	53.980	18,479,945.040	
COPART INC	17,304	116.990	2,024,394.960	
COGNEX CORP	14,677	69.600	1,021,519.200	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,311	83.350	5,693,721.850	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	23,920	118.480	2,834,041.600	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	220.040	1,144,868.120	
COMERICA INC	11,985	53.050	635,804.250	
NRG ENERGY, INC.	21,039	32.610	686,081.790	
COMCAST CORP-CL A	381,909	47.770	18,243,792.930	
CONAGRA BRANDS INC	40,291	34.980	1,409,379.180	
CONSOLIDATED EDISON INC	27,587	82.080	2,264,340.960	
CMS ENERGY CORP	22,567	67.110	1,514,471.370	
COOPER COS INC	4,523	346.390	1,566,721.970	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	42.800	706,756.400	
CORNING INC	64,157	36.020	2,310,935.140	
SEALED AIR CORP	13,870	42.900	595,023.000	
HEICO CORP-CL A	6,236	118.570	739,402.520	
CUMMINS INC	12,578	233.860	2,941,491.080	

DR HORTON INC	29,267	70.880	2,074,444.960	
DANAHER CORP	53,312	225.880	12,042,114.560	
MOODY'S CORP	13,994	270.330	3,782,998.020	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	45,078	75.100	3,385,357.800	
TARGET CORP	42,591	158.070	6,732,359.370	
DEERE & CO	24,809	253.970	6,300,741.730	
MORGAN STANLEY	113,219	55.750	6,311,959.250	
REPUBLIC SERVICES INC	19,136	102.080	1,953,402.880	
COSTAR GROUP INC	3,294	886.130	2,918,912.220	
THE WALT DISNEY CO	151,411	142.110	21,517,017.210	
DOLLAR TREE INC	20,057	94.970	1,904,813.290	
DOVER CORP	12,652	119.810	1,515,836.120	
OMNICOM GROUP	17,365	57.000	989,805.000	
DTE ENERGY CO	16,340	132.000	2,156,880.000	
DUKE ENERGY CORP	61,714	97.140	5,994,897.960	
DARDEN RESTAURANTS INC	10,902	113.350	1,235,741.700	
EBAY INC	58,445	46.540	2,720,030.300	
BANK OF AMERICA CORP	654,489	27.660	18,103,165.740	
CITIGROUP INC	174,329	47.650	8,306,776.850	
EASTMAN CHEMICAL CO	10,903	93.400	1,018,340.200	
EATON CORP PLC	33,610	114.860	3,860,444.600	
CADENCE DESIGN SYS INC	23,585	112.390	2,650,718.150	
DISH NETWORK CORP	17,899	28.880	516,923.120	
ECOLAB INC	21,199	212.230	4,499,063.770	
PERKINELMER INC	9,755	125.530	1,224,545.150	
ELECTRONIC ARTS INC	23,979	118.930	2,851,822.470	
SALESFORCE.COM INC	75,409	247.660	18,675,792.940	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	238.050	533,946.150	
EMERSON ELECTRIC CO	49,931	77.440	3,866,656.640	
ATMOS ENERGY CORP	9,937	102.450	1,018,045.650	
ENTERGY CORP	17,195	109.230	1,878,209.850	
EOG RESOURCES INC	50,062	42.190	2,112,115.780	
EQUIFAX INC	10,322	154.610	1,595,884.420	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	18,603	247.350	4,601,452.050	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	13,942	88.280	1,230,799.760	
EXXON MOBIL CORP	354,007	36.860	13,048,698.020	
FMC CORP	11,416	109.350	1,248,339.600	
NEXTERA ENERGY INC	166,332	75.990	12,639,568.680	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	323.100	1,048,782.600	
FAIR ISAAC CORP	2,482	432.890	1,074,432.980	
ASSURANT INC	4,594	134.160	616,331.040	
FASTENAL CO	47,962	46.760	2,242,703.120	
FIFTH THIRD BANCORP	58,016	26.335	1,527,851.360	
M&T BANK CORP	11,432	123.920	1,416,653.440	
FISERV INC	47,512	106.800	5,074,281.600	
FLIR SYSTEMS INC	12,717	36.060	458,575.020	
FORD MOTOR CO	331,318	8.380	2,776,444.840	

FRANKLIN RESOURCES INC	23,713	20.760	492,281.880	
FREEMPORT-MCMORAN INC	126,973	19.820	2,516,604.860	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	15,963	113.640	1,814,035.320	
DENTSPLY SIRONA INC	18,386	52.960	973,722.560	
GENERAL DYNAMICS CORP	20,458	151.310	3,095,499.980	
GENERAL MILLS INC	50,541	58.920	2,977,875.720	
GENUINE PARTS CO	11,605	99.820	1,158,411.100	
GILEAD SCIENCES INC	106,388	60.620	6,449,240.560	
GARTNER INC	7,522	157.440	1,184,263.680	
MCKESSON CORP	13,579	183.440	2,490,931.760	
NVIDIA CORP	51,560	510.800	26,336,848.000	
GENERAL ELECTRIC CO	733,755	8.980	6,589,119.900	
VW GRAINGER INC	3,745	404.480	1,514,777.600	
HALLIBURTON CO	69,816	14.380	1,003,954.080	
MONSTER BEVERAGE CORP	32,991	81.580	2,691,405.780	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	27,310	217.470	5,939,105.700	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18,168	189.530	3,443,381.040	
HASBRO INC	11,383	85.650	974,953.950	
HENRY SCHEIN INC	11,516	68.080	784,009.280	
HEICO CORP	3,623	129.770	470,156.710	
HERSHEY FOODS CORP	12,450	152.260	1,895,637.000	
HP INC	119,285	19.870	2,370,192.950	
F5 NETWORKS INC	4,874	157.910	769,653.340	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,024	94.180	1,132,420.320	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	21.480	600,129.720	
HOLOGIC INC	21,939	66.690	1,463,111.910	
HOME DEPOT INC	90,151	275.570	24,842,911.070	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	76.180	1,240,819.840	
HORMEL FOODS CORP	26,254	50.940	1,337,378.760	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,899	24.100	1,033,865.900	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	294.320	857,354.160	
HUMANA INC	11,307	430.670	4,869,585.690	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	128.690	970,837.360	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	80,847	12.130	980,674.110	
BIOGEN INC	13,713	236.340	3,240,930.420	
IDEX CORP	6,154	195.960	1,205,937.840	
ILLINOIS TOOL WORKS	26,313	217.540	5,724,130.020	
INTUIT INC	21,859	342.260	7,481,461.340	
IDEX LABORATORIES INC	7,088	441.230	3,127,438.240	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	10,960	50.180	549,972.800	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	20,182	143.580	2,897,731.560	
INTEL CORP	355,553	45.440	16,156,328.320	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,206	112.440	810,242.640	

INTERNATIONAL PAPER CO	31,983	48.820	1,561,410.060	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	29,382	21.420	629,362.440	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,033	101.610	1,121,063.130	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,050	160.520	971,146.000	
INCYTE CORP	15,942	83.070	1,324,301.940	
JOHNSON & JOHNSON	221,267	148.280	32,809,470.760	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	29,620	45.820	1,357,188.400	
KLA CORPORATION	12,667	223.730	2,833,987.910	
KELLOGG CO	21,954	64.190	1,409,227.260	
EAST WEST BANCORP INC	11,560	45.250	523,090.000	
KEYCORP	87,597	15.550	1,362,133.350	
KIMBERLY-CLARK CORP	29,127	136.550	3,977,291.850	
BLACKROCK INC/NEW YORK	12,773	660.600	8,437,843.800	
KROGER CO	65,605	31.920	2,094,111.600	
LAM RESEARCH CORP	12,392	407.870	5,054,325.040	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3,302	369.720	1,220,815.440	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	129.940	1,096,433.720	
AKAMAI TECHNOLOGIES	14,153	96.680	1,368,312.040	
LENNAR CORP	23,570	75.340	1,775,763.800	
ELI LILLY & CO	72,340	146.560	10,602,150.400	
LINCOLN NATIONAL CORP	15,344	42.440	651,199.360	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	59,078	164.730	9,731,918.940	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,084	110.200	2,874,456.800	
LOCKHEED MARTIN CORP	21,201	371.280	7,871,507.280	
LOEWS CORP	21,759	42.360	921,711.240	
LOWE'S COS INC	63,122	155.710	9,828,726.620	
DOMINION ENERGY INC	69,772	85.760	5,983,646.720	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,573	24.780	955,838.940	
MCCORMICK & CO INC	10,757	181.940	1,957,128.580	
MCDONALD'S CORPORATION	62,169	213.320	13,261,891.080	
S&P GLOBAL INC	20,168	335.100	6,758,296.800	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	240.200	820,523.200	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,045.660	1,255,837.660	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	51,562	81.210	4,187,350.020	
MARSH & MCLENNAN COS	42,507	112.510	4,782,462.570	
MASCO CORP	23,151	53.570	1,240,199.070	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,258	266.020	1,398,733.160	
METLIFE INC	64,392	46.030	2,963,963.760	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,874	80.120	1,752,544.880	
MEDTRONIC PLC	112,490	114.560	12,886,854.400	
ACTIVISION BLIZZARD INC	65,735	75.120	4,938,013.200	
CVS HEALTH CORP	109,529	70.230	7,692,221.670	
MERCK & CO. INC.	212,111	81.110	17,204,323.210	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	32,686	27.090	885,463.740	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,070	201.160	1,623,361.200	
MICROSOFT CORP	604,749	211.010	127,608,086.490	
MICRON TECH INC	92,874	55.410	5,146,148.340	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,681	121.920	2,521,427.520	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	54,337	40.320	2,190,867.840	
3M CO	48,271	169.140	8,164,556.940	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	122.800	611,052.800	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14,255	166.800	2,377,734.000	
KANSAS CITY SOUTHERN	7,737	187.790	1,452,931.230	
MYLAN NV	44,496	15.640	695,917.440	
ILLUMINA INC	12,225	301.560	3,686,571.000	
XCEL ENERGY INC	43,530	73.730	3,209,466.900	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	87.580	705,719.640	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	35,209	11.010	387,651.090	
NETAPP INC	17,963	50.010	898,329.630	
NEWELL BRANDS INC	33,317	19.260	641,685.420	
NEWMONT CORP	66,201	64.890	4,295,782.890	
NVR INC	305	4,139.000	1,262,395.000	
NIKE INC-CL B	103,785	127.710	13,254,382.350	
NORDSON CORP	4,644	197.180	915,703.920	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21,392	236.180	5,052,362.560	
EVERSOURCE ENERGY	28,269	93.660	2,647,674.540	
NISOURCE INC	31,427	25.070	787,874.890	
NORTHERN TRUST CORP	17,365	91.850	1,594,975.250	
NORTHROP GRUMMAN CORP	13,148	314.510	4,135,177.480	
WELLS FARGO & CO	326,767	24.190	7,904,493.730	
NUCOR CORP	25,118	51.780	1,300,610.040	
CHENIERE ENERGY INC	19,190	51.500	988,285.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	39,027	86.680	3,382,860.360	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	76,641	12.380	948,815.580	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,813	197.480	1,542,911.240	
OGE ENERGY CORP	16,028	34.220	548,478.160	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,256	456.580	2,856,364.480	
ORACLE CORP	172,094	56.670	9,752,566.980	

PACCAR INC	28,876	91.120	2,631,181.120	
PTC INC	9,433	94.240	888,965.920	
EXELON CORP	81,082	42.990	3,485,715.180	
PARKER HANNIFIN CORP	11,059	261.160	2,888,168.440	
PAYCHEX INC	27,450	91.290	2,505,910.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	6,181	464.320	2,869,961.920	
PPL CORPORATION	64,630	29.740	1,922,096.200	
PEPSICO INC	116,370	141.720	16,491,956.400	
PENTAIR PLC	12,511	53.780	672,841.580	
PFIZER INC	466,697	38.680	18,051,839.960	
ESSENTIAL UTILITIES INC	18,952	46.340	878,235.680	
CONOCOPHILLIPS	90,684	35.530	3,222,002.520	
PG&E CORP	91,170	10.410	949,079.700	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,898	91.750	1,275,141.500	
ALTRIA GROUP INC	155,809	39.590	6,168,478.310	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35,537	126.740	4,503,959.380	
BROWN & BROWN INC	20,308	47.190	958,334.520	
GARMIN LTD	12,365	114.180	1,411,835.700	
PPG INDUSTRIES INC	19,812	142.820	2,829,549.840	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	206.520	692,461.560	
COSTCO WHOLESALE CORP	37,048	366.620	13,582,537.760	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,161	136.900	2,623,140.900	
QUEST DIAGNOSTICS	10,883	120.710	1,313,686.930	
PROCTER & GAMBLE CO	207,673	140.260	29,128,214.980	
PROGRESSIVE CORP	49,891	92.650	4,622,401.150	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42,278	60.730	2,567,542.940	
PULTE GROUP INC	21,209	42.570	902,867.130	
GLOBAL PAYMENTS INC	24,956	193.470	4,828,237.320	
QUALCOMM INC	94,337	140.110	13,217,557.070	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10,744	85.810	921,942.640	
EXACT SCIENCES CORP	12,799	118.780	1,520,265.220	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,052	180.260	730,413.520	
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,411	559.220	4,703,599.420	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	5,042	118.000	594,956.000	
RESMED INC	12,197	212.110	2,587,105.670	
US BANCORP	113,752	44.140	5,021,013.280	
SEAGEN INC	10,296	171.780	1,768,646.880	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	34,383	35.220	1,210,969.260	
ROSS STORES INC	29,874	109.420	3,268,813.080	
ROLLINS INC	12,378	56.810	703,194.180	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8,746	400.980	3,506,971.080	
ROCKWELL AUTOMATION INC	9,811	249.050	2,443,429.550	

ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	14,075	73.730	1,037,749.750	
RPM INTERNATIONAL INC	11,004	90.140	991,900.560	
ACCENTURE PLC-CL A	53,439	238.710	12,756,423.690	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	119,245	57.090	6,807,697.050	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10,744	202.010	2,170,395.440	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	21,167	136.360	2,886,332.120	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	51,606	144.360	7,449,842.160	
BOOKING HOLDINGS INC	3,430	2,007.440	6,885,519.200	
SCHLUMBERGER LTD	118,219	18.310	2,164,589.890	
SCHWAB (CHARLES) CORP	127,865	46.420	5,935,493.300	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17,440	150.160	2,618,790.400	
BUNGE LTD	13,304	58.810	782,408.240	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	55.420	590,389.260	
ANTHEM INC	21,162	328.560	6,952,986.720	
AMERISOURCEBERGEN CORP	12,641	110.080	1,391,521.280	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,175	47.240	1,047,547.000	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,848	722.410	4,947,063.680	
CENTENE CORP	48,565	71.120	3,453,942.800	
SVB FINANCIAL GROUP	4,532	336.550	1,525,244.600	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	54.750	621,467.250	
SNAP-ON INC	4,129	172.670	712,954.430	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	33,814	75.450	2,551,266.300	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	155.420	967,644.920	
EDISON INTERNATIONAL	31,683	62.720	1,987,157.760	
SOUTHERN CO	89,102	64.170	5,717,675.340	
TRUIST FINANCIAL CORP	112,243	49.040	5,504,396.720	
SOUTHWEST AIRLINES	11,791	44.810	528,354.710	
AT&T INC	598,286	28.850	17,260,551.100	
CHEVRON CORP	158,783	83.070	13,190,103.810	
STANLEY BLACK & DECKER INC	13,127	178.790	2,346,976.330	
STATE STREET CORP	29,758	70.050	2,084,547.900	
STARBUCKS CORP	97,667	93.920	9,172,884.640	
STEEL DYNAMICS INC	17,547	33.910	595,018.770	
STRYKER CORP	28,236	230.570	6,510,374.520	
NETFLIX INC	36,888	480.240	17,715,093.120	
NORTONLIFELOCK INC	48,955	19.350	947,279.250	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	9,793	40.130	392,993.090	
SYNOPSIS INC	12,716	219.330	2,789,000.280	
SYSCO CORP	40,230	72.280	2,907,824.400	
INTUITIVE SURGICAL INC	9,747	749.500	7,305,376.500	

TELEFLEX INC	4,002	368.450	1,474,536.900	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	88,322	9.620	849,657.640	
TERADYNE INC	14,284	98.150	1,401,974.600	
TEXAS INSTRUMENTS INC	76,972	151.490	11,660,488.280	
TEXTRON INC	19,486	43.890	855,240.540	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	33,098	468.590	15,509,391.820	
TIFFANY & CO	8,733	131.170	1,145,507.610	
GLOBE LIFE INC	8,088	92.770	750,323.760	
DAVITA INC	6,497	107.170	696,283.490	
TRACTOR SUPPLY CO	9,573	129.830	1,242,862.590	
TRIMBLE INC	20,073	58.250	1,169,252.250	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,473	414.940	1,441,086.620	
TYSON FOODS INC	24,980	60.460	1,510,290.800	
UGI CORP	16,326	37.150	606,510.900	
UNION PACIFIC CORP	56,971	201.260	11,465,983.460	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	127,099	67.890	8,628,751.110	
UNITEDHEALTH GROUP INC	79,603	353.690	28,154,785.070	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	6,153	132.510	815,334.030	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7,226	173.300	1,252,265.800	
VF CORP	28,712	77.530	2,226,041.360	
VIACOMCBS INC	45,361	30.070	1,364,005.270	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,766	215.350	4,687,308.100	
VULCAN MATERIALS CO	11,057	140.020	1,548,201.140	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	62,849	42.350	2,661,655.150	
WALMART INC	118,990	145.560	17,320,184.400	
WASTE MANAGEMENT INC	35,061	123.380	4,325,826.180	
WATERS CORP	5,211	225.310	1,174,090.410	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,271	279.420	1,752,242.820	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,176	117.570	1,078,822.320	
VAIL RESORTS INC	3,109	260.320	809,334.880	
WESTERN DIGITAL CORP	25,867	41.270	1,067,531.090	
WABTEC CORP	16,257	69.010	1,121,895.570	
WHIRLPOOL CORP	5,029	183.050	920,558.450	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,165	137.240	1,944,004.600	
WYNN RESORTS LTD	8,639	96.660	835,045.740	
NASDAQ INC	10,097	127.130	1,283,631.610	
CME GROUP INC	30,562	168.710	5,156,115.020	
WILLIAMS COS INC	102,608	19.990	2,051,133.920	
LKQ CORP	23,691	37.010	876,803.910	
ALLIANT ENERGY CORP	19,435	56.960	1,107,017.600	
WEC ENERGY GROUP INC	26,631	104.850	2,792,260.350	

CARMAX INC	14,209	94.310	1,340,050.790	
XILINX INC	20,586	122.450	2,520,755.700	
TJX COMPANIES INC	100,155	62.260	6,235,650.300	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,227	345.020	1,458,399.540	
ZIONS BANCORP NA	13,142	38.980	512,275.160	
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	27,400	4.620	126,588.000	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.200	456,540.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,800	50.910	906,198.000	
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	17,100	23.370	399,627.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,381	125.050	1,173,094.050	
SIGNATURE BANK	4,171	101.510	423,398.210	
CBRE GROUP INC	29,617	56.530	1,674,249.010	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	20.690	263,425.080	
REGIONS FINANCIAL CORP	77,232	15.230	1,176,243.360	
DOMINO'S PIZZA INC	3,212	381.670	1,225,924.040	
T-MOBILE US INC	46,391	121.720	5,646,712.520	
LAS VEGAS SANDS CORP	27,755	58.570	1,625,610.350	
MOSAIC CO/THE	28,249	17.620	497,747.380	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,209	525.040	1,684,853.360	
CELANESE CORP	9,803	127.880	1,253,607.640	
DEXCOM INC	7,690	339.530	2,610,985.700	
DISCOVERY INC-A	10,423	22.920	238,895.160	
EXPEDIA GROUP INC	11,508	122.750	1,412,607.000	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	30.110	556,282.250	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,614	183.170	1,944,166.380	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	20.120	684,542.760	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	46,643	98.000	4,571,014.000	
LIVE NATION	13,804	65.260	900,849.040	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,229	1,243.050	2,770,758.450	
TRANSDIGM GROUP INC	4,416	574.380	2,536,462.080	
MASTERCARD INC	74,970	334.780	25,098,456.600	
WESTERN UNION CO	35,367	21.660	766,049.220	
OWENS CORNING	8,324	68.230	567,946.520	
LEIDOS HOLDINGS INC	11,057	94.940	1,049,751.580	
AERCAP HOLDINGS NV	8,807	34.780	306,307.460	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	18.100	314,035.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	9,176	146.250	1,341,990.000	

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	40,369	12.960	523,182.240	
DELTA AIR LINES INC	11,158	37.040	413,292.320	
INSULET CORP	5,566	260.000	1,447,160.000	
DISCOVER FINANCIAL	24,889	76.340	1,900,026.260	
TE CONNECTIVITY LTD	27,872	106.880	2,978,959.360	
MASIMO CORP	4,505	243.040	1,094,895.200	
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	16,401	51.500	844,651.500	
LULULEMON ATHLETICA INC	10,304	322.190	3,319,845.760	
VMWARE INC	6,532	139.950	914,153.400	
MERCADOLIBRE INC	3,718	1,226.030	4,558,379.540	
ULTA BEAUTY INC	4,538	265.490	1,204,793.620	
INVESCO LTD	33,443	14.530	485,926.790	
MSCI INC	7,090	379.820	2,692,923.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,662	74.750	9,766,984.500	
VISA INC	141,564	213.310	30,197,016.840	
KEURIG DR PEPPER INC	30,182	28.380	856,565.160	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,412	163.510	2,520,016.120	
DISCOVERY INC-C	30,421	20.725	630,475.220	
MARATHON PETROLEUM CORP	55,102	37.640	2,074,039.280	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	11,744	79.700	935,996.800	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	172,897	12.890	2,228,642.330	
XYLEM INC	15,151	95.110	1,441,011.610	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	22,598	81.370	1,838,799.260	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	161.540	562,805.360	
SPLUNK INC	13,312	187.880	2,501,058.560	
EPAM SYSTEMS INC	4,783	312.600	1,495,165.800	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	43.960	651,223.440	
HCA HEALTHCARE INC	22,479	152.110	3,419,280.690	
VERISK ANALYTICS INC	12,967	195.100	2,529,861.700	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	4,273	150.620	643,599.260	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,095	279.030	1,979,717.850	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	13,975	134.840	1,884,389.000	
NXP SEMICONDUCTOR NV	23,392	140.240	3,280,494.080	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	86.590	1,010,245.530	
LEAR CORP	4,681	137.390	643,122.590	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	8,622	86.040	741,836.880	

SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	64.170	1,298,993.310	
DOLLAR GENERAL CORP	20,975	210.560	4,416,496.000	
FORTINET INC	10,939	111.300	1,217,510.700	
TESLA INC	62,231	410.360	25,537,113.160	
GENERAL MOTORS CO	108,381	41.080	4,452,291.480	
XPO LOGISTICS INC	7,614	101.920	776,018.880	
ALLY FINANCIAL INC	30,122	29.120	877,152.640	
VOYA FINANCIAL INC	10,273	54.040	555,152.920	
APTIV PLC	22,755	108.840	2,476,654.200	
PHILLIPS 66	37,121	58.140	2,158,214.940	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	108.740	779,883.280	
FACEBOOK INC	201,747	272.430	54,961,935.210	
IQVIA HOLDINGS INC	16,071	166.000	2,667,786.000	
DIAMONDBACK ENERGY INC	16,000	33.725	539,600.000	
SERVICENOW INC	15,964	481.280	7,683,153.920	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,043	242.720	1,952,196.960	
WORKDAY INC	14,623	213.900	3,127,859.700	
ABBVIE INC	147,971	98.870	14,629,892.770	
ZOETIS INC	39,683	162.560	6,450,868.480	
NEWS CORP/NEW-CL A	30,263	16.270	492,379.010	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	14,075	44.180	621,833.500	
CDW CORP	11,563	137.530	1,590,259.390	
HOWMET AEROSPACE INC	30,749	23.000	707,227.000	
TWILIO INC	10,273	266.260	2,735,288.980	
COUPA SOFTWARE INC	5,637	275.190	1,551,246.030	
SNAP INC	75,279	38.540	2,901,252.660	
TRADE DESK INC A	3,466	707.280	2,451,432.480	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	19,546	41.150	804,317.900	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	39.390	327,882.360	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	39.680	563,654.400	
OKTA INC	9,766	213.340	2,083,478.440	
BLACK KNIGHT INC	13,042	91.640	1,195,168.880	
BAKER HUGHES CO	51,005	17.600	897,688.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	76.460	1,007,819.260	
ALTICE USA INC-A	28,646	29.820	854,223.720	
BROADCOM INC	33,475	363.130	12,155,776.750	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	6,207	277.010	1,719,401.070	
MONGODB INC	4,188	230.060	963,491.280	
BURLINGTON STORES INC	5,602	233.480	1,307,954.960	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	35,824	31.210	1,118,067.040	
VEEVA SYSTEMS INC	11,332	264.150	2,993,347.800	
TWITTER INC	66,138	42.410	2,804,912.580	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	13,214	46.840	618,943.760	
EVERGY INC	18,388	58.590	1,077,352.920	
ALLEGION PLC	7,469	115.150	860,055.350	
STERIS PLC	7,390	189.480	1,400,257.200	

