

【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9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】	ワールドアセットバランス(基本コース) ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)
【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】	ワールドアセットバランス(基本コース) 1兆円を上限とします。 ワールドアセットバランス(リスク抑制コース) 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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

（以下、総称して「ワールドアセットバランス」、「ワールドアセットバランス（基本コース）／（リスク抑制コース）」または「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「ワールドアセットバランス（基本コース）」は「（基本コース）」、「ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）」は「（リスク抑制コース）」という場合があります。

各ファンドを総称した愛称として「ワールドOne」という名称を用いる場合があります。

（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】

各ファンドにつき、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。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・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、2.2%(税抜2.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

(7) 【申込期間】

継続申込期間:2021年9月11日から2022年3月11日まで

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

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】

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。

（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】

取得申込者は、販売会社の定める方法により、販売会社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）

（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ 1 2 ） 【 その他 】

お申込みの際は、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日には取得またはスイッチングのお申込みの受付は行いません。

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

受益権の取得申込者は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。

<スイッチング>

(基本コース)(リスク抑制コース)の2つのファンド間でスイッチングができます。スイッチングとは、すでに保有しているファンドを解約すると同時に他のファンドの取得の申込みを行うことをいい、ファンドの解約代金が買付代金に充当されます。

スイッチングの際には、税金および各販売会社が定めるお申込手数料がかかる場合があります。

販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。くわしくは販売会社にお問い合わせ下さい。

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】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

●上記資産に関しては、主としてマザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合があります。

●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。

(*)外国株式パッシブ・ファンド・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、外国リート・パッシブ・ファンド・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、エマージング債券パッシブ・マザーファンド

※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。

2 実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

●各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

※経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

●基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

●リスク抑制コースは、基本投資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^(**)を機動的に変更します。

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%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。

(*) 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5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引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、基本投資比率をもとに運用を行います。

●各コース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

基本投資比率のイメージ

基本コース

リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※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。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を、現金等*を用いて機動的に変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%～100%程度とします。それに合わせて現金等*の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少(現金等*比率を増加)させる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。
 その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加(現金等*比率を減少)させます。
 ※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するものではありません。

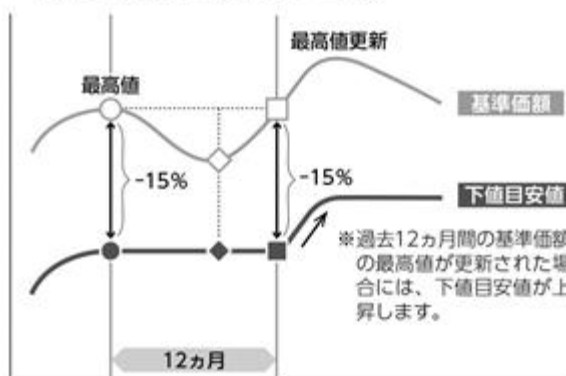
※現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、[DIAMマネーマザーファンド]を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

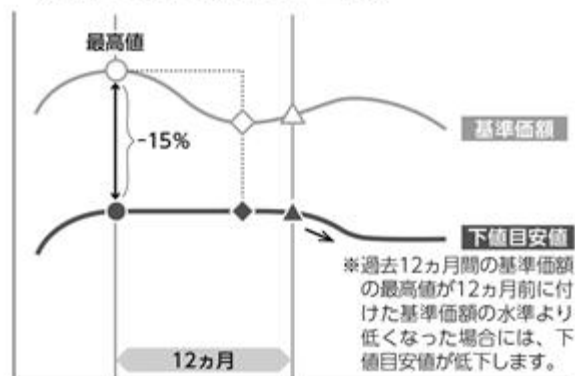
※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が更新された場合には、下値目安値が上昇します。

下値目安値が低下するケース



※過去12ヵ月間の基準価額の最高値が12ヵ月前に付けた基準価額の水準より低くなった場合には、下値目安値が低下します。

※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12ヵ月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12ヵ月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。

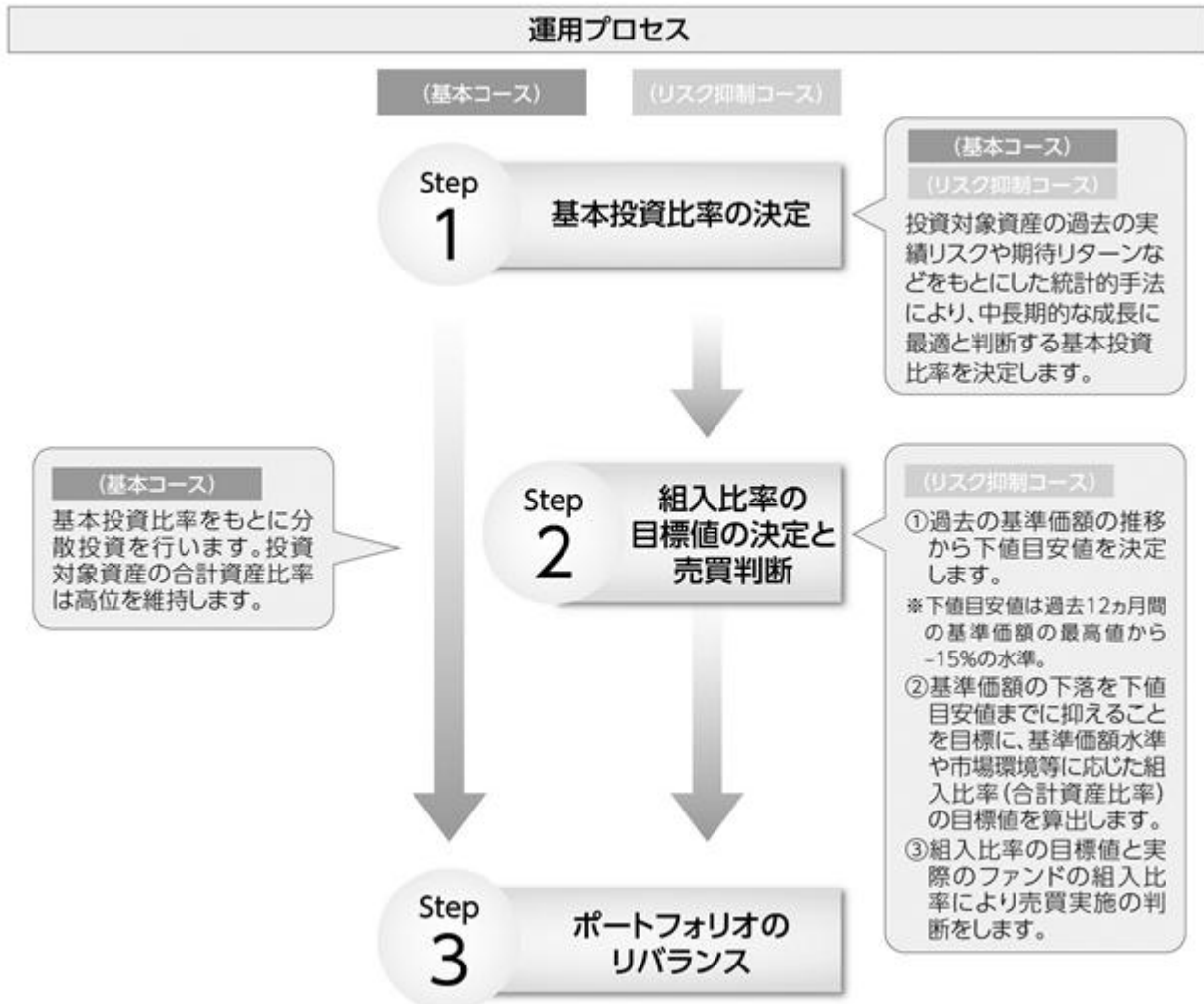
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

5 年2回決算を行います。

- 毎年6月、12月の各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。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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



商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

資産複合（投資信託証券（債券、株式、不動産投信）、先物、ETF、短期金融資産） 資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ETF、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル（日本除く）	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり（フルヘッジ）	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を行う旨の記載があるものをいいます。

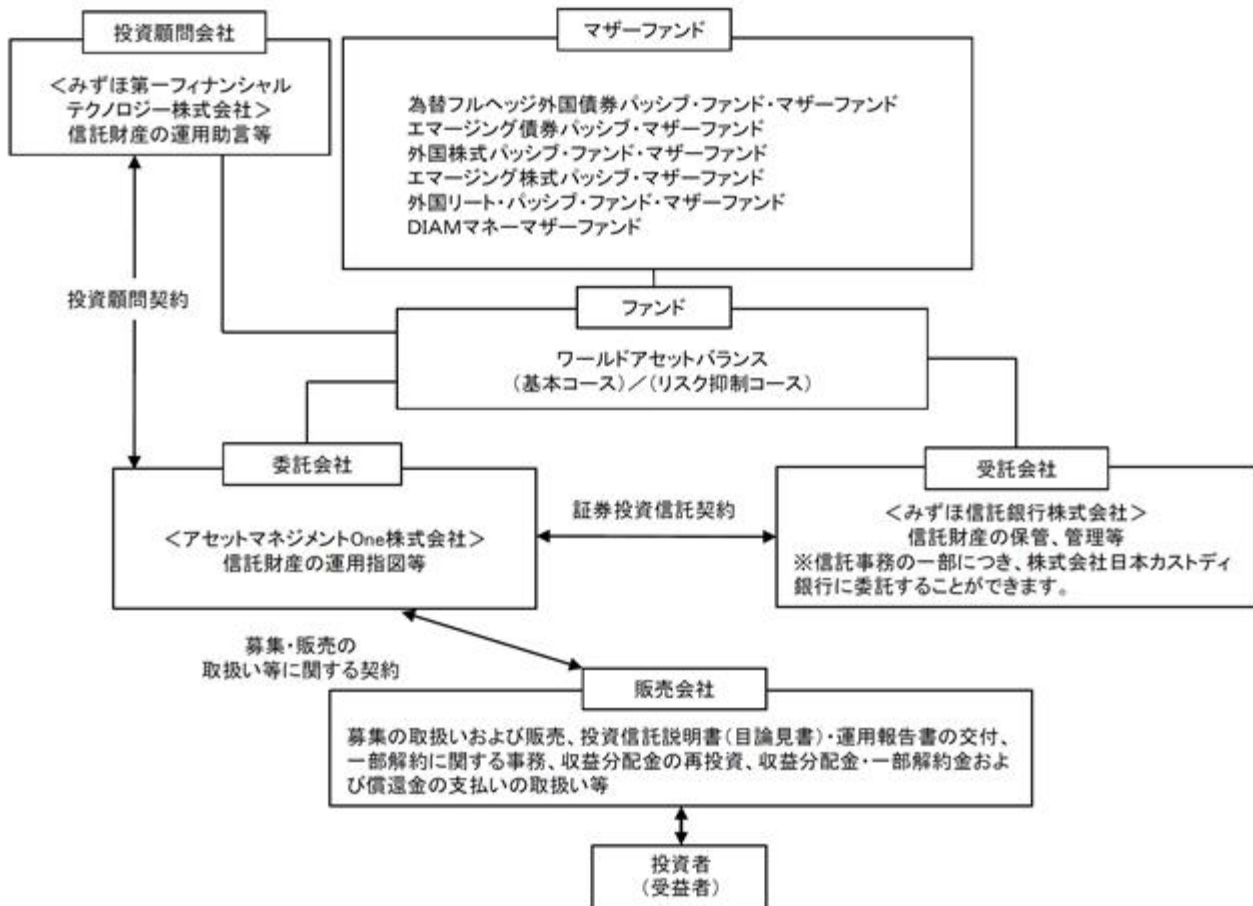
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

（２）【ファンドの沿革】

2017年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、各ファンドにかかる証券投資信託契約を締結しております。

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・「投資顧問契約」の概要

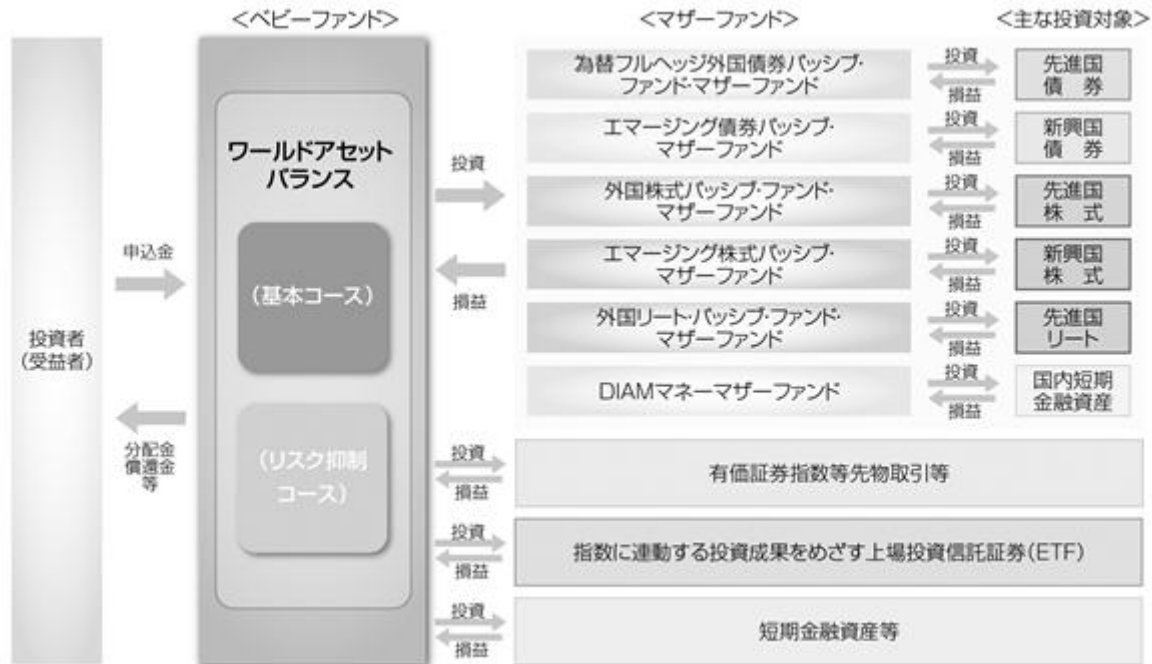
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2021年6月30日現在）

委託会社の沿革

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

大株主の状況

（2021年6月30日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
株式会社みずほフィナンシャルグループ	東京都千代田区大手町一丁目5番5号	28,000株 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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・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、「エマージング株式パッシブ・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、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投資信託証券（ETF）を主要投資対象とします。なお、「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、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
 - ・外国リート・パッシブ・ファンド・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
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・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。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率は、原則として高位を保ちます。

各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・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、「エマージング株式パッシブ・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、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投資信託証券(ETF)を主要投資対象とします。なお、「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、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・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
 - ・外国リート・パッシブ・ファンド・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
 - ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 - ・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。

実質的な組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本投資比率の見直しを行うことがあります。

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12ヵ月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5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。

各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用が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。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

b. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、振替投資法人債を含みます。)

8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
9. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
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、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	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>
	<p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p>
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] H --> C subgraph H_Box [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.クーポン・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	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円換算ベース・為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 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。 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。 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。ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 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。 <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>

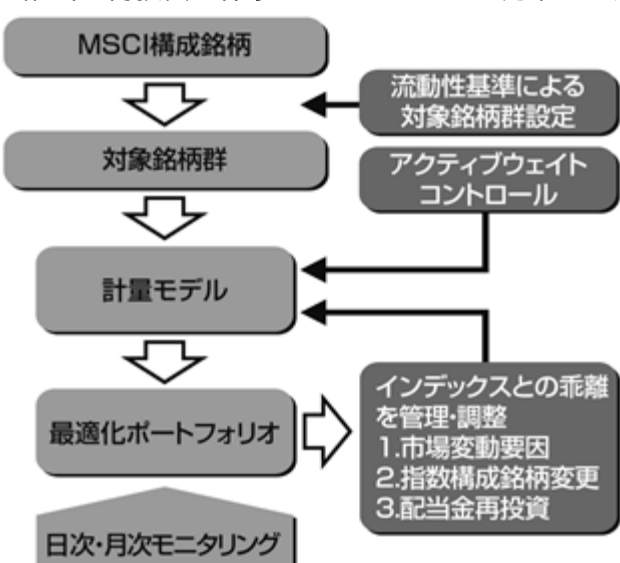
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金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	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

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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  <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[流動性基準による対象銘柄群設定] --> B G[アクティブウェイトコントロール] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] </pre>

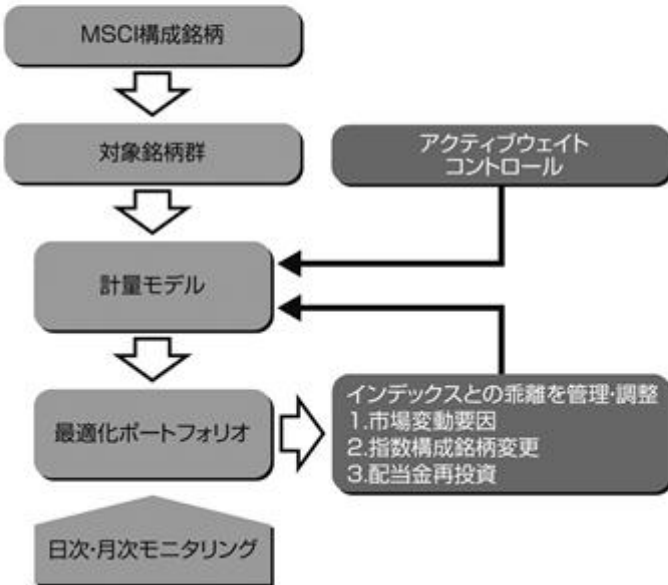
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有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	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

	<p>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。</p>
運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] D[アクティブウェイトコントロール] --> C C --> E[最適化ポートフォリオ] E --> F[日次・月次モニタリング] 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] --> E </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	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	<ol style="list-style-type: none">1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
------	--

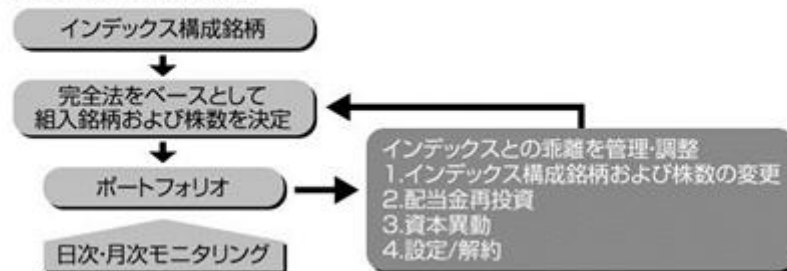
S & P 先進国 R E I T インデックスは、S&P Globalの一部門である S&P ダウ・ジョーンズ・インデックス LLC またはその関連会社 (「SPDJI」) の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor's および S&P は、S&P Global の一部門であるスタンダード & プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ LLC (「S&P」) の登録商標で、Dow Jones は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズ LLC (「Dow Jones」) の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本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

S&P Dow Jones Indices は、S & P 先進国 R E I T インデックス またはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信 (電子通信も含む) を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P Dow Jones Indices は、これに含まれる過誤、遺漏または中断に対して、いかなる義務また

は責任も負わないものとしします。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運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。



<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 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。
---------------	--

<p>ファンド名</p>	<p>D I A Mマネーマザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。</p>
<p>主な投資対象</p>	<p>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。</p>
<p>投資態度</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1.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>(*) 主要格付機関とは、R & I、J C R、M o o d y ' s、S & Pとします。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2.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。 3.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>	<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	<ol style="list-style-type: none">1. 株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。2. 同一銘柄の株式への投資は、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。3. 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。4. 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。5. 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。6. 外貨建て資産への投資は行いません。7. 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。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。
--------	--

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

定期的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6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年6月、12月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める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す。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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)に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

(5) 【投資制限】

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

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

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

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

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、投資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)

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

- 1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象有価証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
- 2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(信託財産の組入ヘッジ対象有価証券およびマザーファンドの組入ヘッジ対象有価証券のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める組入ヘッジ対象有価証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券および組入貸付債権信託受益権の利払

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

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

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

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

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

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

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

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

るヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

- 1)委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2)金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3)金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 4)上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5)為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額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25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28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、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

ンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

資金の借入れ(約款第35条)

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

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

リスク抑制コースでは、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。

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

・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

・為替リスク

為替ヘッジを行っても、為替相場の変動による基準価額への影響を完全には排除できません。

ファンドは、実質組入外貨建資産については原則として対円で為替ヘッジを行い為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。

なお、実質組入資産の直接ヘッジのほか、一部の新興国通貨については代替通貨を用いた為替ヘッジを行う場合があります。代替通貨を用いた為替ヘッジの場合、通貨間の値動きが異なる場

合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、代替通貨と一部の新興国通貨間の為替変動の影響を受ける可能性があります。

また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨および代替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。

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

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

リスク抑制コースでは、過去12ヵ月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15%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。

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

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

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

注意事項

イ. ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。

ロ. 投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。

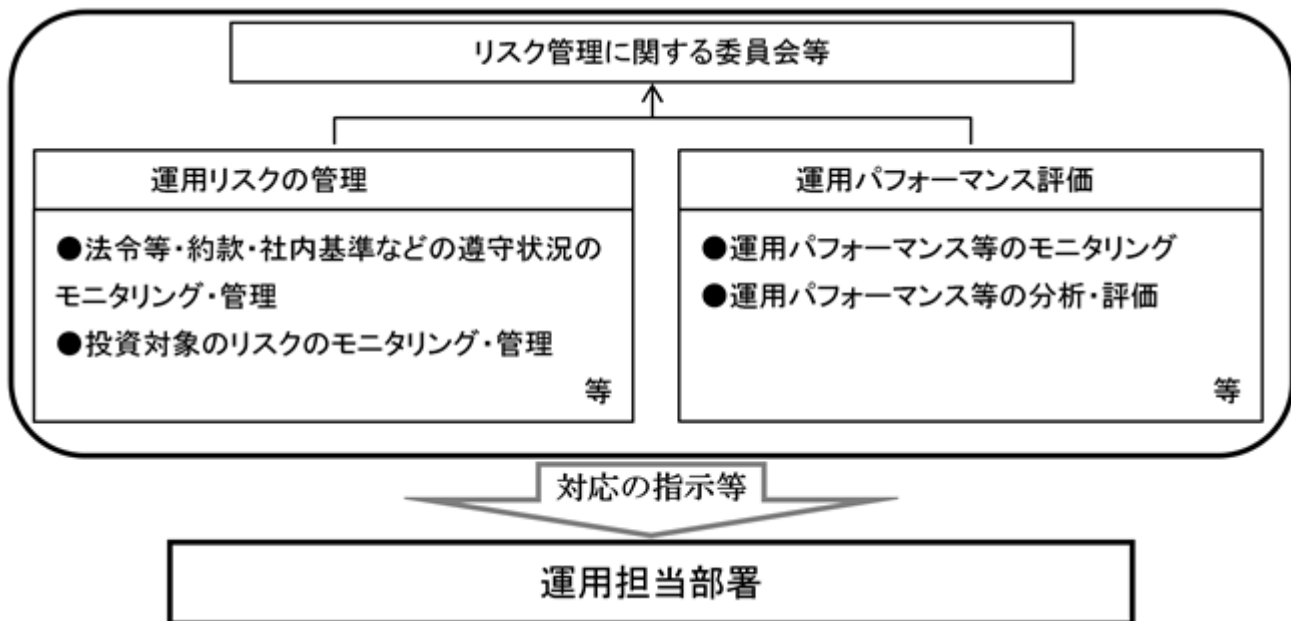
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ. 投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、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6月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

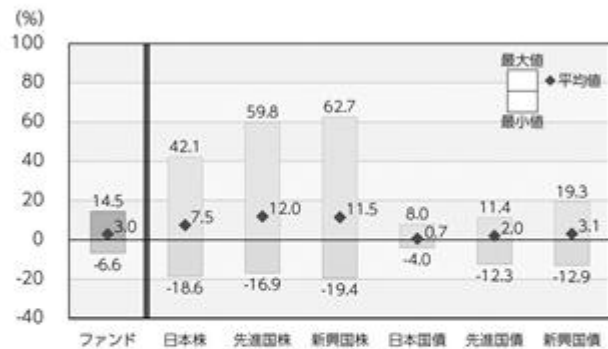
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(基本コース)



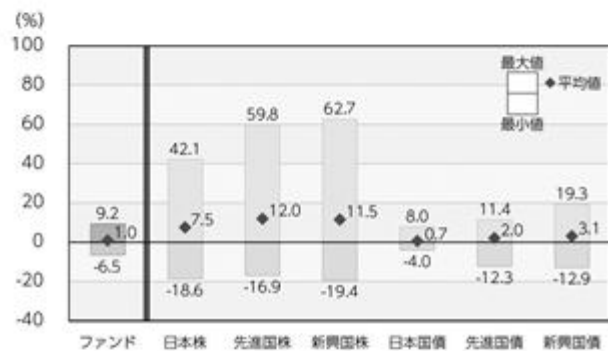
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2018年1月~2021年6月

代表的な資産クラス:2016年7月~2021年6月

(リスク抑制コース)



ファンド:2018年1月~2021年6月

代表的な資産クラス:2016年7月~2021年6月

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

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、東京証券取引所第一部に上場されているすべての株式の時価総額を指数化したものです。同指数は、株式会社東京証券取引所(旧東京証券取引所)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、旧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2.2%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.243%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	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0.55%	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、毎計算期末または信託終了のときに信託報酬にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

上場投資信託(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には、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年6月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

ワールドアセットバランス(基本コース)

2021年6月30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	43,209,577	0.45
内 アメリカ	43,209,577	0.45
親投資信託受益証券	9,438,110,297	98.54
内 日本	9,438,110,297	98.54
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	96,877,889	1.01
純資産総額	9,578,197,763	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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2021年6月30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	66,601,228	0.22
内 アメリカ	66,601,228	0.22
親投資信託受益証券	29,979,753,013	98.89
内 日本	29,979,753,013	98.89
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	269,237,869	0.89
純資産総額	30,315,592,110	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)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	542,343,216,026	94.20
内 アメリカ	375,074,550,262	65.15
内 イギリス	23,806,991,207	4.14
内 カナダ	20,067,712,399	3.49
内 スイス	18,756,915,348	3.26
内 フランス	18,575,429,628	3.23
内 ドイツ	16,450,989,329	2.86
内 オーストラリア	11,431,765,678	1.99
内 オランダ	10,671,716,937	1.85
内 アイルランド	10,074,909,859	1.75
内 スウェーデン	6,269,754,180	1.09
内 デンマーク	4,538,912,203	0.79
内 スペイン	4,400,724,077	0.76
内 香港	4,150,932,898	0.72
内 イタリア	3,283,749,607	0.57
内 フィンランド	2,219,376,018	0.39
内 ジョージア	2,208,955,038	0.38
内 シンガポール	1,564,049,009	0.27
内 ベルギー	1,510,774,425	0.26
内 バミューダ	1,335,539,084	0.23

内 ケイマン諸島	1,107,661,336	0.19
内 ノルウェー	1,100,254,614	0.19
内 イスラエル	1,005,368,728	0.17
内 ニュージーランド	547,100,513	0.10
内 ルクセンブルグ	540,052,828	0.09
内 オランダ領キュラソー	465,912,955	0.08
内 オーストリア	345,526,748	0.06
内 ポルトガル	250,703,305	0.04
内 パナマ	216,087,031	0.04
内 リベリア	188,766,805	0.03
内 マン島	135,270,973	0.02
内 パプアニューギニア	46,763,004	0.01
投資信託受益証券	981,262,440	0.17
内 オーストラリア	768,060,279	0.13
内 シンガポール	213,202,161	0.04
投資証券	11,586,085,938	2.01
内 アメリカ	10,713,579,421	1.86
内 イギリス	307,332,779	0.05
内 フランス	298,098,956	0.05
内 香港	197,919,624	0.03
内 カナダ	69,155,158	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,796,110,918	3.61
純資産総額	575,706,675,322	100.00

その他資産の投資状況

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	20,929,570,100	3.64
内 アメリカ	15,436,216,056	2.68
内 ドイツ	3,304,983,676	0.57
内 イギリス	956,913,048	0.17
内 カナダ	751,356,200	0.13
内 オーストラリア	480,101,120	0.08

(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6月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	564,283,856,880	97.59
内 アメリカ	252,774,140,095	43.72
内 フランス	57,791,281,381	9.99
内 イタリア	53,812,264,532	9.31
内 ドイツ	43,085,739,078	7.45
内 イギリス	37,037,060,781	6.41
内 スペイン	33,683,833,282	5.83
内 ベルギー	13,518,713,725	2.34
内 オーストラリア	11,951,290,633	2.07

内 カナダ	11,514,568,028	1.99
内 オランダ	11,081,406,186	1.92
内 オーストリア	8,416,932,695	1.46
内 アイルランド	4,686,993,480	0.81
内 メキシコ	4,455,980,984	0.77
内 フィンランド	3,510,133,796	0.61
内 ポーランド	3,456,916,190	0.60
内 マレーシア	2,672,160,055	0.46
内 デンマーク	2,670,737,188	0.46
内 イスラエル	2,522,688,760	0.44
内 シンガポール	2,330,199,054	0.40
内 スウェーデン	1,926,253,259	0.33
内 ノルウェー	1,384,563,698	0.24
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,924,533,927	2.41
純資産総額	578,208,390,807	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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年6月30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	8,228,989,035	10.63
内 オーストラリア	5,375,568,348	6.95
内 シンガポール	2,853,420,687	3.69
投資証券	68,687,879,714	88.75
内 アメリカ	57,556,006,619	74.36
内 イギリス	4,123,129,451	5.33
内 フランス	1,763,440,691	2.28
内 カナダ	1,516,212,300	1.96
内 香港	1,197,791,575	1.55
内 ベルギー	1,042,470,505	1.35
内 スペイン	328,968,497	0.43
内 ニュージーランド	314,594,605	0.41
内 ドイツ	208,124,578	0.27
内 ガーンジー	193,492,593	0.25
内 オランダ	148,620,141	0.19
内 韓国	140,809,640	0.18
内 アイルランド	90,121,897	0.12
内 イスラエル	50,271,843	0.06
内 イタリア	13,824,779	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	481,645,999	0.62
純資産総額	77,398,514,748	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6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	55,320,593,382	88.08
内 ケイマン諸島	13,966,765,486	22.24

内 台湾	7,517,060,223	11.97
内 韓国	7,308,006,290	11.64
内 中国	6,048,798,992	9.63
内 インド	5,558,682,349	8.85
内 ブラジル	2,820,982,397	4.49
内 南アフリカ	1,901,154,964	3.03
内 サウジアラビア	1,607,527,172	2.56
内 ロシア	1,504,189,945	2.39
内 タイ	883,990,173	1.41
内 マレーシア	701,360,202	1.12
内 メキシコ	691,214,737	1.10
内 香港	643,504,439	1.02
内 インドネシア	629,806,478	1.00
内 アラブ首長国連邦	391,638,588	0.62
内 バミューダ	358,343,522	0.57
内 ポーランド	349,281,178	0.56
内 カタール	347,275,887	0.55
内 フィリピン	341,130,605	0.54
内 クエート	291,458,613	0.46
内 チリ	241,233,826	0.38
内 アメリカ	212,602,239	0.34
内 オランダ	170,981,782	0.27
内 トルコ	137,704,228	0.22
内 ハンガリー	128,145,295	0.20
内 ルクセンブルグ	127,007,645	0.20
内 キプロス	89,699,163	0.14
内 コロンビア	77,765,705	0.12
内 ギリシャ	71,831,223	0.11
内 チェコ	58,585,168	0.09
内 ジャージー	54,816,921	0.09
内 エジプト	25,878,253	0.04
内 マン島	17,111,490	0.03
内 イギリス領バージン諸島	16,929,357	0.03
内 シンガポール	10,071,524	0.02
内 ペルー	8,658,679	0.01
内 パキスタン	7,261,310	0.01
内 アルゼンチン	2,137,334	0.00
投資信託受益証券	386,915,666	0.62
内 メキシコ	263,951,952	0.42
内 ブラジル	122,963,714	0.20
投資証券	48,035,608	0.08
内 南アフリカ	26,719,812	0.04
内 メキシコ	21,315,796	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,054,044,598	11.23
純資産総額	62,809,589,254	100.00

その他資産の投資状況

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,045,351,471	11.22

内 アメリカ	7,045,351,471	11.22
--------	---------------	-------

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年6月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	156,783,444,105	97.96
内 メキシコ	23,711,150,856	14.81
内 インドネシア	21,795,733,855	13.62
内 ロシア	20,565,185,319	12.85
内 ブラジル	16,848,017,618	10.53
内 コロンビア	14,660,978,984	9.16
内 フィリピン	14,281,516,670	8.92
内 南アフリカ	10,602,776,062	6.62
内 パナマ	9,785,392,002	6.11
内 ペルー	8,745,535,889	5.46
内 ルーマニア	6,329,045,546	3.95
内 ハンガリー	6,160,332,797	3.85
内 クロアチア	3,297,778,507	2.06
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,271,839,694	2.04
純資産総額	160,055,283,799	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	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	2,959,262,035	1.4356 4,248,316,578	1.4329 4,240,326,569	- -	44.27
2	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	657,062,487	2.1577 1,417,743,729	2.1816 1,433,447,521	- -	14.97
3	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	264,093,264	5.3107 1,402,546,506	5.4024 1,426,737,449	- -	14.90
4	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	899,141,189	1.5340 1,379,282,584	1.5480 1,391,870,560	- -	14.53
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	621,739,661	1.5547 966,618,651	1.5211 945,728,198	- -	9.87

6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	13,300	3,250.27	3,248.84	-	0.45
				43,228,696	43,209,577	-	

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.45
親投資信託受益証券	98.54
合計	98.99

(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

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	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	9,313,753,297	1.4356 13,370,824,932	1.4329 13,345,677,099	- -	44.02
2	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	843,452,104	5.3108 4,479,405,489	5.4024 4,556,665,646	- -	15.03
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	2,075,414,708	2.1577 4,478,122,453	2.1816 4,527,724,726	- -	14.94
4	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,892,834,083	1.5340 4,437,607,484	1.5480 4,478,107,160	- -	14.77
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,019,313,906	1.5547 3,139,427,330	1.5211 3,071,578,382	- -	10.13
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信託受益証券	20,500	3,250.27 66,630,697	3,248.84 66,601,228	- -	0.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.22
親投資信託受益証券	98.89
合計	99.11

(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)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,558,371	14,830.01 23,110,663,756	15,075.37 23,493,021,603	- -	4.08
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	664,983	27,084.90 18,011,000,574	30,011.41 19,957,078,785	- -	3.47
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	39,737	361,223.09 14,353,922,081	381,295.32 15,151,532,178	- -	2.63
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	223,360	30,397.26 6,789,532,751	38,911.99 8,691,383,471	- -	1.51
5	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	27,360	234,810.81 6,424,423,941	278,702.51 7,625,300,799	- -	1.32
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	27,929	233,397.34 6,518,554,546	270,417.86 7,552,500,439	- -	1.31
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	71,333	87,393.09 6,234,011,737	75,278.44 5,369,837,017	- -	0.93
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	57,498	66,141.12 3,802,982,178	88,582.32 5,093,306,269	- -	0.88
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	283,274	15,887.44 4,500,499,921	17,044.80 4,828,349,015	- -	0.84
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	243,911	18,373.92 4,481,602,730	18,138.43 4,424,164,404	- -	0.77

11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	157,270	23,429.76 3,684,798,362	26,091.35 4,103,386,771	- -	0.71
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	127,061	27,273.73 3,465,428,599	30,543.30 3,880,862,470	- -	0.67
13	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロ バイ ダー/ヘル スケア ア・サー ビス	88,089	37,102.80 3,268,349,012	44,021.89 3,877,844,972	- -	0.67
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	267,021	12,176.75 3,251,450,565	13,961.81 3,728,097,803	- -	0.65
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	100,005	31,018.65 3,102,020,270	35,190.97 3,519,273,874	- -	0.61
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	228,289	14,183.22 3,237,874,377	14,861.95 3,392,820,160	- -	0.59
17	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	103,429	32,397.33 3,350,823,937	32,373.40 3,348,348,471	- -	0.58
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	82,257	38,132.30 3,136,648,883	40,693.43 3,347,320,294	- -	0.58
19	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	721,445	3,790.77 2,734,832,266	4,521.61 3,262,097,399	- -	0.57
20	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	168,757	20,723.99 3,497,318,533	19,233.17 3,245,733,656	- -	0.56
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	38,957	65,223.94 2,540,929,249	77,619.04 3,023,805,019	- -	0.53
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	44,419	54,862.17 2,436,922,919	65,325.13 2,901,677,171	- -	0.50
23	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	65,397	37,542.43 2,455,162,468	41,873.43 2,738,397,355	- -	0.48
24	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	393,854	5,724.91 2,254,780,385	6,924.51 2,727,249,742	- -	0.47
25	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	424,761	5,929.75 2,518,729,098	6,252.19 2,655,687,835	- -	0.46
26	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	41,162	60,913.25 2,507,311,319	58,994.42 2,428,328,727	- -	0.42

27	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気 通信サー ビス	383,857	6,025.59 2,312,966,000	6,174.78 2,370,235,290	- -	0.41
28	INTEL CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	377,363	6,819.76 2,573,527,533	6,275.41 2,368,109,430	- -	0.41
29	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	85,282	26,315.41 2,244,230,886	27,181.66 2,318,107,163	- -	0.40
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	392,063	5,287.15 2,072,895,929	5,850.78 2,293,877,417	- -	0.40

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	94.20
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.01
合計	96.39

(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6月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	7.30
銀行		5.89
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.64
半導体・半導体製造装置		4.53
情報技術サービス		4.52
医薬品		4.45
コンピュータ・周辺機器		4.37
インターネット販売・通信販売		3.18
資本市場		3.16
石油・ガス・消耗燃料		3.04
ヘルスケア機器・用品		2.91
保険		2.90
化学		2.06
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		1.88
ホテル・レストラン・レジャー		1.76
バイオテクノロジー		1.76
機械		1.69
電力		1.67
自動車		1.65
専門小売り		1.64
飲料		1.58
繊維・アパレル・贅沢品		1.56
食品		1.55
金属・鉱業		1.50

娯楽	1.44
航空宇宙・防衛	1.43
各種電気通信サービス	1.37
食品・生活必需品小売り	1.29
コングロマリット	1.11
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.10
メディア	1.08
家庭用品	1.06
陸運・鉄道	1.03
各種金融サービス	0.91
電気設備	0.87
総合公益事業	0.77
専門サービス	0.76
航空貨物・物流サービス	0.70
通信機器	0.66
タバコ	0.64
パーソナル用品	0.64
建設関連製品	0.61
電子装置・機器・部品	0.53
複合小売り	0.51
消費者金融	0.48
不動産管理・開発	0.42
商業サービス・用品	0.41
家庭用耐久財	0.36
商社・流通業	0.31
無線通信サービス	0.29
自動車部品	0.28
容器・包装	0.28
建設資材	0.26
建設・土木	0.21
ヘルスケア・テクノロジー	0.16
エネルギー設備・サービス	0.16
ガス	0.14
運送インフラ	0.13
紙製品・林産品	0.10
水道	0.10
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	0.08
旅客航空輸送業	0.05
合計	94.20

(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6月30日現在

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

1	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	3,597,167,400	94.86 3,412,531,522	94.87 3,412,812,570	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	3,299,707,200	92.92 3,066,407,571	92.94 3,066,923,150	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	2,695,940,400	96.86 2,611,481,628	96.85 2,611,271,021	1.125 2031/2/15	0.45
4	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	1,372,379,400	173.01 2,374,386,537	172.40 2,366,105,599	4.5 2041/4/25	0.41
5	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	2,159,627,400	105.77 2,284,312,126	105.78 2,284,480,858	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	2,267,995,800	99.85 2,264,806,429	99.87 2,265,160,805	0.125 2023/2/28	0.39
7	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	2,249,197,200	99.84 2,245,682,829	99.87 2,246,297,826	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	2,240,350,800	99.57 2,230,811,788	99.60 2,231,424,390	0.25 2024/3/15	0.39
9	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証 券	2,321,074,200	93.24 2,164,356,359	93.30 2,165,580,353	0.625 2030/5/15	0.37
10	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証 券	2,238,139,200	94.71 2,119,937,473	94.85 2,123,084,856	1.875 2051/2/15	0.37
11	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	1,898,658,600	110.99 2,107,436,862	110.98 2,107,140,198	2.875 2028/5/15	0.36
12	FRANCE OAT 1.75 05/25/23 フランス	国債証 券	1,978,963,200	104.58 2,069,797,610	104.57 2,069,409,734	1.75 2023/5/25	0.36
13	US T N/B 1.375 11/15/40 アメリカ	国債証 券	2,271,313,200	89.29 2,028,122,968	89.42 2,031,139,567	1.375 2040/11/15	0.35
14	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証 券	1,682,908,200	119.35 2,008,567,765	119.36 2,008,803,372	2.75 2027/10/25	0.35
15	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	1,821,252,600	106.24 1,935,080,887	106.22 1,934,654,022	2.75 2024/2/15	0.33
16	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証 券	1,698,697,800	113.89 1,934,653,719	113.82 1,933,551,264	1.5 2031/5/25	0.33
17	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	1,700,720,400	112.98 1,921,481,865	112.98 1,921,481,865	3.125 2028/11/15	0.33
18	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証 券	1,325,010,600	144.40 1,913,382,984	144.31 1,912,226,147	5.5 2029/4/25	0.33
19	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証 券	1,758,222,000	107.50 1,890,157,324	107.54 1,890,844,121	2.375 2027/5/15	0.33
20	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証 券	1,850,003,400	100.78 1,864,456,551	100.78 1,864,456,551	1.5 2030/2/15	0.32
21	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証 券	1,872,119,400	99.49 1,862,685,658	99.55 1,863,782,607	0.75 2026/3/31	0.32
22	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	1,519,749,000	122.38 1,859,885,543	122.37 1,859,735,088	2.5 2030/5/25	0.32
23	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証 券	1,872,119,400	98.39 1,842,136,227	98.48 1,843,745,089	0.5 2026/2/28	0.32
24	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	1,658,700,000	110.10 1,826,254,606	110.05 1,825,477,091	2.75 2028/2/15	0.32
25	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証 券	1,807,983,000	99.32 1,795,694,356	99.35 1,796,329,970	0.125 2024/2/15	0.31

26	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,691,874,000	105.95 1,792,659,457	105.93 1,792,262,915	2.5 2024/5/15	0.31
27	US T N/B 1.875 02/15/41 アメリカ	国債証券	1,837,839,600	97.32 1,788,663,017	97.43 1,790,744,960	1.875 2041/2/15	0.31
28	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,681,921,800	105.90 1,781,260,304	105.91 1,781,326,001	2.375 2024/8/15	0.31
29	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,669,758,000	106.31 1,775,226,692	106.39 1,776,465,971	2.25 2025/11/15	0.31
30	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,606,727,400	109.55 1,760,307,931	109.48 1,759,115,449	2.625 2029/2/15	0.30

(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6月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.59
合計	97.59

(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6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	343,772	13,555.04 4,659,844,945	13,429.94 4,616,837,677	- -	5.97
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	41,633	90,927.89 3,785,601,205	88,721.65 3,693,748,512	- -	4.77
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	70,770	33,566.45 2,375,497,987	33,558.81 2,374,957,578	- -	3.07
4	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	152,435	14,541.33 2,216,608,200	14,484.87 2,208,001,798	- -	2.85
5	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	130,656	17,212.67 2,248,938,922	16,853.49 2,202,010,608	- -	2.85
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	194,150	8,912.98 1,730,456,277	9,223.47 1,790,738,214	- -	2.31
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	64,753	23,453.99 1,518,716,801	23,256.07 1,505,900,935	- -	1.95
8	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	782,002	1,738.88 1,359,812,038	1,767.13 1,381,900,132	- -	1.79
9	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	159,616	8,775.02 1,400,634,976	8,576.58 1,368,960,159	- -	1.77
10	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	173,313	7,525.30 1,304,233,277	7,513.91 1,302,258,457	- -	1.68
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	63,642	20,616.88 1,312,099,604	20,238.35 1,288,009,172	- -	1.66

12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	62,055	18,097.60 1,123,046,787	18,204.78 1,129,697,957	- -	1.46
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	174,557	6,372.42 1,112,351,536	6,399.26 1,117,036,430	- -	1.44
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	263,425	4,150.08 1,093,235,176	4,148.96 1,092,940,209	- -	1.41
15	LINK REIT 香港	投資証券	965,620	1,107.87 1,069,784,177	1,081.52 1,044,345,067	- -	1.35
16	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	30,167	34,075.89 1,027,967,553	33,409.53 1,007,865,454	- -	1.30
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	53,139	18,905.83 1,004,637,261	18,782.01 998,057,388	- -	1.29
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,904	19,480.95 1,011,139,535	19,075.04 990,071,395	- -	1.28
19	SEGRO PLC イギリス	投資証券	557,998	1,674.37 934,296,777	1,693.18 944,793,174	- -	1.22
20	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	250,174	3,742.05 936,163,682	3,724.33 931,731,634	- -	1.20
21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	174,074	5,389.99 938,258,252	5,290.14 920,877,083	- -	1.19
22	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	249,340	3,541.06 882,927,902	3,432.40 855,835,413	- -	1.11
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	65,941	13,228.20 872,281,022	12,587.32 830,020,560	- -	1.07
24	UDR INC アメリカ	投資証券	137,860	5,479.30 755,377,252	5,470.39 754,148,323	- -	0.97
25	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	82,669	8,502.88 702,925,166	8,329.99 688,632,059	- -	0.89
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	45,380	14,976.50 679,633,925	14,812.19 672,177,227	- -	0.87
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	78,394	8,486.26 665,272,168	8,321.14 652,327,841	- -	0.84
28	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	134,254	5,013.41 673,071,112	4,679.74 628,274,565	- -	0.81
29	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD フランス	投資証券	64,340	10,348.05 665,793,855	9,580.33 616,399,062	- -	0.80
30	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	328,320	1,949.45 640,046,000	1,871.01 614,291,185	- -	0.79

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年6月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	10.63
投資証券	88.75
合計	99.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	1,441,083	2,395.34 3,451,889,289	2,357.21 3,396,937,420	- -	5.41
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	8,937.81 3,012,042,367	8,408.72 2,833,738,640	- -	4.51
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	887,568	3,221.54 2,859,342,272	3,124.25 2,772,989,649	- -	4.41
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	279,951	8,126.13 2,274,919,778	7,921.79 2,217,715,831	- -	3.53
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	4,093.17 867,753,084	4,610.91 977,513,344	- -	1.56
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	26,578.13 678,646,080	23,379.66 596,976,340	- -	0.95
7	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	230,721	2,415.20 557,238,168	2,509.37 578,966,209	- -	0.92
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	166,403	2,908.41 483,969,095	3,131.69 521,124,275	- -	0.83
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,603,530	92.33 517,411,979	87.00 487,542,972	- -	0.78
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	199,050	2,033.69 404,806,975	2,344.57 466,687,653	- -	0.74

11	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	8,422.50 428,158,073	8,818.75 448,301,410	- -	0.71
12	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	76,062	3,990.39 303,517,502	5,566.59 423,406,516	- -	0.67
13	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	1,534.05 305,276,786	2,051.98 408,344,816	- -	0.65
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	363,500	1,259.69 457,898,606	1,090.78 396,499,984	- -	0.63
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	32,124	13,153.51 422,543,463	12,225.00 392,715,900	- -	0.63
16	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	14,661.64 378,446,419	14,767.95 381,190,557	- -	0.61
17	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	100,287	3,848.80 385,985,473	3,751.79 376,256,766	- -	0.60
18	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	23,129.44 366,994,853	22,964.14 364,372,145	- -	0.58
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	47,221	7,316.88 345,510,706	7,237.19 341,747,821	- -	0.54
20	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	845,400	376.23 318,065,079	390.88 330,456,715	- -	0.53
21	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	88,507	3,844.50 340,266,027	3,704.18 327,846,700	- -	0.52

22	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	729,225	480.31 350,259,251	441.72 322,120,231	- -	0.51
23	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	23,636	11,966.47 282,839,675	12,687.94 299,892,367	- -	0.48
24	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	160,668	1,712.97 275,221,034	1,854.42 297,947,012	- -	0.47
25	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	351,271	700.10 245,926,655	833.77 292,880,345	- -	0.47
26	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	37,619.29 272,326,072	40,244.69 291,331,383	- -	0.46
27	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	299,985	876.80 263,027,328	960.14 288,030,597	- -	0.46
28	KAKAO CORP 韓国	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	18,304	11,613.28 212,569,605	15,452.39 282,840,729	- -	0.45
29	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	53,622	4,772.67 255,920,182	5,011.27 268,714,588	- -	0.43
30	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	25,186	8,856.65 223,063,800	10,153.45 255,724,932	- -	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6月30日現在

種類	投資比率（％）
株式	88.08
投資信託受益証券	0.62
投資証券	0.08
合計	88.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年6月30日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
----	---------	---------

銀行	外国	10.82
インターネット販売・通信販売		8.78
半導体・半導体製造装置		7.90
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.54
コンピュータ・周辺機器		5.27
石油・ガス・消耗燃料		4.37
金属・鉱業		3.85
自動車		2.87
電子装置・機器・部品		2.43
化学		2.43
保険		2.31
情報技術サービス		1.87
不動産管理・開発		1.76
食品		1.55
医薬品		1.28
無線通信サービス		1.25
娯楽		1.15
ライフサイエンス・ツール/サービス		1.12
繊維・アパレル・贅沢品		1.12
飲料		1.04
食品・生活必需品小売り		0.98
資本市場		0.96
バイオテクノロジー		0.93
各種電気通信サービス		0.92
コングロマリット		0.79
建設資材		0.75
ホテル・レストラン・レジャー		0.69
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.64
電力		0.60
貯蓄・抵当・不動産金融		0.60
海運業		0.58
各種金融サービス		0.58
パーソナル用品		0.57
専門小売り		0.53
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.51
自動車部品		0.50
運送インフラ		0.49
ガス		0.48
電気設備		0.47
機械		0.45
消費者金融		0.45
建設・土木		0.42
複合小売り		0.40
ソフトウェア		0.40
家庭用耐久財		0.38
家庭用品		0.36
ヘルスケア機器・用品		0.34
各種消費者サービス		0.30
商業サービス・用品		0.28
タバコ		0.27

航空貨物・物流サービス	0.24
陸運・鉄道	0.21
通信機器	0.18
紙製品・林産品	0.17
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
メディア	0.12
航空宇宙・防衛	0.12
旅客航空輸送業	0.11
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	0.05
専門サービス	0.03
建設関連製品	0.02
総合公益事業	0.02
販売	0.00
合計	88.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年6月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	3,206,820,000	124.10 3,979,737,266	125.81 4,034,580,412	5.25 2047/6/23	2.52
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,543,340,000	117.98 3,000,707,726	119.00 3,026,574,600	5.1 2035/3/28	1.89
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,322,180,000	109.28 2,537,683,833	106.60 2,475,652,876	5 2045/6/15	1.55
4	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,879,860,000	126.80 2,383,748,732	128.50 2,415,638,898	5.625 2042/4/4	1.51
5	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	2,034,672,000	112.65 2,292,189,598	113.81 2,315,822,976	4.75 2026/5/27	1.45
6	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,647,642,000	123.09 2,028,209,262	125.79 2,072,626,539	6.05 2040/1/11	1.29
7	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,769,280,000	112.64 1,993,037,524	113.33 2,005,257,720	4.5 2029/4/22	1.25
8	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,813,512,000	109.14 1,979,339,537	108.74 1,972,158,029	4.875 2023/9/16	1.23
9	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,426,482,000	135.40 1,931,599,276	135.15 1,928,033,071	6.7 2036/1/26	1.20

10	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,271,670,000	149.53 1,901,586,581	151.39 1,925,266,669	7.75 2038/1/17	1.20
11	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,702,932,000	111.49 1,898,685,139	112.89 1,922,465,478	4.375 2029/3/21	1.20
12	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,879,860,000	100.82 1,895,387,643	101.95 1,916,536,068	2.783 2031/1/23	1.20
13	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,702,932,000	110.87 1,888,209,674	111.87 1,905,093,869	4.25 2027/6/23	1.19
14	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,326,960,000	135.66 1,800,175,499	137.44 1,823,800,363	5.625 2050/11/18	1.14
15	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,592,352,000	114.38 1,821,404,426	113.51 1,807,512,194	6 2024/1/26	1.13
16	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,769,280,000	99.30 1,757,049,852	101.38 1,793,696,064	3.875 2030/6/12	1.12
17	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,570,236,000	111.97 1,758,238,365	113.21 1,777,742,687	5.875 2025/9/16	1.11
18	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,636,584,000	107.56 1,760,408,387	108.52 1,776,176,432	4.625 2028/1/13	1.11
19	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,548,120,000	113.19 1,752,385,587	114.65 1,774,919,580	4.75 2032/4/27	1.11
20	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,747,164,000	98.71 1,724,671,475	101.52 1,773,851,930	5 2045/1/27	1.11
21	ROMANIA 6.125 01/22/44 ルーマニア	国債証券	1,260,612,000	130.28 1,642,341,944	136.73 1,723,695,296	6.125 2044/1/22	1.08
22	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,479,560,400	113.62 1,681,201,990	112.94 1,671,089,493	5.375 2024/3/25	1.04
23	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,371,192,000	117.75 1,614,674,563	121.15 1,661,212,819	5.55 2045/1/21	1.04
24	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,548,120,000	104.92 1,624,427,498	106.30 1,645,784,698	4.85 2029/9/30	1.03
25	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	995,220,000	162.88 1,621,064,760	164.18 1,634,001,957	7.625 2041/3/29	1.02
26	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,437,540,000	115.58 1,661,554,069	113.59 1,632,959,187	5.625 2044/2/26	1.02
27	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,437,540,000	113.18 1,627,122,775	112.41 1,616,029,279	5.75 2023/11/22	1.01
28	BRAZIL 5.625 01/07/41 ブラジル	国債証券	1,448,598,000	107.33 1,554,807,878	109.63 1,588,141,445	5.625 2041/1/7	0.99
29	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,326,960,000	121.75 1,615,621,349	118.74 1,575,698,652	6.125 2041/1/18	0.98
30	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	1,105,800,000	139.72 1,545,038,135	141.67 1,566,633,878	6.375 2034/10/23	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6月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.96
合計	97.96

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

ワールドアセットバランス（基本コース）

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

該当事項はありません。

（参考）

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。

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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・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】

ワールドアセットバランス（基本コース）

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

該当事項はありません。

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Sep21	買建	652	15,294,629,976	15,436,216,056	2.68
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep21	買建	613	3,318,845,629	3,304,983,676	0.57
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep21	買建	89	964,025,032	956,913,048	0.17

モントリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep21	買建	35	747,358,892	751,356,200	0.13
シドニー先 物取引所	SPI 200 FUTURES Sep21	買建	32	480,516,720	480,101,120	0.08

(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。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年6月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Sep21	買建	927	7,013,448,588	7,045,351,471	11.22

(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場で評価しています。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

直近日(2021年6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 (2017年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (2017年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (2018年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (2018年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
第5計算期間末 (2019年6月11日)	12,878	12,878	1.0565	1.0565
第6計算期間末 (2019年12月11日)	12,003	12,003	1.0853	1.0853
第7計算期間末 (2020年6月11日)	11,343	11,343	1.0724	1.0724

第8計算期間末 (2020年12月11日)	10,467	10,467	1.1486	1.1486
第9計算期間末 (2021年6月11日)	9,706	9,706	1.1869	1.1869
2020年6月末日	11,021	-	1.0634	-
7月末日	11,113	-	1.0979	-
8月末日	11,008	-	1.1095	-
9月末日	10,472	-	1.0944	-
10月末日	10,286	-	1.0961	-
11月末日	10,557	-	1.1439	-
12月末日	10,350	-	1.1546	-
2021年1月末日	10,168	-	1.1625	-
2月末日	9,977	-	1.1502	-
3月末日	9,722	-	1.1465	-
4月末日	9,720	-	1.1687	-
5月末日	9,620	-	1.1719	-
6月末日	9,578	-	1.1848	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2021年6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 (2017年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2017年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
第3計算期間末 (2018年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
第4計算期間末 (2018年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
第5計算期間末 (2019年6月11日)	49,438	49,438	1.0392	1.0392
第6計算期間末 (2019年12月11日)	46,310	46,310	1.0681	1.0681
第7計算期間末 (2020年6月11日)	41,188	41,188	1.0437	1.0437
第8計算期間末 (2020年12月11日)	36,032	36,032	1.0685	1.0685
第9計算期間末 (2021年6月11日)	30,943	30,943	1.0971	1.0971
2020年6月末日	40,195	-	1.0412	-
7月末日	39,241	-	1.0489	-
8月末日	38,633	-	1.0524	-
9月末日	37,338	-	1.0424	-
10月末日	36,379	-	1.0408	-
11月末日	36,514	-	1.0660	-
12月末日	35,307	-	1.0722	-
2021年1月末日	34,172	-	1.0770	-

2月末日	32,893	-	1.0645	-
3月末日	32,041	-	1.0612	-
4月末日	31,869	-	1.0804	-
5月末日	30,912	-	1.0833	-
6月末日	30,315	-	1.0951	-

【分配の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

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

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

【収益率の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	1.6
第4計算期間	3.6
第5計算期間	5.6
第6計算期間	2.7
第7計算期間	1.2
第8計算期間	7.1
第9計算期間	3.3

(注) 収益率は期間騰落率です。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	収益率(%)
第1計算期間	3.4
第2計算期間	2.0
第3計算期間	1.8

第4計算期間	3.7
第5計算期間	4.2
第6計算期間	2.8
第7計算期間	2.3
第8計算期間	2.4
第9計算期間	2.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959
第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324
第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143
第5計算期間	180,523,898	2,065,395,074
第6計算期間	287,056,004	1,416,879,908
第7計算期間	213,369,846	696,011,702
第8計算期間	122,826,944	1,586,765,325
第9計算期間	227,608,795	1,163,074,115

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597
第5計算期間	226,859,362	6,670,815,337
第6計算期間	398,143,626	4,613,079,433
第7計算期間	284,570,545	4,182,089,512
第8計算期間	108,436,378	5,849,150,571
第9計算期間	107,132,818	5,624,497,695

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

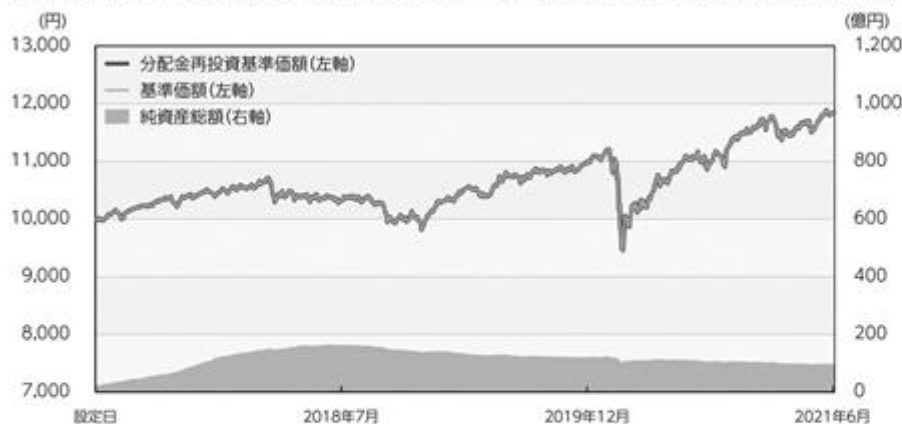
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021年6月30日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2021年6月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2019年 6月	0円
2019年 12月	0円
2020年 6月	0円
2020年 12月	0円
2021年 6月	0円
設定来累計	0円