DOCUSIGN INC	14,553	198.310	2,886,005.430	
WIX.COM LTD	4,454	244.170	1,087,533.180	
DROPBOX INC	17,573	18.470	324,573.310	
KKR & CO INC	43,097	38.380	1,654,062.860	
PERRIGO CO PLC	10,553	48.510	511,926.030	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	13,341	376.010	5,016,349.410	
MODERNA INC	23,007	76.050	1,749,682.350	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	24,001	104.240	2,501,864.240	
ARAMARK	18,632	36.180	674,105.760	
CIGNA CORP	30,953	220.200	6,815,850.600	
DELL TECHNOLOGIES INC	20,586	64.610	1,330,061.460	
DOW INC	61,890	53.460	3,308,639.400	
AMCOR PLC	130,000	11.860	1,541,800.000	
PINTEREST INC	34,445	55.670	1,917,553.150	
PELOTON INTERACTIVE INC	16,480	105.210	1,733,860.800	
FOX CORP-A	31,751	26.850	852,514.350	
FOX CORP-B	13,009	26.700	347,340.300	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	12,052	123.500	1,488,422.000	
AVANTOR INC	36,868	26.120	962,992.160	
DYNATRACE INC	15,949	34.360	548,007.640	
TRADEWEB MARKETS INC	7,065	57.930	409,275.450	
CARRIER GLOBAL CORP	69,248	37.810	2,618,266.880	
OTIS WORLDWIDE CORP	34,448	65.740	2,264,611.520	
UBER TECHNOLOGIES INC	79,977	47.000	3,758,919.000	
CORTEVA INC	62,843	36.230	2,276,801.890	
MATCH GROUP INC	20,510	132.220	2,711,832.200	
SLACK TECHNOLOGIES INC	32,512	24.100	783,539.200	
BLACKSTONE GROUP INC	55,746	57.110	3,183,654.060	
CARLYLE GROUP INC	12,509	27.990	350,126.910	
DATADOG INC	11,247	92.600	1,041,472.200	
INGERSOLL RAND INC	28,361	42.750	1,212,432.750	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,330	377.680	1,635,354.400	
AON PLC	19,716	200.080	3,944,777.280	
IAC/INTERACTIVECORP	6,364	133.180	847,557.520	
SNOWFLAKE INC	2,357	235.680	555,497.760	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	257.400	1,297,810.800	
IHS MARKIT LTD	32,101	91.280	2,930,179.280	
FNF GROUP	21,372	33.950	725,579.400	
CATALENT INC	13,173	99.940	1,316,509.620	
SYNCHRONY FINANCIAL	45,491	29.610	1,346,988.510	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34,959	32.800	1,146,655.200	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	95.650	330,662.050	
CDK GLOBAL INC	9,969	49.370	492,169.530	
WAYFAIR INC	5,543	242.710	1,345,341.530	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	15,869	112.000	1,777,328.000	

	QORVO INC	10,168	140.930	1,432,976.240	
	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,947	147.800	435,566.600	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	8,307	148.280	1,231,761.960	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	17,018	28.040	477,184.720	
	GODADDY INC	14,540	70.180	1,020,417.200	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	26,204	15.310	401,183.240	
	TRANSUNION	16,760	91.830	1,539,070.800	
	SQUARE INC	30,291	172.000	5,210,052.000	
	DUPONT DE NEMOURS INC	61,404	61.760	3,792,311.040	
	COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	18,296	40.700	744,647.200	
	TELADOC HEALTH INC	8,801	172.440	1,517,644.440	
	WESTROCK CO	22,778	41.730	950,525.940	
	KRAFT HEINZ CO	56,879	30.480	1,733,671.920	
	FORTIVE CORP	25,981	69.800	1,813,473.800	
	WASTE CONNECTIONS INC	22,342	107.080	2,392,381.360	
	ALPHABET INC-CL A	25,136	1,737.720	43,679,329.920	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	105,599	9.910	1,046,486.090	
	PAYPAL HOLDINGS INC	93,493	183.360	17,142,876.480	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	24.710	871,694.670	
	SUNRUN INC	10,000	53.590	535,900.000	
	ZILLOW GROUP INC-C	12,061	100.390	1,210,803.790	
	ALPHABET INC-CL C	25,431	1,740.390	44,259,858.090	
	BEIGENE LTD ADR	3,159	282.510	892,449.090	
	ZSCALER INC	6,193	127.760	791,217.680	
	CABLE ONE INC	392	1,885.220	739,006.240	
	LINDE PLC	43,894	262.040	11,501,983.760	
	ATHENE HOLDING LTD	11,847	40.910	484,660.770	
	ROKU INC	8,597	216.980	1,865,377.060	
	AVALARA INC	6,312	150.870	952,291.440	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,030	626.880	7,541,366.400	
	VISTRA CORP	38,032	20.180	767,485.760	
アメリカ・ドル	小計	26,086,356		2,581,698,847.420 (271,465,633,806)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	31,798	11.220	356,773.560	
	ASHTED GROUP	38,916	31.700	1,233,637.200	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	24.940	547,009.020	
	BHP GROUP PLC	176,526	16.642	2,937,745.690	
	BARCLAYS PLC	1,493,804	1.344	2,007,672.570	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	82,283	6.084	500,609.770	
	BT GROUP PLC	723,199	1.192	862,053.200	
	BUNZL PLC	28,834	24.150	696,341.100	
	AVIVA PLC	318,596	3.155	1,005,170.380	

CRODA INTERNATIONAL	10,391	66.600	692,040.600	
DIAGEO PLC	195,420	29.765	5,816,676.300	
SCHRODERS PLC	11,354	30.350	344,593.900	
DCC PLC	7,898	55.800	440,708.400	
NATIONAL GRID PLC	290,859	9.442	2,746,290.670	
KINGFISHER PLC	165,680	2.759	457,111.120	
BAE SYSTEMS PLC	273,749	4.636	1,269,100.360	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	194,304	26.920	5,230,663.680	
HALMA PLC	31,901	24.500	781,574.500	
NEXT PLC	11,467	67.580	774,939.860	
IMPERIAL BRANDS PLC	78,235	13.365	1,045,610.770	
JOHNSON MATTHEY PLC	15,017	24.560	368,817.520	
ANGLO AMERICAN PLC	107,554	20.845	2,241,963.130	
COMPASS GROUP PLC	149,561	14.445	2,160,408.640	
HSBC HOLDINGS PLC	1,709,168	3.739	6,390,579.150	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	514,692	2.323	1,195,629.510	
UNILEVER PLC	98,261	46.810	4,599,597.410	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.666	383,533.190	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,487	8.980	489,293.260	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	80,864	6.526	527,718.460	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	20.700	645,136.200	
PEARSON PLC	65,009	6.022	391,484.190	
PERSIMMON PLC	28,126	26.820	754,339.320	
PRUDENTIAL PLC	217,400	12.670	2,754,458.000	
RIO TINTO PLC	93,813	47.755	4,480,039.810	
VODAFONE GROUP PLC	2,224,388	1.166	2,593,636.400	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	59,219	69.380	4,108,614.220	
RELX PLC	165,948	18.030	2,992,042.440	
RENTOKIL INITIAL PLC	146,366	5.308	776,910.720	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	670,969	1.070	717,936.830	
NATWEST GROUP PLC	423,054	1.416	599,044.460	
ST JAMES'S PLACE PLC	39,914	11.020	439,852.280	
SSE PLC	88,646	13.500	1,196,721.000	
BP PLC	1,692,291	2.417	4,090,267.340	
SAGE GROUP PLC(THE)	87,111	6.838	595,665.010	
SMITHS GROUP PLC	31,720	15.420	489,122.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	114.050	749,764.700	
STANDARD CHARTERED PLC	220,443	4.175	920,349.520	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,109,041	0.321	1,961,002.160	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.455	504,585.270	
TESCO PLC	816,229	2.186	1,784,276.590	

3I GROUP PLC	77,445	10.450	809,300.250		
SMITH & NEPHEW PLC	76,928	15.835	1,218,154.880		
GLAXOSMITHKLINE PLC	420,949	14.676	6,177,847.520		
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	26,272	82.620	2,170,592.640		
WPP PLC	111,598	7.558	843,457.680		
ASTRAZENECA PLC	110,084	85.300	9,390,165.200		
WHITBREAD PLC	18,594	26.890	499,992.660		
INTERTEK GROUP PLC	13,842	60.300	834,672.600		
BURBERRY GROUP PLC	31,686	16.135	511,253.610		
INTERCONTINENTAL HOTELS	13,315	46.270	616,085.050		
SAINSBURY (J) PLC	137,215	2.057	282,251.250		
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	28.050	445,798.650		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,581	45.350	525,198.350		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	346,240	11.792	4,082,862.080		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	309,765	11.298	3,499,724.970		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	13,010	24.930	324,339.300		
AVEVA GROUP PLC	5,704	41.100	234,434.400		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.670	550,855.710		
EXPERIAN PLC	75,976	30.180	2,292,955.680		
MONDI PLC	39,767	16.970	674,845.990		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	28,011	15.770	441,733.470		
OCADO GROUP PLC	39,210	21.640	848,504.400		
INFORMA PLC	120,480	5.708	687,699.840		
GLENCORE PLC	836,468	1.875	1,568,377.500		
GVC HOLDINGS PLC	49,618	9.852	488,836.530		
EVRAZ PLC	48,765	3.754	183,063.810		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.850	321,177.900		
COCA-COLA HBC AG	15,208	21.370	324,994.960		
FERGUSON PLC	18,896	80.000	1,511,680.000		
M&G PLC	204,940	1.807	370,326.580		
JD SPORTS FASHION PLC	32,086	7.974	255,853.760		
AUTO TRADER GROUP PLC	76,348	5.686	434,114.720		
MELROSE INDUSTRIES PLC	364,735	1.511	551,114.580		
イギリス・ポンド 小計	24,720,820		125,621,378.300 (17,514,132.563)		
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	22.030	2,254,968.770	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	17.600	2,300,372.800	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	389.000	684,640.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	10.770	1,099,983.180	
	ICL GROUP LTD	49,411	12.500	617,637.500	
	NICE LTD	4,902	789.900	3,872,089.800	

	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	75.400	787,477.600	
	AZRIELI GROUP	2,291	196.000	449,036.000	
イスラエル・シュケル 小計		404,004		12,066,205.650 (375,258,996)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	69.490	1,171,184.460	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	235,974	20.190	4,764,315.060	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	304,650	18.680	5,690,862.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	142,206	17.600	2,502,825.600	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	2.900	1,056,786.100	
	AMP LTD	302,414	1.695	512,591.730	
	ASX LTD	15,573	81.170	1,264,060.410	
	BHP GROUP LTD	247,453	36.030	8,915,731.590	
	AMPOL LTD	20,946	27.710	580,413.660	
	COMPUTERSHARE LT	38,040	13.550	515,442.000	
	CSL LIMITED	38,115	304.600	11,609,829.000	
	REA GROUP LTD	4,119	132.900	547,415.100	
	TRANSURBAN GROUP	230,892	14.960	3,454,144.320	
	COCA-COLA AMATIL LTD	52,693	12.710	669,728.030	
	COCHLEAR LTD	5,533	223.370	1,235,906.210	
	ORIGIN ENERGY LTD	132,860	4.690	623,113.400	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	149,393	72.400	10,816,053.200	
	RIO TINTO LIMITED	31,595	95.440	3,015,426.800	
	APA GROUP	94,106	10.790	1,015,403.740	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	32.730	1,692,697.410	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	177,176	5.190	919,543.440	
	TPG TELECOM LTD	28,719	7.660	219,987.540	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,839	36.210	1,442,570.190	
	ORICA LTD	41,311	16.560	684,110.160	
	CIMIC GROUP LTD	8,709	22.680	197,520.120	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	14.000	869,624.000	
	BLUESCOPE STEEL LTD	36,941	16.200	598,444.200	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	6.620	768,290.720	
	MACQUARIE GROUP LTD	28,020	139.180	3,899,823.600	
	SUNCORP GROUP LTD	117,454	9.150	1,074,704.100	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	269,278	21.260	5,724,850.280	
NEWCREST MINING LTD	66,127	29.490	1,950,085.230		
OIL SEARCH LTD	197,895	3.310	655,032.450		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	5.070	315,769.740		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	117,359	9.860	1,157,159.740		

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	63,404	14.910	945,353.640	
	SANTOS LTD	132,862	5.620	746,684.440	
	SONIC HEALTHCARE	40,148	34.600	1,389,120.800	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	26.660	224,103.960	
	TABCORP HOLDINGS LTD	205,649	3.970	816,426.530	
	WESFARMERS LTD	95,839	47.410	4,543,726.990	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	19.660	1,694,613.360	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	106,718	37.640	4,016,865.520	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	9,995	60.510	604,797.450	
	SEEK LTD	25,899	23.760	615,360.240	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.970	325,180.020	
	AGL ENERGY LTD	49,076	13.230	649,275.480	
	BRAMBLES LTD	127,166	10.680	1,358,132.880	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	9.550	313,822.550	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	5.780	814,771.920	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.950	593,092.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	9.050	521,886.350	
	AFTERPAY LTD	18,322	93.180	1,707,243.960	
	MEDIBANK PVT LTD	206,910	2.760	571,071.600	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.220	915,405.900	
	COLES GROUP LTD	109,456	17.690	1,936,276.640	
	WISETECH GLOBAL LTD	8,000	32.640	261,120.000	
	オーストラリア・ドル 小計	6,101,923		107,695,778.060 (8,243,034,853)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	20,578	95.490	1,964,993.220	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	72,789	45.840	3,336,647.760	
	BARRICK GOLD CORP	148,244	33.790	5,009,164.760	
	ATCO LTD	7,193	38.740	278,656.820	
	BANK OF MONTREAL	53,729	87.570	4,705,048.530	
	BANK OF NOVA SCOTIA	100,955	61.350	6,193,589.250	
	NATIONAL BANK OF CANADA	29,132	68.500	1,995,542.000	
	BCE INC	11,673	55.740	650,653.020	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	112,408	48.790	5,484,386.320	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	25.400	716,076.800	
	SAPUTO INC	18,601	34.100	634,294.100	
	BLACKBERRY LTD	39,652	6.550	259,720.600	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	46,369	21.220	983,950.180	
	CGI INC	19,859	89.640	1,780,160.760	
	CCL INDUSTRIES INC	11,340	57.400	650,916.000	
	CAE INC	19,684	30.020	590,913.680	
	CAMECO CORP	32,627	12.570	410,121.390	
	ROGERS COMM-CL B	31,543	59.380	1,873,023.340	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	37,542	105.520	3,961,431.840	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	100,758	27.150	2,735,579.700	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	4,862	165.040	802,424.480	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,119	31.510	287,339.690	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	59,874	142.180	8,512,885.320	
YAMANA GOLD INC	84,317	7.030	592,748.510	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,911	31.780	505,651.580	
OPEN TEXT CORP	21,795	53.310	1,161,891.450	
EMPIRE CO LTD	15,093	36.300	547,875.900	
KINROSS GOLD CORP	99,741	10.080	1,005,389.280	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	87.730	874,053.990	
FORTIS INC	38,963	54.800	2,135,172.400	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	49,694	15.470	768,766.180	
TELUS CORP	31,890	24.590	784,175.100	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	29.340	740,835.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	22.040	474,785.680	
ENBRIDGE INC	168,466	39.650	6,679,676.900	
IGM FINANCIAL INC	6,069	33.180	201,369.420	
MANULIFE FINANCIAL CORP	162,090	21.980	3,562,738.200	
LOBLAW CO LTD	15,136	65.980	998,673.280	
MAGNA INTERNATIONAL INC	23,678	78.040	1,847,831.120	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,404	59.520	2,881,006.080	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,072	413.140	856,026.080	
METRO INC	20,760	62.150	1,290,234.000	
EMERA INC	18,876	56.380	1,064,228.880	
ONEX CORP	6,646	62.150	413,048.900	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	42.590	799,243.940	
POWER CORP OF CANADA	46,551	28.210	1,313,203.710	
QUEBECOR INC-B	16,042	33.330	534,679.860	
ROYAL BANK OF CANADA	119,582	99.400	11,886,450.800	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,496	426.910	4,907,757.360	
SHAW COMM INC-B	43,484	23.190	1,008,393.960	
SUNCOR ENERGY INC	130,806	19.070	2,494,470.420	
LUNDIN MINING CORP	43,480	8.720	379,145.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	19.420	796,530.720	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	108.680	1,635,525.320	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	151,245	64.480	9,752,277.600	
TC ENERGY CORP	78,459	55.710	4,370,950.890	
WESTON (GEORGE) LTD	6,184	99.610	615,988.240	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	133.250	1,667,623.750	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	36,085	57.650	2,080,300.250	

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,731	1,477.760	2,558,002.560	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	16,165	176.610	2,854,900.650	
	B2GOLD CORP	101,675	7.830	796,115.250	
	CI FINANCIAL CORP	20,285	16.490	334,499.650	
	KEYERA CORP	16,668	21.010	350,194.680	
	PARKLAND CORP	10,583	39.800	421,203.400	
	ALTAGAS LTD	23,944	17.930	429,315.920	
	PEMBINA PIPELINE CORP	43,740	30.780	1,346,317.200	
	DOLLARAMA INC	23,536	49.470	1,164,325.920	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	80,721	5.720	461,724.120	
	TMX GROUP LTD	5,058	125.400	634,273.200	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	21,840	57.570	1,257,328.800	
	INTER PIPELINE LTD	41,863	13.420	561,801.460	
	NUTRIEN LTD	47,550	55.030	2,616,676.500	
	CRONOS GROUP INC	16,000	9.490	151,840.000	
	SSR MINING INC	18,000	23.980	431,640.000	
	WSP GLOBAL INC	10,194	90.010	917,561.940	
	IA FINANCIAL CORP INC	8,104	56.860	460,793.440	
	AIR CANADA	10,722	20.120	215,726.640	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	76.210	1,918,662.960	
	SHOPIFY INC	8,980	1,154.970	10,371,630.600	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	30.890	575,604.260	
	HYDRO ONE LTD	27,340	29.650	810,631.000	
カナダ・ドル 小計		3,272,348		159,087,010.060 (12,825,594,751)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.770	471,250.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	155,700	24.400	3,799,080.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.070	257,348.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,944	19.990	118,820.560	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.000	620,100.000	
	CAPITALAND LTD	204,515	2.770	566,506.550	
	GENTING SINGAPORE LTD	426,800	0.735	313,698.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	4.860	655,614.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	271,653	9.430	2,561,687.790	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	676,822	2.220	1,502,544.840	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	160,850	3.910	628,923.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	102,400	21.260	2,177,024.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	6.990	283,095.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	19.260	404,460.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	142,300	4.300	611,890.000	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	188,800	0.965	182,192.000	
シンガポール・ドル 小計		2,762,484		15,154,234.240	

				(1,182,636,440)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	208,841	10.750	2,245,040.750	
	LOGITECH INTL-REG	14,429	71.600	1,033,116.400	
	NESTLE SA-REGISTERED	249,626	104.460	26,075,931.960	
	CIE FINANC RICHEMONT	43,922	75.460	3,314,354.120	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	58,925	305.250	17,986,856.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,467	243.400	843,867.800	
	SIKA INHABER	11,880	230.000	2,732,400.000	
	SGS SA-REG	492	2,595.000	1,276,740.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	186,615	77.320	14,429,071.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	148.600	632,887.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	265	1,994.000	528,410.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	18.060	360,820.740	
	SWISSCOM AG-REG	2,159	476.600	1,028,979.400	
	ABB LTD	152,415	24.840	3,785,988.600	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,944	53.920	697,940.480	
	GEBERIT AG	3,181	548.600	1,745,096.600	
	LONZA GROUP AG-REG	6,246	576.200	3,598,945.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	7,630.000	724,850.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	9	82,900.000	746,100.000	
	GIVAUDAN-REG	768	3,670.000	2,818,560.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	12,545	340.900	4,276,590.500	
	LAFARGEHOLCIM LTD	43,996	46.330	2,038,334.680	
	TEMENOS GROUP	5,723	113.400	648,988.200	
	SONOVA HOLDING AG	4,698	244.600	1,149,130.800	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,518	186.000	840,348.000	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,074.000	987,006.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,441	228.200	557,036.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	44.380	203,792.960	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	241.600	401,780.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	2,761	379.700	1,048,351.700	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	96.400	241,000.000	
	VIFOR PHARMA AG	3,465	125.300	434,164.500	
	EMS-CHEMIE HOLDING	633	825.500	522,541.500	
SWISS PRIME SITE AG	5,990	84.350	505,256.500		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,515	919.600	1,393,194.000		
JULIUS BAER GROUP LTD	17,849	48.960	873,887.040		
SWISS RE LTD	24,871	79.580	1,979,234.180		
ALCON INC	41,312	59.100	2,441,539.200		
UBS GROUP AG	306,864	12.480	3,829,662.720		
スイス・フラン 小計	1,469,372		110,977,796.980 (12,760,227,097)		
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	53,126	421.100	22,371,358.600	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	367.600	13,252,347.600	

ERICSSON LM-B SHS	245,215	99.820	24,477,361.300	
LUNDBERGS B	7,382	442.000	3,262,844.000	
SKF AB-B SHS	34,849	208.300	7,259,046.700	
SANDVIK AB	93,940	181.250	17,026,625.000	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	130,827	90.400	11,826,760.800	
SKANSKA AB-B SHS	31,653	212.400	6,723,097.200	
SWEDBANK AB	71,958	156.940	11,293,088.520	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	130.000	6,882,850.000	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	126,411	83.780	10,590,713.580	
VOLVO AB-B SHS	121,239	193.700	23,483,994.300	
SWEDISH MATCH AB	13,845	661.600	9,159,852.000	
TELE2 AB-B SHS	47,055	108.000	5,081,940.000	
INDUSTRIVARDEN C	11,403	249.500	2,845,048.500	
ELECTROLUX AB-SER B	19,191	199.100	3,820,928.100	
SECURITAS AB-B SHS	24,098	145.600	3,508,668.800	
INVESTOR AB-B SHS	37,641	589.600	22,193,133.600	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	68,814	175.000	12,042,450.000	
ASSA ABLOY AB-B	87,021	219.100	19,066,301.100	
TELIA CO AB	210,477	35.680	7,509,819.360	
LUNDIN ENERGY AB	14,739	202.300	2,981,699.700	
BOLIDEN AB	21,855	269.100	5,881,180.500	
ALFA LAVAL AB	23,343	197.000	4,598,571.000	
KINNEVIK AB-B	21,722	392.050	8,516,110.100	
ICA GRUPPEN AB	9,009	409.900	3,692,789.100	
HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	86.840	2,925,813.280	
NIBE INDUSTRIER AB	23,117	233.500	5,397,819.500	
HEXAGON AB	24,223	684.000	16,568,532.000	
EPIROC AB-A	60,750	143.800	8,735,850.000	
EPIROC AB-B	30,899	136.900	4,230,073.100	
ESSITY AB-B	52,143	269.000	14,026,467.000	
EQT AB	20,934	186.450	3,903,144.300	
EVOLUTION GAMING GROUP AB	10,916	637.000	6,953,492.000	
NORDEA BANK ABP	273,625	77.330	21,159,421.250	
INVESTMENT AB LATOUR	14,945	228.200	3,410,449.000	
スウェーデン・クローナ 小計	2,161,053		356,659,640.890 (4,354,814,215)	
デンマーク・クローネ				
CARLSBERG AS-B	8,656	949.200	8,216,275.200	
A P MOLLER A/S	568	10,755.000	6,108,840.000	
AP MOLLER MAERSK A	255	9,885.000	2,520,675.000	
DANSKE BANK A/S	59,305	99.040	5,873,567.200	
GENMAB A/S	5,641	2,299.000	12,968,659.000	
NOVOZYMES-B SHS	17,740	368.000	6,528,320.000	
NOVO NORDISK A/S-B	144,558	421.600	60,945,652.800	
GN STORE NORD A/S	10,133	461.700	4,678,406.100	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,538	1,134.000	18,754,092.000	
	COLOPLAST-B	9,511	929.400	8,839,523.400	
	DSV PANALPINA A S	17,560	1,021.000	17,928,760.000	
	DEMANT A/S	7,244	227.100	1,645,112.400	
	H LUNDBECK A/S	4,840	189.350	916,454.000	
	TRYG A/S	11,107	188.500	2,093,669.500	
	PANDORA A/S	8,251	579.400	4,780,629.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	640.200	5,976,907.200	
	AMBU A/S B	14,156	200.000	2,831,200.000	
	ORSTED A/S	15,500	1,079.500	16,732,250.000	
デンマーク・クローネ 小計		360,899		188,338,993.200 (3,143,377,797)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.600	837,717.600	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	29,894	15.500	463,357.000	
	A2 MILK CO LTD	55,091	15.330	844,545.030	
	FISHER & PAYKEL	49,044	32.430	1,590,496.920	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.720	753,420.560	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	5.830	359,909.220	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	6.145	762,975.490	
ニュージーランド・ドル 小計		589,774		5,612,421.820 (403,028,011)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	35,183	179.450	6,313,589.350	
	DNB ASA	80,709	151.800	12,251,626.200	
	NORSK HYDRO ASA	93,139	31.140	2,900,348.460	
	TELENOR ASA	63,038	153.350	9,666,877.300	
	ORKLA ASA	65,283	87.540	5,714,873.820	
	EQUINOR ASA	83,149	135.400	11,258,374.600	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	356.400	5,414,785.200	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	191.000	3,186,453.000	
	ADEVINTA ASA	22,265	141.700	3,154,950.500	
	SCHIBSTED ASA	7,445	320.000	2,382,400.000	
ノルウェー・クローネ 小計		482,087		62,244,278.430 (727,013,172)	
ユーロ	CRH PLC	66,036	33.940	2,241,261.840	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,105	143.200	1,876,636.000	
	KERRY GROUP PLC-A	13,475	116.600	1,571,185.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	76.950	1,035,131.400	
	UMICORE	17,654	34.240	604,472.960	
	AIR LIQUIDE	39,352	141.150	5,554,534.800	
	AIRBUS SE	49,650	87.920	4,365,228.000	
	AXA SA	162,082	18.068	2,928,497.570	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	44,117	18.860	832,046.620	
	ADIDAS AG	15,912	281.500	4,479,228.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	13.470	1,314,254.430	

DASSAULT AVIATION SA	295	889.000	262,255.000	
DANONE	51,855	54.060	2,803,281.300	
SAFRAN SA	26,914	118.750	3,196,037.500	
INTESA SANPAOLO	1,394,419	1.844	2,571,308.630	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	28,642	69.500	1,990,619.000	
ACCOR SA	17,380	28.520	495,677.600	
BOUYGUES	17,572	33.320	585,499.040	
BNP PARIBAS	93,396	42.200	3,941,311.200	
THALES SA	8,549	73.460	628,009.540	
CAPGEMINI SA	13,568	114.800	1,557,606.400	
UNICREDIT SPA	173,574	8.140	1,412,892.360	
NATIXIS	70,166	2.409	169,029.890	
KONINKLIJKE DSM NV	14,438	141.150	2,037,923.700	
COMMERZBANK AG	83,118	4.941	410,686.030	
EIFFAGE	6,494	83.100	539,651.400	
FRESENIUS SE & CO KGAA	34,713	37.700	1,308,680.100	
UNITED INTERNET	9,882	29.980	296,262.360	
FUCHS PETROLUB SE PEF	5,546	46.400	257,334.400	
PUBLICIS GROUPE	18,595	36.630	681,134.850	
FAURECIA	6,117	37.540	229,632.180	
IBERDROLA SA	499,273	11.060	5,521,959.380	
ENI SPA	219,331	7.678	1,684,023.410	
JERONIMO MARTINS	19,517	13.990	273,042.830	
KBC GROUPE	21,038	54.000	1,136,052.000	
HANNOVER RUECK SE	4,868	150.100	730,686.800	
WARTSILA OYJ	34,935	7.960	278,082.600	
L'OREAL	21,014	315.400	6,627,815.600	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	23,231	474.000	11,011,494.000	
GEA GROUP AG	11,838	28.380	335,962.440	
BOLLORE	71,347	3.410	243,293.270	
MEDIOBANCA SPA	57,442	7.280	418,177.760	
MICHELIN(CGDE) -B	14,802	103.700	1,534,967.400	
CONTINENTAL AG	8,803	107.050	942,361.150	
DEUTSCHE POST AG-REG	83,086	38.540	3,202,134.440	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	25.830	547,750.980	
OMV AG	12,817	25.960	332,729.320	
VERBUND AG	4,908	53.650	263,314.200	
PERNOD-RICARD	17,811	160.100	2,851,541.100	
PEUGEOT SA	47,343	18.395	870,874.480	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	12,649	54.400	688,105.600	
RENAULT SA	14,917	27.815	414,916.350	
REPSOL SA	124,165	7.646	949,365.590	
REMY COINTREAU	1,860	151.800	282,348.000	
MERCK KGAA	10,841	129.000	1,398,489.000	

COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	44,560	38.900	1,733,384.000	
RWE AG	53,941	32.630	1,760,094.830	
SEB SA	1,551	141.800	219,931.800	
SOCIETE GENERALE-A	69,595	16.202	1,127,578.190	
VINCI S.A.	43,513	88.060	3,831,754.780	
SODEXO	7,075	72.820	515,201.500	
SOFINA	1,382	250.000	345,500.000	
SOLVAY SA	5,563	87.200	485,093.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	45,834	119.050	5,456,537.700	
VIVENDI SA	70,995	25.480	1,808,952.600	
SAP SE	87,580	99.090	8,678,302.200	
TELEFONICA S.A	403,880	3.386	1,367,537.680	
TOTAL SE	206,028	33.055	6,810,255.540	
VALEO	19,653	31.000	609,243.000	
E.ON SE	188,262	9.378	1,765,521.030	
VOEST-ALPINE AG	9,875	25.460	251,417.500	
HENKEL AG & CO KGAA	8,602	84.850	729,879.700	
SIEMENS AG-REG	63,902	118.400	7,565,996.800	
UPM-KYMMENE OYJ	44,829	26.700	1,196,934.300	
ING GROEP NV-CVA	329,234	7.461	2,456,414.870	
PUMA AG	7,534	79.840	601,514.560	
BAYER AG	84,197	47.590	4,006,935.230	
STORA ENSO OYJ-R SHS	53,250	13.890	739,642.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	14,859	92.980	1,381,589.820	
DAIMLER AG	72,434	53.000	3,839,002.000	
BASF SE	76,828	57.520	4,419,146.560	
BEIERSDORF AG	8,371	99.460	832,579.660	
HOCHTIEF AG	1,707	78.100	133,316.700	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,031	58.340	701,888.540	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	17,842	73.300	1,307,818.600	
ORANGE	169,379	10.035	1,699,718.260	
SAMPO OYJ-A SHS	40,512	37.710	1,527,707.520	
RANDSTAD NV	9,362	51.280	480,083.360	
ALLIANZ SE	35,019	192.520	6,741,857.880	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,662	4.357	1,039,850.330	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	92,201	22.930	2,114,168.930	
HERMES INTL	2,667	833.000	2,221,611.000	
ENDESA S.A.	27,736	24.130	669,269.680	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	9.548	267,248.520	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	21.780	527,163.120	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	11,715	243.100	2,847,916.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	61,594	13.440	827,823.360	
DASSAULT SYSTEMES SA	11,280	149.450	1,685,796.000	

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,395	25.780	551,563.100	
HEINEKEN NV	22,683	93.140	2,112,694.620	
AKZO NOBEL	16,208	85.360	1,383,514.880	
ASML HOLDING NV	35,438	340.700	12,073,726.600	
AEGON NV	150,349	2.905	436,763.840	
BANKINTER S.A.	57,960	4.129	239,316.840	
VOLKSWAGEN AG	2,758	158.000	435,764.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	15,599	149.820	2,337,042.180	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	578,251	3.091	1,787,373.840	
KERING	6,306	611.000	3,852,966.000	
CNP ASSURANCES	13,987	12.000	167,844.000	
FORTUM OYJ	39,409	17.535	691,036.810	
AGEAS	14,365	39.460	566,842.900	
UCB SA	10,571	96.100	1,015,873.100	
NEMETSCHEK SE	5,095	62.350	317,673.250	
THYSSENKRUPP AG	27,110	5.018	136,037.980	
CARREFOUR SA	49,926	14.080	702,958.080	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	18.370	433,752.440	
ATOS SE	8,972	64.900	582,282.800	
NOKIA OYJ	476,230	3.111	1,481,551.530	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	76,388	44.650	3,410,724.200	
WOLTERS KLUWER-CVA	23,137	73.740	1,706,122.380	
SANOFI	94,862	84.690	8,033,862.780	
STMICROELECTRONICS NV	54,176	28.640	1,551,600.640	
ELISA OYJ	10,787	45.320	488,866.840	
BANCO SANTANDER SA	1,418,804	2.313	3,281,693.650	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	34,596	16.215	560,974.140	
QIAGEN N.V.	17,974	38.760	696,672.240	
DEUTSCHE BANK AG-REG	165,949	9.063	1,503,995.780	
BMW VORZUG	4,116	51.750	213,003.000	
ENEL SPA	675,152	8.047	5,432,948.140	
COLRUYT NV	4,673	48.380	226,079.740	
VOPAK (KON.)	5,364	44.400	238,161.600	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	285,762	14.775	4,222,133.550	
SARTORIUS AG	3,044	351.800	1,070,879.200	
LEONARDO SPA	28,316	5.420	153,472.720	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	73.620	565,843.320	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	105,299	26.180	2,756,727.820	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	114.300	431,025.300	
KONINKLIJKE KPN NV	291,029	2.445	711,565.900	
EUROFINS SCIENTIFIC	1,133	695.000	787,435.000	
TELEPERFORMANCE	4,699	269.500	1,266,380.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	15,851	129.000	2,044,779.000	
EURAZEO	2,748	50.000	137,400.000	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	80.000	792,320.000	

FRAPORT AG	3,149	48.540	152,852.460	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	81.350	813,825.400	
INDITEX	92,847	27.270	2,531,937.690	
JC DECAUX SA	6,058	18.840	114,132.720	
ANDRITZ AG	6,265	33.800	211,757.000	
MAPFRE SA	84,474	1.606	135,665.240	
ESSILORLUXOTTICA	23,967	120.000	2,876,040.000	
SNAM SPA	171,294	4.530	775,961.820	
CREDIT AGRICOLE SA	98,685	8.848	873,164.880	
ORPEA	4,932	109.050	537,834.600	
ENAGAS	23,477	19.845	465,901.060	
WENDEL	2,220	91.650	203,463.000	
TENARIS SA	36,959	5.594	206,748.640	
TELECOM ITALIA SPA	762,675	0.335	255,496.120	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.342	170,177.830	
ATLANTIA SPA	37,690	15.520	584,948.800	
ILIAD SA	1,046	168.600	176,355.600	
PROXIMUS	13,739	17.005	233,631.690	
SES FDR	28,847	7.992	230,545.220	
TERNA SPA	113,654	6.174	701,699.790	
BIOMERIEUX	3,248	114.000	370,272.000	
GRIFOLS SA	23,518	26.180	615,701.240	
FERROVIAL SA	40,192	23.450	942,502.400	
LANXESS AG	6,856	51.560	353,495.360	
NESTE OYJ	36,796	53.220	1,958,283.120	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9,641	15.270	147,218.070	
RECORDATI SPA	10,303	44.480	458,277.440	
GALAPAGOS NV	3,426	102.950	352,706.700	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	9.590	530,365.360	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,168	202.000	841,936.000	
KONE OYJ	28,383	73.360	2,082,176.880	
ELIA GROUP	2,862	90.200	258,152.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	299.600	715,145.200	
ENGIE	154,115	11.975	1,845,527.120	
ALSTOM	15,712	44.600	700,755.200	
TELENET GROUP HOLDING NV	3,634	33.560	121,957.040	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	10.980	601,462.440	
IPSEN SA	3,646	83.900	305,899.400	
DEUTSCHE WOHNEN	29,097	41.360	1,203,451.920	
ARKEMA SA	6,393	91.360	584,064.480	
LEGRAND SA	21,521	71.960	1,548,651.160	
UNILEVER NV	122,376	52.020	6,365,999.520	
ADP	2,313	113.100	261,600.300	
ORION OYJ	8,051	38.970	313,747.470	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	8.874	355,740.910	
SYMRISE AG	11,308	102.800	1,162,462.400	

SCOR SE	15,667	29.000	454,343.000	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	17,397	36.220	630,119.340	
PRYSMIAN SPA	22,328	25.020	558,646.560	
DIASORIN SPA	2,223	166.000	369,018.000	
CAIXABANK	307,331	2.036	625,725.910	
BUREAU VERITAS SA	23,179	21.240	492,321.960	
GETLINK	37,646	14.420	542,855.320	
SUEZ SA	26,620	16.085	428,182.700	
AMADEUS IT GROUP SA	38,173	58.020	2,214,797.460	
BRENTAG AG	12,353	57.900	715,238.700	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	23.650	404,793.400	
EDENRED	19,188	47.000	901,836.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.302	226,482.270	
LEG IMMOBILIEN AG	5,934	114.920	681,935.280	
KION GROUP AG	5,903	71.040	419,349.120	
VONOVIA SE	43,096	55.380	2,386,656.480	
KNORR-BREMSE AG	6,860	102.860	705,619.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	21,468	39.020	837,681.360	
FERRARI NV	10,596	173.100	1,834,167.600	
METRO AG	10,774	8.542	92,031.500	
CNH INDUSTRIAL NV	77,951	8.086	630,311.780	
AROUNDTOWN SA	83,054	5.236	434,870.740	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	33.380	270,110.960	
MONCLER SPA	17,567	39.710	697,585.570	
NEXI SPA	33,176	14.810	491,336.560	
TEAMVIEWER AG	11,117	37.160	413,107.720	
PROSUS NV	40,543	89.380	3,623,733.340	
FERROVIAL SA-RTS	40,192	0.234	9,404.920	
SIEMENS ENERGY AG	31,959	20.500	655,159.500	
WORLDLINE SA	20,129	73.560	1,480,689.240	
NN GROUP NV	25,274	34.130	862,601.620	
FINECOBANK SPA	53,818	12.040	647,968.720	
ARGENX SE	3,879	214.800	833,209.200	
ZALANDO SE	13,039	76.420	996,440.380	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	94,487	12.220	1,154,631.140	
AENA SME SA	5,338	148.200	791,091.600	
CELLNEX TELECOM SAU	27,234	51.160	1,393,291.440	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	10,836	90.960	985,642.560	
ABN AMRO BANK NV	34,251	8.704	298,120.700	
EXOR NV	7,971	53.980	430,274.580	
ALTICE EUROPE NV	56,763	4.285	243,229.450	
SCOUT24 AG	9,670	66.300	641,121.000	
COVESTRO AG	16,337	44.870	733,041.190	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	63,579	56.730	3,606,836.670	
POSTE ITALIANE SPA	40,015	8.046	321,960.690	

	AMUNDI SA	4,119	66.650	274,531.350	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	10.050	234,607.200	
	ADYEN NV	1,516	1,548.000	2,346,768.000	
	PIRELLI & C SPA	34,086	4.233	144,286.030	
	UNIPER SE	18,203	26.700	486,020.100	
	DELIVERY HERO SE	10,974	107.150	1,175,864.100	
ユーロ 小計		16,075,795		337,716,563.980 (41,974,791,737)	
香港・ドル	ASM PACIFIC TECH	32,900	79.900	2,628,710.000	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	20.800	3,411,200.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	15.120	1,570,363.200	
	CLP HOLDINGS LTD	134,500	72.550	9,757,975.000	
	PCCW LTD	331,000	4.720	1,562,320.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	39.450	1,952,775.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	100,340	380.600	38,189,404.000	
	MTR CORP	126,000	40.200	5,065,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	131.800	8,659,260.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	30.700	3,544,315.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	134,500	40.900	5,501,050.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	913,292	11.640	10,630,718.880	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	177,000	61.250	10,841,250.000	
	KERRY PROPERTIES LTD	68,500	21.150	1,448,775.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	24.150	7,667,625.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	121,066	39.750	4,812,373.500	
	SINO LAND CO	255,400	9.680	2,472,272.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	108,500	104.000	11,284,000.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	40.750	2,017,125.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	116,500	99.950	11,644,175.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	9.630	1,502,280.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	13.700	1,704,280.000	
	AIA GROUP LTD	1,016,027	87.000	88,394,349.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	289,000	10.000	2,890,000.000	
	SANDS CHINA LTD	198,800	32.600	6,480,880.000	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	66,000	30.600	2,019,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.200	2,417,440.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	39.250	5,877,687.500	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.940	1,826,200.000	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	25.450	3,832,770.000	
	WH GROUP LTD	731,500	6.650	4,864,475.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	228,332	51.800	11,827,597.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	40.800	9,173,145.600	
香港・ドル	小計	7,154,449		287,471,591.280 (3,898,114,778)	
合計		91,641,364		378,867,658,216 (378,867,658,216)	

(2) 株式以外の有価証券

2020年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益 証券	オーストラリ ア・ドル	DEXUS	84,575.000	825,452.000		
		GOODMAN GROUP	134,222.000	2,456,262.600		
		GPT GROUP	158,232.000	745,272.720		
		MIRVAC GROUP	329,418.000	856,486.800		
		SCENTRE GROUP	420,268.000	1,159,939.680		
		STOCKLAND	194,018.000	847,858.660		
		VICINITY CENTRES	270,443.000	447,583.160		
		オーストラリア・ドル	小計	1,591,176.000	7,338,855.620 (561,716,009)	
	シンガポール・ ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	933,413.140		
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	347,536.000	688,121.280		
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	384,600.000		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	182,300.000	357,308.000		
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192,100.000	284,308.000		
		シンガポール・ドル	小計	1,206,842.000	2,647,750.420 (206,630,443)	
	投資信託受益証券 合計			2,798,018	768,346,452 (768,346,452)	
	投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	683,976.080	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT			10,713.000	1,732,934.880		
AMERICAN TOWER CORP			37,134.000	8,629,198.920		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT			127,559.000	970,723.990		
AVALONBAY COMMUNITIES INC			12,329.000	2,117,998.910		
BOSTON PROPERTIES INC			12,947.000	1,197,985.910		
CAMDEN PROPERTY TRUST			7,601.000	770,741.400		
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP			34,807.000	5,583,738.940		

DIGITAL REALTY TRUST INC		22,230.000	3,019,278.600	
DUKE REALTY TRUST		31,929.000	1,263,430.530	
EQUINIX INC		7,385.000	5,367,196.450	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		13,626.000	845,629.560	
EQUITY RESIDENTIAL		32,078.000	1,970,872.320	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		5,504.000	1,425,205.760	
EXTRA SPACE STORAGE INC		10,566.000	1,220,478.660	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6,000.000	564,480.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		45,543.000	1,337,142.480	
HOST HOTELS & RESORTS INC		55,116.000	737,452.080	
INVITATION HOMES INC		46,060.000	1,291,983.000	
IRON MOUNTAIN INC		24,591.000	667,891.560	
MEDICAL PROPERTIES TRUST		40,988.000	797,626.480	
MID AMERICA		9,014.000	1,173,262.240	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		13,649.000	560,837.410	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC		17,771.000	620,030.190	
PROLOGIS INC		61,657.000	6,162,000.580	
PUBLIC STORAGE		13,090.000	3,063,583.600	
REALTY INCOME CORP		29,466.000	1,905,566.220	
REGENCY CENTERS CORP		14,499.000	677,828.250	
SBA COMMUNICATIONS CORP		9,281.000	2,697,429.840	
SIMON PROPERTY GROUP INC		25,902.000	2,042,113.680	
SUN COMMUNITIES INC		8,298.000	1,190,597.040	
UDR INC		27,057.000	1,080,115.440	
VENTAS INC		31,091.000	1,504,493.490	
VEREIT INC		102,670.000	767,971.600	
VICI PROPERTIES INC		40,024.000	1,011,806.720	
VORNADO REALTY TRUST		12,714.000	496,100.280	
WELLTOWER INC		35,270.000	2,392,716.800	
WEYERHAEUSER CO		64,096.000	1,780,586.880	
WP CAREY INC		15,529.000	1,066,842.300	
アメリカ・ドル	小計	1,161,812.000	72,389,849.070 (7,611,792,631)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	324,588.530	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	373,701.350	
	SEGRO PLC	100,956.000	879,528.670	
イギリス・ポンド	小計	226,618.000	1,577,818.550 (219,979,462)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	7,954.000	389,746.000	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,935.000	191,826.050	

		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	217,896.060	
		SMARTCENTRES REIT	3,067.000	73,792.020	
	カナダ・ドル	小計	37,423.000	873,260.130 (70,402,232)	
	ユーロ	COVIVIO	4,663.000	321,980.150	
		GECINA SA	3,670.000	469,760.000	
		ICADE	2,234.000	143,311.100	
		KLEPIERRE	17,099.000	303,079.770	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	668,222.400	
	ユーロ	小計	40,586.000	1,906,353.420 (236,940,667)	
	香港・ドル	LINK REIT	176,700.000	11,918,415.000	
	香港・ドル	小計	176,700.000	11,918,415.000 (161,613,707)	
投資証券	合計		1,643,139	8,300,728,699 (8,300,728,699)	
合計				9,069,075,151 (9,069,075,151)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)	
アメリカ・ドル	株式	591銘柄	68.89	-	-	71.94
	投資証券	39銘柄	-	-	1.93	
イギリス・ポンド	株式	83銘柄	4.44	-	-	4.57
	投資証券	3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式	8銘柄	0.10	-	-	0.10
オーストラリア・ドル	株式	57銘柄	2.09	-	-	2.27
	投資信託受益証券	7銘柄	-	0.14	-	
カナダ・ドル	株式	82銘柄	3.25	-	-	3.32
	投資証券	4銘柄	-	-	0.02	
シンガポール・ドル	株式	16銘柄	0.30	-	-	0.36
	投資信託受益証券	5銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式	39銘柄	3.24	-	-	3.29
スウェーデン・クローナ	株式	36銘柄	1.11	-	-	1.12
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.80	-	-	0.81
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.10	-	-	0.10
ノルウェー・クローネ	株式	10銘柄	0.18	-	-	0.19
ユーロ	株式	240銘柄	10.65	-	-	10.88
	投資証券	5銘柄	-	-	0.06	
香港・ドル	株式	33銘柄	0.99	-	-	1.05

	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,365,369,737
投資証券	47,652,397,590
派生商品評価勘定	13,654,630
未収配当金	446,204,794
前払金	249,300
差入委託証拠金	188,399,000
流動資産合計	50,666,275,051
資産合計	50,666,275,051
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	490,390
未払金	1,828,114,160
未払解約金	159,730,000
流動負債合計	1,988,334,550
負債合計	1,988,334,550
純資産の部	
元本等	
元本	24,485,467,090
剰余金	
剰余金又は欠損金()	24,192,473,411
元本等合計	48,677,940,501
純資産合計	48,677,940,501
負債純資産合計	50,666,275,051

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	17,448,816,585円
同期中追加設定元本額	33,457,555,650円
同期中一部解約元本額	26,420,905,145円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	369,104円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,029,297円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,028,077円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	3,585,015円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	3,184,130円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,576,126円
たわらノーロード 国内リート	4,286,875,535円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	892,636,104円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	778,886,324円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,505,039円
たわらノーロード バランス(標準型)	247,872,614円
たわらノーロード バランス(積極型)	253,885,353円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	91,454,870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)	215,459,961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)	118,192,338円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	152,985,131円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,209,277円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,613,032円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,523,812円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,315,120円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,534,923円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	348,800,060円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	130,509,613円

D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国20)	147,057,515円
D I A M D C 8 資産バランスファンド(新興国30)	273,540,357円
投資のソムリエ	3,062,181,402円
投資のソムリエ<DC年金>	217,204,098円
D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	118,464,447円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	113,139,913円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,223,783,741円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	6,197,651円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	3,243,067円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,147,102円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	12,447,624円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,108,509,845円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	110,456,020円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	1,669,865円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	825,297円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	760,433円
Jリートインデックスファンド(DC)	33,025,671円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	84,114,865円
D I A M J - R E I Tインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	760,446,184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)	327,415,170円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	222,995,243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)	401,528,624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)	31,446,706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)	202,328,093円
D I A M J - R E I Tインデックスファンド(適格機関投資家向け)	5,176,762,354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)	683,057,801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)	617,026,965円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,972,922,480円
計	24,485,467,090円
2. 受益権の総数	24,485,467,090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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。</p> <p>また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2020年11月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	200,481,735
合計	200,481,735

（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6月9日から2020年11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2020年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	1,000,844,300	-	1,014,073,000	13,228,700
合計	1,000,844,300	-	1,014,073,000	13,228,700

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

2020年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9880円 (19,880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

2020年11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	1,410	218,268,000	
	GLP投資法人	14,852	2,401,568,400	
	MCUBS MidCity 投資法人	6,320	538,464,000	
	Oneリート投資法人	805	202,135,500	
	SOSILA物流リート投資法人	1,151	154,579,300	
	いちごオフィスリート投資法人	4,285	316,661,500	
	いちごホテルリート投資法人	903	68,176,500	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	2,588	1,080,490,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	4,906	1,513,501,000	
	イオンリート投資法人	5,239	656,446,700	
	インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人	33,183	480,489,840	
	インヴィンシブル投資法人	21,597	821,765,850	

エスコンジャパンリート投資法人	844	96,553,600	
オリックス不動産投資法人	10,291	1,657,880,100	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,587	372,689,300	
ケネディクス・オフィス投資法人	1,598	1,025,916,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,370	587,054,000	
ケネディクス商業リート投資法人	1,899	418,539,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,254	682,962,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	994	103,276,600	
サンケイリアルエステート投資法人	1,264	127,664,000	
ザイマックス・リート投資法人	791	73,404,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	16,639	960,070,300	
ジャパンエクセレント投資法人	4,793	607,273,100	
ジャパンリアルエステイト投資法人	5,165	2,871,740,000	
スターアジア不動産投資法人	5,306	254,688,000	
スターツプロシード投資法人	804	161,684,400	
タカラレーベン不動産投資法人	1,552	135,955,200	
トーセイ・リート投資法人	1,143	124,015,500	
ヒューリックリート投資法人	4,158	606,652,200	
フロンティア不動産投資法人	1,714	658,176,000	
プレミアム投資法人	4,665	563,065,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人	1,102	139,733,600	
マリモ地方創生リート投資法人	484	54,643,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	11,046	1,434,875,400	
ラサルロジポート投資法人	5,756	938,803,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,631	226,219,700	
阪急阪神リート投資法人	2,333	295,124,500	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,803	891,583,500	
三菱地所物流リート投資法人	1,162	485,716,000	
産業ファンド投資法人	7,301	1,318,560,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,119	133,049,100	
森トラスト総合リート投資法人	3,691	494,224,900	
森ヒルズリート投資法人	6,067	817,224,900	
星野リゾート・リート投資法人	786	411,078,000	
積水ハウス・リート投資法人	15,192	1,145,476,800	
大江戸温泉リート投資法人	834	62,466,600	
大和ハウスリート投資法人	7,370	1,831,445,000	