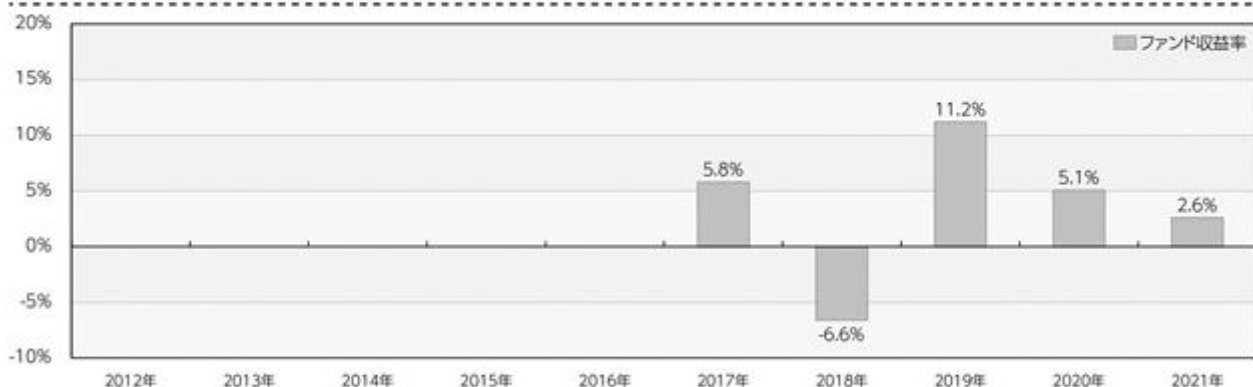
※分配金は1万口当たりです。

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	種類	国/地域	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	親投資信託受益証券	日本	44.27
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.97
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.90
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.53
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.87
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.45

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年6月30日

(リスク抑制コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2021年6月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2019年 6月	0円
2019年12月	0円
2020年 6月	0円
2020年12月	0円
2021年 6月	0円
設定来累計	0円

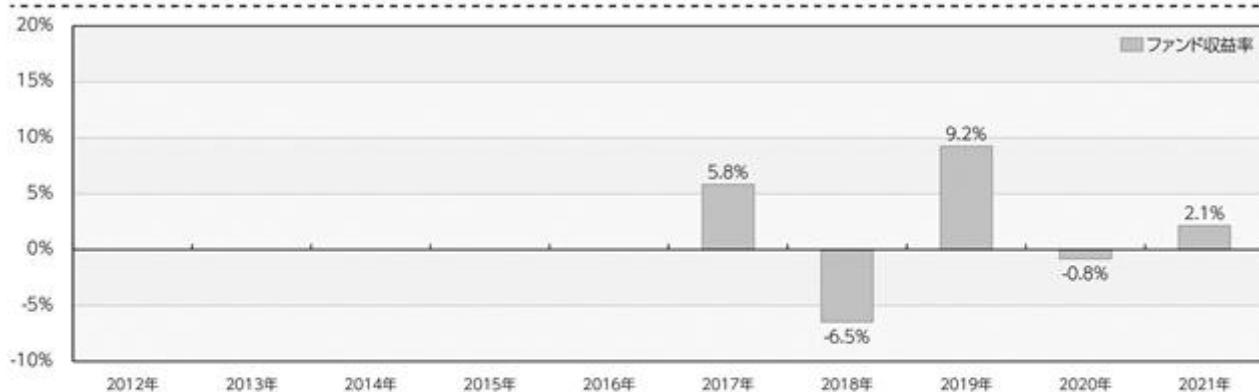
※分配金は1万口当たりです。

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	種類	国/地域	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	親投資信託受益証券	日本	44.02
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	15.03
3	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.94
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.77
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	10.13
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.22

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年6月30日

主要な資産の状況

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.08
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.47
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.63
4	FACEBOOK INC	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.51
5	ALPHABET INC-CL C	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.32

■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	0.41
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	5.97
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.77
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.07
4	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.85
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.85

■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	5.41
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	4.51
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	4.41
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.53
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.56

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年6月30日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	国債証券	ロシア	5.25	2047/6/23	2.52
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.89
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.55
4	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.51
5	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	国債証券	ロシア	4.75	2026/5/27	1.45

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

受益権の取得申込者は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。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、各計算期間終了日の基準価額とします。

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金自動けいぞく投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権

の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
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
上場先物取引等	計算日における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	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。

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2017年1月18日（設定日）から原則として2027年6月11日までです。

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

- 計算期間は、原則として毎年6月12日から12月11日まで、および12月12日から翌年6月11日までとします。
- 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

り次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回るようになった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ. 信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ. 信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支

払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa. からg. に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- 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、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行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a. からg. の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ハ. 関係法人との契約の更改

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

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

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

・委託会社は、毎年6月11日、12月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため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、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第9期計算期間(2020年12月12日から2021年6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】

【ワールドアセットバランス（基本コース）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 2020年12月11日現在	第9期 2021年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	2,710,662	3,340,915
コール・ローン	365,889,546	246,722,644
投資信託受益証券	37,723,491	42,790,858
親投資信託受益証券	10,156,192,544	9,478,428,496
派生商品評価勘定	10,792,255	1,489,842
未収入金	342,118	22,130
流動資産合計	10,573,650,616	9,772,794,885
資産合計		
	10,573,650,616	9,772,794,885
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,122,380	3,962,141
未払金	133,452	45,855
未払解約金	28,310,671	568,273
未払受託者報酬	1,786,932	1,641,017
未払委託者報酬	65,522,337	60,172,380
その他未払費用	213,803	194,651
流動負債合計	106,089,575	66,584,317
負債合計		
	106,089,575	66,584,317
純資産の部		
元本等		
元本	9,113,224,888	8,177,759,568
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,354,336,153	1,528,451,000
（分配準備積立金）	1,023,620,542	1,205,461,067
元本等合計	10,467,561,041	9,706,210,568
純資産合計		
	10,467,561,041	9,706,210,568
負債純資産合計		
	10,573,650,616	9,772,794,885

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期 自 2020年6月12日 至 2020年12月11日	第9期 自 2020年12月12日 至 2021年6月11日
営業収益		
受取配当金	132,343	488,115
受取利息	249	251
有価証券売買等損益	707,584,285	699,526,654
為替差損益	97,076,792	314,473,991
営業収益合計	804,793,669	385,541,029
営業費用		
支払利息	50,700	16,886
受託者報酬	1,786,932	1,641,017
委託者報酬	65,522,337	60,172,380
その他費用	531,498	833,805
営業費用合計	67,891,467	62,664,088
営業利益又は営業損失()	736,902,202	322,876,941
経常利益又は経常損失()	736,902,202	322,876,941
当期純利益又は当期純損失()	736,902,202	322,876,941
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()	46,098,820	12,011,727
期首剰余金又は期首欠損金()	765,946,556	1,354,336,153
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,631,729	36,244,353
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,631,729	36,244,353
剰余金減少額又は欠損金増加額	115,045,514	172,994,720
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	115,045,514	172,994,720
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	1,354,336,153	1,528,451,000

(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9期	
	自 2020年12月12日	至 2021年6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>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。</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	第8期	第9期
	2020年12月11日現在	2021年6月11日現在
1. 期首元本額	10,577,163,269円	9,113,224,888円
期中追加設定元本額	122,826,944円	227,608,795円
期中一部解約元本額	1,586,765,325円	1,163,074,115円
2. 受益権の総数	9,113,224,888口	8,177,759,568口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期	第9期
	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日	自 2020年12月12日 至 2021年6月11日
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（104,326,838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（368,760,635円）、信託約款に規定される収益調整金（330,715,611円）及び分配準備積立金（550,533,069円）より分配対象収益は1,354,336,153円（1万口当たり1,486.12円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（86,429,139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（224,436,075円）、信託約款に規定される収益調整金（322,989,933円）及び分配準備積立金（894,595,853円）より分配対象収益は1,528,451,000円（1万口当たり1,869.03円）であります。分配を行っておりません。</p>

(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8期	第9期
	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日	自 2020年12月12日 至 2021年6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8期	第9期
	2020年12月11日現在	2021年6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	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載していません。</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>	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	<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>	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第8期 2020年12月11日現在	第9期 2021年6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)
投資信託受益証券	6,543,165	3,090,702
親投資信託受益証券	617,186,405	587,822,631
合計	623,729,570	590,913,333

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第8期 2020年12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	5,638,107,875	-	5,637,438,000	669,875
アメリカ・ドル	4,543,284,720	-	4,533,862,800	9,421,920
イギリス・ポンド	126,559,615	-	125,798,400	761,215
イスラエル・シェケル	2,520,800	-	2,555,200	34,400

オーストラリア・ドル	111,922,140	-	114,288,800	2,366,660
カナダ・ドル	74,642,451	-	75,841,500	1,199,049
シンガポール・ドル	43,546,440	-	43,612,800	66,360
スイス・フラン	52,844,800	-	54,022,400	1,177,600
スウェーデン・クローナ	18,372,623	-	18,603,200	230,577
デンマーク・クローネ	13,214,962	-	13,406,300	191,338
ニュージーランド・ドル	6,584,850	-	6,633,000	48,150
ノルウェー・クローネ	3,167,694	-	3,202,200	34,506
メキシコ・ペソ	25,315,860	-	25,485,600	169,740
ユーロ	224,164,800	-	227,340,000	3,175,200
香港・ドル	340,954,920	-	340,345,800	609,120
南アフリカ・ランド	51,011,200	-	52,440,000	1,428,800
合計	5,638,107,875	-	5,637,438,000	669,875

種類	第9期 2021年6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	5,162,196,678	-	5,164,668,977	2,472,299
アメリカ・ドル	4,173,566,832	-	4,176,031,968	2,465,136
イギリス・ポンド	127,607,580	-	127,187,330	420,250
イスラエル・シェケル	2,354,803	-	2,361,506	6,703
オーストラリア・ドル	101,691,360	-	101,796,000	104,640
カナダ・ドル	72,564,800	-	72,413,200	151,600
シンガポール・ドル	38,113,254	-	38,035,790	77,464
スイス・フラン	42,636,020	-	42,851,725	215,705
スウェーデン・クローナ	16,482,125	-	16,587,500	105,375
デンマーク・クローネ	11,333,511	-	11,294,892	38,619
ニュージーランド・ドル	4,774,368	-	4,721,088	53,280
ノルウェー・クローネ	2,895,640	-	2,910,600	14,960
メキシコ・ペソ	22,194,802	-	22,491,994	297,192
ユーロ	204,751,485	-	204,002,856	748,629
香港・ドル	292,875,398	-	293,031,248	155,850
南アフリカ・ランド	48,354,700	-	48,951,280	596,580
合計	5,162,196,678	-	5,164,668,977	2,472,299

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 2020年12月11日現在	第9期 2021年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,1486円 (11,486円)	1,1869円 (11,869円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年6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	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300,000	390,926,900	
	アメリカ・ドル	小計	13,300,000	390,926,900 (42,790,858)	
投資信託受益証券 合計			13,300	42,790,858 (42,790,858)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	266,773,082	1,416,778,483	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	631,670,857	982,058,681	
		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	2,973,015,177	4,268,060,588	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	904,352,237	1,387,276,331	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	660,079,906	1,424,254,413	
日本円 小計			5,435,891,259	9,478,428,496	
親投資信託受益証券 合計			5,435,891,259	9,478,428,496	
合計				9,521,219,354 (42,790,858)	

（注）投資信託受益証券及び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。

（注）

1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	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 1銘柄	0.44	0.45

(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。

【ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第8期 2020年12月11日現在	第9期 2021年6月11日現在
資産の部		
流動資産		
預金	3,867,101	4,822,280
コール・ローン	3,585,845,602	699,744,679
国債証券	10,002,100,000	-
投資信託受益証券	58,145,230	65,955,834
親投資信託受益証券	22,691,935,758	30,481,022,519
派生商品評価勘定	24,712,095	4,796,310
未収入金	-	66,390
未収利息	57,204,240	-
流動資産合計	36,423,810,026	31,256,408,012
資産合計	36,423,810,026	31,256,408,012
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	23,343,919	12,708,993
未払金	-	103,954
未払解約金	129,251,845	95,111,002
未払受託者報酬	6,329,372	5,439,902
未払委託者報酬	232,078,818	199,465,219
その他未払費用	577,061	517,939
流動負債合計	391,581,015	313,347,009
負債合計	391,581,015	313,347,009
純資産の部		
元本等		
元本	33,721,664,491	28,204,299,614
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,310,564,520	2,738,761,389
(分配準備積立金)	1,765,776,885	1,714,593,021
元本等合計	36,032,229,011	30,943,061,003
純資産合計	36,032,229,011	30,943,061,003
負債純資産合計	36,423,810,026	31,256,408,012

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第8期 自 2020年6月12日 至 2020年12月11日	第9期 自 2020年12月12日 至 2021年6月11日
営業収益		
受取配当金	203,988	752,358
受取利息	66,519,247	2,799,699
有価証券売買等損益	877,454,088	1,975,950,624
為替差損益	168,460,027	930,208,347
営業収益合計	1,112,637,350	1,049,294,334
営業費用		
支払利息	1,894,421	316,908
受託者報酬	6,329,372	5,439,902
委託者報酬	232,078,818	199,465,219
その他費用	894,756	1,377,204
営業費用合計	241,197,367	206,599,233
営業利益又は営業損失()	871,439,983	842,695,101
経常利益又は経常損失()	871,439,983	842,695,101
当期純利益又は当期純損失()	871,439,983	842,695,101
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()	35,864,299	37,108,668
期首剰余金又は期首欠損金()	1,725,625,262	2,310,564,520
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,158,995	8,061,260
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,158,995	8,061,260
剰余金減少額又は欠損金増加額	255,795,421	385,450,824
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	255,795,421	385,450,824
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()	2,310,564,520	2,738,761,389

(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9期	
	自 2020年12月12日	至 2021年6月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</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>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。</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	第8期	第9期
	2020年12月11日現在	2021年6月11日現在
1. 期首元本額	39,462,378,684円	33,721,664,491円
期中追加設定元本額	108,436,378円	107,132,818円
期中一部解約元本額	5,849,150,571円	5,624,497,695円
2. 受益権の総数	33,721,664,491口	28,204,299,614口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第8期	第9期
	自 2020年6月12日 至 2020年12月11日	自 2020年12月12日 至 2021年6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(191,725,867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(947,021,906円)及び分配準備積立金(1,574,051,018円)より分配対象収益は2,712,798,791円(1万口当たり804.46円)であります、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(242,775,763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(1,024,168,368円)及び分配準備積立金(1,471,817,258円)より分配対象収益は2,738,761,389円(1万口当たり971.04円)であります、分配を行っておりません。
-------------	---	---

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第8期 自 2020年6月12日 至 2020年12月11日	第9期 自 2020年12月12日 至 2021年6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8期	第9期
	2020年12月11日現在	2021年6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8期	第9期
	2020年12月11日現在	2021年6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)
国債証券	69,900,000	-
投資信託受益証券	10,085,330	4,763,863
親投資信託受益証券	938,736,695	1,655,273,059
合計	878,922,025	1,660,036,922

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第8期			
	2020年12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	12,903,930,576	-	12,902,562,400	1,368,176
アメリカ・ドル	10,354,147,960	-	10,332,675,400	21,472,560
イギリス・ポンド	304,577,535	-	302,745,600	1,831,935
イスラエル・シケル	5,356,700	-	5,429,800	73,100
オーストラリア・ドル	271,372,860	-	277,111,200	5,738,340
カナダ・ドル	170,152,684	-	172,886,000	2,733,316
シンガポール・ドル	108,088,485	-	108,253,200	164,715
スイス・フラン	114,880,000	-	117,440,000	2,560,000
スウェーデン・クローナ	40,152,090	-	40,656,000	503,910
デンマーク・クローネ	28,939,094	-	29,358,100	419,006
ニュージーランド・ドル	16,096,300	-	16,214,000	117,700
ノルウェー・クローネ	6,921,998	-	6,997,400	75,402
メキシコ・ペソ	54,233,570	-	54,597,200	363,630
ユーロ	531,768,720	-	539,301,000	7,532,280
香港・ドル	787,904,100	-	786,496,500	1,407,600
南アフリカ・ランド	109,338,480	-	112,401,000	3,062,520
合計	12,903,930,576	-	12,902,562,400	1,368,176

種類	第9期			
	2021年6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	16,525,978,622	-	16,533,891,305	7,912,683
アメリカ・ドル	13,340,976,996	-	13,348,856,904	7,879,908
イギリス・ポンド	409,277,970	-	407,930,095	1,347,875
イスラエル・シケル	7,064,411	-	7,084,518	20,107
オーストラリア・ドル	327,107,208	-	327,443,800	336,592
カナダ・ドル	231,300,300	-	230,817,075	483,225
シンガポール・ドル	121,796,703	-	121,549,155	247,548
スイス・フラン	136,435,264	-	137,125,520	690,256
スウェーデン・クローナ	52,874,657	-	53,212,700	338,043
デンマーク・クローネ	36,339,194	-	36,215,368	123,826
ニュージーランド・ドル	16,710,288	-	16,523,808	186,480
ノルウェー・クローネ	9,081,780	-	9,128,700	46,920
メキシコ・ペソ	71,832,438	-	72,794,286	961,848
ユーロ	658,416,540	-	656,009,184	2,407,356
香港・ドル	950,365,163	-	950,870,888	505,725
南アフリカ・ランド	156,399,710	-	158,329,304	1,929,594
合計	16,525,978,622	-	16,533,891,305	7,912,683

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第8期 2020年12月11日現在	第9期 2021年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0685円 (10,685円)	1.0971円 (10,971円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年6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	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	602,556.500	
	アメリカ・ドル	小計	20,500.000	602,556.500 (65,955,834)	
投資信託受益証券 合計			20,500	65,955,834 (65,955,834)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	856,510,941	4,548,758,305	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,025,831,537	3,149,560,290	
		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	9,562,282,979	13,727,613,444	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2,938,450,268	4,507,582,711	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	2,107,571,845	4,547,507,769		
日本円 小計			17,490,647,570	30,481,022,519	
親投資信託受益証券 合計			17,490,647,570	30,481,022,519	
合計				30,546,978,353	

(注) 投資信託受益証券及び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。

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	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 1銘柄	0.21	0.22

(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。

(参考)

「ワールドアセットバランス(基本コース)」、「ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)」は、「外国株式パッシブ・ファンド・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、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・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。

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6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	5,638,251,131
コール・ローン	1,245,422,853
株式	533,029,244,861
投資信託受益証券	1,012,218,882
投資証券	11,761,204,229
派生商品評価勘定	157,682,649
未収入金	75,977,637
未収配当金	650,557,126
差入委託証拠金	3,452,170,778
流動資産合計	557,022,730,146
資産合計	
557,022,730,146	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,933,241
未払金	131,367,621
未払解約金	96,804,000
流動負債合計	230,104,862
負債合計	
230,104,862	
純資産の部	
元本等	
元本	104,842,284,348
剰余金	
剰余金又は欠損金()	451,950,340,936
元本等合計	556,792,625,284
純資産合計	
556,792,625,284	
負債純資産合計	
557,022,730,146	

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12月12日 至 2021年6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6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	95,048,377,388円
同期中追加設定元本額	31,669,435,770円
同期中一部解約元本額	21,875,528,810円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,627,516,583円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,581,280円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,348,813円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,360,258円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,993,692円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,418,061円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,963,790円
たわらノーロード 先進国株式	22,627,801,511円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	258,752,295円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,447,895,857円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	451,142,176円
たわらノーロード バランス(堅実型)	50,843,182円
たわらノーロード バランス(標準型)	407,582,643円
たわらノーロード バランス(積極型)	490,212,820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)	130,661,539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)	355,040,062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)	239,414,085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)	373,990,082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)	629,554円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	5,005,273円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,347,451円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	5,929,758円
たわらノーロード 全世界株式	111,438,316円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	48,390,892,669円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,075,012,132円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	160,558,295円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	873,440,637円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,056,373,002円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	100,169,772円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	307,993,050円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	273,894,109円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	21,200,412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	150,359,072円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	186,475,738円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,716,522円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	291,917,198円
投資のソムリエ	6,185,339,854円
クルーズコントロール	161,683,058円
投資のソムリエ<DC年金>	328,706,467円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	182,424,505円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	120,210,800円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,296,385円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	3,309,421円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	144,081,994円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,491,402,159円
ワールドアセットバランス(基本コース)	266,773,082円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	856,510,941円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	20,826,680円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,992,901円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,359,538円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	34,942,646円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	37,876,402円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	801,141,243円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	156,076,723円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	14,604,977円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,642,927円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,260,662円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	8,664,169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)	6,873,573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
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	118,955,458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)	438,279,127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)	59,598,138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)	1,344,769,468円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,192,818,192円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,118,855,728円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	155,649,758円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	9,551,408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)	37,498,644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)	65,370,755円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,978,859円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,146,158円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,274,606円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	797,336円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	8,455,939円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	34,881,007円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	247,077,312円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	357,201,090円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,161,230,754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)	233,108,325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)	61,964,817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)	402,380,752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)	17,999,465円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,278,503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)	169,210,368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)	13,950,727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)	52,943,261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)	85,525,475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)	173,859,987円
計	104,842,284,348円