大和証券オフィス投資法人	1,100	712,800,000	
大和証券リビング投資法人	6,516	654,206,400	
投資法人みらい	5,578	219,773,200	
東急リアル・エステート投資法人	3,463	528,107,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,716	1,019,304,000	
日本ビルファンド投資法人	5,813	3,325,036,000	
日本プライムリアルティ投資法人	3,216	980,880,000	
日本プロロジスリート投資法人	7,815	2,715,712,500	
日本リート投資法人	1,678	608,275,000	
日本リテールファンド投資法人	9,704	1,644,828,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,375	991,237,500	
福岡リート投資法人	2,671	371,001,900	
平和不動産リート投資法人	3,169	380,913,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	16,703	2,278,289,200	
投資証券 合計	310,264	47,652,397,590	
合計		47,652,397,590	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	246,238,677
コール・ローン	442,465,207
投資信託受益証券	5,072,111,267
投資証券	44,217,336,771
派生商品評価勘定	5,630,009
未収入金	1,147,360
未収配当金	91,117,317
流動資産合計	50,076,046,608
資産合計	
50,076,046,608	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	172,518
未払金	6,268,808,106
未払解約金	21,983,000
流動負債合計	6,290,963,624
負債合計	
6,290,963,624	
純資産の部	
元本等	
元本	37,037,959,546
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,747,123,438
元本等合計	43,785,082,984
純資産合計	
43,785,082,984	
負債純資産合計	
50,076,046,608	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,743,134,014円
同期中追加設定元本額	59,128,627,964円
同期中一部解約元本額	61,833,802,432円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	61,595,993円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	30,317,251円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	5,944,499円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	16,689,823円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	16,811,732円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	58,519,035円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	52,640,614円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	25,609,426円
たわらノーロード 先進国リート	7,469,327,705円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,454,821,800円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	312,412,548円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,380,104,319円
たわらノーロード バランス(堅実型)	12,803,070円

たわらノーロード バランス(標準型)	223,556,501円
たわらノーロード バランス(積極型)	419,246,469円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	65,282,948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)	288,259,367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)	210,909,644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)	327,765,863円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,437,921円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,320,098円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,504,362円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,840,501円
One DC 先進国リートインデックスファンド	122,707,464円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,399,807円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	620,627,534円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	54,446,524円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	229,297,790円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	258,974,243円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	481,755,325円
投資のソムリエ	3,983,531,675円
投資のソムリエ<DC年金>	284,241,072円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	208,590,169円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	200,860,037円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,167,823,510円
ワールドアセットバランス(基本コース)	812,123,062円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,800,661,282円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	10,905,443円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	5,707,228円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,034,983円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	17,308,137円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,866,762,131円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	195,813,014円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	2,948,377円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	1,454,231円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,334,899円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	655,720,977円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	120,652,287円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	2,713,306円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	616,268,860円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	3,335,855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)	125,561,441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)	1,814,964円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	4,357,352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)	198,255,147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)	437,104,459円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,286,550,680円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,222,759,236円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	555,835,556円
計	37,037,959,546円

2. 受益権の総数	37,037,959,546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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2020年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券	312,107,153	
投資証券	2,457,635,051	
合計	2,769,742,204	

(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6月23日から2020年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
買建				
アメリカ・ドル	7,315,464,209	-	7,320,921,700	5,457,491
イギリス・ポンド	5,130,866,050	-	5,130,832,000	34,050
イスラエル・シケル	418,247,400	-	418,230,000	17,400
オーストラリア・ドル	6,842,176	-	6,839,800	2,376
カナダ・ドル	723,008,582	-	726,269,700	3,261,118
シンガポール・ドル	130,613,372	-	130,588,200	25,172
ニュージーランド・ドル	334,236,600	-	335,529,000	1,292,400
ニュージーランド・ドル	46,433,806	-	46,670,000	236,194
ユーロ	345,480,841	-	345,526,200	45,359
韓国・ウォン	8,482,800	-	8,496,000	13,200
香港・ドル	171,252,582	-	171,940,800	688,218
合計	7,315,464,209	-	7,320,921,700	5,457,491

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2020年11月11日現在	
1口当たり純資産額	1.1822円

(1万口当たり純資産額)

(11,822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

2020年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	224,200.000	160,303.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	490,600.000	375,309.000	
		PRIME US REIT	167,500.000	131,487.500	
	アメリカ・ドル	小計	955,000.000	667,099.500 (70,145,512)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	115,972.000	365,311.800	
		APN INDUSTRIA REIT	38,627.000	107,383.060	
		ARENA REIT	121,294.000	342,049.080	
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	131,532.000	339,352.560	
		BWP TRUST	170,161.000	711,272.980	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	165,724.000	391,108.640	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	142,779.000	448,326.060	
		CENTURIA OFFICE REIT	129,686.000	289,199.780	
		CHARTER HALL GROUP	160,298.000	2,106,315.720	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	151,878.000	730,533.180	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	170,179.000	653,487.360	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	116,687.000	357,062.220	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	623,900.000	592,705.000	
		DEXUS	374,673.000	3,656,808.480	
		GDI PROPERTY GROUP	146,227.000	168,161.050	
		GOODMAN GROUP	569,731.000	10,426,077.300	
		GPT GROUP	669,334.000	3,152,563.140	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	104,022.000	376,559.640	
		HOME CONSORTIUM LTD	44,002.000	171,607.800	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	58,989.000	194,663.700	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	97,717.000	455,361.220			
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY FUND	194,689.000	239,467.470			
MIRVAC GROUP	1,351,362.000	3,513,541.200			

	NATIONAL STORAGE REIT	309,415.000	564,682.370	
	RURAL FUNDS GROUP	121,661.000	299,286.060	
	SCENTRE GROUP	1,780,759.000	4,914,894.840	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	373,698.000	904,349.160	
	STOCKLAND	818,536.000	3,577,002.320	
	VICINITY CENTRES	1,326,407.000	2,195,203.580	
	WAYPOINT REIT LTD	271,884.000	720,492.600	
	オーストラリア・ドル 小計	10,851,823.000	42,964,829.370 (3,288,528,040)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	153,995.000	183,254.050	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	331,080.000	196,992.600	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	967,360.000	3,085,878.400	
	ASCOTT TRUST	649,916.000	633,668.100	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,555,009.000	3,078,917.820	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	234,780.000	295,822.800	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	246,100.000	295,320.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,500.000	43,437.500	
	ESR REIT	771,530.000	281,608.450	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	351,700.000	225,088.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	175,700.000	77,308.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	341,000.000	794,530.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	286,700.000	126,148.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	918,764.000	1,176,017.920	
	IREIT GLOBAL	126,300.000	78,306.000	
	KEPPEL DC REIT	439,400.000	1,212,744.000	
	KEPPEL REIT	590,100.000	619,605.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	304,100.000	199,185.500	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	611,800.000	53,838.400	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	753,200.000	1,506,400.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	574,220.000	1,739,886.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	906,020.000	1,775,799.200	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	714,100.000	646,260.500	

		OUÉ COMMERCIAL REIT	806,555.000	270,195.920	
		PARKWAY LIFE REIT	135,600.000	524,772.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	190,800.000	68,688.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	189,200.000	146,630.000	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	298,200.000	141,645.000	
		SPH REIT	338,400.000	265,644.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	476,500.000	216,807.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	737,390.000	1,091,337.200	
	シンガポール・ドル 小計		15,238,019.000	21,051,736.460 (1,642,877,513)	
	ユーロ	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	429,300.000	195,331.500	
	ユーロ 小計		429,300.000	195,331.500 (24,277,752)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	499,000.000	3,413,160.000	
	香港・ドル 小計		499,000.000	3,413,160.000 (46,282,450)	
投資信託受益証券 合計			27,973,142	5,072,111,267 (5,072,111,267)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,038.000	480,020.600	
		AGREE REALTY CORP	21,480.000	1,426,057.200	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	25,579.000	415,658.750	
		ALEXANDER'S INC.	892.000	245,647.880	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	46,459.000	7,515,207.840	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	17,499.000	468,798.210	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	54,721.000	2,239,730.530	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	38,891.000	291,876.950	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	105,822.000	3,069,896.220	
		AMERICOLD REALTY TRUST	80,860.000	2,791,287.200	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	59,277.000	1,767,047.370	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	83,066.000	1,026,695.760	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	18,005.000	195,894.400	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	55,731.000	9,574,028.490	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,102.000	75,591.660	
		BOSTON PROPERTIES INC	56,141.000	5,194,726.730	
BRANDYWINE REALTY TRUST	68,659.000	696,202.260			

BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	118,069.000	1,723,807.400	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	22,601.000	359,355.900	
BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	54,414.400	
CAMDEN PROPERTY TRUST	38,636.000	3,917,690.400	
CARETRUST REIT INC	38,478.000	740,316.720	
CHATHAM LODGING TRUST	16,490.000	159,293.400	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,617.000	46,862.550	
CITY OFFICE REIT INC	15,156.000	115,640.280	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	29,803.960	
COLONY CAPITAL INC	193,507.000	774,028.000	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	46,214.000	578,137.140	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	7,508.000	358,131.600	
CORECIVIC INC	42,675.000	272,266.500	
COREPOINT LODGING INC	13,648.000	82,297.440	
CORESITE REALTY CORP	16,917.000	2,042,051.070	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	44,849.000	1,111,358.220	
COUSINS PROPERTIES INC	59,145.000	1,855,378.650	
CUBESMART	76,995.000	2,557,773.900	
CYRUSONE INC	46,388.000	3,212,369.000	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	80,595.000	541,598.400	
DIGITAL REALTY TRUST INC	106,464.000	14,459,940.480	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	84,911.000	343,889.550	
DOUGLAS EMMETT INC	65,607.000	1,955,744.670	
DUKE REALTY TRUST	146,848.000	5,810,775.360	
EAST GROUP	15,642.000	2,193,790.500	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	32,069.000	687,880.050	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	50,118.000	380,395.620	
EPR PROPERTIES	29,859.000	961,161.210	
EQUINIX INC	35,037.000	25,463,840.490	
EQUITY COMMONWEALTH	48,501.000	1,302,251.850	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	67,195.000	4,170,121.700	
EQUITY RESIDENTIAL	135,619.000	8,332,431.360	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	40,915.000	788,432.050	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,835.000	6,689,714.900	
EXTRA SPACE STORAGE INC	51,153.000	5,908,683.030	
FARMLAND PARTNERS INC	9,378.000	68,178.060	

FEDERAL REALTY INVS TRUST	27,348.000	2,572,899.840	
FIRST INDUSTRIAL RT	50,593.000	2,114,787.400	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	28,245.000	814,020.900	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	27,897.000	137,532.210	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	20,113.000	268,910.810	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	82,310.000	3,391,995.100	
GEO GROUP INC	42,688.000	371,812.480	
GETTY REALTY CORP	12,404.000	354,134.200	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	12,291.000	223,819.110	
GLADSTONE LAND CORP	5,675.000	80,953.870	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	15,162.000	215,300.400	
GLOBAL NET LEASE INC	36,138.000	596,277.000	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	54,182.000	1,724,071.240	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	86,866.000	2,440,065.940	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	213,290.000	6,262,194.400	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	12,444.000	86,734.680	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	41,435.000	1,461,826.800	
HOST HOTELS & RESORTS INC	279,766.000	3,743,269.080	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,165.000	1,474,076.500	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	38,365.000	529,437.000	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,374.000	551,744.080	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,662.000	1,329,530.380	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4,529.000	336,278.250	
INVITATION HOMES INC	222,097.000	6,229,820.850	
IRON MOUNTAIN INC	114,392.000	3,106,886.720	
JBG SMITH PROPERTIES	44,860.000	1,314,846.600	
KILROY REALTY CORP	41,661.000	2,472,580.350	
KIMCO REALTY	171,902.000	2,430,694.280	
KITE REALTY GROUP TRUST	29,723.000	411,069.090	
LEXINGTON REALTY TRUST	110,628.000	1,144,999.800	
LIFE STORAGE INC	18,665.000	2,124,450.300	
LTC PROPERTIES INC	15,851.000	583,316.800	
MACK CALI	30,354.000	389,745.360	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	209,744.000	4,081,618.240	

MID AMERICA	45,321.000	5,898,981.360	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	39,559.000	586,264.380	
NATIONAL HEALTH INVS INC	17,843.000	1,152,657.800	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	68,933.000	2,832,456.970	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	24,838.000	883,984.420	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	26,824.000	121,780.960	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	7,698.000	345,101.340	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,015.000	373,819.550	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	90,099.000	3,143,554.110	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,480.000	91,899.600	
PARAMOUNT GROUP INC	68,197.000	538,074.330	
PARK HOTELS & RESORTS INC	93,982.000	1,351,461.160	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	52,469.000	889,874.240	
PHYSICIANS REALTY TRUST	82,969.000	1,540,734.330	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	50,700.000	732,108.000	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6,913.000	93,118.110	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	20,886.000	153,720.960	
PROLOGIS INC	292,279.000	29,210,363.260	
PS BUSINESS PARKS	8,024.000	1,070,883.040	
PUBLIC STORAGE	60,195.000	14,088,037.800	
QTS REALTY TRUST INC	24,434.000	1,491,207.020	
REALTY INCOME CORP	136,642.000	8,836,638.140	
REGENCY CENTERS CORP	62,641.000	2,928,466.750	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	47,551.000	623,869.120	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	86,376.000	658,185.120	
RETAIL VALUE INC	5,389.000	76,362.130	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	49,201.000	2,451,685.830	
RLJ LODGING TRUST	66,308.000	781,108.240	
RPT REALTY	24,335.000	164,261.250	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,949.000	1,296,966.410	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	82,022.000	1,356,643.880	
SAFEHOLD INC	4,861.000	312,416.470	
SAUL CENTERS INC	5,164.000	153,164.240	

	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	12,896.000	181,446.720	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	66,212.000	729,656.240	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	121,120.000	9,549,100.800	
	SITE CENTERS CORP	60,879.000	558,260.430	
	SL GREEN	29,163.000	1,666,082.190	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41,088.000	1,479,168.000	
	STAG INDUSTRIAL INC	59,364.000	1,882,432.440	
	STORE CAPITAL CORP	90,599.000	2,917,287.800	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	37,945.000	305,077.800	
	SUN COMMUNITIES INC	38,950.000	5,588,546.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	86,461.000	865,474.610	
	TANGER FACTORY OUTLET	33,450.000	293,356.500	
	TAUBMAN CENTERS INC	24,730.000	910,558.600	
	TERRENO REALTY CORP	27,223.000	1,620,585.190	
	THE MACERICH COMPANY	45,624.000	411,984.720	
	UDR INC	116,996.000	4,670,480.320	
	UMH PROPERTIES INC	13,485.000	198,768.900	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,580.000	280,937.200	
	URBAN EDGE PROPERTIES	44,344.000	576,028.560	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,266.000	117,237.720	
	VENTAS INC	147,795.000	7,151,800.050	
	VEREIT INC	427,918.000	3,200,826.640	
	VICI PROPERTIES INC	211,540.000	5,347,731.200	
	VORNADO REALTY TRUST	62,289.000	2,430,516.780	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	89,326.000	58,061.900	
	WASHINGTON REIT	33,140.000	714,167.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	48,217.000	987,966.330	
	WELLTOWER INC	165,206.000	11,207,575.040	
	WHITESTONE REIT	13,413.000	103,950.750	
	WP CAREY INC	68,950.000	4,736,865.000	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	45,959.000	553,346.360	
アメリカ・ドル	小計	8,786,823.000	350,421,002.030 (36,846,768,364)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	54,933.000	42,847.740	
	ASSURA PLC	1,063,714.000	792,466.930	
	BIG YELLOW GROUP PLC	66,020.000	742,725.000	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	285,345.000	209,728.570	
	BRITISH LAND CO PLC	374,320.000	1,740,213.680	

	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	345,156.000	475,624.960	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	254,272.000	276,647.930	
	CUSTODIAN REIT PLC	152,700.000	137,430.000	
	DERWENT LONDON PLC	44,537.000	1,458,141.380	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	252,342.000	171,087.870	
	GCP STUDENT LIVING PLC	162,134.000	226,987.600	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	101,701.000	709,872.980	
	HAMMERSON PLC	1,560,896.000	338,714.430	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	120,448.000	127,072.640	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	3,927.680	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	298,487.000	1,997,475.000	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	362,926.000	811,502.530	
	LXI REIT PLC	184,834.000	219,952.460	
	NEWRIVER REIT PLC	132,864.000	94,333.440	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	199,287.000	144,682.360	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	525,676.000	770,641.010	
	RDI REIT PLC	77,261.000	74,016.030	
	REGIONAL REIT LTD	160,485.000	124,696.840	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	83,870.000	670,960.000	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	197,180.000	71,379.160	
	SEGRO PLC	471,956.000	4,111,680.670	
	SHAFTESBURY PLC	97,657.000	556,644.900	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	126,136.000	76,816.820	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	271,782.000	284,012.190	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	125,288.000	141,575.440	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	680,422.000	1,100,242.370	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	304,490.000	234,761.790	
	UNITE GROUP PLC	158,351.000	1,705,440.270	
	WORKSPACE GROUP PLC	51,845.000	391,948.200	
	イギリス・ボンド 小計	9,580,355.000	21,036,250.870 (2,932,874,096)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	70,388.000	1,105,091.600	
	イスラエル・シュケル 小計	70,388.000	1,105,091.600 (34,368,349)	

カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,252.000	964,259.520	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	27,865.000	279,764.600	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,603.000	48,239.440	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,253.000	255,512.880	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	33,385.000	1,635,865.000	
	CHOICE PROPERTIES REIT	64,521.000	860,710.140	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	32,167.000	276,636.200	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	16,616.000	229,134.640	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,298.000	314,145.500	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	30,790.000	390,109.300	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,474.000	197,438.160	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,668.000	603,106.440	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,406.000	877,007.340	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	56,872.000	677,914.240	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	27,835.000	374,380.750	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,738.000	359,804.300	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,391.000	116,060.560	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	127,114.230	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	35,324.000	426,360.680	
	PLAZA RETAIL REIT	11,977.000	41,560.190	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	62,394.000	1,009,534.920	
	SLATE GROCERY REIT	6,660.000	74,991.600	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	44,558.220	
	SMARTCENTRES REIT	28,643.000	689,150.580	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	30,338.000	427,159.040		
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	14,570.000	86,982.900		
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,688.000	257,040.000		
カナダ・ドル 小計	661,945.000	11,644,541.370 (938,782,925)		

ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	279,054.000	404,628.300	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	381,704.000	923,723.680	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	538,661.000	694,872.690	
	PRECINCT PROPERTIES	376,646.000	681,729.260	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	114,681.000	347,483.430	
ニュージーランド・ドル 小計		1,690,746.000	3,052,437.360 (219,195,527)	
ユーロ	AEDIFICA	13,156.000	1,249,820.000	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	70,865.000	921,245.000	
	ALTAREA	1,273.000	169,054.400	
	BEFIMMO	10,437.000	380,428.650	
	CARE PROPERTY INVEST NV	9,400.000	258,500.000	
	CARMILA SA	14,600.000	141,474.000	
	COFINIMMO SA	10,781.000	1,392,905.200	
	COVIVIO	19,220.000	1,327,141.000	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,949.000	214,667.640	
	GECINA SA	21,462.000	2,747,136.000	
	HAMBORNER REIT AG	26,620.000	238,435.340	
	HIBERNIA REIT PLC	278,872.000	341,339.320	
	ICADE	12,454.000	798,924.100	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	22,255.000	72,551.300	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	101,730.000	817,909.200	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	7,670.000	180,628.500	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	162,294.000	235,326.300	
	KLEPIERRE	81,317.000	1,441,343.820	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	21,821.000	85,101.900	
	MERCIALYS	16,204.000	91,471.580	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	131,763.000	957,258.190	
	MONTEA SCA	4,091.000	400,099.800	
	NSI NV	7,175.000	222,425.000	
	RETAIL ESTATES	3,878.000	221,046.000	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	54,662.000	2,827,118.640		
VASTNED RETAIL	6,866.000	172,336.600		
WAREHOUSES DE PAUW	52,144.000	1,494,447.040		
WERELDHAVE NV	14,865.000	148,352.700		
XIOR STUDENT HOUSING NV	5,557.000	295,076.700		
ユーロ 小計		1,198,381.000	19,843,563.920 (2,466,356,560)	
韓国・ウォン	LOTTE REIT CO LTD	26,121.000	142,881,870.000	

	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	27,697.000	113,142,245.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	16,057.000	115,449,830.000	
韓国・ウォン 小計		69,875.000	371,473,945.000 (35,067,140)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	666,070.000	2,844,118.900	
	LINK REIT	708,620.000	47,796,419.000	
	PROSPERITY REIT	456,000.000	1,044,240.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	344,000.000	1,245,280.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	511,000.000	1,931,580.000	
香港・ドル 小計		2,685,690.000	54,861,637.900 (743,923,810)	
投資証券 合計		24,744,203	44,217,336,771 (44,217,336,771)	
合計			49,289,448,038 (49,289,448,038)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	0.16	-	74.90
	投資証券 151銘柄	-	84.15	
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-	6.70	5.95
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.08	0.07
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	7.51	-	6.67
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-	2.14	1.90
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	3.75	-	3.33
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.50	0.44
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	0.06	-	5.05
	投資証券 29銘柄	-	5.63	
韓国・ウォン	投資証券 3銘柄	-	0.08	0.07
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.11	-	1.60
	投資証券 5銘柄	-	1.70	

(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)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	31,031,600
コール・ローン	5,711,205,751
国債証券	100,903,445,658
派生商品評価勘定	98,238,823
未収利息	723,780,870
前払費用	196,135,731
流動資産合計	107,663,838,433
資産合計	107,663,838,433
負債の部	
流動負債	
未払金	14,143,822,712
未払解約金	2,219,600
流動負債合計	14,146,042,312
負債合計	14,146,042,312
純資産の部	
元本等	
元本	44,361,222,545
剰余金	
剰余金又は欠損金()	49,156,573,576
元本等合計	93,517,796,121
純資産合計	93,517,796,121
負債純資産合計	107,663,838,433

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	74,574,074,462円
同期中追加設定元本額	90,676,465,926円
同期中一部解約元本額	120,889,317,843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）	115,836,237円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	723,575,996円
たわらノーロード バランス（堅実型）	53,901,862円
たわらノーロード バランス（標準型）	139,000,810円
たわらノーロード バランス（積極型）	54,748,775円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	549,741円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,477,420円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	3,756,470円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	770,763円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,042,648円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	44,240,071円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	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）	225,010,486円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	420,701,140円
投資のソムリエ	10,133,878,294円
クルーズコントロール	335,046,630円
投資のソムリエ<DC年金>	718,632,177円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	183,350,267円
クルーズコントロール<DC年金>	71,581円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	2,529,487円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	6,647,706円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	314,141,235円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,394,837,994円
ワールドアセットバランス（基本コース）	764,791,995円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,423,225,444円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,825,659円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,281,485円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,187,814円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	32,162,895円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,538,104,277円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	168,689,030円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	4,278,349円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	2,108,641円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	1,940,616円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	10,920,521,258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)	1,799,707,576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)	485,881,517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)	10,823,406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)	223,267,746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)	109,258,163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)	5,105,234,951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)	2,668,045,847円
計	44,361,222,545円
2. 受益権の総数	44,361,222,545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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<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	2020年11月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	3,833,042,680	
合計	3,833,042,680	

(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2020年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年11月11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 買建 アメリカ・ドル	16,040,000,000	-	16,138,238,823	98,238,823
合計	16,040,000,000	-	16,138,238,823	98,238,823

(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）

	2020年11月11日現在
1口当たり純資産額	2,1081円
（1万口当たり純資産額）	（21,081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

2020年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.625 01/05/23	7,800,000.000	8,092,500.000	
		BRAZIL 4.25 01/07/25	10,100,000.000	11,012,181.500	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	7,000,000.000	7,709,800.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	8,800,000.000	9,734,516.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	7,000,000.000	7,301,945.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	9,800,000.000	10,626,091.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	7,100,000.000	8,205,825.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	7,600,000.000	8,820,142.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	6,800,000.000	8,070,750.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	6,300,000.000	8,287,996.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	6,200,000.000	8,684,340.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	7,800,000.000	9,815,910.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	6,000,000.000	6,284,250.000	
		COLOMBIA 3.875 04/25/27	8,600,000.000	9,460,516.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	7,100,000.000	7,638,641.500	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	6,000,000.000	6,752,130.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	7,000,000.000	8,022,490.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	13,000,000.000	15,986,750.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	5,000,000.000	6,327,500.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,000,000.000	10,368,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	9,000,000.000	12,105,000.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	8,400,000.000	12,285,084.000	
		COLOMBIA 8.125 05/21/24	4,900,000.000	5,956,440.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	8,400,000.000	9,281,445.600	
		CROATIA 6.0 01/26/24	11,400,000.000	13,145,625.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	9,358,000.000	10,340,337.330	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	8,380,000.000	9,630,455.220	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	8,000,000.000	9,186,848.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	5,000,000.000	9,011,210.000			
INDONESIA 2.85 02/14/30	4,000,000.000	4,289,655.560			
INDONESIA 3.375 04/15/23	6,700,000.000	7,102,770.500			

INDONESIA 3.4 09/18/29	3,000,000.000	3,336,993.630	
INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,547,460.320	
INDONESIA 3.7 10/30/49	3,000,000.000	3,327,947.430	
INDONESIA 3.85 07/18/27	3,600,000.000	4,071,600.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	3,456,203.340	
INDONESIA 4.125 01/15/25	9,800,000.000	10,961,128.500	
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,000,000.000	4,636,494.400	
INDONESIA 4.35 01/11/48	5,000,000.000	5,989,721.300	
INDONESIA 4.625 04/15/43	4,400,000.000	5,331,582.690	
INDONESIA 4.75 01/08/26	6,800,000.000	7,915,722.780	
INDONESIA 4.75 02/11/29	5,000,000.000	6,025,143.900	
INDONESIA 5.125 01/15/45	5,400,000.000	7,011,611.580	
INDONESIA 5.25 01/08/47	4,400,000.000	5,879,774.120	
INDONESIA 5.25 01/17/42	6,300,000.000	8,189,937.310	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	4,138,647.690	
INDONESIA 5.875 01/15/24	9,200,000.000	10,591,776.550	
INDONESIA 5.95 01/08/46	4,200,000.000	6,101,542.310	
INDONESIA 6.75 01/15/44	4,500,000.000	6,922,918.620	
INDONESIA 7.75 01/17/38	5,500,000.000	8,703,929.300	
PANAMA 3.16 01/23/30	4,000,000.000	4,409,600.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	3,200,000.000	3,523,696.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	4,100,000.000	4,683,655.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	7,000,000.000	8,890,000.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	6,300,000.000	8,001,063.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	7,900,000.000	11,616,160.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	3,800,000.000	4,820,528.000	
PANAMA 9.375 04/01/29	5,900,000.000	9,166,063.000	
PERU 2.844 06/20/30	6,000,000.000	6,522,360.000	
PERU 4.125 08/25/27	2,300,000.000	2,670,461.000	
PERU 5.625 11/18/50	8,000,000.000	12,594,360.000	
PERU 6.55 03/14/37	7,000,000.000	10,375,400.000	
PERU 7.35 07/21/25	5,300,000.000	6,711,920.000	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	7,000,000.000	7,733,240.550	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	7,003,217.940	
PHILIPPINES 3.7 03/01/41	6,000,000.000	6,989,520.660	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,821,292.250	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	5,800,000.000	6,933,235.490	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,679,057.420	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,800,000.000	6,325,321.290	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	5,600,000.000	6,958,726.090	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	3,600,000.000	5,133,175.480	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	8,000,000.000	11,711,333.360	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	5,100,000.000	7,817,906.480	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	5,800,000.000	9,536,165.350	

ROMANIA 4.375 08/22/23	10,000,000.000	10,928,000.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	6,600,000.000	7,359,297.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	5,789,100.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	4,400,000.000	6,124,624.000	
ROMANIA 6.75 02/07/22	4,500,000.000	4,837,500.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	8,517,000.000	9,808,177.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,400,000.000	10,669,000.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	11,400,000.000	13,203,274.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	5,800,000.000	6,081,996.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	10,400,000.000	11,991,096.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,400,000.000	9,233,280.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	14,000,000.000	17,534,090.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	19,000,000.000	25,766,280.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	9,000,000.000	12,261,672.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	6,200,000.000	8,755,032.400	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	9,200,000.000	9,262,008.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	6,000,000.000	6,156,624.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	6,400,000.000	6,783,520.000	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,200,000.000	4,001,382.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	10,000,000.000	9,531,000.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,199,695.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	7,400,000.000	8,116,105.400	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	7,200,000.000	8,023,608.000	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	3,000,000.000	3,047,910.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	10,000,000.000	10,655,100.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	6,200,000.000	6,780,196.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.625 03/15/22	3,900,000.000	4,051,320.000	

	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	7,200,000.000	7,957,044.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	7,500,000.000	8,194,537.500	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	7,000,000.000	7,903,490.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	7,400,000.000	8,416,649.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.35 01/15/47	4,000,000.000	4,503,180.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	8,000,000.000	9,113,600.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	11,000,000.000	12,775,125.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	9,000,000.000	10,428,885.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	6,400,000.000	7,416,288.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 03/08/44	11,400,000.000	13,387,077.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	8,400,000.000	10,890,852.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	7,800,000.000	9,832,329.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	10,900,000.000	14,516,674.500	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	10,200,000.000	14,022,960.000	
	アメリカ・ドル 小計	796,055,000.000 (83,705,183,250)	959,614,319.140 (100,903,445,658)	
国債証券	合計	83,705,183,250 (83,705,183,250)	100,903,445,658 (100,903,445,658)	
合計			100,903,445,658 (100,903,445,658)	

(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 116銘柄	107.90	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)

2020年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,161,164,869
コール・ローン	87,133,473
株式	48,775,906,831
新株予約権証券	13,795
投資信託受益証券	281,839,906
投資証券	36,747,121
派生商品評価勘定	82,795,403
未収入金	587,840
未収配当金	33,796,417
差入委託証拠金	2,625,978,477
流動資産合計	54,085,964,132
資産合計	54,085,964,132
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	69,484,212
未払金	61,666
未払解約金	34,750,400
流動負債合計	104,296,278
負債合計	104,296,278
純資産の部	
元本等	
元本	43,111,578,609
剰余金	
剰余金又は欠損金()	10,870,089,245
元本等合計	53,981,667,854
純資産合計	53,981,667,854
負債純資産合計	54,085,964,132

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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	2020年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,960,776,794円
同期中追加設定元本額	57,820,153,817円
同期中一部解約元本額	57,669,352,002円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	6,777,769,935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)	246,310,063円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,580,748円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	7,723,304円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	7,351,181円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,364,391円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	25,185,677円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,599,376円
たわらノーロード 新興国株式	6,743,361,289円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,885,284,961円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,242,471,330円
たわらノーロード バランス(堅実型)	11,425,223円
たわらノーロード バランス(標準型)	39,401,752円
たわらノーロード バランス(積極型)	62,060,035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)	700,974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)	58,636,199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)	176,728,660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)	107,049,009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)	168,978,394円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	325,836円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	808,698円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	995,792円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	1,796,621円
たわらノーロード 全世界株式	38,773,022円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	74,741,066円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	452,026,003円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	367,912,633円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	403,952,982円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	741,695,141円
投資のソムリエ	7,693,377,894円
クルーズコントロール	580,314,415円
投資のソムリエ< D C 年金>	545,536,588円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	345,843,375円
クルーズコントロール< D C 年金>	124,333円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	10,980,986円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	28,863,903円
投資のソムリエ< D C 年金>リスク抑制型	362,022,373円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,917,002,469円
ワールドアセットバランス(基本コース)	1,295,917,778円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,516,623,607円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,689,516円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,304,973円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	3,667,083円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	31,056,822円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,163,738,631円
9資産分散投資・スタンダード< D C 年金>	296,256,869円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	5,321,246円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	2,624,095円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	2,413,999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)	19,864,402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)	387,142,039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)	189,880,918円
計	43,111,578,609円
2. 受益権の総数	43,111,578,609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 2019年11月12日 至 2020年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引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	2020年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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	2020年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	6,563,153,894	
新株予約権証券	59,775	
投資信託受益証券	34,608,118	
投資証券	820,800	
合計	6,596,881,437	

(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2020年11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2020年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	26,531,832	-	26,513,598	18,234
アメリカ・ドル	26,196,816	-	26,179,860	16,956
サウジアラビア・リアル	115,365	-	115,324	41
ブラジル・レアル	219,651	-	218,414	1,237
買建	14,855,593,676	-	14,852,465,883	3,127,793
アメリカ・ドル	10,860,666,176	-	10,860,665,883	293
インド・ルピー	1,260,685,000	-	1,263,800,000	3,115,000
オフショア・人民元	796,730,000	-	796,000,000	730,000
台湾・ドル	1,937,512,500	-	1,932,000,000	5,512,500
合計	14,882,125,508	-	14,878,979,481	3,109,559

(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	2020年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち	時価(円)	評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	19,865,313,385	-	19,881,734,135	16,420,750
合計	19,865,313,385	-	19,881,734,135	16,420,750

(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)

2020年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2521円 (12,521円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2020年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	32,556	36.130	1,176,248.280	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	16,135	12.040	194,265.400	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.060	122,502.600	
	CREDICORP LTD	4,831	112.920	545,516.520	
	SINA CORP	3,176	42.950	136,409.200	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	38,291	8.400	321,644.400	
	NETEASE INC-ADR	27,750	87.550	2,429,512.500	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,745	54.160	256,989.200	
	TELECOM ARGENTINA SA SP ADR	3,789	7.430	28,152.270	
	YPF SA ADR	4,248	4.750	20,178.000	
	LUKOIL SPON ADR	28,759	63.460	1,825,046.140	
	GAZPROM PAO ADR	402,661	4.475	1,801,907.970	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	105,627	3.995	421,979.860	

INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	70,100	0.645	45,214.500	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	54,736	0.834	45,649.820	
SURGUTNEFTEGAZ ADR	53,784	4.796	257,948.060	
51JOB INC ADR	2,130	71.990	153,338.700	
X5 RETAIL GROUP NV GDR	9,229	36.500	336,858.500	
NOVATEK PJSC GDR	6,425	154.300	991,377.500	
BAIDU INC -SPON ADR	18,424	143.250	2,639,238.000	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	7,790	25.020	194,905.800	
MMC NORILSK NICKEL ADR	43,376	26.980	1,170,284.480	
ROSNEFT OIL CO GDR	84,871	5.420	460,000.820	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	9,647	173.970	1,678,288.590	
SEVERSTAL GDR	18,579	14.210	264,007.590	
TATNEFT ADR	17,232	39.100	673,771.200	
MAGNITOGORSK IRON & STEEL SPON GDR	17,236	6.580	113,412.880	
VTB BANK OJSC GDR	152,000	0.871	132,392.000	
MAGNIT PJSC GDR	26,116	15.270	398,791.320	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,337	20.690	627,672.530	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	25,644	70.060	1,796,618.640	
YANDEX NV	20,771	61.310	1,273,470.010	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,630	28.600	46,618.000	
SBERBANK ADR	182,698	12.570	2,296,513.860	
PHOSAGRO PJSC GDR	8,886	12.980	115,340.280	
HUAZHU GROUP LTD ADR	11,047	45.940	507,499.180	
JOYY INC-ADR	4,068	96.510	392,602.680	
GDS HOLDINGS LTD ADR	6,147	90.170	554,274.990	
ZAI LAB LTD ADR	4,833	86.080	416,024.640	
BEST INC ADR	10,426	2.870	29,922.620	
HUYA INC ADR	4,204	19.910	83,701.640	
BILIBILI INC ADR	8,330	43.700	364,021.000	
NIO INC ADR	72,057	41.550	2,993,968.350	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	25,825	14.950	386,083.750	
AUTOHOME INC ADR	4,165	102.100	425,246.500	
GSX TECHEDU INC ADR	4,712	70.340	331,442.080	
WEIBO CORP ADR	3,047	46.420	141,441.740	
KE HOLDINGS INC ADR	6,373	67.700	431,452.100	
JD.COM INC ADR	57,196	80.080	4,580,255.680	
XPENG INC ADR	6,500	32.900	213,850.000	
GLOBANT SA	2,612	190.240	496,906.880	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	126,138	266.540	33,620,822.520	
MOMO INC SPON ADR	9,813	14.880	146,017.440	
BAOZUN INC-SPN ADR	3,310	38.240	126,574.400	
PINDUODUO INC ADR	18,361	103.090	1,892,835.490	

	YUM CHINA HOLDINGS INC	26,894	57.330	1,541,833.020	
	IQIYI INC ADR	15,721	26.360	414,405.560	
	POLYUS PJSC GDR	4,704	106.900	502,857.600	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD ADR	3,471	32.650	113,328.150	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	27,805	30.030	834,984.150	
アメリカ・ドル	小計	2,026,178		76,534,417.580 (8,047,594,009)	
アラブ首長国 連邦・ディル ハム	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	128,376	4.250	545,598.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	124,753	17.020	2,123,296.060	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	178,306	6.110	1,089,449.660	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	170,388	11.900	2,027,617.200	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	300,971	2.900	872,815.900	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	300,433	2.650	796,147.450	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	154,770	10.000	1,547,700.000	
	EMAAR MALLS PJSC	95,355	1.670	159,242.850	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,453,352		9,161,867.120 (262,670,730)	
イギリス・ボ ンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	17,018	16.580	282,158.440	
イギリス・ボ ンド	小計	17,018		282,158.440 (39,338,530)	
インド・ル ピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	191,337	2,084.550	398,851,543.350	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	47,274	382.800	18,096,487.200	
	ASIAN PAINTS LTD	19,357	2,199.750	42,580,560.750	
	EICHER MOTORS LTD	9,713	2,234.850	21,707,098.050	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	22,335	789.500	17,633,482.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	52,430	619.950	32,503,978.500	
	SHREE CEMENT LTD	646	22,762.800	14,704,768.800	
	ICICI BANK LTD	344,082	483.850	166,484,075.700	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	34,110	212.500	7,248,375.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	127,150	231.700	29,460,655.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,379	388.100	4,028,089.900	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	19,809	321.900	6,376,517.100	
	TATA STEEL LTD	21,454	441.900	9,480,522.600	
	TATA MOTORS LTD	91,124	146.000	13,304,104.000	
	JSW STEEL LTD	60,652	334.800	20,306,289.600	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	25,126	498.400	12,522,798.400	

BRITANNIA INDUSTRIES LTD	3,654	3,508.350	12,819,510.900	
NESTLE INDIA LTD	1,591	16,604.750	26,418,157.250	
GAIL INDIA LTD	131,540	90.200	11,864,908.000	
VEDANTA LTD	140,074	99.750	13,972,381.500	
AXIS BANK LTD	154,740	583.600	90,306,264.000	
TITAN COMPANY LTD	21,689	1,305.400	28,312,820.600	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	160,277	70.750	11,339,597.750	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	4,661	1,467.500	6,840,017.500	
LUPIN LTD	14,204	858.700	12,196,974.800	
BAJAJ FINANCE LTD	12,417	4,208.550	52,257,565.350	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	110,700	2,272.100	251,521,470.000	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISES LTD	46,557	193.100	8,990,156.700	
INFOSYS LTD	228,529	1,091.050	249,336,565.450	
WIPRO LTD	78,684	342.300	26,933,533.200	
INDIAN OIL CORP LTD	102,155	84.250	8,606,558.750	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	54,908	2,136.600	117,316,432.800	
HCL TECHNOLOGIES LTD	73,459	809.700	59,479,752.300	
DABUR INDIA LTD	37,536	515.000	19,331,040.000	
HERO MOTOCORP LTD	7,071	2,951.250	20,868,288.750	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,857	4,698.000	36,912,186.000	
BHARTI AIRTEL LTD	86,556	466.400	40,369,718.400	
UNITED SPIRITS LTD	17,515	563.950	9,877,584.250	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	58,796	490.900	28,862,956.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	4,948	3,263.400	16,147,303.200	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,262	6,793.450	56,127,483.900	
AUROBINDO PHARMA LTD	20,977	761.050	15,964,545.850	
HAVELLS INDIA LTD	19,287	841.650	16,232,903.550	
INDRAPRASTHA GAS LTD	11,528	423.150	4,878,073.200	
BIOCON LTD	15,880	406.150	6,449,662.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	42,676	127.400	5,436,922.400	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	3,777	857.750	3,239,721.750	
PETRONET LNG LTD	50,647	239.100	12,109,697.700	
CIPLA LTD/INDIA	21,626	717.300	15,512,329.800	
LARSEN & TOUBRO LTD	34,668	1,033.700	35,836,311.600	
ULTRATECH CEMENT LTD	7,880	4,719.550	37,190,054.000	
BOSCH LTD	216	12,000.100	2,592,021.600	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	60,224	2,649.600	159,569,510.400	
NTPC LTD	176,417	91.500	16,142,155.500	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,024	1,381.750	6,941,912.000	

	AMBUJA CEMENTS LTD	53,675	249.900	13,413,382.500	
	BHARAT FORGE LTD	15,849	519.700	8,236,725.300	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	88,685	192.350	17,058,559.750	
	ITC LTD	204,546	178.350	36,480,779.100	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,016	1,573.700	14,188,479.200	
	UNITED PHOSPHORUS LTD	31,469	432.800	13,619,783.200	
	TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,753	2,431.700	6,694,470.100	
	SIEMENS INDIA LTD	3,443	1,357.650	4,674,388.950	
	INFO EDGE INDIA LTD	4,493	3,536.700	15,890,393.100	
	GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	29,323	677.000	19,851,671.000	
	TECH MAHINDRA LTD	32,496	821.300	26,688,964.800	
	MARICO LTD	23,394	369.500	8,644,083.000	
	PAGE INDUSTRIES LTD	378	22,084.250	8,347,846.500	
	DLF LTD	31,144	180.500	5,621,492.000	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	131,583	185.900	24,461,279.700	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	27,188	366.750	9,971,199.000	
	REC LTD	43,697	111.900	4,889,694.300	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,490	6,687.650	16,652,248.500	
	BAJAJ AUTO LTD	4,391	2,997.500	13,162,022.500	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	4,605	2,239.300	10,311,976.500	
	COAL INDIA LTD	99,458	124.800	12,412,358.400	
	BHARTI INFRATEL LTD	14,070	177.000	2,490,390.000	
	TATA STEEL LTD-PARTLY PAID	2,333	73.550	171,592.150	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	48,721	609.650	29,702,757.650	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	3,364	2,447.750	8,234,231.000	
	BANDHAN BANK LTD	38,992	344.950	13,450,290.400	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	11,612	641.300	7,446,775.600	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	10,818	2,362.400	25,556,443.200	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	15,064	1,269.250	19,119,982.000	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	24,802	421.450	10,452,802.900	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,020	1,627.550	8,170,301.000	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	24,883	829.400	20,637,960.200	
インド・ルピー	小計	4,159,940		2,807,099,719.050 (3,986,081,601)	
インドネシア・ルピア	BARITO PACIFIC TBK PT	1,297,300	970.000	1,258,381,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	105,001	20,650.000	2,168,270,650.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	7,150.000	2,523,235,000.000	

	UNILEVER INDONESIA TBK PT	546,400	7,800.000	4,261,920,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,455,000	5,750.000	8,366,250,000.000	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PERSERO TBK	3,504,100	2,860.000	10,021,726,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	461,500	6,675.000	3,080,512,500.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	42,400.000	1,373,760,000.000	
	HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	456,300	1,505.000	686,731,500.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	75,000	14,100.000	1,057,500,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	142,800	9,575.000	1,367,310,000.000	
	BANK MANDIRI	1,328,100	6,375.000	8,466,637,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,820,200	4,000.000	15,280,800,000.000	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	822,200	1,175.000	966,085,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	369,000	5,325.000	1,964,925,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,720,100	1,495.000	2,571,549,500.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	155,400	10,600.000	1,647,240,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	663,500	32,400.000	21,497,400,000.000	
	XL AXIATA TBK PT	371,000	2,190.000	812,490,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,140.000	1,064,874,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	9,675.000	1,596,375,000.000	
	ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT	304,300	1,700.000	517,310,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	19,081,601		92,551,282,650.000 (694,134,620)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	9,032	63.010	569,106.320	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	20.370	109,998.000	
	ACCELINK TECHNOLOGIES CO LTD	5,800	32.750	189,950.000	
	BEIJING THUNISOFT CORP LTD	6,400	25.220	161,408.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	53.900	161,700.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	15.900	190,800.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	3,500	72.630	254,205.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	7,840	23.620	185,180.800	

WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	10.310	168,053.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	14.830	283,253.000	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	52.750	211,000.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	125.560	150,672.000	
JOYOUNG CO LTD	5,100	36.490	186,099.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	25.630	192,225.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	1,600	347.000	555,200.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,530	26.400	277,992.000	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	23.000	151,800.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,200	73.670	383,084.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	22.200	130,980.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	2,000	28.810	57,620.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	5.100	121,380.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	30.180	199,188.000	
BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD	5,850	39.050	228,442.500	
GEM CO LTD	29,100	4.970	144,627.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	48.420	334,098.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	8.250	153,450.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	6,120	36.060	220,687.200	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	43.400	256,233.600	
ZHEJIANG NHU CO LTD	18,200	30.250	550,550.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	1,900	26.430	50,217.000	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	8,500	58.120	494,020.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	24.600	162,360.000	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDICINES CORP LTD	3,900	48.920	190,788.000	

HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	49.170	167,178.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	2,100	38.980	81,858.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	21.230	31,845.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	1,700	20.110	34,187.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	3,700	59.260	219,262.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	41,000	10.450	428,450.000	
ZHEJIANG WANFENG AUTO WHEEL CO LTD	27,000	7.230	195,210.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	26.060	218,904.000	
VENUSTECH GROUP INC	1,000	31.870	31,870.000	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONMENT CO LTD	40,700	5.100	207,570.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,700	70.830	1,182,861.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	6,400	145.480	931,072.000	
GLODON CO LTD	2,300	71.970	165,531.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	6,800	18.900	128,520.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	20.000	204,000.000	
TIANQI LITHIUM CORP	14,900	25.880	385,612.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	16.350	183,120.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	28,400	15.030	426,852.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	5.450	171,130.000	
NAVINFO CO LTD	1,100	15.180	16,698.000	
BY-HEALTH CO LTD	13,900	26.860	373,354.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	8.020	114,686.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	18.580	50,723.400	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	23.330	60,658.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	45.040	351,312.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	25,900	23.260	602,434.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	27.240	163,440.000	

UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	109.980	351,936.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	30.270	108,063.900	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	17.950	267,455.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.960	151,892.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	16.660	143,276.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	50,000	3.620	181,000.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	18,280	69.310	1,266,986.800	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	13,900	32.880	457,032.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	29.090	200,721.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	5.160	197,112.000	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,300	43.280	56,264.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	41.020	200,998.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	11.620	177,786.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	8.350	175,350.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	30.560	229,200.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	28.950	144,750.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	28.720	189,552.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	6,600	189.450	1,250,370.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	7,400	82.100	607,540.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.210	122,739.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	9.700	171,690.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	17,800	24.590	437,702.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	18.000	106,920.000	

BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,800	38.120	144,856.000	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	7.240	115,840.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	143.620	301,602.000	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD	60,100	3.970	238,597.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	5.590	203,923.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	12.150	173,745.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	29,654	58.110	1,723,193.940	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	8.000	220,000.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	9.870	439,215.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	26.360	524,564.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	6,500	23.350	151,775.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	9.310	35,378.000	
IFLYTEK CO LTD	7,500	41.330	309,975.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.150	225,105.000	
GOERTEK INC	10,500	45.070	473,235.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	8.830	188,079.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	20,900	34.580	722,722.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	33.560	489,976.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	7.030	333,222.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	8.480	239,984.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	7.020	263,952.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	12,200	16.510	201,422.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	9.520	216,104.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	7,900	48.910	386,389.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	7,200	101.190	728,568.000	
AVIC AIRCRAFT CO LTD	10,700	24.800	265,360.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	43,240	26.670	1,153,210.800	

JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	6,800	181.800	1,236,240.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,800	272.800	4,310,240.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	8.470	176,176.000	
SUNING.COM CO LTD	29,100	9.530	277,323.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	120,000	5.440	652,800.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	21,500	14.630	314,545.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	9,500	65.860	625,670.000	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL TECHNOLOGY CO LTD	39,700	48.770	1,936,169.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	13.610	231,370.000	
PING AN BANK CO LTD	84,900	18.110	1,537,539.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	30,280	19.250	582,890.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	65,700	5.300	348,210.000	
CHINA VANKE CO LTD	47,900	29.330	1,404,907.000	
ZTE CORP	17,500	36.560	639,800.000	
ZOONLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.520	214,320.000	
WEICHAI POWER CO LTD	22,000	16.390	360,580.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	45.750	192,150.000	
GF SECURITIES CO LTD	18,300	17.890	327,387.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	12.280	259,108.000	
BYD CO LTD	8,400	182.580	1,533,672.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	14.200	484,220.000	
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	11,000	27.350	300,850.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	18.060	232,974.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	53.800	156,020.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	20.930	167,440.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,200	195.000	234,000.000	
JIANGXI ZHENGBO TECHNOLOGY CO LTD	3,600	17.090	61,524.000	

HUNAN VALIN STEEL CO LTD	49,400	5.660	279,604.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	29.700	164,835.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	235.950	283,140.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	12.630	197,028.000	
GUOCHENG MINING CO LTD	7,900	10.810	85,399.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	32.120	211,992.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	73.310	43,986.000	
NINESTAR CORP	5,700	31.290	178,353.000	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD FUJIAN	24,100	6.850	165,085.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	18.700	131,274.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.830	129,454.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	18.190	218,280.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	4,200	68.170	286,314.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	107.600	172,160.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	289.930	144,965.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	12.170	183,767.000	
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	21.120	111,936.000	
SF HOLDING CO LTD	9,400	82.660	777,004.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	10.370	244,732.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	40.290	261,885.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	37,790	7.930	299,674.700	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	13,300	15.580	207,214.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	44.790	609,144.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	5,000	52.480	262,400.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,100	112.340	235,914.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	17,100	23.000	393,300.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	75.990	235,569.000	

ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	15.780	355,050.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	41.120	213,824.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	69.350	218,452.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	105.000	346,500.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	103.300	278,910.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	81.100	251,410.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	134.220	281,862.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	6.960	164,256.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	45.980	198,633.600	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	17.360	164,920.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	52.700	158,100.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	20.650	161,070.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	120.410	101,144.400	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	59.910	161,757.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	1,600	72.800	116,480.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	68.900	91,637.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	136.050	176,865.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	73.060	219,180.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	1,700	167.650	285,005.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	13.190	167,513.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	10.220	275,940.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	92.690	176,111.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	13.040	127,792.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	15.060	216,864.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,300	354.990	1,526,457.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	42.200	223,660.000	

HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	12.290	190,495.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,100	195.900	215,490.000	
OVCTEK CHINA INC	2,900	67.790	196,591.000	
SG MICRO CORP	600	322.000	193,200.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	9,800	265.920	2,606,016.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	2,440	216.440	528,113.600	
WUXI APPTec CO LTD	11,660	120.310	1,402,814.600	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	2,500	113.780	284,450.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	800	538.000	430,400.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	1,400	224.910	314,874.000	
TIANFENG SECURITIES CO LTD	61,700	6.080	375,136.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.070	169,119.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	181.140	163,026.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	60,900	5.780	352,002.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.200	465,780.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	5.020	1,063,236.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.210	880,824.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.220	270,480.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.040	170,084.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	42.650	426,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	17.850	276,675.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	87,200	43.720	3,812,384.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	46,200	83.200	3,843,840.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	87,800	18.560	1,629,568.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	118,800	9.460	1,123,848.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	5.220	721,404.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	24,500	26.750	655,375.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,000	1,745.000	8,725,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	137,200	4.610	632,492.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	41,000	29.750	1,219,750.000	

CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	25,900	33.630	871,017.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	4.750	181,925.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	88,100	20.220	1,781,382.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	97,700	6.490	634,073.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	141,600	4.070	576,312.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	200,300	5.270	1,055,581.000	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTRY CO LTD	73,600	4.270	314,272.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	66,100	14.660	969,026.000	
HUAXIA BANK CO LTD	31,500	6.240	196,560.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	28,300	38.940	1,102,002.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	54,800	4.790	262,492.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	185,100	4.870	901,437.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	56,900	6.450	367,005.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	21,900	54.000	1,182,600.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	21.920	734,320.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	5.140	40,092.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	39,700	16.120	639,964.000	
CRRC CORP LTD	181,300	5.550	1,006,215.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	22,060	87.950	1,940,177.000	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	3,300	11.510	37,983.000	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP LTD	29,800	8.410	250,618.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	46,100	19.660	906,326.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	21,000	7.530	158,130.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	54,900	5.500	301,950.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	7,100	58.790	417,409.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	18,300	28.500	521,550.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	39,300	27.320	1,073,676.000	

GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	61,800	2.050	126,690.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	18,100	6.450	116,745.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	3,200	56.660	181,312.000	
GEMDALE CORP	10,600	14.250	151,050.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	24.950	551,395.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	14,000	90.240	1,263,360.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	116,300	5.180	602,434.000	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOPMENT CO LTD	12,870	14.080	181,209.600	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	70,000	7.700	539,000.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	58,000	9.160	531,280.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	9.560	302,096.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	14,500	22.760	330,020.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.530	134,994.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	8,400	185.270	1,556,268.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	173,900	1.170	203,463.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	5,600	83.900	469,840.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	32,200	4.530	145,866.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	65,800	3.280	215,824.000	
AIR CHINA LTD	28,400	7.650	217,260.000	
TBEA CO LTD	26,700	8.290	221,343.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	31,400	5.780	181,492.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	33,600	2.650	89,040.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	169,400	3.960	670,824.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	74.300	245,190.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	31.200	215,280.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	37,800	16.120	609,336.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.300	181,790.000	

HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,400	34.040	285,936.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	17.160	253,968.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	14.320	68,736.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	10.480	248,376.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	2,100	20.690	43,449.000	
AEC AVIATION POWER CO LTD	9,300	36.980	343,914.000	
BANK OF NANJING CO LTD	21,800	8.090	176,362.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	18.130	137,788.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	92,500	8.230	761,275.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	61,800	4.220	260,796.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	9.620	314,574.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	8.730	246,186.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	3,600	27.540	99,144.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	24.890	236,952.800	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	32.100	243,960.000	
BBMG CORP	54,200	3.070	166,394.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	8.080	237,552.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	9.320	173,352.000	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO LTD	12,500	17.590	219,875.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	23.440	37,504.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	10.610	159,351.590	
AISINO CORP	10,300	14.150	145,745.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	5,640	94.660	533,882.400	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	47.960	779,350.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.100	199,470.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.040	179,360.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	8.820	166,698.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	7.260	185,856.000	

AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	51.470	236,762.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	10.170	170,856.000	
INNER MONGOLIA MENGDIAN HUANENG THERMAL POWER CORP LTD	63,000	2.600	163,800.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	6.140	241,916.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.470	126,812.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,100	231.340	717,154.000	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	14.730	132,570.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	26,600	5.630	149,758.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	4,000	249.800	999,200.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	25.710	30,852.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	26,300	6.080	159,904.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	9.100	227,500.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	6.720	174,048.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	75.660	234,546.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	7.030	158,878.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	35.120	189,648.000	
MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD	72,400	2.710	196,204.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	12,900	7.210	93,009.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	11.070	139,482.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.660	199,800.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	64.800	272,160.000	
INNER MONGOLIA FIRST MACHINERY GROUP CO LTD	19,900	10.320	205,368.000	

JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	6,400	22.830	146,112.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	32.850	191,515.500	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,900	14.010	166,719.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	14.590	172,162.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	27.620	124,290.000	
TONGWEI CO LTD	11,600	33.560	389,296.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,100	63.210	69,531.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	107.050	267,625.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	50.590	268,127.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	24.630	137,928.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	9,300	35.860	333,498.000	
CHINA JUSHI CO LTD	23,400	16.420	384,228.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	3,224	87.600	282,422.400	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	6,700	15.350	102,845.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	16.970	266,429.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	102.770	174,709.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	50.440	247,156.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	16,900	74.790	1,263,951.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	193.000	347,400.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,800	22.460	152,728.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	9.710	314,128.210	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	11,280	167.790	1,892,671.200	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	54.400	272,000.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	25.950	31,140.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	52.100	302,180.000	

	DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	12.980	171,336.000	
	JUNEYAO AIRLINES CO LTD	12,800	11.890	152,192.000	
	GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	50,600	18.910	956,846.000	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	4.670	278,799.000	
	ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	62.240	211,616.000	
	HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	8.140	134,310.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	21,800	6.060	132,108.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	12.990	306,564.000	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	9,000	32.890	296,010.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,100	162.090	178,299.000	
	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	24.530	49,060.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	185.040	222,048.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	12.660	496,272.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	6,500	14.750	95,875.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	500	239.100	119,550.000	
	TOLY BREAD CO LTD	3,600	61.600	221,760.000	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,200	104.840	230,648.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	102.000	299,880.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	22,700	11.520	261,504.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	1,000	47.160	47,160.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	19.130	306,080.000	
	DAWNING INFORMATION INDUSTRY CO LTD	4,100	36.720	150,552.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,300	85.140	536,382.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	6.440	188,048.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	3,700	34.930	129,241.000	
	オフショア・人民元 小計	8,849,684		153,039,388.060 (2,437,917,452)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	296,720	18.220	5,406,238.400	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	132,693	4.290	569,252.970	
	OOREDOO QSC	68,912	6.800	468,601.600	
	QATAR FUEL QSC	25,661	18.490	474,471.890	

	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	38,453	17.320	666,005.960	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	8.680	442,923.040	
	INDUSTRIES QATAR QSC	116,366	10.290	1,197,406.140	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	77,846	16.600	1,292,243.600	
	MASRAF AL RAYAN	204,697	4.315	883,267.550	
	BARWA REAL ESTATE CO	124,139	3.445	427,658.850	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	315,368	2.098	661,642.060	
カタール・リアル 小計		1,451,883		12,489,712.060 (357,205,765)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	33,828	23,190.000	784,471,320.000	
	ECOPETROL SA	267,551	1,982.000	530,286,082.000	
	BANCOLOMBIA SA	13,029	26,500.000	345,268,500.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	29,826	26,600.000	793,371,600.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	22,820	21,500.000	490,630,000.000	
コロンビア・ペソ 小計		367,054		2,944,027,502.000 (85,376,798)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	17,834	58.800	1,048,639.200	
	JARIR MARKETING CO	4,471	181.400	811,039.400	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	85.900	356,914.500	
	ETIHAD ETISALAT CO	27,620	28.950	799,599.000	
	SAUDI BRITISH BANK	44,501	24.680	1,098,284.680	
	AL RAJHI BANK	79,459	71.000	5,641,589.000	
	ARAB NATIONAL BANK	43,653	20.420	891,394.260	
	BANK ALBILAD	28,593	24.780	708,534.540	
	BANK AL-JAZIRA	35,440	13.640	483,401.600	
	BANQUE SAUDI FRANSI	41,518	31.000	1,287,058.000	
	RIYAD BANK	92,062	19.200	1,767,590.400	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	67,310	30.000	2,019,300.000	
	SAUDI TELECOM CO	39,493	103.800	4,099,373.400	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	14,296	80.100	1,145,109.600	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	59,040	95.900	5,661,936.000	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	57.500	372,427.500	
	SAUDI ELECTRICITY CO	58,364	20.360	1,188,291.040	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	15,467	22.840	353,266.280	
	SAVOLA GROUP	18,780	45.300	850,734.000	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	14,636	12.220	178,851.920	
ALMARAI CO JSC	13,893	54.500	757,168.500		
EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	9.640	272,918.040		

	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	31,742	15.800	501,523.600	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	6,651	61.300	407,706.300	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	58,284	10.640	620,141.760	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	29,487	8.500	250,639.500	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	13.620	145,965.540	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	14,000	12.920	180,880.000	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	3,723	123.000	457,929.000	
	ALINMA BANK	66,795	16.140	1,078,071.300	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	2,636	128.600	338,989.600	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	30,946	38.350	1,186,779.100	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	3,088	78.100	241,172.800	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	145,393	35.350	5,139,642.550	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA-RTS	14,039	2.100	29,481.900	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	97,970	42.000	4,114,740.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,270,844		46,487,083.810 (1,305,357,313)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	37,300	117.000	4,364,100.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	64,600	34.250	2,212,550.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	146,200	10.300	1,505,860.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	40,800	52.250	2,131,800.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	68,000	77.750	5,287,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	585,955	3.040	1,781,303.200	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	44,200	94.250	4,165,850.000	
	TMB BANK PCL -NVDR	1,336,200	1.030	1,376,286.000	
	IRPC PCL NVDR	964,700	2.460	2,373,162.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	25,500	191.500	4,883,250.000	
	SHIN CORP PCL	159,400	54.750	8,727,150.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	280,400	28.000	7,851,200.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	80,300	181.500	14,574,450.000	

HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	355,220	14.900	5,292,778.000	
PTT PCL	770,000	38.250	29,452,500.000	
THAI UNION GROUP PCL- NVDR	146,400	15.600	2,283,840.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	65,600	43.000	2,820,800.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	808,900	7.200	5,824,080.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	52,650	367.000	19,322,550.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	296,500	67.750	20,087,875.000	
KASIKORNBANK PCL - FOREIGN	64,000	94.250	6,032,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	173,500	50.250	8,718,375.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	677,100	20.800	14,083,680.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	30,300	109.000	3,302,700.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	207,910	23.100	4,802,721.000	
THAI OIL PCL NVDR	59,100	45.000	2,659,500.000	
CP ALL PCL NVDR	391,400	63.000	24,658,200.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	464,300	10.300	4,782,290.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	99,345	90.750	9,015,558.750	
TOTAL ACCESS COMMUNICATION PCL	29,200	35.000	1,022,000.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	123,422	27.250	3,363,249.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	165,508	49.250	8,151,269.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	72,600	45.000	3,267,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	613,600	9.200	5,645,120.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	48.000	2,716,800.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	117,300	33.750	3,958,875.000	
OSOTSPA PCL NVDR	26,700	36.250	967,875.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	23.100	2,432,430.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	455,600	4.080	1,858,848.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	89,333	32.500	2,903,322.500	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	56,800	52.500	2,982,000.000	

	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	55.750	3,406,325.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	66.250	3,252,875.000	
タイ・パーツ 小計		10,517,943		270,301,397.950 (937,945,851)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,964	550.000	2,730,200.000	
	CEZ	8,611	473.000	4,073,003.000	
	MONETA MONEY BANK AS	51,527	58.500	3,014,329.500	
チェコ・コルナ 小計		65,102		9,817,532.500 (46,142,403)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,676,246	32.540	184,705,044.840	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,710	27,300.000	73,983,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,588,385	71.210	255,528,895.850	
	EMPRESAS CMPC SA	58,710	1,704.000	100,041,840.000	
	EMPRESAS COPEC SA	30,491	6,360.000	193,922,760.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	7,085	5,195.000	36,806,575.000	
	ENTEL CHILE SA	6,610	5,212.000	34,451,320.000	
	ENEL AMERICAS SA	2,417,505	114.000	275,595,570.000	
	COLBUN SA	580,423	128.750	74,729,461.250	
	AGUAS ANDINAS SA	122,191	214.000	26,148,874.000	
	EMBOTELLADORA ANDINA SA	20,026	1,705.000	34,144,330.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	7,812	32,200.000	251,546,400.000	
	FALABELLA SA	43,581	2,454.500	106,969,564.500	
	CENCOSUD SA	93,545	1,210.000	113,189,450.000	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,300.000	38,000,300.000	
ENEL CHILE SA	1,502,784	55.300	83,103,955.200		
チリ・ペソ 小計		14,187,335		1,882,867,340.640 (261,718,560)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	189,755	5.660	1,074,013.300	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE MALT SANAYII AS	5,860	21.540	126,224.400	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	18.030	809,510.940	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	65,707	11.570	760,229.990	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	117.300	547,556.400	
	KOC HOLDING AS	53,770	16.790	902,798.300	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	6.740	606,600.000	
	TURK HAVA YOLLARI	44,206	11.500	508,369.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	89,787	15.380	1,380,924.060	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	209,164	7.760	1,623,112.640	
	TURKIYE IS BANKASI	69,478	6.180	429,374.040	

	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	5,995	84.300	505,378.500	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	239,230	2.550	610,036.500	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	28,304	9.460	267,755.840	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	33,169	69.000	2,288,661.000	
トルコ・リラ 小計		1,173,991		12,440,544.910 (159,861,002)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	10,285	6,820.000	70,143,700.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	22,160	1,848.000	40,951,680.000	
	OTP BANK NYRT	15,563	12,060.000	187,689,780.000	
ハンガリー・フォリント 小計		48,008		298,785,160.000 (104,395,535)	
パキスタン・ ルピー	MCB BANK LTD	12,400	172.720	2,141,728.000	
	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	21,868	97.750	2,137,597.000	
	HABIB BANK LTD	19,300	130.610	2,520,773.000	
パキスタン・ルピー 小計		53,568		6,800,098.000 (4,556,066)	
フィリピン・ ペソ	AYALA LAND INC	564,100	37.750	21,294,775.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	134,530	48.900	6,578,517.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	39,480	81.000	3,197,880.000	
	AYALA CORP	19,553	840.000	16,424,520.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,555	2,030.000	3,156,650.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	51,530	128.000	6,595,840.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	210,120	74.000	15,548,880.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	32,590	200.200	6,524,518.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	148,275	43.150	6,398,066.250	
	BDO UNIBANK INC	144,133	95.500	13,764,701.500	
	MEGAWORLD CORP	879,000	3.450	3,032,550.000	
	PLDT INC	5,550	1,425.000	7,908,750.000	
	ROBINSONS LAND CORP	94,000	16.800	1,579,200.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	681,575	38.300	26,104,322.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	63,430	148.500	9,419,355.000	
	SM INVESTMENTS CORP	15,968	1,100.000	17,564,800.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	4.290	3,869,151.000	
	ABOITIZ POWER CORP	95,700	27.500	2,631,750.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	310.000	5,490,100.000	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	67,600	41.000	2,771,600.000	

	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	529.500	3,495,229.500	
フィリピン・ペソ 小計		4,174,900		183,351,155.750 (399,705,520)	
ブラジル・レアル	BRF SA	29,092	19.600	570,203.200	
	VALE SA	247,721	63.160	15,646,058.360	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	7,900	69.300	547,470.000	
	RAIA DROGASIL SA	76,100	25.590	1,947,399.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	16,450	34.970	575,256.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	34.730	684,181.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,800	34.370	2,089,696.000	
	ITAUSA SA	306,760	10.770	3,303,805.200	
	LOJAS AMERICANAS SA	65,274	25.110	1,639,030.140	
	GERDAU SA	76,130	20.830	1,585,787.900	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO	8,306	67.080	557,166.480	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	262,810	23.640	6,212,828.400	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	60,600	22.600	1,369,560.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	307,412	23.080	7,095,068.960	
	COGNA EDUCACAO	85,547	4.900	419,180.300	
	CCR SA	93,220	12.500	1,165,250.000	
	WEG SA	56,672	79.030	4,478,788.160	
	BANCO BRADESCO SA PREF	310,285	24.420	7,577,159.700	
	BANCO BRADESCO SA	77,125	21.890	1,688,266.250	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	43,506	20.010	870,555.060	
	SUZANO SA	51,675	47.970	2,478,849.750	
	CPFL ENERGIA SA	16,900	30.790	520,351.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	326,147	28.880	9,419,125.360	
	PORTO SEGURO SA	4,600	52.100	239,660.000	
	B2W CIA DIGITAL	13,700	73.070	1,001,059.000	
	BRASKEM SA	10,330	25.420	262,588.600	
	ENGIE BRASIL SA	14,887	43.340	645,202.580	
	LOCALIZA RENT A CAR	41,989	66.320	2,784,710.480	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	33,428	45.760	1,529,665.280	
	LOJAS RENNER SA	58,337	48.520	2,830,511.240	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	57,104	21.700	1,239,156.800		
COSAN SA	10,700	76.270	816,089.000		
EQUATORIAL ENERGIA SA	70,200	21.990	1,543,698.000		
JBS SA	67,300	20.940	1,409,262.000		
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	47,769	11.690	558,419.610		

	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	18,098	46.740	845,900.520	
	MULTIPLAN EMPREENHIMENTOS IMOBILIARIOS SA	14,240	24.040	342,329.600	
	HYPERA SA	25,400	31.070	789,178.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	139,116	54.100	7,526,175.600	
	MAGAZINE LUIZA SA	198,400	25.220	5,003,648.000	
	CIELO SA	76,407	3.750	286,526.250	
	VIA VAREJO S/A	89,700	17.840	1,600,248.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	38,900	27.250	1,060,025.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	33,800	69.360	2,344,368.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	11,800	68.310	806,058.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	19.640	587,236.000	
	AMBEV SA	321,695	15.210	4,892,980.950	
	NATURA &CO HOLDING SA	61,200	48.450	2,965,140.000	
	TIM SA	62,200	12.880	801,136.000	
	RUMO SA	93,400	20.070	1,874,538.000	
	IRB BRASIL RESSEGUROS S/A	50,100	6.540	327,654.000	
	ブラジル・リアル 小計	4,300,832		119,354,201.230 (2,319,052,130)	
ポーランド・ ズロチ	MBANK	668	169.000	112,892.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,085	134.650	1,357,945.250	
	BANK PEKAO SA	9,807	52.060	510,552.420	
	ORANGE POLSKA SA	29,777	6.605	196,677.080	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	23,203	47.940	1,112,351.820	
	LPP SA	87	7,610.000	662,070.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,761	171.200	643,883.200	
	CD PROJEKT RED SA	4,689	365.700	1,714,767.300	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	63,300	24.200	1,531,860.000	
	GRUPA LOTOS SA	3,978	33.940	135,013.320	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	86,893	4.840	420,562.120	
	CYFROWY POLSAT SA	17,679	27.540	486,879.660	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	5.900	307,932.800	

	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	45,253	25.000	1,131,325.000	
	DINO POLSKA SA	3,139	266.000	834,974.000	
	ALLEGRO.EU SA	16,700	82.750	1,381,925.000	
ポーランド・ズロチ 小計		371,211		12,541,610.970 (346,524,711)	
マレーシア・ リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	84,400	3.130	264,172.000	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,100	10.000	141,000.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	497,900	3.380	1,682,902.000	
	DIGI.COM BHD	235,600	4.200	989,520.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	68,520	5.220	357,674.400	
	RHB BANK BHD	137,280	4.850	665,808.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	34,400	8.180	281,392.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	323,000	7.800	2,519,400.000	
	GAMUDA BHD	87,400	3.720	325,128.000	
	GENTING BHD	201,000	3.600	723,600.000	
	YTL CORP BHD	248,217	0.795	197,332.510	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	8,756	15.100	132,215.600	
	HONG LEONG BANK BHD	34,708	16.180	561,575.440	
	IOI CORP BHD	153,313	4.520	692,974.760	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	34,200	22.800	779,760.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	32.440	376,304.000	
	MALAYAN BANKING BHD	256,875	7.660	1,967,662.500	
	MISC BHD	100,880	7.210	727,344.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	3,100	141.000	437,100.000	
	PPB GROUP BHD	39,260	19.120	750,651.200	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	19.800	441,540.000	
	PETRONAS GAS BHD	41,800	16.180	676,324.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	149,700	2.380	356,286.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	56,700	4.300	243,810.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	158,950	11.200	1,780,240.000	
	QL RESOURCES BHD	96,650	6.320	610,828.000	
	DIALOG GROUP BHD	289,144	3.790	1,095,855.760	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	199,330	17.200	3,428,476.000	
	CARLSBERG BREWERY-MALAY BHD	7,000	22.580	158,060.000	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	6.580	544,824.000	
	SUPERMAX CORP BHD	92,400	8.830	815,892.000	
	SIME DARBY BERHAD	133,200	2.460	327,672.000	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	116,900	15.700	1,835,330.000		
AXIATA GROUP BERHAD	145,700	3.340	486,638.000		
MAXIS BHD	128,300	5.200	667,160.000		

	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	173,200	6.750	1,169,100.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	168,700	5.650	953,155.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	42,000	4.010	168,420.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	94,300	6.050	570,515.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	135,100	5.150	695,765.000	
マレーシア・リンギット 小計		4,908,683		31,599,407.970 (806,416,891)	
メキシコ・ペ ソ	ALFA SAB DE CV	161,300	14.790	2,385,627.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	100,000	42.940	4,294,000.000	
	GRUMA SAB DE CV	17,065	214.820	3,665,903.300	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	16,460	157.940	2,599,692.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	43.290	1,510,821.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	175,700	105.890	18,604,873.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	62,925	37.090	2,333,888.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,675	325.190	2,495,833.250	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	116,900	31.490	3,681,181.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	15,875	307.290	4,878,228.750	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	208,352	64.370	13,411,618.240	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,247,278	14.370	32,293,384.860	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	115,800	17.890	2,071,662.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	29,200	93.930	2,742,756.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	343,500	53.620	18,418,470.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	26,940	199.850	5,383,959.000	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA SAB DE CV	30,200	74.490	2,249,598.000	
	BEACLE SAB DE CV	38,400	46.700	1,793,280.000	
メキシコ・ペソ 小計		3,748,470		124,814,776.050 (645,292,392)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,912	12.900	179,464.800	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	MOTOR OIL HELLAS CORINTH REFIN	4,897	9.200	45,052.400	
	OPAP SA	10,575	8.490	89,781.750	
	JUMBO SA	7,156	14.900	106,624.400	

ユーロ 小計		39,670		420,923.350 (52,316,563)	
韓国・ウォン	CHEIL WORLDWIDE INC	3,354	21,500.000	72,111,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	2,222	83,600.000	185,759,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,174	195,000.000	423,930,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,843	47,200.000	181,389,600.000	
	COWAY CO LTD	3,037	75,000.000	227,775,000.000	
	KT&G CORP	8,076	84,500.000	682,422,000.000	
	S-1 CORPORATION	867	83,900.000	72,741,300.000	
	KOREA GAS CORP	802	30,800.000	24,701,600.000	
	CJ CORP	1,001	79,800.000	79,879,800.000	
	KAKAO CORP	3,844	356,000.000	1,368,464,000.000	
	CJ ENM CO LTD	563	134,700.000	75,836,100.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	24,300.000	60,677,100.000	
	KMW CO LTD	1,651	70,400.000	116,230,400.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,691	227,000.000	610,857,000.000	
	DAELIM INDUSTRIAL CO	1,516	82,200.000	124,615,200.000	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	18,794	9,060.000	170,273,640.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,129	797,000.000	899,813,000.000	
	LG UPLUS CORP	11,355	11,750.000	133,421,250.000	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	3,649	14,000.000	51,086,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	653	1,529,000.000	998,437,000.000	
	LG CHEM LTD	3,080	702,000.000	2,162,160,000.000	
	LG CHEM LTD	527	354,000.000	186,558,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	78	704,000.000	54,912,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	30,254	32,950.000	996,869,300.000	
	S-OIL CORP	3,627	66,400.000	240,832,800.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,270	51,800.000	376,586,000.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	3,570.000	72,299,640.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	5,263	33,950.000	178,678,850.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,403	81,100.000	113,783,300.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,227	268,000.000	328,836,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	1,667	80,100.000	133,526,700.000	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	3,020	93,000.000	280,860,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,523	241,000.000	1,090,043,000.000		
SK HYNIX INC	36,635	86,500.000	3,168,927,500.000		

HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,114	32,950.000	135,556,300.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	83,700.000	126,805,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	10,162	173,500.000	1,763,107,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,619	32,150.000	148,500,850.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	21,114	8,860.000	187,070,040.000	
KIA MOTORS CORP	17,935	54,500.000	977,457,500.000	
KOREA ZINC CO LTD	629	390,000.000	245,310,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	18,182	20,700.000	376,367,400.000	
HANWHA CORP	1,880	26,400.000	49,632,000.000	
KOREAN AIR CO LTD	4,343	24,250.000	105,317,750.000	
CJ LOGISTICS	433	155,500.000	67,331,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,197	136,000.000	162,792,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,026	103,500.000	106,191,000.000	
HLB INC	2,771	93,300.000	258,534,300.000	
LG ELECTRONICS INC	7,289	85,900.000	626,125,100.000	
LOTTE CORP	1,591	30,750.000	48,923,250.000	
LG CORP	6,663	74,000.000	493,062,000.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	10,250.000	93,920,750.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	3,627	29,900.000	108,447,300.000	
NAVER CORP	8,310	283,000.000	2,351,730,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,434	72,500.000	176,465,000.000	
OTTOGI CORP	39	545,000.000	21,255,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,001	47,750.000	95,547,750.000	
KANGWON LAND INC	8,713	22,300.000	194,299,900.000	
POSCO	5,003	237,000.000	1,185,711,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,686	12,150.000	105,534,900.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,704	533,000.000	1,974,232,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,847	139,500.000	536,656,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	320,412	60,200.000	19,288,802,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	36,740	5,880.000	216,031,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	54,339	55,500.000	3,015,814,500.000	
SHINSEGAE CO LTD	513	228,000.000	116,964,000.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,812	128,500.000	232,842,000.000	
YUHAN CORP	3,718	64,500.000	239,811,000.000	
HANON SYSTEMS	10,245	12,550.000	128,574,750.000	
HYUNDAI MARINE & FIRE INSURANCE CO LTD	3,018	24,950.000	75,299,100.000	