2. 受益権の総数

104,842,284,348口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月12日 至 2021年6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	2021年6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	2021年6月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	32,461,730,974	
投資信託受益証券	99,971,987	
投資証券	1,742,741,358	
合計	34,304,444,319	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年2月16日から2021年6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	2021年6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	1,902,215,057	-	1,900,948,575	1,266,482	
イギリス・ポンド	1,332,114,310	-	1,330,883,623	1,230,687	
オーストラリア・ドル	93,092,596	-	93,236,472	143,876	
カナダ・ドル	20,445,331	-	20,444,030	1,301	
ユーロ	67,881,276	-	67,909,140	27,864	
ユーロ	388,681,544	-	388,475,310	206,234	
合計	1,902,215,057	-	1,900,948,575	1,266,482	

(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6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					
	11,634,795,469	-	11,791,811,359	157,015,890	
合計	11,634,795,469	-	11,791,811,359	157,015,890	

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.3108円 (53,108円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年6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	39,737	3,349.650	133,105,042.050	
	ABBOTT LABORATORIES	164,639	110.150	18,134,985.850	
	AES CORP	58,916	25.380	1,495,288.080	
	ABIOMED INC	3,987	298.130	1,188,644.310	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	83,017	150.540	12,497,379.180	
	ADVANCED MICRO DEVICES	112,775	81.560	9,197,929.000	
	ADOBE INC	44,419	535.520	23,787,262.880	
	CHUBB LTD	41,807	165.460	6,917,386.220	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,624	298.600	6,158,326.400	
	ALLEGHANY CORP	1,278	702.340	897,590.520	
	ALLSTATE CORP	28,336	131.410	3,723,633.760	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	64,514	226.250	14,596,292.500	
	AMGEN INC	53,604	244.640	13,113,682.560	
	HESS CORP	24,776	89.030	2,205,807.280	
	AMERICAN EXPRESS CO	63,637	162.230	10,323,830.510	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	46,414	84.730	3,932,658.220	
	AFLAC INC	61,310	56.200	3,445,622.000	
	AMERICAN INTL GROUP	80,846	51.570	4,169,228.220	
	AMERCO	929	550.240	511,172.960	
	ANALOG DEVICES	34,575	167.340	5,785,780.500	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,674	181.990	3,762,461.260		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	67,283	66.980	4,506,615.340		
VALERO ENERGY CORP	37,400	81.940	3,064,556.000		

ANSYS INC	8,258	335.730	2,772,458.340	
APPLE INC	1,558,371	126.110	196,526,166.810	
APPLIED MATERIALS INC	85,120	137.160	11,675,059.200	
ALBEMARLE CORP	10,736	167.780	1,801,286.080	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,757	67.230	3,546,853.110	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,236	88.120	990,116.320	
AMEREN CORP	22,273	85.850	1,912,137.050	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	121.190	806,034.690	
AUTOLIV INC	7,570	104.050	787,658.500	
AUTODESK INC	20,519	277.500	5,694,022.500	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	39,834	200.060	7,969,190.040	
AUTOZONE INC	2,054	1,374.530	2,823,284.620	
AVERY DENNISON CORP	7,627	217.090	1,655,745.430	
BALL CORP	30,947	80.460	2,489,995.620	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	127,061	284.910	36,200,949.510	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	76,146	49.870	3,797,401.020	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,518	84.090	3,995,788.620	
BECTON DICKINSON & CO	27,192	245.410	6,673,188.720	
AMETEK INC	21,813	136.350	2,974,202.550	
VERIZON COMM INC	383,857	57.340	22,010,360.380	
WR BERKLEY CORP	12,511	75.350	942,703.850	
BEST BUY CO INC	21,291	112.540	2,396,089.140	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,002	602.970	1,207,145.940	
YUM! BRANDS INC	27,273	118.710	3,237,577.830	
FIRSTENERGY CORP	47,800	38.630	1,846,514.000	
BOEING CO	51,487	248.340	12,786,281.580	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	91.230	1,025,242.740	
BORGWARNER INC	21,938	52.250	1,146,260.500	
BOSTON BEER COMPANY INC- CL A	860	1,028.490	884,501.400	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	132,377	42.840	5,671,030.680	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	99.170	1,162,173.230	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,777	184.970	1,993,421.690	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,130	1,300.390	2,769,830.700	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	208,287	67.390	14,036,460.930	
ONEOK INC	39,284	54.780	2,151,977.520	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	124.100	923,800.400	
UNITED RENTALS INC	6,451	303.320	1,956,717.320	
SEMPRA ENERGY	28,827	139.690	4,026,843.630	

FEDEX CORP	23,453	292.840	6,867,976.520	
VERISIGN INC	9,090	220.970	2,008,617.300	
AMPHENOL CORP	56,395	68.270	3,850,086.650	
BROWN-FORMAN CORP	28,552	75.540	2,156,818.080	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.690	649,839.840	
CSX CORP	70,793	96.670	6,843,559.310	
CAMPBELL SOUP CO	16,623	45.720	760,003.560	
CONSTELLATION BRANDS INC	15,878	237.170	3,765,785.260	
CARDINAL HEALTH INC	25,949	60.010	1,557,199.490	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	75,800	29.830	2,261,114.000	
CATERPILLAR INC	50,694	225.730	11,443,156.620	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	120.250	1,186,266.250	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	118.650	1,375,034.850	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	80,424	15.070	1,211,989.680	
CERNER CORP	27,258	81.080	2,210,078.640	
JPMORGAN CHASE & CO	283,274	160.400	45,437,149.600	
CHURCH & DWIGHT CO INC	21,977	84.730	1,862,111.210	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	121.550	1,770,618.850	
CINTAS CORP	8,689	351.110	3,050,794.790	
CISCO SYSTEMS INC	392,063	55.030	21,575,226.890	
CLOROX COMPANY	11,142	176.320	1,964,557.440	
COCA-COLA CO/THE	379,685	55.910	21,228,188.350	
COPART INC	20,203	123.930	2,503,757.790	
COGNEX CORP	16,685	79.700	1,329,794.500	
COLGATE-PALMOLIVE CO	74,700	83.600	6,244,920.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL - CL A	26,524	143.970	3,818,660.280	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	250.840	1,305,120.520	
NRG ENERGY, INC.	21,039	36.430	766,450.770	
COMCAST CORP-CL A	424,761	56.600	24,041,472.600	
CONAGRA BRANDS INC	43,383	37.170	1,612,546.110	
CONSOLIDATED EDISON INC	32,567	77.040	2,508,961.680	
CMS ENERGY CORP	25,936	60.240	1,562,384.640	
COOPER COS INC	4,682	374.120	1,751,629.840	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	60.720	1,002,669.360	
CORNING INC	69,986	43.040	3,012,197.440	
SEALED AIR CORP	13,870	58.020	804,737.400	
HEICO CORP-CL A	7,477	133.850	1,000,796.450	
CUMMINS INC	13,999	252.240	3,531,107.760	
DR HORTON INC	33,099	87.840	2,907,416.160	
DANAHER CORP	59,569	246.260	14,669,461.940	
MOODY'S CORP	15,692	339.960	5,334,652.320	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	48,360	71.170	3,441,781.200	
TARGET CORP	46,626	231.660	10,801,379.160	
DEERE & CO	27,714	341.440	9,462,668.160	

MORGAN STANLEY	131,119	91.680	12,020,989.920	
REPUBLIC SERVICES INC	21,249	109.100	2,318,265.900	
COSTAR GROUP INC	3,715	856.890	3,183,346.350	
THE WALT DISNEY CO	168,757	176.570	29,797,423.490	
DOLLAR TREE INC	21,528	99.700	2,146,341.600	
DOVER CORP	13,837	150.290	2,079,562.730	
OMNICOM GROUP	21,323	82.950	1,768,742.850	
DTE ENERGY CO	18,373	138.160	2,538,413.680	
DUKE ENERGY CORP	71,333	101.710	7,255,279.430	
DARDEN RESTAURANTS INC	11,636	136.900	1,592,968.400	
EBAY INC	61,614	66.750	4,112,734.500	
BANK OF AMERICA CORP	721,445	41.690	30,077,042.050	
CITIGROUP INC	193,389	76.890	14,869,680.210	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,081	124.970	1,634,732.570	
EATON CORP PLC	37,269	146.820	5,471,834.580	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,386	128.510	3,390,864.860	
DISH NETWORK CORP	21,420	40.060	858,085.200	
ECOLAB INC	23,238	213.560	4,962,707.280	
PERKINELMER INC	9,755	146.110	1,425,303.050	
ELECTRONIC ARTS INC	26,968	145.660	3,928,158.880	
SALESFORCE.COM INC	85,282	240.190	20,483,883.580	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	189.830	425,788.690	
EMERSON ELECTRIC CO	56,135	97.590	5,478,214.650	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	101.220	1,164,333.660	
ENTERGY CORP	19,089	108.660	2,074,210.740	
EOG RESOURCES INC	55,339	86.170	4,768,561.630	
EQUIFAX INC	11,135	229.010	2,550,026.350	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	21,346	298.280	6,367,084.880	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	15,999	125.440	2,006,914.560	
EXXON MOBIL CORP	393,854	62.750	24,714,338.500	
FMC CORP	11,416	118.610	1,354,051.760	
NEXTERA ENERGY INC	181,597	73.510	13,349,195.470	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,246	324.440	1,053,132.240	
FAIR ISAAC CORP	2,810	496.420	1,394,940.200	
ASSURANT INC	5,523	162.080	895,167.840	
FASTENAL CO	54,270	52.680	2,858,943.600	
FIFTH THIRD BANCORP	68,183	40.400	2,754,593.200	
M&T BANK CORP	12,653	153.890	1,947,170.170	
FISERV INC	56,229	109.490	6,156,513.210	
FORD MOTOR CO	366,733	15.110	5,541,335.630	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	34.440	920,030.160	
FREEPORT-MCMORAN INC	136,911	40.140	5,495,607.540	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	144.330	2,586,682.260	
DENTSPLY SIRONA INC	19,366	66.070	1,279,511.620	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,069	191.480	4,225,772.120	
GENERAL MILLS INC	58,257	62.570	3,645,140.490	
GENUINE PARTS CO	12,867	127.710	1,643,244.570	
GILEAD SCIENCES INC	117,093	69.290	8,113,373.970	

GARTNER INC	7,895	230.980	1,823,587.100	
MCKESSON CORP	14,289	195.510	2,793,642.390	
NVIDIA CORP	57,498	697.000	40,076,106.000	
GENERAL ELECTRIC CO	815,986	13.630	11,121,889.180	
WW GRAINGER INC	4,182	459.550	1,921,838.100	
HALLIBURTON CO	84,523	23.910	2,020,944.930	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,030	93.770	3,472,303.100	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,139	373.940	12,018,057.660	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,744	219.580	4,335,387.520	
HASBRO INC	11,383	96.220	1,095,272.260	
HENRY SCHEIN INC	12,161	78.580	955,611.380	
HEICO CORP	3,623	145.040	525,479.920	
HERSHEY FOODS CORP	13,964	174.380	2,435,042.320	
HP INC	113,061	29.970	3,388,438.170	
F5 NETWORKS INC	5,529	194.290	1,074,229.410	
CROWN HOLDINGS INC NPR	11,874	100.340	1,191,437.160	
JUNIPER NETWORKS INC	27,939	28.930	808,275.270	
HOLOGIC INC	24,690	62.300	1,538,187.000	
HOME DEPOT INC	100,005	308.310	30,832,541.550	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16,288	83.670	1,362,816.960	
HORMEL FOODS CORP	26,254	48.670	1,277,782.180	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	25.950	1,273,236.750	
LENNOX INTERNATIONAL INC	2,913	338.390	985,730.070	
HUMANA INC	12,034	420.960	5,065,832.640	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	164.200	1,238,724.800	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	135,857	14.500	1,969,926.500	
BIOGEN INC	14,278	414.710	5,921,229.380	
IDEX CORP	7,369	220.010	1,621,253.690	
ILLINOIS TOOL WORKS	29,465	232.680	6,855,916.200	
INTUIT INC	25,432	471.330	11,986,864.560	
IDEXX LABORATORIES INC	8,039	580.530	4,666,880.670	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	22,329	183.690	4,101,614.010	
INTEL CORP	377,363	57.380	21,653,088.940	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	22,578	147.750	3,335,899.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,936	62.830	2,257,858.880	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	33.560	1,185,238.520	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,541	141.260	1,630,281.660	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	163.130	1,121,355.620	
INCYTE CORP	18,028	87.530	1,577,990.840	
JOHNSON & JOHNSON	243,911	167.080	40,752,649.880	

HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31,886	64.880	2,068,763.680	
KLA CORPORATION	14,434	319.310	4,608,920.540	
DEVON ENERGY CORP	62,146	29.390	1,826,470.940	
KELLOGG CO	25,753	65.300	1,681,670.900	
KEYCORP	92,367	21.760	2,009,905.920	
KIMBERLY-CLARK CORP	31,829	129.650	4,126,629.850	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,158	867.440	12,281,215.520	
KROGER CO	67,295	38.790	2,610,373.050	
LAM RESEARCH CORP	13,268	640.770	8,501,736.360	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,354	421.520	1,835,298.080	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	142.620	1,203,427.560	
AKAMA I TECHNOLOGIES	15,625	119.080	1,860,625.000	
PLUG POWER INC	42,511	31.490	1,338,671.390	
LENNAR CORP	24,511	91.140	2,233,932.540	
ELI LILLY & CO	75,722	233.540	17,684,115.880	
L BRANDS INC	21,742	65.520	1,424,535.840	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	66.970	1,211,487.300	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	66,872	203.200	13,588,390.400	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,630	143.060	4,095,807.800	
LOCKHEED MARTIN CORP	23,377	387.720	9,063,730.440	
LOEWS CORP	22,394	55.920	1,252,272.480	
LOWE'S COS INC	68,048	188.780	12,846,101.440	
DOMINION ENERGY INC	75,079	77.450	5,814,868.550	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,356	42.670	1,551,310.520	
MCCORMICK & CO INC	22,130	88.740	1,963,816.200	
MCDONALD'S CORPORATION	69,267	234.590	16,249,345.530	
S&P GLOBAL INC	22,343	386.730	8,640,708.390	
EVEREST RE GROUP LTD	3,416	254.880	870,670.080	
MARKEL CORPORATION	1,201	1,201.980	1,443,577.980	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	58,367	99.940	5,833,197.980	
MARSH & MCLENNAN COS	47,233	138.490	6,541,298.170	
MASCO CORP	23,151	58.450	1,353,175.950	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,781	350.050	2,023,639.050	
METLIFE INC	70,118	63.890	4,479,839.020	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,532	103.600	2,645,115.200	
MEDTRONIC PLC	124,970	124.740	15,588,757.800	
ACTIVISION BLIZZARD INC	72,222	97.690	7,055,367.180	
CVS HEALTH CORP	122,194	85.500	10,447,587.000	
MERCK & CO. INC.	234,751	76.140	17,873,941.140	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	36,651	37.770	1,384,308.270	

LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	8,588	261.010	2,241,553.880	
MICROSOFT CORP	664,983	257.240	171,060,226.920	
MICRON TECH INC	104,357	79.280	8,273,422.960	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	24,537	153.440	3,764,957.280	
3M CO	53,837	203.130	10,935,909.810	
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,976	190.940	950,117.440	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	4,764	354.780	1,690,171.920	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,003	212.580	3,401,917.740	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	294.030	2,453,974.380	
ILLUMINA INC	13,616	450.670	6,136,322.720	
XCEL ENERGY INC	50,530	69.630	3,518,403.900	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	8,058	100.510	809,909.580	
NETAPP INC	19,804	83.630	1,656,208.520	
NEWELL BRANDS INC	33,317	27.630	920,548.710	
NEWMONT CORP	72,905	71.060	5,180,629.300	
NOVAVAX INC	6,444	204.940	1,320,633.360	
NVR INC	308	4,602.940	1,417,705.520	
NIKE INC-CL B	118,200	130.980	15,481,836.000	
NORDSON CORP	4,644	223.170	1,036,401.480	
NORFOLK SOUTHERN CORP	23,434	270.120	6,329,992.080	
EVERSOURCE ENERGY	32,548	83.120	2,705,389.760	
NISOURCE INC	33,097	25.750	852,247.750	
NORTHERN TRUST CORP	18,957	117.120	2,220,243.840	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,764	372.510	5,499,737.640	
WELLS FARGO & CO	384,099	45.090	17,319,023.910	
NUCOR CORP	28,381	106.310	3,017,184.110	
CHENIERE ENERGY INC	22,775	88.000	2,004,200.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,947	158.740	6,817,406.780	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	86,193	28.330	2,441,847.690	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,119	248.410	2,265,250.790	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,576	527.740	3,470,418.240	
ORACLE CORP	177,719	82.300	14,626,273.700	
PACCAR INC	32,894	91.710	3,016,708.740	
PTC INC	9,801	136.370	1,336,562.370	
EXELON CORP	90,816	46.710	4,242,015.360	
PARKER HANNIFIN CORP	12,149	303.160	3,683,090.840	
PAYCHEX INC	29,778	104.790	3,120,436.620	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,020	612.150	4,297,293.000	
PPL CORPORATION	67,795	29.080	1,971,478.600	
PEPSICO INC	127,848	147.600	18,870,364.800	
PENTAIR PLC	16,339	67.290	1,099,451.310	
PFIZER INC	517,964	40.680	21,070,775.520	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,211	48.010	970,330.110	

CONOCOPHILLIPS	123,976	60.170	7,459,635.920	
PG&E CORP	140,021	10.490	1,468,820.290	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,533	163.130	3,186,418.290	
ALTRIA GROUP INC	173,639	50.140	8,706,259.460	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	39,490	188.750	7,453,737.500	
BROWN & BROWN INC	20,308	51.810	1,052,157.480	
GARMIN LTD	14,305	142.600	2,039,893.000	
PPG INDUSTRIES INC	22,227	177.390	3,942,847.530	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	205.210	688,069.130	
COSTCO WHOLESALE CORP	41,084	383.010	15,735,582.840	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,795	191.730	3,987,025.350	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	128.180	1,528,674.680	
PROCTER & GAMBLE CO	228,289	135.790	30,999,363.310	
PROGRESSIVE CORP	54,685	94.020	5,141,483.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,460	61.630	2,924,959.800	
PULTE GROUP INC	25,385	53.990	1,370,536.150	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,589	191.670	5,287,983.630	
QUALCOMM INC	105,545	134.220	14,166,249.900	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,126	128.860	1,562,556.360	
EXACT SCIENCES CORP	16,027	121.910	1,953,851.570	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	149.490	693,334.620	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,840	532.040	5,235,273.600	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	123.370	752,186.890	
RESMED INC	13,332	220.530	2,940,105.960	
US BANCORP	133,011	58.610	7,795,774.710	
SEAGEN INC	12,602	158.480	1,997,164.960	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	39.010	1,513,939.090	
ROSS STORES INC	33,574	117.970	3,960,724.780	
ROLLINS INC	18,567	33.190	616,238.730	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,805	453.670	4,448,234.350	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,708	281.670	3,016,122.360	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,567	90.630	1,863,987.210	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	91.370	1,178,398.890	
ACCENTURE PLC-CL A	58,712	284.220	16,687,124.640	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	130,959	63.630	8,332,921.170	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11,761	257.500	3,028,457.500	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,554	154.020	3,627,787.080	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	57,816	145.380	8,405,290.080	