	GS HOLDINGS CORP	4,870	36,850.000	179,459,500.000	
	LG DISPLAY CO LTD	17,034	14,900.000	253,806,600.000	
	CELLTRION INC	6,403	276,500.000	1,770,429,500.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	20,673	34,900.000	721,487,700.000	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,360	194,000.000	263,840,000.000	
	CELLTRION PHARM INC	876	112,200.000	98,287,200.000	
	LOTTE SHOPPING CO	550	93,600.000	51,480,000.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,027	66,800.000	335,803,600.000	
	AMOREPACIFIC CORP	2,293	170,000.000	389,810,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP-PREF	368	54,600.000	20,092,800.000	
	SAMSUNG CARD CO	3,026	32,150.000	97,285,900.000	
	SK INNOVATION CO LTD	3,851	160,000.000	616,160,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	621	379,500.000	235,669,500.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	13,510	4,225.000	57,079,750.000	
	LG INNOTEK CO LTD	734	152,000.000	111,568,000.000	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,450	195,000.000	477,750,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	26,718	44,700.000	1,194,294,600.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,711	23,200.000	86,095,200.000	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	27,657	6,030.000	166,771,710.000	
	HANMI PHARM CO LTD	478	289,000.000	138,142,000.000	
	FILA HOLDINGS CORP	2,424	46,300.000	112,231,200.000	
	SEEGENE INC	1,133	250,500.000	283,816,500.000	
	E-MART CO LTD	1,464	150,500.000	220,332,000.000	
	GS RETAIL CO LTD	1,288	34,150.000	43,985,200.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	3,911	32,400.000	126,716,400.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	533	248,500.000	132,450,500.000	
	BGF RETAIL CO LTD	786	132,000.000	103,752,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,835	117,000.000	214,695,000.000	
	NETMARBLE CORP	1,353	125,500.000	169,801,500.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	39,251	9,860.000	387,014,860.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,464	171,000.000	421,344,000.000	
	ALTEOGEN INC	1,138	159,800.000	181,852,400.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,825	116,500.000	678,612,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,128	752,000.000	848,256,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	314	198,800.000	62,423,200.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,922	32,350.000	94,526,700.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	4,764	90,300.000	430,189,200.000	
韓国・ウォン	小計	999,074		63,758,628,540.000 (6,018,814,534)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	68,000	10.260	697,680.000	

JIANGSU EXPRESS	90,000	8.630	776,700.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	162,000	4.850	785,700.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	5,700	94.090	536,313.000	
CHINA MOBILE LIMITED	410,000	51.250	21,012,500.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	75,000	51.900	3,892,500.000	
BEIJING ENTERPRISES	54,000	25.700	1,387,800.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	206,000	3.040	626,240.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	222,000	21.500	4,773,000.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	5.900	413,000.000	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	47,000	53.700	2,523,900.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LT	216,000	3.540	764,640.000	
CNOOC LTD	1,207,000	8.410	10,150,870.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	232,000	7.430	1,723,760.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	613,600	8.170	5,013,112.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	262,620	20.850	5,475,627.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	216,888	36.250	7,862,190.000	
CITIC LTD	443,000	6.310	2,795,330.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	100,000	6.000	600,000.000	
LENOVO GROUP LTD	516,000	5.230	2,698,680.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,396,000	2.480	3,462,080.000	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	442,742	5.220	2,311,113.240	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	130,390	12.940	1,687,246.600	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,657,200	3.550	5,883,060.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	50,000	18.340	917,000.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	163,000	23.750	3,871,250.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	54,400	98.350	5,350,240.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	256,000	5.930	1,518,080.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	96,000	5.460	524,160.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	378,000	1.630	616,140.000	

CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	152,000	9.820	1,492,640.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	2.060	300,760.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	100,000	18.000	1,800,000.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	61,500	13.060	803,190.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	50,000	11.420	571,000.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	182,000	27.300	4,968,600.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	52,000	25.600	1,331,200.000	
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	401,000	20.400	8,180,400.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	148,000	2.500	370,000.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	66,000	36.200	2,389,200.000	
BYD CO LTD	42,500	184.500	7,841,250.000	
CHINA TELECOM CORP LTD	918,000	2.580	2,368,440.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	5.570	657,260.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,070,000	1.110	1,187,700.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	236,592	4.180	988,954.560	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	6.050	423,500.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	485,788	5.890	2,861,291.320	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	153,000	4.320	660,960.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	157,200	8.360	1,314,192.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	214,500	13.500	2,895,750.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	499,000	17.980	8,972,020.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	407,000	6.600	2,686,200.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	176,000	14.840	2,611,840.000	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	243,200	24.200	5,885,440.000	
WEICHAJ POWER CO LTD	139,440	16.960	2,364,902.400	
CHINA SHIPPING DEVELOPMENT CO	34,000	3.450	117,300.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL	233,000	1.610	375,130.000	
SHANGHAI INDUSTRIAL	27,000	11.280	304,560.000	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO LTD	48,000	7.620	365,760.000	

TINGYI HOLDING CORP	122,000	13.660	1,666,520.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	28,000	67.000	1,876,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	214,000	12.900	2,760,600.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	158,000	3.270	516,660.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	99,333	54.150	5,378,881.950	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	86,000	5.700	490,200.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	710,250	8.010	5,689,102.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	188,000	40.500	7,614,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	384,900	595.000	229,015,500.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	393,500	85.100	33,486,850.000	
LI NING CO LTD	143,500	45.000	6,457,500.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	478,000	3.090	1,477,020.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	435,240	0.940	409,125.600	
CHINA POWER INTERNATIONAL	210,000	1.560	327,600.000	
AIR CHINA / HONG KONG	78,000	6.050	471,900.000	
ZTE CORP	44,288	21.750	963,264.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	284,000	2.360	670,240.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	226,500	14.300	3,238,950.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	160,000	6.380	1,020,800.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	547,205	4.220	2,309,205.100	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	102,250	5.780	591,005.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	52,500	45.300	2,378,250.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,425,530	6.000	38,553,180.000	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	56,000	143.500	8,036,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	144,000	8.800	1,267,200.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	11.600	1,136,800.000	
SSY GROUP LTD	132,000	4.520	596,640.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	123,000	11.300	1,389,900.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	268,000	9.970	2,671,960.000	
BANK OF CHINA LTD	5,181,200	2.720	14,092,864.000	

SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	87,000	30.000	2,610,000.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	106,400	10.600	1,127,840.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	255,970	48.400	12,388,948.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	4,034,235	4.740	19,122,273.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	53,500	10.440	558,540.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	56,500	11.500	649,750.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	4.700	787,720.000	
CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCTION CO LTD	281,000	4.280	1,202,680.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	32,000	21.400	684,800.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	28,700	26.800	769,160.000	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	89,000	35.650	3,172,850.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	529,142	11.060	5,852,310.520	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	240,000	3.300	792,000.000	
CHINA CITIC BANK-H	633,800	3.390	2,148,582.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	64,500	11.620	749,490.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	48,700	146.900	7,154,030.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	73,000	102.200	7,460,600.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	21.550	431,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	193,028	10.760	2,076,981.280	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	376,000	4.160	1,564,160.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	8.480	720,800.000	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	345,500	1.690	583,895.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	150,000	3.590	538,500.000	
SOHO CHINA LTD	111,500	2.240	249,760.000	
KINGSOFT CORP LTD	59,000	42.000	2,478,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	44,000	19.440	855,360.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	318,000	3.830	1,217,940.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	59,000	7.070	417,130.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	48,500	35.150	1,704,775.000	

CHINA RAILWAY CONSTRUCTION CORP	108,000	5.390	582,120.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	373,000	5.200	1,939,600.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	186,600	27.350	5,103,510.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	134,000	17.120	2,294,080.000	
CRRC CORP LTD - H	254,450	3.270	832,051.500	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	70,000	8.580	600,600.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	152,000	8.380	1,273,760.000	
SINOPHARM GROUP CO	87,200	19.000	1,656,800.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	176,000	10.480	1,844,480.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	212,527	9.090	1,931,870.430	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	84,500	6.150	519,675.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	3.340	661,320.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	172,000	6.110	1,050,920.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	64,200	13.340	856,428.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	178,000	31.550	5,615,900.000	
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	86,000	3.330	286,380.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,600	7.450	421,670.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	120,500	48.450	5,838,225.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	60,300	32.700	1,971,810.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	398,156	4.410	1,755,867.960	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	126,000	3.820	481,320.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,800	12.380	269,884.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	70,000	13.500	945,000.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.910	727,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,812,000	2.890	5,236,680.000	

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	40,000	58.700	2,348,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	166,000	7.970	1,323,020.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	147,500	18.100	2,669,750.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	110,000	6.680	734,800.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	156,800	6.930	1,086,624.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	498,000	2.430	1,210,140.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	39,000	37.350	1,456,650.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	258,000	5.930	1,529,940.000	
SINOPEC ENGINEERING GROUP CO LTD	88,500	3.330	294,705.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	211,000	4.800	1,012,800.000	
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	76,000	8.520	647,520.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	26,000	11.300	293,800.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	630,000	4.190	2,639,700.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	32,000	94.950	3,038,400.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	78,000	12.160	948,480.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	12,500	26.100	326,250.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	95,000	47.500	4,512,500.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.930	453,560.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	35,700	100.500	3,587,850.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	13.420	697,840.000	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	20,000	16.780	335,600.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	22,500	35.400	796,500.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,078,000	1.330	4,093,740.000	
XIAOMI CORP	709,200	24.450	17,339,940.000	
WUXI APPTec CO LTD	15,860	137.200	2,175,992.000	
MEITUAN	239,500	300.000	71,850,000.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	44,400	14.300	634,920.000	

HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	55,000	55.100	3,030,500.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	280,000	13.440	3,763,200.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	65,500	55.900	3,661,450.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	415,000	1.530	634,950.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	111,000	13.200	1,465,200.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	114,000	36.850	4,200,900.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	56.000	324,800.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	28,000	16.280	455,840.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	3,000	154.900	464,700.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	62,000	11.280	699,360.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	82,000	34.300	2,812,600.000	
CHINA FEIHE LTD	74,000	17.480	1,293,520.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	104,961	27.750	2,912,667.750	
LUYE PHARMA GROUP LTD	109,500	4.480	490,560.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	24,000	34.500	828,000.000	
CGN POWER CO LTD	499,000	1.700	848,300.000	
BAIC MOTOR CORP LTD	82,000	3.360	275,520.000	
GF SECURITIES CO LTD	68,200	11.580	789,756.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	42,000	36.900	1,549,800.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	79,000	12.900	1,019,100.000	
3SBIO INC	64,000	7.480	478,720.000	
LEGEND HOLDINGS CORP	37,000	10.920	404,040.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	4.240	398,560.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	521,000	0.880	458,480.000	
CHINA LITERATURE LTD	22,600	60.000	1,356,000.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.890	716,385.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	154,000	2.920	449,680.000	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	6.180	395,520.000	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	5.390	350,350.000	
CHINA REINSURANCE GROUP CORP	774,000	0.800	619,200.000	
BOC AVIATION LTD	11,600	64.300	745,880.000	

	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	20,000	41.200	824,000.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	99,200	19.700	1,954,240.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	68,500	228.400	15,645,400.000	
香港・ドル	小計	60,814,685		853,416,597.610 (11,572,329,061)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	31,000	217.500	6,742,500.000	
	ACER INC	222,532	23.000	5,118,236.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	48,554	241.500	11,725,791.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	33,616	348.500	11,715,176.000	
	ASIA CEMENT CORP	152,928	42.250	6,461,208.000	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	20,000	182.000	3,640,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	325,267	9.930	3,229,901.310	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	66,000	98.300	6,487,800.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	42,000	113.500	4,767,000.000	
	CHICONY ELECTRONICS CO LTD	47,975	87.000	4,173,825.000	
	QUANTA COMPUTER INC	194,858	72.100	14,049,261.800	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	80,777	42.950	3,469,372.150	
	EVA AIRWAYS CORP	145,125	12.150	1,763,268.750	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	48,760	187.500	9,142,500.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	377,761	17.950	6,780,809.950	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	150,169	38.600	5,796,523.400	
	CHINA STEEL CORP	794,058	20.800	16,516,406.400	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	228,973	19.850	4,545,114.050	
	ADVANTECH CO LTD	21,675	295.500	6,404,962.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	272,304	19.100	5,201,006.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	129,663	193.000	25,024,959.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	90,000	60.600	5,454,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	237,327	110.000	26,105,970.000	
	AU OPTRONICS CORP	626,194	11.200	7,013,372.800	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	95,800	99.700	9,551,260.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	125,820	19.950	2,510,109.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	191,824	26.900	5,160,065.600	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	28,768	186.500	5,365,232.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	14,322	416.000	5,957,952.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	40,285	291.500	11,743,077.500	

FORMOSA PLASTICS CORP	251,633	84.900	21,363,641.700	
FORMOSA TAFFETA CO LTD	82,000	31.750	2,603,500.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	235,594	74.200	17,481,074.800	
GIANT MANUFACTURING	18,151	272.500	4,946,147.500	
MEDIATEK INC	100,507	686.000	68,947,802.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	438,936	43.600	19,137,609.600	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	511,944	18.150	9,291,783.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	20,000	656.000	13,120,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	117,000	61.000	7,137,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	650,146	18.600	12,092,715.600	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	512,941	40.400	20,722,816.400	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	976,403	8.670	8,465,414.010	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	753,448	25.800	19,438,958.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	827,225	80.800	66,839,780.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	710,495	29.000	20,604,355.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	3,300.000	20,526,000.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	707,058	13.200	9,333,165.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	833,061	8.370	6,972,720.570	
INVENTEC CO LTD	195,005	22.300	4,348,611.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	150,845	47.500	7,165,137.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	738,443	11.200	8,270,561.600	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,167,048	19.100	22,290,616.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	684,977	21.450	14,692,756.650	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	58,560	88.800	5,200,128.000	
NAN YA PLASTICS CORP	343,828	63.000	21,661,164.000	
WISTRON CORP	212,916	29.150	6,206,501.400	
POU CHEN CORP	145,990	27.700	4,043,923.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	326,297	64.300	20,980,897.100	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	39,392	262.000	10,320,704.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	61,480	86.000	5,287,280.000	

	PHISON ELECTRONICS CORP	10,658	318.000	3,389,244.000	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	42,589	40.650	1,731,242.850	
	FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	62,588	51.600	3,229,540.800	
	STANDARD FOODS CORP	15,639	63.300	989,948.700	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	91,899	42.800	3,933,277.200	
	TAIWAN CEMENT CORP	323,171	41.550	13,427,755.050	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,652,083	451.000	745,089,433.000	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	787,525	31.000	24,413,275.000	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	157,000	17.500	2,747,500.000	
	YAGEO CORP	25,160	388.000	9,762,080.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	151,000	31.600	4,771,600.000	
	INNOLUX CORPORATION	601,345	9.710	5,839,059.950	
	WPG HOLDINGS CO LTD	124,203	40.000	4,968,120.000	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	15,994	282.000	4,510,308.000	
	PEGATRON CORP	134,554	60.300	8,113,606.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	7,000	796.000	5,572,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	19,000	315.000	5,985,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	85,470	159.000	13,589,730.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,525.000	3,050,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	31,385	122.000	3,828,970.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	619,954	20.150	12,492,073.100	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	238,993	39.550	9,452,173.150	
	WIWYNN CORP	5,000	788.000	3,940,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	226,903	71.500	16,223,564.500	
	SILERGY CORP	4,000	2,205.000	8,820,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	420.000	5,460,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	352.500	3,525,000.000	
	台湾・ドル 小計	22,219,991		1,649,963,928.440 (6,071,867,257)	
南アフリカ・ランド	BIDVEST GROUP LTD	23,315	159.680	3,722,939.200	
	CLICKS GROUP LTD	17,820	260.670	4,645,139.400	
	DISCOVERY LTD	24,989	127.720	3,191,595.080	
	GOLD FIELDS LTD	59,749	177.020	10,576,767.980	
	REMGRO LTD	41,000	99.830	4,093,030.000	
	NORTHAM PLATINUM LTD	25,447	176.950	4,502,846.650	

MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LTD	39,505	14.990	592,179.950	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	33,877	80.000	2,710,160.000	
EXXARO RESOURCES LTD	16,476	129.940	2,140,891.440	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,826	1,373.470	6,628,366.220	
MTN GROUP LTD	116,545	68.660	8,001,979.700	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	28,390	384.860	10,926,175.400	
FIRSTRAND LTD	322,808	46.440	14,991,203.520	
NASPERS LTD	29,205	3,175.000	92,725,875.000	
NEDBANK GROUP LTD	26,013	127.570	3,318,478.410	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,829	1,146.400	4,389,565.600	
SASOL LTD	30,704	110.180	3,382,966.720	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,743	140.280	4,873,748.040	
MR PRICE GROUP LTD	17,420	160.890	2,802,703.800	
STANDARD BANK GROUP LTD	88,040	125.500	11,049,020.000	
SPAR GROUP LTD/THE	10,097	188.470	1,902,981.590	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	53,358	39.730	2,119,913.340	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	28,005	129.040	3,613,765.200	
ABSA GROUP LTD	51,919	101.280	5,258,356.320	
TIGER BRANDS LTD	9,616	215.830	2,075,421.280	
SANLAM LTD	126,146	56.570	7,136,079.220	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	54,618	164.540	8,986,845.720	
KUMBA IRON ORE LTD	3,074	550.000	1,690,700.000	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	73,218	18.360	1,344,282.480	
RMI HOLDINGS	39,820	32.830	1,307,290.600	
VODACOM GROUP PTY LTD	44,659	129.240	5,771,729.160	
NEPI ROCKCASTLE PLC	23,695	73.000	1,729,735.000	
OLD MUTUAL LTD	362,240	12.180	4,412,083.200	
REINET INVESTMENTS SCA	7,789	286.530	2,231,782.170	
PEPKOR HOLDINGS LTD	91,940	13.920	1,279,804.800	
MULTICHOICE GROUP LTD	31,604	128.150	4,050,052.600	
SIBANYE STILLWATER LTD	154,483	53.400	8,249,392.200	
BID CORP LTD	23,793	277.750	6,608,505.750	
南アフリカ・ランド 小計	2,174,775		269,034,352.740 (1,813,291,537)	
合計	168,475,792		48,775,906,831 (48,775,906,831)	

(2) 株式以外の有価証券

2020年11月11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	3,975.300	
	タイ・パーツ 小計		9,465.000	3,975.300	

				(13,795)		
新株予約権証券 合計			9,465	13,795	(13,795)	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	13,900.000	1,055,705.000		
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,300.000	784,692.000		
		ENERGISA SA	17,500.000	815,675.000		
		KLABIN SA	43,800.000	1,020,540.000		
		SUL AMERICA SA	14,869.000	632,229.880		
	ブラジル・リアル 小計			111,369.000	4,308,841.880	(83,720,798)
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,040,875.000	9,586,458.750		
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	41,500.000	3,661,960.000		
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	132,400.000	18,305,624.000		
		GRUPO TELEVISA SAB	180,800.000	5,832,608.000		
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	13,800.000	934,260.000		
メキシコ・ペソ 小計			1,409,375.000	38,320,910.750	(198,119,108)	
投資信託受益証券 合計			1,520,744	281,839,906	(281,839,906)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	245,700.000	4,265,352.000		
	メキシコ・ペソ 小計		245,700.000	4,265,352.000	(22,051,870)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	172,084.000	2,180,304.280		
	南アフリカ・ランド 小計		172,084.000	2,180,304.280	(14,695,251)	
投資証券 合計			417,784	36,747,121	(36,747,121)	
合計				318,600,822	(318,600,822)	

(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)

- 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 60銘柄	14.91	-	-	-	16.39
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 8銘柄	0.49	-	-	-	0.54

イギリス・ポンド	株式	1銘柄	0.07	-	-	-	0.08
インド・ルピー	株式	87銘柄	7.38	-	-	-	8.12
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.29	-	-	-	1.41
オフショア・人民元	株式	374銘柄	4.52	-	-	-	4.97
カタール・リアル	株式	11銘柄	0.66	-	-	-	0.73
コロンビア・ペソ	株式	5銘柄	0.16	-	-	-	0.17
サウジアラビア・リアル	株式	36銘柄	2.42	-	-	-	2.66
タイ・バーツ	株式	43銘柄	1.74	-	-	-	1.91
	新株予約権証券	1銘柄	-	0.00	-	-	
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.09	-	-	-	0.09
チリ・ペソ	株式	16銘柄	0.48	-	-	-	0.53
トルコ・リラ	株式	15銘柄	0.30	-	-	-	0.33
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.19	-	-	-	0.21
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	21銘柄	0.74	-	-	-	0.81
ブラジル・レアル	株式	51銘柄	4.30	-	-	-	4.89
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.16	-	
ポーランド・ズロチ	株式	16銘柄	0.64	-	-	-	0.71
マレーシア・リンギット	株式	40銘柄	1.49	-	-	-	1.64
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.20	-	-	-	1.76
	投資信託受益証券	5銘柄	-	-	0.37	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	
ユーロ	株式	5銘柄	0.10	-	-	-	0.11
韓国・ウォン	株式	107銘柄	11.15	-	-	-	12.26
香港・ドル	株式	206銘柄	21.44	-	-	-	23.57
台湾・ドル	株式	87銘柄	11.25	-	-	-	12.37
南アフリカ・ランド	株式	38銘柄	3.36	-	-	-	3.72
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間(2020年11月12日から2021年5月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2020年11月11日現在	第4期中間計算期間末 2021年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,273,460,105	3,845,811,524
親投資信託受益証券	99,842,511,510	77,372,159,847
未収入金	367,255	19,309,663,262
流動資産合計	118,116,338,870	100,527,634,633
資産合計	118,116,338,870	100,527,634,633
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	258,720,946	84,337,897
未払金	6,570,489	13,290,132
未払解約金	400,632,183	272,857,676
未払受託者報酬	20,689,253	17,636,726
未払委託者報酬	662,057,689	564,376,952
その他未払費用	1,442,256	1,240,543
流動負債合計	1,350,112,816	953,739,926
負債合計	1,350,112,816	953,739,926
純資産の部		
元本等		
元本	114,606,469,417	98,060,492,764
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	2,159,756,637	1,513,401,943
(分配準備積立金)	759,677,574	628,449,832
元本等合計	116,766,226,054	99,573,894,707
純資産合計	116,766,226,054	99,573,894,707
負債純資産合計	118,116,338,870	100,527,634,633

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期中間計算期間 自 2019年11月12日 至 2020年5月11日	第4期中間計算期間 自 2020年11月12日 至 2021年5月11日
営業収益		
受取利息	-	3,924
有価証券売買等損益	3,905,128,781	1,224,148,337
為替差損益	780,149,898	917,209,993
営業収益合計	3,124,978,883	306,942,268
営業費用		
支払利息	5,486,797	642,827
受託者報酬	17,478,237	17,636,726
委託者報酬	559,304,939	564,376,952
その他費用	1,272,334	1,394,424
営業費用合計	583,542,307	584,050,929
営業利益又は営業損失()	3,708,521,190	277,108,661
経常利益又は経常損失()	3,708,521,190	277,108,661
中間純利益又は中間純損失()	3,708,521,190	277,108,661
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	83,840,115	65,695,567
期首剰余金又は期首欠損金()	2,362,137,226	2,159,756,637
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,255,981,574	76,798,476
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,255,981,574	76,798,476
剰余金減少額又は欠損金増加額	362,312,582	380,348,942
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	362,312,582	380,348,942
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,631,125,143	1,513,401,943

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期中間計算期間	
	自 2020年11月12日	至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
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。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期中間計算期間末
	2020年11月11日現在	2021年5月11日現在
1. 期首元本額	60,780,949,246円	114,606,469,417円
期中追加設定元本額	84,183,367,871円	3,553,382,076円
期中一部解約元本額	30,357,847,700円	20,099,358,729円
2. 受益権の総数	114,606,469,417口	98,060,492,764口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	第4期中間計算期間末
	2020年11月11日現在	2021年5月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第3期 2020年11月11日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 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	8,826,652,554	-	9,085,373,500	258,720,946
イギリス・ポンド	520,245,221	-	522,396,700	2,151,479
オーストラリア・ドル	3,639,645,429	-	3,748,466,000	108,820,571
カナダ・ドル	2,072,185,044	-	2,161,972,500	89,787,456
ユーロ	1,037,547,982	-	1,066,470,300	28,922,318
ユーロ	1,557,028,878	-	1,586,068,000	29,039,122
合計	8,826,652,554	-	9,085,373,500	258,720,946

種類	第4期中間計算期間末 2021年5月11日現在			
	契約額等（円）	時価（円）		評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
イギリス・ポンド	6,974,307,354	-	7,058,645,251	84,337,897
オーストラリア・ドル	5,473,062,936	-	5,550,782,751	77,719,815
ユーロ	1,000,879,038	-	1,005,451,200	4,572,162
ユーロ	500,365,380	-	502,411,300	2,045,920
合計	6,974,307,354	-	7,058,645,251	84,337,897

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第3期 2020年11月11日現在	第4期中間計算期間末 2021年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0188円 (10,188円)	1.0154円 (10,154円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,694,408,640
国債証券	296,264,497,800
地方債証券	18,222,680,500
特殊債券	17,090,056,082
社債券	12,590,441,180
未収利息	448,447,524
前払費用	83,213,760
流動資産合計	347,393,745,486
資産合計	347,393,745,486
負債の部	
流動負債	
未払金	35,509,888,000
未払解約金	2,728,840,000
流動負債合計	38,238,728,000
負債合計	38,238,728,000
純資産の部	
元本等	
元本	236,574,874,490
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	72,580,142,996
元本等合計	309,155,017,486
純資産合計	309,155,017,486
負債純資産合計	347,393,745,486