BOOKING HOLDINGS INC	3,817	2,324.450	8,872,425.650	
SCHLUMBERGER LTD	132,163	34.940	4,617,775.220	
SCHWAB (CHARLES) CORP	134,479	72.620	9,765,864.980	
POOL CORP	3,925	429.000	1,683,825.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,585	159.260	3,119,107.100	
BUNGE LTD	13,581	87.530	1,188,744.930	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	62.470	665,492.910	
ANTHEM INC	22,815	384.430	8,770,770.450	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	120.940	1,673,325.840	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	64.380	1,611,946.440	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	23,815	277.860	6,617,235.900	
CENTENE CORP	52,847	71.020	3,753,193.940	
SVB FINANCIAL GROUP	4,933	566.470	2,794,396.510	
SMITH (A.O.) CORP	11,351	67.790	769,484.290	
SNAP-ON INC	5,408	240.580	1,301,056.640	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,586	104.920	3,943,523.120	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	195.850	1,219,362.100	
EDISON INTERNATIONAL	35,704	57.490	2,052,622.960	
SOUTHERN CO	97,928	63.880	6,255,640.640	
TRUIST FINANCIAL CORP	125,807	57.830	7,275,418.810	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	57.500	760,150.000	
AT&T INC	662,933	29.180	19,344,384.940	
CHEVRON CORP	178,889	108.410	19,393,356.490	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,115	204.000	3,083,460.000	
STATE STREET CORP	32,482	83.640	2,716,794.480	
STARBUCKS CORP	109,634	112.210	12,302,031.140	
STEEL DYNAMICS INC	20,423	64.360	1,314,424.280	
STRYKER CORP	31,516	256.660	8,088,896.560	
NETFLIX INC	41,162	487.270	20,057,007.740	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	28.670	1,587,973.960	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	46.240	734,614.880	
SYNOPSIS INC	14,414	262.070	3,777,476.980	
SYSCO CORP	46,146	78.930	3,642,303.780	
INTUITIVE SURGICAL INC	10,982	859.140	9,435,075.480	
TELEFLEX INC	4,122	396.400	1,633,960.800	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	11.530	1,219,378.210	
TERADYNE INC	15,807	127.870	2,021,241.090	
TEXAS INSTRUMENTS INC	85,379	188.000	16,051,252.000	
TEXTRON INC	19,486	68.220	1,329,334.920	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	36,589	464.910	17,010,591.990	
GLOBE LIFE INC	10,611	103.550	1,098,769.050	
DAVITA INC	6,497	121.800	791,334.600	

TRACTOR SUPPLY CO	10,462	179.840	1,881,486.080	
BIO-TECHNE CORP	3,634	435.800	1,583,697.200	
TRIMBLE INC	22,159	78.760	1,745,242.840	
TYLER TECHNOLOGIES INC	3,534	424.520	1,500,253.680	
TYSON FOODS INC	25,913	76.940	1,993,746.220	
UGI CORP	19,377	47.580	921,957.660	
UNION PACIFIC CORP	62,039	219.590	13,623,144.010	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	141,233	88.250	12,463,812.250	
UNITEDHEALTH GROUP INC	88,089	401.490	35,366,852.610	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	159.530	1,234,283.610	
VF CORP	31,762	78.550	2,494,905.100	
VIACOMCBS INC	50,493	41.510	2,095,964.430	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,339	216.770	5,275,965.030	
VULCAN MATERIALS CO	12,232	173.100	2,117,359.200	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	66,589	55.310	3,683,037.590	
WALMART INC	144,351	139.880	20,191,817.880	
WASTE MANAGEMENT INC	39,623	139.930	5,544,446.390	
WATERS CORP	5,847	333.770	1,951,553.190	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,128	343.780	2,450,463.840	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	135.680	1,398,318.080	
VAIL RESORTS INC	3,590	319.250	1,146,107.500	
WESTERN DIGITAL CORP	27,103	73.560	1,993,696.680	
WABTEC CORP	16,043	81.230	1,303,172.890	
WHIRLPOOL CORP	5,587	222.650	1,243,945.550	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,115	169.410	2,560,632.150	
WYNN RESORTS LTD	9,809	126.170	1,237,601.530	
NASDAQ INC	11,126	168.360	1,873,173.360	
CME GROUP INC	33,458	212.870	7,122,204.460	
WILLIAMS COS INC	110,870	27.710	3,072,207.700	
LKQ CORP	25,055	49.000	1,227,695.000	
ALLIANT ENERGY CORP	22,453	58.540	1,314,398.620	
WEC ENERGY GROUP INC	29,256	93.130	2,724,611.280	
CARMAX INC	14,684	115.000	1,688,660.000	
XILINX INC	22,599	128.790	2,910,525.210	
TJX COMPANIES INC	112,163	64.770	7,264,797.510	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	4,873	508.630	2,478,553.990	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.940	536,978.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	62.430	1,286,058.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	10,239	163.260	1,671,619.140	
CBRE GROUP INC	31,654	88.020	2,786,185.080	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	28.040	357,005.280	

REGIONS FINANCIAL CORP	85,582	21.290	1,822,040.780	
DOMINO'S PIZZA INC	3,716	448.430	1,666,365.880	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,275	343.400	1,468,035.000	
T-MOBILE US INC	57,799	146.510	8,468,131.490	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,060	55.390	1,831,193.400	
MOSAIC CO/THE	32,592	34.440	1,122,468.480	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,402	432.890	1,472,691.780	
CELANESE CORP	10,141	161.140	1,634,120.740	
DEXCOM INC	8,767	398.980	3,497,857.660	
DISCOVERY INC-A	14,886	30.140	448,664.040	
EXPEDIA GROUP INC	12,635	171.580	2,167,913.300	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18,475	53.740	992,846.500	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,068	257.320	2,848,017.760	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	28.030	953,664.690	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	52,262	111.720	5,838,710.640	
LIVE NATION	15,697	87.010	1,365,795.970	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,668	1,344.690	3,587,632.920	
TRANSDIGM GROUP INC	4,893	660.000	3,229,380.000	
MASTERCARD INC	82,257	364.300	29,966,225.100	
WESTERN UNION CO	35,367	24.770	876,040.590	
OWENS CORNING	9,740	98.980	964,065.200	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	106.680	1,372,544.880	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	17.260	299,461.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,146	161.370	1,798,630.020	
DELTA AIR LINES INC	14,723	46.280	681,380.440	
INSULET CORP	6,122	281.600	1,723,955.200	
DISCOVER FINANCIAL	28,906	122.180	3,531,735.080	
TE CONNECTIVITY LTD	31,111	136.940	4,260,340.340	
MASIMO CORP	4,505	218.630	984,928.150	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,647	329.800	3,841,180.600	
VMWARE INC	7,464	163.490	1,220,289.360	
MERCADOLIBRE INC	4,210	1,373.350	5,781,803.500	
ULTA BEAUTY INC	4,737	332.010	1,572,731.370	
INVESCO LTD	33,443	28.810	963,492.830	
MSCI INC	7,461	476.460	3,554,868.060	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	144,618	97.550	14,107,485.900	
VISA INC	157,270	233.950	36,793,316.500	
KEURIG DR PEPPER INC	64,776	34.940	2,263,273.440	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,257	159.730	2,756,460.610	
DISCOVERY INC-C	30,388	28.340	861,195.920	

MARATHON PETROLEUM CORP	61,181	63.440	3,881,322.640	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	98.700	1,331,068.200	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	185,954	19.000	3,533,126.000	
XYLEM INC	17,428	118.230	2,060,512.440	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	110.390	2,719,568.040	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	220.750	769,093.000	
SPLUNK INC	15,277	120.540	1,841,489.580	
EPAM SYSTEMS INC	5,349	505.630	2,704,614.870	
ZILLOW GROUP INC	4,265	112.540	479,983.100	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	14,814	57.300	848,842.200	
HCA HEALTHCARE INC	25,366	210.100	5,329,396.600	
VERISK ANALYTICS INC	14,768	170.820	2,522,669.760	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5,257	185.940	977,486.580	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,343	271.420	1,993,037.060	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,017	191.930	3,074,142.810	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,918	201.050	5,210,813.900	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	11,667	88.210	1,029,146.070	
LEAR CORP	5,733	190.040	1,089,499.320	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	113.420	1,193,972.340	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	20,243	73.940	1,496,767.420	
DOLLAR GENERAL CORP	23,052	206.450	4,759,085.400	
FORTINET INC	13,050	228.950	2,987,797.500	
HORIZON PHARMA PLC	19,642	93.950	1,845,365.900	
TESLA INC	71,333	610.120	43,521,689.960	
GENERAC HOLDINGS INC	5,632	344.620	1,940,899.840	
ENPHASE ENERGY INC	11,597	143.500	1,664,169.500	
GENERAL MOTORS CO	121,301	61.340	7,440,603.340	
XPO LOGISTICS INC	7,614	145.540	1,108,141.560	
ALLY FINANCIAL INC	34,962	53.970	1,886,899.140	
VOYA FINANCIAL INC	10,611	63.940	678,467.340	
APTIV PLC	25,515	155.540	3,968,603.100	
PHILLIPS 66	41,488	91.640	3,801,960.320	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	109.460	785,047.120	
FACEBOOK INC	223,360	332.460	74,258,265.600	
IQVIA HOLDINGS INC	17,929	242.800	4,353,161.200	
SERVICENOW INC	18,317	489.130	8,959,394.210	
PALO ALTO NETWORKS INC	8,870	362.450	3,214,931.500	
WORKDAY INC	16,912	229.070	3,874,031.840	
ABBVIE INC	164,008	116.240	19,064,289.920	
ZOETIS INC	44,185	182.100	8,046,088.500	

NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	26.460	1,015,323.120	
CDW CORP	13,668	167.410	2,288,159.880	
HOWMET AEROSPACE INC	34,315	35.010	1,201,368.150	
TWILIO INC	15,096	324.100	4,892,613.600	
COUPA SOFTWARE INC	6,721	223.470	1,501,941.870	
SNAP INC	87,965	62.630	5,509,247.950	
TRADE DESK INC A	4,058	590.270	2,395,315.660	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	45.260	839,889.820	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	45.590	379,491.160	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	45.470	645,901.350	
OKTA INC	11,656	222.120	2,589,030.720	
BLACK KNIGHT INC	13,669	74.560	1,019,160.640	
BAKER HUGHES CO	67,871	25.510	1,731,389.210	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	82.070	1,081,764.670	
ALTICE USA INC-A	21,506	35.400	761,312.400	
BROADCOM INC	37,923	468.670	17,773,372.410	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,215	268.000	1,933,620.000	
MONGODB INC	5,041	329.520	1,661,110.320	
BURLINGTON STORES INC	5,894	303.860	1,790,950.840	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	33.590	1,358,681.910	
VEEVA SYSTEMS INC	12,865	294.980	3,794,917.700	
TWITTER INC	75,008	60.300	4,522,982.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	59.840	956,542.400	
EVERGY INC	22,104	64.010	1,414,877.040	
ALLEGION PLC	8,924	138.660	1,237,401.840	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	11,454	87.710	1,004,630.340	
STERIS PLC	9,656	198.230	1,914,108.880	
DOCUSIGN INC	16,984	243.080	4,128,470.720	
WIX.COM LTD	4,918	271.870	1,337,056.660	
DROPBOX INC	28,170	29.750	838,057.500	
KKR & CO INC	47,754	56.020	2,675,179.080	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	144.120	685,722.960	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	19,118	346.500	6,624,387.000	
MODERNA INC	29,560	217.000	6,414,520.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,893	126.590	3,404,384.870	
ARAMARK	20,857	37.510	782,346.070	
CIGNA CORP	32,870	239.650	7,877,295.500	
DELL TECHNOLOGIES INC	24,036	103.790	2,494,696.440	
DOW INC	69,681	67.990	4,737,611.190	
AMCOR PLC	138,490	12.070	1,671,574.300	
PINTEREST INC	48,234	68.250	3,291,970.500	
PELOTON INTERACTIVE INC	22,820	106.080	2,420,745.600	
FOX CORP-A	31,751	37.470	1,189,709.970	
FOX CORP-B	13,009	35.860	466,502.740	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	26.010	822,358.170	

CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	16,160	228.600	3,694,176.000	
CHEWY INC	6,586	79.350	522,599.100	
AVANTOR INC	49,965	33.470	1,672,328.550	
LYFT INC	23,625	55.660	1,314,967.500	
DYNATRACE INC	15,949	54.470	868,742.030	
CLOUDFLARE INC	20,681	93.470	1,933,053.070	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	82.360	814,210.960	
CARRIER GLOBAL CORP	77,461	45.860	3,552,361.460	
OTIS WORLDWIDE CORP	38,820	80.420	3,121,904.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	112,201	49.550	5,559,559.550	
CORTEVA INC	70,517	44.560	3,142,237.520	
MATCH GROUP INC	23,105	141.880	3,278,137.400	
SLACK TECHNOLOGIES INC	43,514	44.460	1,934,632.440	
BLACKSTONE GROUP INC	63,860	93.660	5,981,127.600	
CARLYLE GROUP INC	16,487	44.010	725,592.870	
10X GENOMICS INC	6,780	191.160	1,296,064.800	
DATADOG INC	16,727	94.500	1,580,701.500	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	19,641	97.460	1,914,211.860	
INGERSOLL RAND INC	35,181	47.360	1,666,172.160	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,913	335.410	1,647,869.330	
PPD INC	10,828	46.520	503,718.560	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	100.810	541,047.270	
AON PLC	21,016	249.440	5,242,231.040	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	63.690	1,019,167.380	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	151.370	1,069,277.680	
AIRBNB INC	4,882	146.120	713,357.840	
ZENDESK INC	10,590	136.600	1,446,594.000	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	46.630	786,228.430	
VIATRIS INC	116,960	15.790	1,846,798.400	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,899	111.400	2,105,348.600	
DRAFTKINGS INC	14,671	53.650	787,099.150	
SNOWFLAKE INC	2,127	248.800	529,197.600	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	57.670	527,334.480	
ARISTA NETWORKS INC	5,042	369.160	1,861,304.720	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	48,435	24.140	1,169,220.900	
IHS MARKIT LTD	35,312	107.290	3,788,624.480	
FNF GROUP	24,567	47.050	1,155,877.350	
MARVELL TECHNOLOGY INC	72,625	51.800	3,761,975.000	
CATALENT INC	16,458	108.870	1,791,782.460	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,993	48.990	2,645,117.070	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	37,788	47.250	1,785,483.000	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	136.590	472,191.630	
WAYFAIR INC	6,651	328.150	2,182,525.650	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,862	148.940	2,660,366.280	

	HUBSPOT INC	4,048	502.430	2,033,836.640	
	QORVO INC	10,168	182.910	1,859,828.880	
	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	157.430	381,767.750	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,950	161.100	2,408,445.000	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	4,257	239.690	1,020,360.330	
	GODADDY INC	16,574	81.670	1,353,598.580	
	ETSY INC	12,049	167.150	2,013,990.350	
	TRANSUNION	16,760	106.630	1,787,118.800	
	SQUARE INC	36,396	217.140	7,903,027.440	
	DUPONT DE NEMOURS INC	50,291	82.810	4,164,597.710	
	CARVANA CO	6,428	266.670	1,714,154.760	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	18,296	61.340	1,122,276.640	
	TELADOC HEALTH INC	12,418	154.290	1,915,973.220	
	WESTROCK CO	22,778	56.150	1,278,984.700	
	KRAFT HEINZ CO	60,603	42.950	2,602,898.850	
	NOVOCURE LTD	8,475	217.480	1,843,143.000	
	FORTIVE CORP	30,123	70.470	2,122,767.810	
	WASTE CONNECTIONS INC	24,861	120.730	3,001,468.530	
	ALPHABET INC-CL A	27,929	2,435.130	68,010,745.770	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,591	15.630	1,962,987.330	
	PAYPAL HOLDINGS INC	103,429	269.470	27,871,012.630	
	SEA LTD ADR	1,322	271.120	358,420.640	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	30.320	1,069,598.640	
	SUNRUN INC	16,213	45.040	730,233.520	
	ZILLOW GROUP INC-C	15,665	109.130	1,709,521.450	
	ALPHABET INC-CL C	27,360	2,521.600	68,990,976.000	
	ZSCALER INC	7,764	204.910	1,590,921.240	
	CABLE ONE INC	542	1,778.280	963,827.760	
	LINDE PLC	48,578	290.330	14,103,650.740	
	ATHENE HOLDING LTD	13,416	62.560	839,304.960	
	ROKU INC	10,251	347.810	3,565,400.310	
	AVALARA INC	8,515	135.500	1,153,782.500	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,607	682.910	8,609,446.370	
	VISTRA CORP	38,032	18.170	691,041.440	
アメリカ・ドル	小計	29,269,344		3,469,490,292.320 (379,770,407,396)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	14.970	527,857.170	
	ASHTREAD GROUP	42,475	50.680	2,152,633.000	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	24.840	544,815.720	
	BHP GROUP PLC	197,559	21.340	4,215,909.060	
	BARCLAYS PLC	1,639,400	1.790	2,934,526.000	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	7.286	713,641.840	

BT GROUP PLC	795,507	1.951	1,552,034.150	
BUNZL PLC	28,834	22.580	651,071.720	
AVIVA PLC	380,790	4.124	1,570,377.960	
CRODA INTERNATIONAL	12,568	69.700	875,989.600	
DIAGEO PLC	217,896	34.570	7,532,664.720	
SCHRODERS PLC	11,354	35.340	401,250.360	
DCC PLC	7,898	60.300	476,249.400	
NATIONAL GRID PLC	332,836	9.140	3,042,121.040	
KINGFISHER PLC	211,460	3.390	716,849.400	
BAE SYSTEMS PLC	297,008	5.350	1,588,992.800	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	200,509	28.165	5,647,335.980	
HALMA PLC	33,758	26.800	904,714.400	
NEXT PLC	13,140	80.000	1,051,200.000	
IMPERIAL BRANDS PLC	91,182	16.250	1,481,707.500	
JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	31.540	602,634.780	
ANGLO AMERICAN PLC	117,948	30.995	3,655,798.260	
COMPASS GROUP PLC	169,036	15.945	2,695,279.020	
HSBC HOLDINGS PLC	1,896,264	4.361	8,269,607.300	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	572,590	2.735	1,566,033.650	
UNILEVER PLC	244,295	42.805	10,457,047.470	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	1.748	402,410.570	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.100	683,911.400	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	23.290	725,856.140	
PEARSON PLC	65,009	8.514	553,486.620	
PERSIMMON PLC	28,126	30.580	860,093.080	
PRUDENTIAL PLC	236,500	14.730	3,483,645.000	
RIO TINTO PLC	104,789	60.330	6,321,920.370	
VODAFONE GROUP PLC	2,521,502	1.298	3,272,909.590	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	66,793	64.900	4,334,865.700	
RELX PLC	181,197	18.860	3,417,375.420	
RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	4.809	816,404.690	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	746,540	1.110	828,659.400	
NATWEST GROUP PLC	423,054	2.033	860,068.780	
ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	14.265	710,240.080	
SSE PLC	99,877	15.465	1,544,597.800	
BP PLC	1,901,602	3.233	6,147,879.260	
SAGE GROUP PLC(THE)	110,105	6.570	723,389.850	
SMITHS GROUP PLC	35,235	15.840	558,122.400	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	130.300	856,592.200	
STANDARD CHARTERED PLC	240,093	4.975	1,194,462.670	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,677,834	0.482	3,218,715.980	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.634	566,661.390	