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	203,797,769,973円
同期中追加設定元本額	115,061,682,443円
同期中一部解約元本額	82,284,577,926円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	22,838,915,573円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	74,200,842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)	14,730,710円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	739,041,315円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	158,106,666円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	20,854,960円
たわらノーロード 国内債券	13,806,034,198円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,640,150,170円
たわらノーロード バランス(堅実型)	572,254,828円
たわらノーロード バランス(標準型)	948,708,643円
たわらノーロード バランス(積極型)	115,047,383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)	44,338,367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)	935,108,076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)	991,498,707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)	317,829,147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)	115,263,936円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	14,213,615円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,109,601円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	24,787,753円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,775,900円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,140,662円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,474,300,641円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,249,291,538円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	11,127,604,818円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,478,898,620円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,030,775,409円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,183,888,352円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	343,240,718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)	3,966,351,618円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,316,712,571円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	273,618,300円
投資のソムリエ	27,922,615,836円
クルーズコントロール	1,057,244,764円
投資のソムリエ<DC年金>	1,509,313,799円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,863,263,512円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	513,980,714円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	4,123,956円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	10,270,569円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,915,486,723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)	18,302,937円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,642,753円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	28,552,132円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	43,474,768円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	723,736,337円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,540,875,892円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,796,362,446円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	10,472,529円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,223,553円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,389,711円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	40,074,227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)	813,731,222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)	997,353,860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)	1,428,088,715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)	505,583,737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)	797,014,655円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	369,455,815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)	7,790,486,396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)	1,431,805,359円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	623,508,550円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	313,258,044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)	6,464,550,464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)	6,440,455,834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)	1,328,998,612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)	184,626,342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)	103,868,536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)	42,844,846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)	112,226,822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)	45,778,227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)	6,398,308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)	50,584,248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)	139,080,024円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,037,195,129円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,474,158,089円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,707,386,341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)	355,738,449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)	206,761,577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)	2,457,672,626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)	219,009,558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)	11,338,296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)	2,770,742,014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)	56,048,903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)	445,303,489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)	710,153,511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)	1,175,955,438円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	335,769,441円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	106,753,765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	236,574,874,490円
2. 受益権の総数	236,574,874,490口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.3068円
(1万口当たり純資産額)	(13,068円)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,659,903,410
株式	341,151,143,760
派生商品評価勘定	2,873,880
未収配当金	2,828,121,602
前払金	335,000
差入委託証拠金	352,275,000
流動資産合計	353,994,652,652
資産合計	
353,994,652,652	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	196,388,650
未払解約金	4,465,011,000
流動負債合計	4,661,399,650
負債合計	
4,661,399,650	
純資産の部	
元本等	
元本	111,968,253,392
剰余金	
剰余金又は欠損金()	237,364,999,610
元本等合計	349,333,253,002
純資産合計	
349,333,253,002	
負債純資産合計	
353,994,652,652	

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	95,587,668,609円
同期中追加設定元本額	47,333,477,727円
同期中一部解約元本額	30,952,892,944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	16,685,631,275円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,385,952,302円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,756,948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)	8,975,037円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,556,482円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,791,596円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,708,930円
たわらノーロード TOPIX	948,335,194円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	714,455,248円
たわらノーロード バランス(堅実型)	26,663,545円
たわらノーロード バランス(標準型)	167,759,957円
たわらノーロード バランス(積極型)	250,324,149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)	1,996,360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)	113,523,812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)	270,126,954円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	185,870,042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)	264,889,583円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	501,107円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,280,673円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,109,997円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,314,493円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,122,553円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,390,315,581円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	997,133,845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	3,444,275,693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	1,075,654,313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)	262,181,127円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	467,717,921円
投資のソムリエ	19,624,569,285円
クルーズコントロール	428,526,113円
投資のソムリエ<DC年金>	1,043,917,762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>	393,795,453円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,013,149円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	12,499,988円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	494,794,218円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,328,501,104円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	21,678,429円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,394,201円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,794,341円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	48,677,691円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	114,868,204円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,943,353,338円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	264,083,954円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	12,591,279円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	6,283,207円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,484,274円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	13,408,023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)	46,165,729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)	56,585,429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)	28,675,749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)	45,213,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	127,353,070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)	39,999,523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)	444,161,248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)	75,391,998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)	64,604,481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)	109,119,074円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,707,703円

D I A M国際分散バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	31,417,463円
D I A M国内重視バランスファンド3 0 V A (適格機関投資家限定)	7,683,993円
D I A M国内重視バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	2,013,885円
D I A M世界バランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	14,159,837円
D I A M世界バランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	38,931,385円
D I A Mバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	635,524,739円
D I A Mバランスファンド3 7 . 5 V A (適格機関投資家限定)	692,558,083円
D I A Mバランスファンド5 0 V A (適格機関投資家限定)	1,976,912,297円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A (適格機関投資家限定)	99,591,697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)	34,341,063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)	335,002,282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)	90,168,895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)	1,564,848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)	436,200,914円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	23,537,221円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	93,474,376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)	223,662,528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)	296,222,175円
D I A M世界バランス2 5 V A (適格機関投資家限定)	42,274,657円
D I A M国内バランス3 0 V A (適格機関投資家限定)	19,209,499円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 2 1 2) (適格機関投資家限定)	321,266,809円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 3) (適格機関投資家限定)	992,662,363円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 6) (適格機関投資家限定)	1,314,318,490円
D I A M世界アセットバランスファンド7 V A (1 3 0 9) (適格機関投資家限定)	52,594,563円
M H A Mトピックスファンド	637,375,982円
計	111,968,253,392円
2. 受益権の総数	111,968,253,392口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	--

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年5月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	9,144,225,000	-		8,950,865,000	193,360,000
合計	9,144,225,000	-		8,950,865,000	193,360,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	3.1199円
(1万口当たり純資産額)	(31,199円)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	35,894,753,945
国債証券	553,260,192,542
派生商品評価勘定	735,490,465
未収入金	34,446,142,269
未収利息	2,211,304,792
前払費用	1,377,542,249
流動資産合計	627,925,426,262
資産合計	
627,925,426,262	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,941,458,698
前受金	32,723,430,499
未払金	5,612,858,585
未払解約金	34,292,612,000
流動負債合計	74,570,359,782
負債合計	
74,570,359,782	
純資産の部	
元本等	
元本	387,959,406,447
剰余金	
剰余金又は欠損金()	165,395,660,033
元本等合計	553,355,066,480
純資産合計	553,355,066,480
負債純資産合計	627,925,426,262

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	304,195,161,058円
同期中追加設定元本額	303,130,279,799円
同期中一部解約元本額	219,366,034,410円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	6,624,657,740円
たわらノーロード バランス(堅実型)	485,786,954円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,207,658,332円
たわらノーロード バランス(積極型)	546,658,131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)	29,680,961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)	903,084,097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)	1,030,567,301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)	354,457,038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)	180,847,022円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,123,473円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,128,020円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	26,573,554円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,465,143円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,443,605円
投資のソムリエ	201,026,285,401円
投資のソムリエ<DC年金>	10,958,898,200円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,365,998,094円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	68,575,837,681円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,983,374,970円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	9,772,820,753円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	124,540,463円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	58,818,148円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	61,675,345円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	371,753,150円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	30,179,753,077円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,381,458,837円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	73,164,032円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	35,554,082円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	36,680,298円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,939,313,069円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	6,548,303,164円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	4,562,508,217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)	634,021,264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)	51,321,474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)	407,743,266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)	812,853,856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)	1,076,768,027円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,176,918,764円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,239,578,405円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,967,567,434円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	118,765,605円
計	387,959,406,447円
2. 受益権の総数	387,959,406,447口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	557,653,701,414	-	558,865,378,318	1,211,676,904
アメリカ・ドル	246,773,556,257	-	246,078,885,395	694,670,862
イギリス・ポンド	36,152,762,480	-	36,741,875,945	589,113,465
イスラエル・シケル	2,618,375,039	-	2,596,395,717	21,979,322
オーストラリア・ドル	12,409,231,263	-	12,532,987,584	123,756,321
カナダ・ドル	11,474,131,717	-	11,620,539,177	146,407,460
シンガポール・ドル	2,375,332,285	-	2,374,938,963	393,322
スウェーデン・クローナ	2,016,820,391	-	2,035,963,125	19,142,734
デンマーク・クローネ	2,902,229,178	-	2,915,626,630	13,397,452
ノルウェー・クローネ	1,425,259,265	-	1,425,920,216	660,951
ポーランド・ズロチ	3,517,639,754	-	3,531,127,346	13,487,592
マレーシア・リンギット	2,602,388,380	-	2,599,462,020	2,926,360
メキシコ・ペソ	4,592,405,828	-	4,632,049,803	39,643,975
ユーロ	228,793,569,577	-	229,779,606,397	986,036,820
買建	6,500,000,000	-	6,505,708,671	5,708,671
アメリカ・ドル	2,965,000,000	-	2,971,896,096	6,896,096
イギリス・ポンド	410,529,000	-	410,724,980	195,980
オーストラリア・ドル	141,009,000	-	140,588,125	420,875
カナダ・ドル	129,429,000	-	129,526,300	97,300
ユーロ	2,854,033,000	-	2,852,973,170	1,059,830
合計	564,153,701,414	-	565,371,086,989	1,205,968,233

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.4263円
(1万口当たり純資産額)	(14,263円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,553,292,532
コール・ローン	1,103,398,881
株式	487,946,726,780
投資信託受益証券	935,053,184
投資証券	10,295,661,425
派生商品評価勘定	299,941,458
未収入金	28,913,564
未収配当金	565,086,864
差入委託証拠金	6,044,506,909
流動資産合計	515,772,581,597
資産合計	
515,772,581,597	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,715,576
未払解約金	876,873,000
流動負債合計	880,588,576
負債合計	
880,588,576	
純資産の部	
元本等	
元本	99,287,308,113
剰余金	
剰余金又は欠損金()	415,604,684,908
元本等合計	514,891,993,021
純資産合計	514,891,993,021
負債純資産合計	515,772,581,597

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	94,213,969,059円
同期中追加設定元本額	26,322,248,146円
同期中一部解約元本額	21,248,909,092円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,613,416,011円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,620,763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)	8,486,373円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,195,637円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,734,584円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,019,403円
たわらノーロード 先進国株式	21,458,622,304円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	251,918,685円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,397,939,454円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	432,467,782円
たわらノーロード バランス(堅実型)	47,897,000円
たわらノーロード バランス(標準型)	388,422,713円
たわらノーロード バランス(積極型)	463,035,643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)	1,191,191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)	348,804,596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)	237,222,596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)	368,048,929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)	611,989円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	3,645,795円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,087,212円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,867,632円
たわらノーロード 全世界株式	103,463,164円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	47,759,122,978円
One DC 先進国株式インデックスファンド	847,120,185円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	160,700,294円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	897,060,174円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,073,429,586円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	104,742,275円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	326,855,114円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	279,977,640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)	188,785,974円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,749,111円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	287,479,000円
投資のソムリエ	3,975,161,749円
クルーズコントロール	134,089,435円
投資のソムリエ<DC年金>	214,778,862円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	185,189,706円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	113,492,231円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,042,702円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,591,459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)	283,293,240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)	17,322,213円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,180,798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)	25,288,296円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	35,061,546円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	545,912,824円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	161,211,862円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,787,035円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,943,949円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,102,497円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	4,092,241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)	440,791,635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)	61,561,913円
DIAM外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,345,546,830円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,219,970,501円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	901,083,137円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	88,709,016円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	10,252,518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)	38,658,766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)	65,292,618円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,612,224円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,199,333円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,298,264円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	803,559円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,472,497円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,950,021円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	253,432,642円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	362,583,447円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,182,902,943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)	297,445,485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)	62,925,024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)	411,622,187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)	18,320,152円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,313,984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)	173,995,257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)	14,084,653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)	55,927,461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)	89,206,228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)	177,254,488円
計	99,287,308,113円
2. 受益権の総数	99,287,308,113口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	14,919,251	-	15,014,724	95,473
イギリス・ポンド	12,669,767	-	12,767,807	98,040
ユーロ	2,249,484	-	2,246,917	2,567
買建	1,891,141,341	-	1,891,486,571	345,230
アメリカ・ドル	1,429,265,838	-	1,429,597,866	332,028
イギリス・ポンド	87,372,600	-	87,374,360	1,760
オーストラリア・ドル	51,779,891	-	51,764,960	14,931
カナダ・ドル	75,298,900	-	75,321,155	22,255
ユーロ	247,424,112	-	247,428,230	4,118
合計	1,906,060,592	-	1,906,501,295	249,757

(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5月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	16,960,946,699	-	17,256,922,824	295,976,125
合計	16,960,946,699	-	17,256,922,824	295,976,125

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	5.1859円
(1万口当たり純資産額)	(51,859円)

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,392,879,998
投資証券	76,518,921,950
派生商品評価勘定	135,683,640
未収配当金	673,664,962
差入委託証拠金	92,124,000
流動資産合計	79,813,274,550
資産合計	79,813,274,550
負債の部	
流動負債	
前受金	123,408,970
未払金	30,235,182
未払解約金	1,213,193,000
流動負債合計	1,366,837,152
負債合計	1,366,837,152
純資産の部	
元本等	
元本	32,426,571,903
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,019,865,495
元本等合計	78,446,437,398
純資産合計	78,446,437,398
負債純資産合計	79,813,274,550

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	24,485,467,090円
同期中追加設定元本額	25,937,715,759円
同期中一部解約元本額	17,996,610,946円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	269,889円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	729,533円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	870,227円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,693,926円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,751,456円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,239,047円
たわらノーロード 国内リート	4,436,846,681円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	910,710,362円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	923,423,470円
たわらノーロード バランス(堅実型)	17,514,964円
たわらノーロード バランス(標準型)	312,371,259円
たわらノーロード バランス(積極型)	325,174,301円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	110,050,285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)	290,122,277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)	179,548,022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)	233,744,930円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,318,520円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,200,008円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,922,673円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,726,697円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,233,129円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	387,435,662円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,701,541円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	130,509,613円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	147,057,515円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	277,479,584円
投資のソムリエ	8,637,189,830円
投資のソムリエ<DC年金>	470,575,485円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	118,464,447円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	341,852,103円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,683,702,079円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	9,839,421円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,647,894円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,313,089円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	21,269,784円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,060,995,887円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	104,388,907円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	5,626,965円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	2,810,264円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	2,899,970円
Jリートインデックスファンド(DC)	41,461,271円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	82,539,527円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	745,865,657円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	6,368,638円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	158,500,539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)	7,749,693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)	91,725,469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)	4,021,095円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	212,081,935円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	83,568,801円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	46,469,693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)	6,178,777円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	25,002,179円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,620,652,271円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	197,812,399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)	616,049,902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)	10,384,997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)	2,279,881,203円
計	32,426,571,903円
2. 受益権の総数	32,426,571,903口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2021年5月11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				
先物取引				
買建	1,626,947,030	-	1,762,724,500	135,777,470
合計	1,626,947,030	-	1,762,724,500	135,777,470

(注)時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	2.4192円
(1万口当たり純資産額)	(24,192円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	112,105,529
コール・ローン	1,509,218,699
投資信託受益証券	7,671,697,372
投資証券	62,598,123,190
派生商品評価勘定	23,552
未収入金	41,950,125
未収配当金	95,434,768
流動資産合計	72,028,553,235
資産合計	
72,028,553,235	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,884
未払金	316,506,124
未払解約金	1,472,766,000
流動負債合計	1,789,276,008
負債合計	
1,789,276,008	
純資産の部	
元本等	
元本	48,371,251,129
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,868,026,098
元本等合計	70,239,277,227
純資産合計	
70,239,277,227	
負債純資産合計	
72,028,553,235	

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	37,037,959,546円
同期中追加設定元本額	55,570,454,432円
同期中一部解約元本額	44,237,162,849円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	78,355,323円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	40,494,256円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,315,746円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	11,703,647円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	13,966,733円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	43,118,229円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	27,335,766円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,861,958円
たわらノーロード 先進国リート	8,527,437,404円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,422,160,630円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	334,748,207円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,568,695,417円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,704,625円

たわらノーロード バランス(標準型)	263,216,203円
たわらノーロード バランス(積極型)	506,782,760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)	2,849,915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)	48,439,032円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	99,804,312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)	210,377,136円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,185,305円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,251,990円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,835,461円
One DC 先進国リートインデックスファンド	490,255,946円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,707,227円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	584,044,636円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	58,826,726円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	227,868,421円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	258,547,175円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	473,697,908円
投資のソムリエ	12,528,618,644円
投資のソムリエ<DC年金>	677,072,661円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	208,590,169円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	428,026,925円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,606,724,836円
ワールドアセットバランス(基本コース)	681,168,431円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,227,066,658円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,003,112円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,103,014円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,143,576円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	36,108,958円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,596,928,955円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,061,381円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	8,580,386円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,320,516円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,399,209円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	503,548,696円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	150,042,486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)	181,662,674円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	182,354,426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)	222,747,122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)	87,622,646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)	112,913,068円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	14,584,701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)	178,235,653円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	758,859,724円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	279,629,571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)	297,275,502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)	131,922,693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)	312,760,291円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,979,717,609円
P - O n eマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	852,733,298円
D I A M海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	555,008,469円
計	48,371,251,129円
2. 受益権の総数	48,371,251,129口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時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は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	351,620,457	-	351,640,125	19,668
イギリス・ポンド	261,553,680	-	261,573,600	19,920
オーストラリア・ドル	15,382,600	-	15,382,900	300
カナダ・ドル	26,438,970	-	26,436,800	2,170
シンガポール・ドル	7,199,392	-	7,199,176	216
ニュージーランド・ドル	15,604,700	-	15,607,759	3,059
ニュージーランド・ドル	2,372,280	-	2,372,082	198
ユーロ	17,182,035	-	17,182,308	273
韓国・ウォン	975,600	-	975,000	600
香港・ドル	4,911,200	-	4,910,500	700
合計	351,620,457	-	351,640,125	19,668

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.4521円
(1万口当たり純資産額)	(14,521円)

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,727,818,441
国債証券	155,146,071,517
派生商品評価勘定	200,679
未収入金	1,362,857,063
未収利息	1,259,401,742
前払費用	368,812,682
流動資産合計	160,865,162,124
資産合計	160,865,162,124
負債の部	
流動負債	
前受金	391,329,624
未払金	3,061,052,814
未払解約金	2,601,430,000
流動負債合計	6,053,812,438
負債合計	6,053,812,438
純資産の部	
元本等	
元本	72,726,536,638
剰余金	
剰余金又は欠損金()	82,084,813,048
元本等合計	154,811,349,686
純資産合計	154,811,349,686
負債純資産合計	160,865,162,124

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	44,361,222,545円
同期中追加設定元本額	73,769,810,031円
同期中一部解約元本額	45,404,495,938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）	195,967,524円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,057,704,834円
たわらノーロード バランス（堅実型）	79,398,173円
たわらノーロード バランス（標準型）	212,881,949円
たわらノーロード バランス（積極型）	85,420,019円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	741,331円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,513,584円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	4,507,643円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,032,236円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,291,392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）	259,109,747円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	519,627,208円
投資のソムリエ	16,082,047,148円
クルーズコントロール	326,100,799円
投資のソムリエ<DC年金>	869,147,268円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	186,039,611円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	2,558,346円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	6,323,226円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	637,131,511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）	669,422,645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)	15,891,708円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,505,559円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,238,125円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	37,729,038円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,245,140,662円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	197,005,575円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,735,281円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,535,062円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,678,966円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	25,121,744,356円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	359,085,291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)	3,902,448,757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)	917,233,739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)	11,621,866円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	215,002,611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)	110,226,030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)	6,172,356,433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	72,726,536,638円
2. 受益権の総数	72,726,536,638口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち 1年超		
			評価損益(円)

市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	2,700,000,000 2,700,000,000	- -	2,700,200,679 2,700,200,679	200,679 200,679
合計	2,700,000,000	-	2,700,200,679	200,679

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1287円 (21,287円)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,209,957,312
コール・ローン	693,715,328
株式	54,171,865,827
新株予約権証券	30,232
投資信託受益証券	397,790,307
投資証券	52,927,352
派生商品評価勘定	25,336,113
未収入金	334,757
未収配当金	55,353,473
差入委託証拠金	2,069,938,077
流動資産合計	58,677,248,778
資産合計	58,677,248,778
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	24,834,461
未払解約金	569,276,000
流動負債合計	594,110,461
負債合計	594,110,461
純資産の部	
元本等	
元本	39,106,133,415
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,977,004,902
元本等合計	58,083,138,317
純資産合計	58,083,138,317
負債純資産合計	58,677,248,778

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11月12日 至 2021年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,111,578,609円
同期中追加設定元本額	32,721,474,667円
同期中一部解約元本額	36,726,919,861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>	7,346,066,449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)	311,618,147円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,653,354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)	8,627,064円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,525,892円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,960,149円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,219,487円
たわらノーロード 新興国株式	7,232,297,008円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	1,981,600,343円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,510,467,749円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,185,035円
たわらノーロード バランス(標準型)	50,690,701円
たわらノーロード バランス(積極型)	81,329,817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)	826,300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)	88,073,636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)	185,720,334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)	119,561,838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)	201,635,152円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	249,855円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,094,620円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,078,968円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,419,377円
たわらノーロード 全世界株式	56,336,311円
O n e D C 新興国株式インデックスファンド	170,255,465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)	737,367,376円
投資のソムリエ	6,815,962,299円
クルーズコントロール	465,189,170円
投資のソムリエ< D C年金>	368,539,286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)	9,048,938円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	22,533,024円
投資のソムリエ< D C年金>リスク抑制型	271,830,541円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,932,069,176円
ワールドアセットバランス(基本コース)	923,919,156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)	9,607,057円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	4,531,431円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	2,635,378円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	22,724,657円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,686,899,156円
9資産分散投資・スタンダード< D C年金>	281,681,553円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	5,476,671円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	2,736,089円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	2,805,539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)	16,302,124円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	152,211,387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)	299,778,777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)	153,691,631円
計	39,106,133,415円
2. 受益権の総数	39,106,133,415口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年5月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	641,892,200	-	641,939,909	47,709	
合計	641,892,200	-	641,939,909	47,709	

(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5月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	4,072,523,064	-		4,072,977,007	453,943
合計	4,072,523,064	-		4,072,977,007	453,943

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年5月11日現在
1口当たり純資産額	1.4853円
(1万口当たり純資産額)	(14,853円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年5月31日現在

資産総額	98,527,170,854円
負債総額	384,772,964円
純資産総額（ - ）	98,142,397,890円
発行済数量	96,460,948,607口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0174円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	357,221,170,553円
負債総額	5,812,856,000円
純資産総額（ - ）	351,408,314,553円
発行済数量	269,203,485,511口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3054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5月31日現在

資産総額	356,607,350,708円
負債総額	246,172,862円
純資産総額（ - ）	356,361,177,846円
発行済数量	113,156,439,520口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1493円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	578,465,626,233円
負債総額	11,041,673,952円
純資産総額（ - ）	567,423,952,281円
発行済数量	397,429,564,285口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4277円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	548,777,257,323円
負債総額	16,186,469,023円
純資産総額（ - ）	532,590,788,300円
発行済数量	101,044,239,957口
1口当たり純資産額（ / ）	5.2709円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	86,814,578,131円
負債総額	135,088,561円
純資産総額（ - ）	86,679,489,570円
発行済数量	35,694,217,185口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4284円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	73,284,130,869円
負債総額	483,521,413円
純資産総額(-)	72,800,609,456円
発行済数量	49,335,489,411口
1口当たり純資産額(/)	1.4756円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	159,528,710,729円
負債総額	3,851,432,881円
純資産総額(-)	155,677,277,848円
発行済数量	72,681,138,016口
1口当たり純資産額(/)	2.1419円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年5月31日現在

資産総額	60,927,728,514円
負債総額	54,594,530円
純資産総額(-)	60,873,133,984円
発行済数量	40,193,163,573口
1口当たり純資産額(/)	1.5145円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者等名簿

該当事項はありません。

(3) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4) 受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(6) 受益権の再分割

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

(7) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2021年5月31日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2021年5月31日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,456,996,517,130
追加型株式投資信託	833	15,634,860,948,038
単位型公社債投資信託	29	64,928,430,507
単位型株式投資信託	210	1,297,503,990,239
合計	1,098	18,454,289,885,914

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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	14,146,079	45,949,372	67,502,329
当期変動額									
剰余金の配当							11,280,000	11,280,000	11,280,000
当期純利益							15,005,011	15,005,011	15,005,011
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,725,011	3,725,011	3,725,011
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341

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

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あります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第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) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a. 名称

みずほ信託銀行株式会社

b. 資本金の額

2020年3月末日現在 247,369百万円

c. 事業の内容

日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

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

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長野銀行	13,017	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「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。
楽天証券株式会社	7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2020年3月末日現在

(3)投資顧問会社

a. 名称

アセットマネジメントOne U.S.A.・インク

b. 資本金の額

2020年12月末日現在 400万米ドル

c. 事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、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、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

3【資本関係】

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

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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
業務執行社員 公認会計士 丘本 正彦 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 長谷川 敬 印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の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

2020年12月18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」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの2019年11月12日から2020年11月11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、リスクコントロール世界資産分散ファンドの2020年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。

独立監査人の中間監査報告書

2021年6月18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

中間監査意見

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」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの2020年11月12日から2021年5月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの2021年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年11月12日から2021年5月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

中間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中間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中間財務諸表の作成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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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) 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。