TESCO PLC	746,432	2.280	1,701,864.960		
3I GROUP PLC	87,095	12.195	1,062,123.520		
SMITH & NEPHEW PLC	84,627	15.425	1,305,371.470		
GLAXOSMITHKLINE PLC	470,791	13.966	6,575,067.100		
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	29,483	75.680	2,231,273.440		
WPP PLC	109,394	9.822	1,074,467.860		
ASTRAZENECA PLC	122,171	82.820	10,118,202.220		
WHITBREAD PLC	18,594	32.820	610,255.080		
INTERTEK GROUP PLC	13,842	52.980	733,349.160		
BURBERRY GROUP PLC	38,764	22.010	853,195.640		
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	50.900	847,586.800		
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.543	465,018.060		
ADMIRAL GROUP PLC	15,893	30.470	484,259.710		
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,434	45.640	521,847.760		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	382,682	14.098	5,395,050.830		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	343,666	13.462	4,626,431.690		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	24.450	440,931.300		
AVEVA GROUP PLC	10,408	34.800	362,198.400		
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	206,313	2.786	574,788.010		
EXPERIAN PLC	83,789	26.810	2,246,383.090		
MONDI PLC	47,464	19.170	909,884.880		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	16.200	572,054.400		
OCADO GROUP PLC	42,789	18.990	812,563.110		
INFORMA PLC	151,566	5.578	845,435.140		
GLENCORE PLC	908,462	3.199	2,906,169.930		
ENTAIN PLC	49,618	17.650	875,757.700		
EVRAZ PLC	48,765	6.232	303,903.480		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.916	328,615.700		
COCA-COLA HBC AG	20,233	26.530	536,781.490		
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	53,472	7.144	382,003.960		
FERGUSON PLC	20,531	95.760	1,966,048.560		
M&G PLC	259,117	2.420	627,063.140		
JD SPORTS FASHION PLC	47,098	9.064	426,896.270		
THUNGELA RESOURCES LTD	11,794	1.260	14,860.440		
AUTO TRADER GROUP PLC	81,805	6.156	503,591.580		
MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.639	696,042.320		
イギリス・ボンド 小計	27,337,147		162,847,948.890 (25,264,230,791)		
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	26.910	2,754,480.690	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	25.300	3,306,785.900	

	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	424.000	746,240.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	16.140	1,648,442.760	
	ICL GROUP LTD	68,048	23.660	1,610,015.680	
	NICE LTD	5,535	737.500	4,082,062.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	101.200	1,056,932.800	
	AZRIELI GROUP	4,414	244.200	1,077,898.800	
イスラエル・シュケル 小計		425,397		16,282,859.130 (549,323,420)	
オーストラリア ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	63.220	1,065,509.880	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	267,571	28.690	7,676,611.990	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	344,560	26.590	9,161,850.400	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	158,803	22.830	3,625,472.490	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.570	1,300,940.130	
	ASX LTD	19,940	74.500	1,485,530.000	
	BHP GROUP LTD	274,735	48.300	13,269,700.500	
	AMPOL LTD	20,946	29.650	621,048.900	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	16.260	839,081.040	
	CSL LIMITED	42,426	295.210	12,524,579.460	
	REA GROUP LTD	4,278	167.700	717,420.600	
	TRANSURBAN GROUP	261,689	14.450	3,781,406.050	
	COCHLEAR LTD	5,743	234.650	1,347,594.950	
	ORIGIN ENERGY LTD	196,680	4.860	955,864.800	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	165,421	101.850	16,848,128.850	
	RIO TINTO LIMITED	33,859	124.920	4,229,666.280	
	APA GROUP	118,205	9.360	1,106,398.800	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	40.920	2,116,259.640	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	5.230	1,177,691.400	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,410	44.400	1,749,804.000	
	ORICA LTD	41,311	14.160	584,963.760	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	12.720	790,115.520	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	22.120	1,034,707.240	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	6.050	702,138.800	
	MACQUARIE GROUP LTD	32,731	152.510	4,991,804.810	
	SUNCORP GROUP LTD	118,236	11.290	1,334,884.440	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	311,116	26.620	8,281,907.920		
NEWCREST MINING LTD	73,202	27.490	2,012,322.980		
OIL SEARCH LTD	148,835	4.070	605,758.450		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	4.770	297,085.140		
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	11.470	1,649,638.340		

	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	11.010	1,028,378.040	
	REECE LTD	30,319	22.470	681,267.930	
	SANTOS LTD	159,618	7.600	1,213,096.800	
	SONIC HEALTHCARE	40,148	35.830	1,438,502.840	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	31.410	264,032.460	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.060	1,085,860.820	
	WESFARMERS LTD	107,472	54.610	5,869,045.920	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	23.410	2,017,848.360	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	119,574	42.960	5,136,899.040	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	49.860	775,472.580	
	SEEK LTD	28,713	31.050	891,538.650	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	114.050	694,108.300	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.810	298,769.460	
	AGL ENERGY LTD	49,076	9.300	456,406.800	
	BRAMBLES LTD	127,166	11.200	1,424,259.200	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	12.400	407,476.400	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.940	696,362.160	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.840	576,576.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	11.940	688,543.980	
	XERO LTD	12,462	133.110	1,658,816.820	
	AFTERPAY LTD	20,778	99.850	2,074,683.300	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.110	880,608.940	
	SOUTH32 LTD(AUD)	412,345	2.980	1,228,788.100	
	COLES GROUP LTD	121,032	16.690	2,020,024.080	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	30.690	417,506.760	
	オーストラリア・ドル 小計	6,316,925		141,810,761.300 (12,029,806,881)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,375	87.600	1,872,450.000	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	77,535	44.940	3,484,422.900	
	BARRICK GOLD CORP	169,906	28.670	4,871,205.020	
	ATCO LTD	7,193	45.340	326,130.620	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	21.640	460,326.080	
	BANK OF MONTREAL	60,339	126.950	7,660,036.050	
	BANK OF NOVA SCOTIA	112,706	80.830	9,110,025.980	
	NATIONAL BANK OF CANADA	31,010	91.560	2,839,275.600	
	BCE INC	7,275	61.390	446,612.250	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	119,609	60.330	7,216,010.970	
	BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	38.110	1,074,397.120	
	SAPUTO INC	25,395	36.480	926,409.600	
	BLACKBERRY LTD	46,671	16.810	784,539.510	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,605	19.270	1,090,778.350	
CGI INC	19,859	109.690	2,178,333.710	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	67.880	1,042,501.040	
CAE INC	25,006	38.540	963,731.240	
CAMECO CORP	32,627	26.170	853,848.590	
ROGERS COMM-CL B	31,543	62.350	1,966,706.050	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,847	144.180	6,033,500.460	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	110,821	44.720	4,955,915.120	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	201.920	1,189,106.880	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,291	35.810	583,380.710	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,074	133.310	8,808,324.940	
YAMANA GOLD INC	84,317	6.310	532,040.270	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	42.960	894,212.400	
OPEN TEXT CORP	24,883	60.000	1,492,980.000	
EMPIRE CO LTD	15,093	41.880	632,094.840	
KINROSS GOLD CORP	118,575	9.650	1,144,248.750	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	69.730	694,719.990	
FORTIS INC	44,292	56.330	2,494,968.360	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	28.550	1,624,894.700	
TELUS CORP	31,890	27.420	874,423.800	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	36.490	921,372.500	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	41.780	900,024.760	
ENBRIDGE INC	189,269	48.060	9,096,268.140	
IGM FINANCIAL INC	6,069	44.340	269,099.460	
MANULIFE FINANCIAL CORP	182,556	24.640	4,498,179.840	
LOBLAW CO LTD	15,136	76.100	1,151,849.600	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,820	118.790	3,067,157.800	
SUN LIFE FINANCIAL INC	54,375	63.970	3,478,368.750	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	559.600	1,341,920.800	
METRO INC	25,305	58.650	1,484,138.250	
EMERA INC	22,433	57.230	1,283,840.590	
ONEX CORP	6,646	86.040	571,821.840	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	39.080	733,375.280	
POWER CORP OF CANADA	50,405	39.500	1,990,997.500	
QUEBECOR INC-B	16,042	32.330	518,637.860	
ROYAL BANK OF CANADA	131,691	124.700	16,421,867.700	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	62,219	96.790	6,022,177.010	
SHAW COMM INC-B	47,913	36.180	1,733,492.340	
SUNCOR ENERGY INC	143,571	30.160	4,330,101.360	
LUNDIN MINING CORP	64,310	13.010	836,673.100	
TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	28.340	1,162,393.440	
THOMSON REUTERS CORP	15,049	118.380	1,781,500.620	

TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	108.320	803,409.440	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	168,099	87.080	14,638,060.920	
TC ENERGY CORP	84,983	64.170	5,453,359.110	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	87.060	626,832.000	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	118.580	935,121.880	
INTACT FINANCIAL CORP	12,515	168.730	2,111,655.950	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	44,630	59.160	2,640,310.800	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,912	1,769.810	3,383,876.720	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	17,971	187.310	3,366,148.010	
B2GOLD CORP	101,675	6.060	616,150.500	
KEYERA CORP	23,772	35.160	835,823.520	
PARKLAND CORP	14,497	41.500	601,625.500	
ALTAGAS LTD	23,944	25.130	601,712.720	
PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	39.900	2,011,359.000	
DOLLARAMA INC	26,906	54.370	1,462,879.220	
CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	12.170	1,456,858.530	
NORTHLAND POWER INC	23,490	41.440	973,425.600	
TMX GROUP LTD	5,058	131.680	666,037.440	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	53.070	1,431,350.970	
IVANHOE MINES LTD	61,930	8.720	540,029.600	
INTER PIPELINE LTD	41,863	20.150	843,539.450	
NUTRIEN LTD	52,496	78.130	4,101,512.480	
LIGHTSPEED POS INC	9,164	85.970	787,829.080	
WSP GLOBAL INC	10,194	138.240	1,409,218.560	
IA FINANCIAL CORP INC	8,771	69.060	605,725.260	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	40.140	661,707.900	
NUVEI CORP	4,960	83.230	412,820.800	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	51.650	560,144.250	
AIR CANADA	17,940	28.410	509,675.400	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	82.060	2,065,942.560	
SHOPIFY INC	10,485	1,493.250	15,656,726.250	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	206.100	721,968.300	
CANOPY GROWTH CORP	18,634	31.000	577,654.000	
HYDRO ONE LTD	27,340	30.640	837,697.600	
カナダ・ドル 小計	3,813,752		219,625,999.760 (19,887,134,278)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.870	483,750.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	168,400	29.890	5,033,476.000	
CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.650	278,460.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	10.430	718,627.000	
CAPITALAND LTD	232,915	3.740	871,102.100	
GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.875	633,675.000	

	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.220	704,178.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	297,553	12.390	3,686,681.670	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.330	1,883,623.260	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.120	809,216.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	112,500	26.100	2,936,250.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.460	302,130.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.800	394,800.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.790	868,906.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD- RTS	209,313	0.001	209.310	
	シンガポール・ドル 小計	3,319,453		19,605,084.340 (1,621,732,577)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	232,092	9.594	2,226,690.640	
	LOGITECH INTL-REG	16,174	119.400	1,931,175.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	267,021	113.740	30,370,968.540	
	CIE FINANC RICHEMONT	48,893	114.650	5,605,582.450	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	65,397	340.750	22,284,027.750	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	267.000	1,100,574.000	
	SIKA INHABER	13,317	292.100	3,889,895.700	
	SGS SA-REG	540	2,787.000	1,504,980.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	205,646	83.560	17,183,779.760	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	145.700	620,536.300	
	BARRY CALLEBAUT AG	401	2,060.000	826,060.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.415	387,892.280	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	527.200	1,312,200.800	
	ABB LTD	160,075	30.930	4,951,119.750	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,600	61.560	837,216.000	
	GEBERIT AG	3,524	662.800	2,335,707.200	
	LONZA GROUP AG-REG	6,994	653.400	4,569,879.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	8,725.000	828,875.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	92,300.000	1,015,300.000	
	GIVAUDAN-REG	869	4,230.000	3,675,870.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	13,588	368.200	5,003,101.600	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,699	363.600	981,356.400	
	HOLCIM LTD	49,333	56.280	2,776,461.240	
	TEMENOS GROUP	5,723	142.200	813,810.600	
	SONOVA HOLDING AG	5,268	321.200	1,692,081.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,816	317.100	1,527,153.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	919	1,397.500	1,284,302.500	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	324.800	971,476.800	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	62.800	288,377.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	258.000	429,054.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	454.200	1,403,478.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	82.300	205,750.000	

	VIFOR PHARMA AG	5,256	136.450	717,181.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	841.000	473,483.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	94.050	756,162.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,078	1,370.000	2,846,860.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	20,118	60.180	1,210,701.240	
	SWISS RE LTD	27,789	83.800	2,328,718.200	
	ALCON INC	47,036	62.460	2,937,868.560	
	UBS GROUP AG	333,713	14.550	4,855,524.150	
スイス・フラン	小計	1,607,273		140,961,233.660 (17,253,655,000)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	62,737	510.200	32,008,417.400	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	434.700	15,671,369.700	
	ERICSSON LM-B SHS	274,779	108.660	29,857,486.140	
	LUNDBERGS B	7,382	546.400	4,033,524.800	
	SKF AB-B SHS	34,849	220.200	7,673,749.800	
	SANDVIK AB	103,400	225.100	23,275,340.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144,990	108.300	15,702,417.000	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	242.200	7,666,356.600	
	SWEDBANK AB	79,825	153.000	12,213,225.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	135.100	7,152,869.500	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	93.200	12,976,236.000	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	232.400	5,505,788.400	
	VOLVO AB-B SHS	129,470	224.900	29,117,803.000	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	78.020	12,352,828.580	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	115.350	5,427,794.250	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	340.800	4,134,244.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	323.800	3,692,291.400	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	232.800	4,467,664.800	
	SECURITAS AB-B SHS	35,948	132.600	4,766,704.800	
	INVESTOR AB-B SHS	169,486	194.850	33,024,347.100	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	207.900	14,739,278.400	
	ASSA ABLOY AB-B	94,311	257.800	24,313,375.800	
	TELIA CO AB	269,954	36.685	9,903,262.490	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	299.700	6,222,371.400	
	BOLIDEN AB	23,180	344.300	7,980,874.000	
	ALFA LAVAL AB	28,392	300.300	8,526,117.600	
	KINNEVIK AB-B	21,722	314.300	6,827,224.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	576.800	5,172,165.600	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	407.600	3,672,068.400	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	116.600	3,928,487.200	
	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	88.140	12,141,020.580	
	HEXAGON AB-B SHS	187,573	121.250	22,743,226.250	
	EPIROC AB-A	60,750	182.550	11,089,912.500	
	EPIROC AB-B	38,943	161.600	6,293,188.800	

	ESSITY AB-B	58,695	291.200	17,091,984.000	
	EQT AB	20,934	323.000	6,761,682.000	
	EMBRACER GROUP AB	24,571	249.200	6,123,093.200	
	KINNEVIK AB-B	21,722	174.000	3,779,628.000	
	EVOLUTION AB	15,299	1,572.400	24,056,147.600	
	NORDEA BANK ABP	296,126	93.080	27,563,408.080	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	274.800	4,106,886.000	
	SINCH AB	4,279	1,593.000	6,816,447.000	
スウェーデン・クローナ 小計		3,037,014		510,572,308.570 (6,775,294,535)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	9,728	1,133.000	11,021,824.000	
	A P MOLLER A/S	568	18,420.000	10,462,560.000	
	AP MOLLER MAERSK A	255	17,710.000	4,516,050.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	114.700	7,882,757.500	
	GENMAB A/S	6,269	2,629.000	16,481,201.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	452.800	9,178,708.800	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	3,008.000	2,445,504.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	160,094	515.500	82,528,457.000	
	GN STORE NORD A/S	11,641	520.400	6,057,976.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	92,150	215.800	19,885,970.000	
	COLOPLAST-B	10,734	972.400	10,437,741.600	
	DSV PANALPINA A S	19,457	1,470.000	28,601,790.000	
	DEMANT A/S	10,739	340.200	3,653,407.800	
	TRYG A/S	35,784	143.850	5,147,528.400	
	PANDORA A/S	9,639	823.200	7,934,824.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	558.800	5,216,956.800	
AMBU A/S B	14,156	234.200	3,315,335.200		
ORSTED A/S	17,328	835.400	14,475,811.200		
デンマーク・クローネ 小計		497,687		249,244,404.500 (4,466,459,729)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.690	847,637.940	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	13.180	651,737.820	
	A2 MILK CO LTD	62,165	5.970	371,125.050	
	FISHER & PAYKEL	49,044	29.300	1,436,989.200	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.750	758,209.250	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.480	400,036.320	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.330	661,783.460	
ニュージーランド・ドル 小計		616,403		5,127,519.040 (403,587,024)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	227.800	9,841,415.600	
	DNB ASA	89,294	187.400	16,733,695.600	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	53.240	6,869,876.640	
	TELENOR ASA	63,038	144.300	9,096,383.400	
	SCHIBSTED ASA	7,537	418.200	3,151,973.400	

	ORKLA ASA	65,283	88.740	5,793,213.420	
	EQUINOR ASA	91,961	189.800	17,454,197.800	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	465.500	7,072,341.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	182.250	3,040,476.750	
	ADEVINTA ASA	22,265	162.550	3,619,175.750	
	SCHIBSTED ASA	7,445	362.400	2,698,068.000	
	ノルウェー・クローネ 小計	550,937		85,370,817.860 (1,129,455,920)	
ユーロ	CRH PLC	74,044	43.030	3,186,113.320	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,178	160.500	2,436,069.000	
	KERRY GROUP PLC-A	14,113	108.850	1,536,200.050	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	78.840	1,060,555.680	
	UMICORE	17,654	49.490	873,696.460	
	AIR LIQUIDE	43,860	141.320	6,198,295.200	
	AIRBUS SE	54,819	110.520	6,058,595.880	
	AXA SA	180,491	22.305	4,025,851.750	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,630	25.650	1,298,659.500	
	ADIDAS AG	17,790	291.300	5,182,227.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	17.125	1,670,869.120	
	DASSAULT AVIATION SA	295	1,036.000	305,620.000	
	DANONE	59,226	59.050	3,497,295.300	
	SAFRAN SA	31,890	123.120	3,926,296.800	
	INTESA SANPAOLO	1,552,995	2.439	3,787,754.800	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30,673	92.850	2,847,988.050	
	ACCOR SA	17,380	34.420	598,219.600	
	BOUYGUES	21,417	33.200	711,044.400	
	BNP PARIBAS	104,911	56.090	5,884,457.990	
	THALES SA	10,448	85.960	898,110.080	
	CAPGEMINI SA	15,076	152.750	2,302,859.000	
	UNICREDIT SPA	203,331	10.800	2,195,974.800	
	NATIXIS	70,166	4.000	280,664.000	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,537	151.650	2,507,836.050	
	COMMERZBANK AG	83,118	6.638	551,737.280	
	EIFFAGE	8,477	89.260	756,657.020	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	39,898	45.270	1,806,182.460	
	UNITED INTERNET	9,882	34.370	339,644.340	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	41.640	230,935.440	
	PUBLICIS GROUPE	19,879	55.540	1,104,079.660	
	FAURECIA	10,774	45.430	489,462.820	
	IBERDROLA SA	534,454	10.540	5,633,145.160	
	ENI SPA	238,596	10.514	2,508,598.340	
	JERONIMO MARTINS	19,517	15.820	308,758.940	
	KESKO OYJ-B	24,085	30.170	726,644.450	
	KBC GROUPE	24,033	67.780	1,628,956.740	
	HANNOVER RUECK SE	5,923	141.250	836,623.750	
	WARTSILA OYJ	48,612	11.895	578,239.740	

L'OREAL	23,241	382.000	8,878,062.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	25,787	657.700	16,960,109.900	
GEA GROUP AG	13,284	33.980	451,390.320	
BOLLORE	71,347	4.402	314,069.490	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.898	568,560.910	
MICHELIN(CGDE) -B	16,350	130.350	2,131,222.500	
CONTINENTAL AG	10,336	128.740	1,330,656.640	
DEUTSCHE POST AG-REG	92,637	56.330	5,218,242.210	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	24.480	519,122.880	
OMV AG	12,817	49.950	640,209.150	
VERBUND AG	6,916	73.900	511,092.400	
PERNOD-RICARD	18,956	179.750	3,407,341.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	13,577	96.880	1,315,339.760	
RENAULT SA	19,019	34.470	655,584.930	
REPSOL SA	135,990	11.222	1,526,079.780	
REMY COINTREAU	1,860	170.200	316,572.000	
MERCK KGAA	11,875	155.700	1,848,937.500	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	47,367	56.640	2,682,866.880	
RWE AG	56,755	30.450	1,728,189.750	
SEB SA	2,439	154.300	376,337.700	
SOCIETE GENERALE-A	77,718	26.400	2,051,755.200	
VINCI S.A.	49,669	94.100	4,673,852.900	
SODEXO	9,325	80.080	746,746.000	
SOFINA	1,382	354.400	489,780.800	
SOLVAY SA	7,183	112.950	811,319.850	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	49,940	130.700	6,527,158.000	
VIVENDI SA	65,938	28.930	1,907,586.340	
SAP SE	96,931	116.040	11,247,873.240	
TELEFONICA S.A	504,323	4.098	2,066,715.650	
TOTALENERGIES SE	232,231	39.820	9,247,438.420	
VALEO	19,653	28.000	550,284.000	
E.ON SE	209,405	10.030	2,100,332.150	
VOEST-ALPINE AG	9,875	35.260	348,192.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	79.600	825,133.600	
SIEMENS AG-REG	71,190	135.100	9,617,769.000	
UPM-KYMMENE OYJ	46,882	31.690	1,485,690.580	
ING GROEP NV-CVA	367,322	11.052	4,059,642.740	
PUMA AG	10,448	91.740	958,499.520	
BAYER AG	92,074	53.120	4,890,970.880	
STORA ENSO OYJ-R SHS	51,891	14.560	755,532.960	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,809	92.240	1,458,222.160	
DAIMLER AG	80,089	78.170	6,260,557.130	
BASF SE	86,104	67.180	5,784,466.720	
BEIERSDORF AG	10,342	100.300	1,037,302.600	

HEIDELBERGCEMENT AG	13,238	74.340	984,112.920	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	68.400	1,351,173.600	
ASM INTERNATIONAL NV	4,578	270.200	1,236,975.600	
ORANGE	184,093	10.450	1,923,771.850	
SAMPO OYJ-A SHS	46,965	38.190	1,793,593.350	
RANDSTAD NV	11,017	64.060	705,749.020	
ALLIANZ SE	38,199	218.200	8,335,021.800	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.488	1,205,638.360	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,453	24.670	2,404,165.510	
HERMES INTL	2,960	1,184.000	3,504,640.000	
ENDESA S.A.	27,736	21.700	601,871.200	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	10.634	297,645.660	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	33.800	818,095.200	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,138	231.700	3,044,074.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,239	26.705	1,795,617.490	
DASSAULT SYSTEMES SA	12,064	188.950	2,279,492.800	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	25.010	543,567.340	
HEINEKEN NV	24,566	98.020	2,407,959.320	
AKZO NOBEL	16,929	105.350	1,783,470.150	
ASML HOLDING NV	38,957	571.200	22,252,238.400	
AEGON NV	150,349	3.737	561,854.210	
VOLKSWAGEN AG	2,758	294.000	810,852.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,670	230.050	4,064,983.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	610,214	5.273	3,217,658.420	
KERING	6,992	739.200	5,168,486.400	
CNP ASSURANCES	13,987	14.585	204,000.390	
FORTUM OYJ	39,409	23.710	934,387.390	
AGEAS	17,055	48.370	824,950.350	
UCB SA	10,571	82.120	868,090.520	
NEMETSCHEK SE	5,095	59.760	304,477.200	
CARREFOUR SA	53,060	17.185	911,836.100	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	21.780	514,269.360	
ATOS SE	8,972	53.780	482,514.160	
NOKIA OYJ	510,419	4.501	2,297,395.910	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	83,400	46.625	3,888,525.000	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,053	80.560	2,098,829.680	
SANOFI	105,226	88.210	9,281,985.460	
STMICROELECTRONICS NV	62,523	31.055	1,941,651.760	
ELISA OYJ	13,642	49.920	681,008.640	
BANCO SANTANDER SA	1,623,415	3.446	5,594,288.090	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	16.930	803,379.290	
QIAGEN N.V.	20,763	39.210	814,117.230	
DEUTSCHE BANK AG-REG	188,943	11.896	2,247,665.920	

BMW VORZUG	4,116	79.900	328,868.400	
ENEL SPA	754,833	7.961	6,009,225.510	
COLRUYT NV	4,673	52.020	243,089.460	
VOPAK (KON.)	5,364	39.450	211,609.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	311,165	17.696	5,506,375.840	
SARTORIUS AG	2,441	413.000	1,008,133.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	58.400	448,862.400	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	122,634	33.725	4,135,831.650	
RATIONAL AG	479	707.000	338,653.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	151.900	572,814.900	
BECHTLE AG	2,511	152.450	382,801.950	
KONINKLIJKE KPN NV	288,984	2.686	776,211.020	
EUROFINS SCIENTIFIC	11,330	85.940	973,700.200	
TELEPERFORMANCE	5,626	312.700	1,759,250.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,989	133.550	2,402,430.950	
EURAZEO	3,007	72.100	216,804.700	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	93.700	928,004.800	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	83.100	831,332.400	
INDITEX	102,523	31.080	3,186,414.840	
ESSILORLUXOTTICA	26,761	146.320	3,915,669.520	
SNAM SPA	171,294	4.965	850,474.710	
CREDIT AGRICOLE SA	108,321	12.392	1,342,313.830	
ORPEA	4,932	105.700	521,312.400	
ENAGAS	23,477	19.775	464,257.670	
WENDEL	2,220	115.000	255,300.000	
TENARIS SA	36,959	9.550	352,958.450	
TELECOM ITALIA SPA	1,123,551	0.452	507,845.050	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.492	244,817.230	
ATLANTIA SPA	45,299	15.790	715,271.210	
ILIAD SA	1,046	134.850	141,053.100	
PROXIMUS	13,739	17.315	237,890.780	
TERNA SPA	126,172	6.446	813,304.710	
BIOMERIEUX	3,248	90.860	295,113.280	
GRIFOLS SA	23,518	22.370	526,097.660	
FERROVIAL SA	46,794	24.960	1,167,978.240	
LANXESS AG	6,856	60.760	416,570.560	
NESTE OYJ	39,886	54.900	2,189,741.400	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	20.520	367,533.720	
RECORDATI SPA	10,303	47.370	488,053.110	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	11.140	616,086.560	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	207.200	1,009,685.600	
KONE OYJ	32,102	66.380	2,130,930.760	
ELIA GROUP	2,862	90.150	258,009.300	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,387	369.000	880,803.000	
ENGIE	166,851	12.206	2,036,583.300	
ALSTOM	26,382	45.220	1,192,994.040	

ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	11.670	639,259.260	
IPSEN SA	3,646	92.300	336,525.800	
DEUTSCHE WOHNEN	33,021	51.540	1,701,902.340	
ARKEMA SA	6,393	107.600	687,886.800	
LEGRAND SA	25,357	88.100	2,233,951.700	
AMPLIFON SPA	11,372	39.310	447,033.320	
ADP	2,313	122.800	284,036.400	
ORION OYJ	8,051	37.920	305,293.920	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	9.644	386,608.670	
SYMRISE AG	12,698	110.600	1,404,398.800	
SCOR SE	15,667	26.100	408,908.700	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	44.190	1,070,635.320	
PRYSMIAN SPA	22,328	29.200	651,977.600	
DIASORIN SPA	2,223	145.400	323,224.200	
CAIXABANK	394,299	2.784	1,097,728.410	
BUREAU VERITAS SA	29,810	26.190	780,723.900	
GETLINK	37,646	12.600	474,339.600	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	18.520	518,041.440	
SUEZ SA	34,245	20.070	687,297.150	
AMADEUS IT GROUP SA	41,188	63.660	2,622,028.080	
BRENTAG SE	14,044	76.580	1,075,489.520	
EVONIK INDUSTRIES AG	17,116	28.510	487,977.160	
EDENRED	21,488	47.860	1,028,415.680	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.272	223,530.720	
LEG IMMOBILIEN SE	6,537	120.900	790,323.300	
KION GROUP AG	5,903	89.280	527,019.840	
VONOVIA SE	51,151	53.960	2,760,107.960	
KNORR-BREMSE AG	6,860	102.150	700,749.000	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,805	47.580	1,132,641.900	
FERRARI NV	11,553	173.900	2,009,066.700	
CNH INDUSTRIAL NV	89,378	14.505	1,296,427.890	
AROUNDTOWN SA	83,054	7.058	586,195.130	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	48.510	392,542.920	
MONCLER SPA	17,567	56.800	997,805.600	
NEXI SPA	43,586	17.450	760,575.700	
TEAMVIEWER AG	13,668	30.150	412,090.200	
PROSUS NV	45,840	84.690	3,882,189.600	
TELEFONICA SA-RTS	455,887	0.205	93,456.830	
JDE PEET'S BV	7,308	31.520	230,348.160	
SIEMENS ENERGY AG	35,831	24.730	886,100.630	
INPOST SA	20,395	15.770	321,629.150	
WORLDLINE SA	21,160	76.660	1,622,125.600	
NN GROUP NV	24,900	40.590	1,010,691.000	
FINECOBANK SPA	53,818	13.895	747,801.110	
ARGENX SE	4,403	245.400	1,080,496.200	
ZALANDO SE	15,459	93.180	1,440,469.620	

	STELLANTIS NV	182,809	17.000	3,107,753.000	
	AENA SME SA	7,240	141.250	1,022,650.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	46,542	50.940	2,370,849.480	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,836	76.800	1,293,004.800	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	10.680	365,800.680	
	EXOR NV	9,966	70.420	701,805.720	
	SCOUT24 AG	9,670	66.540	643,441.800	
	COVESTRO AG	19,158	54.240	1,039,129.920	
	HELLOFRESH SE	15,236	82.700	1,260,017.200	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	70,978	64.530	4,580,210.340	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	11.985	668,151.760	
	AMUNDI SA	5,924	73.900	437,783.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	23,344	9.472	221,114.360	
	ADYEN NV	1,855	1,909.600	3,542,308.000	
	UNIPER SE	10,427	30.010	312,914.270	
	DELIVERY HERO SE	14,389	109.900	1,581,351.100	
ユーロ 小計		18,063,630		440,745,230.530 (58,755,746,682)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	19.640	3,220,960.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	15.620	1,622,293.200	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	78.200	12,668,400.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	48.050	2,378,475.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	112,740	467.000	52,649,580.000	
	MTR CORP	126,000	43.300	5,455,800.000	
	HANG SENG BANK LTD	65,700	159.000	10,446,300.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	38.550	4,450,597.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	48.250	7,044,500.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,074,456	12.300	13,215,808.800	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	197,000	62.350	12,282,950.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	28.050	8,905,875.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	42.200	6,881,385.200	
	SINO LAND CO	255,400	12.380	3,161,852.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	123.100	14,833,550.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	57.900	2,866,050.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	130,500	136.600	17,826,300.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	29.950	4,971,700.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.680	1,354,080.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	12.980	1,614,712.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	15.340	3,331,848.000	

AIA GROUP LTD	1,123,627	95.600	107,418,741.200	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.480	4,663,600.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	33.700	8,492,400.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	23.700	2,469,540.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	44.900	6,723,775.000	
ESR CAYMAN LTD	147,400	24.250	3,574,450.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.880	1,812,400.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	25.750	3,877,950.000	
WH GROUP LTD	897,000	7.220	6,476,340.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	242,332	59.900	14,515,686.800	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	52.600	11,826,163.200	
香港・ドル 小計	7,983,513		363,034,062.900 (5,122,410,628)	
合計	102,838,475		533,029,244,861 (533,029,244,861)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年6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	118,215.000	1,294,454.250	
		GOODMAN GROUP	160,839.000	3,330,975.690	
		GPT GROUP	158,232.000	780,083.760	
		MIRVAC GROUP	329,418.000	981,665.640	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,412,077.500	
		STOCKLAND	194,018.000	942,927.480	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	626,333.030	
	オーストラリア・ドル 小計		1,817,683.000	9,368,517.350 (794,731,327)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	869,039.820	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	369,636.000	798,413.760	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	413,445.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	548,303.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,124,642.000	2,629,201.580 (217,487,555)	
投資信託受益証券 合計		2,942,325	1,012,218,882 (1,012,218,882)		
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	857,041.360	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,466.000	2,415,412.160	
		AMERICAN TOWER CORP	41,332.000	11,193,532.240	

	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,213,086.090	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,300.000	2,854,978.000	
	BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,785,016.810	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	8,873.000	1,198,209.920	
	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	40,185.000	8,046,644.400	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	25,285.000	4,145,222.900	
	DUKE REALTY TRUST	35,962.000	1,786,592.160	
	EQUINIX INC	8,346.000	6,868,674.540	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,554.000	1,188,325.600	
	EQUITY RESIDENTIAL	32,922.000	2,660,097.600	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,750.000	1,805,730.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	12,714.000	2,023,560.240	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,851,854.940	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,151,775.520	
	INVITATION HOMES INC	54,837.000	2,081,064.150	
	IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,319,616.000	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,178,494.460	
	MID AMERICA	10,200.000	1,749,606.000	
	OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	754,811.250	
	PROLOGIS INC	68,777.000	8,685,159.560	
	PUBLIC STORAGE	14,381.000	4,249,154.070	
	REALTY INCOME CORP	35,640.000	2,533,291.200	
	REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	986,801.940	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	9,838.000	3,134,878.700	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	30,857.000	4,151,500.780	
	SUN COMMUNITIES INC	9,670.000	1,717,198.600	
	UDR INC	26,674.000	1,338,768.060	
	VENTAS INC	35,060.000	2,022,611.400	
	VEREIT INC	19,960.000	983,429.200	
	VICI PROPERTIES INC	48,258.000	1,584,310.140	
	VORNADO REALTY TRUST	17,313.000	870,497.640	
	WELLTOWER INC	39,394.000	3,117,641.160	
	WEYERHAEUSER CO	69,174.000	2,421,090.000	
	WP CAREY INC	15,529.000	1,204,273.950	
アメリカ・ドル	小計	1,180,185.000	99,129,952.740 (10,850,764,626)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	354,121.960	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	55,843.000	396,261.920	
	SEGRO PLC	116,375.000	1,253,358.750	
イギリス・ポンド	小計	242,037.000	2,003,742.630	

				(310,860,632)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT		8,220.000	467,964.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST		13,467.000	294,523.290	
カナダ・ドル 小計			21,687.000	762,487.890 (69,043,278)	
ユーロ	COVIVIO		4,663.000	379,568.200	
	GECINA SA		4,763.000	642,528.700	
	KLEPIERRE		17,099.000	427,987.970	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		12,920.000	1,041,093.600	
ユーロ 小計			39,445.000	2,491,178.470 (332,099,002)	
香港・ドル	LINK REIT		183,000.000	14,063,550.000	
香港・ドル 小計			183,000.000	14,063,550.000 (198,436,691)	
投資証券 合計			1,666,354	11,761,204,229 (11,761,204,229)	
合計				12,773,423,111 (12,773,423,111)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 600銘柄	68.21	-	-	71.57
	投資証券 37銘柄	-	-	1.95	
イギリス・ポンド	株式 84銘柄	4.54	-	-	4.69
	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 56銘柄	2.16	-	-	2.35
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.14	-	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.57	-	-	3.66
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 15銘柄	0.29	-	-	0.34
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.04	-	
スイス・フラン	株式 40銘柄	3.10	-	-	3.16
スウェーデン・クローナ	株式 42銘柄	1.22	-	-	1.24
デンマーク・クローネ	株式 18銘柄	0.80	-	-	0.82
ニュージーランド・ドル	株式 7銘柄	0.07	-	-	0.07
ノルウェー・クローネ	株式 11銘柄	0.20	-	-	0.21
ユーロ	株式 233銘柄	10.55	-	-	10.83
	投資証券 4銘柄	-	-	0.06	
香港・ドル	株式 32銘柄	0.92	-	-	0.97

	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。

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6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,525,772,760
コール・ローン	2,018,889,628
国債証券	562,762,244,813
派生商品評価勘定	930,734,380
未収入金	405,520
未収利息	1,749,596,396
前払費用	1,003,670,370
流動資産合計	570,991,313,867
資産合計	
570,991,313,867	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	278,963,828
未払金	1,053,421
未払解約金	9,486,000
流動負債合計	289,503,249
負債合計	
289,503,249	
純資産の部	
元本等	
元本	397,546,249,818
剰余金	
剰余金又は欠損金()	173,155,560,800
元本等合計	570,701,810,618
純資産合計	
570,701,810,618	
負債純資産合計	
570,991,313,867	

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12月12日 至 2021年6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6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	352,957,920,687円
同期中追加設定元本額	343,158,082,282円
同期中一部解約元本額	298,569,753,151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>	6,832,556,625円
たわらノーロード バランス(堅実型)	521,030,345円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,287,287,180円
たわらノーロード バランス(積極型)	593,948,066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)	29,644,118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)	939,700,554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)	1,074,437,867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)	367,712,446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)	189,436,025円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,532,504円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	8,474,454円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	36,963,893円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	7,367,905円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,109,070円
投資のソムリエ	209,721,269,420円
投資のソムリエ<DC年金>	11,145,267,997円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,623,250,466円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	68,534,931,432円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,973,015,177円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	9,562,282,979円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	146,131,384円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	70,114,338円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	62,485,089円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	468,309,186円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	29,613,002,313円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,315,726,932円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	109,739,032円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	53,757,770円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	50,943,220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)	19,937,776,056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)	6,547,276,220円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	5,277,272,203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)	624,858,449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)	51,516,049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)	391,169,305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)	789,818,482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)	1,070,305,059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	397,546,249,818円
2. 受益権の総数	397,546,249,818口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月12日 至 2021年6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	2021年6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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年6月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	8,494,246,446	
合計	8,494,246,446	

(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2021年6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	2021年6月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	565,460,529,213	-	564,808,758,661	651,770,552
イギリス・ポンド	249,001,526,811	-	249,153,842,394	152,315,583
イスラエル・シケル	37,373,580,131	-	37,287,447,493	86,132,638
オーストラリア・ドル	2,618,523,283	-	2,623,484,728	4,961,445
カナダ・ドル	12,136,253,626	-	12,159,905,452	23,651,826
シンガポール・ドル	11,674,753,873	-	11,674,392,742	361,131
シンガポール・ドル	2,451,497,937	-	2,448,628,399	2,869,538
スウェーデン・クローナ	2,106,266,244	-	2,118,735,972	12,469,728
デンマーク・クローネ	2,960,831,453	-	2,951,054,082	9,777,371
ノルウェー・クローネ	1,463,280,998	-	1,472,563,827	9,282,829
ポーランド・ズロチ	3,690,829,465	-	3,686,144,934	4,684,531

マレーシア・リングgit	2,557,206,608	-	2,564,295,580	7,088,972
メキシコ・ペソ	4,692,058,974	-	4,751,322,934	59,263,960
ユーロ	232,733,919,810	-	231,916,940,124	816,979,686
合計	565,460,529,213	-	564,808,758,661	651,770,552

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月11日現在
1口当たり純資産額	1.4356円
(1万口当たり純資産額)	(14,356円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年6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 01/15/24	13,000,000.000	12,966,484.310	
		US T N/B 0.125 01/31/23	11,630,000.000	11,629,545.610	
		US T N/B 0.125 02/15/24	16,350,000.000	16,304,654.250	
		US T N/B 0.125 02/28/23	20,510,000.000	20,507,596.420	
		US T N/B 0.125 03/31/23	15,000,000.000	14,997,070.200	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,626,628.940	
		US T N/B 0.125 05/31/22	8,000,000.000	8,004,531.200	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,994,023.370	
		US T N/B 0.125 07/31/22	11,110,000.000	11,116,075.720	
		US T N/B 0.125 08/15/23	8,310,000.000	8,302,858.550	
		US T N/B 0.125 08/31/22	6,920,000.000	6,921,892.130	
		US T N/B 0.125 09/15/23	12,630,000.000	12,615,199.150	
		US T N/B 0.125 10/15/23	13,940,000.000	13,919,307.740	
		US T N/B 0.125 10/31/22	7,910,000.000	7,911,544.900	
US T N/B 0.125 11/30/22	8,450,000.000	8,450,990.170			

US T N/B 0.125 12/15/23	10,000,000.000	9,979,296.800	
US T N/B 0.125 12/31/22	10,000,000.000	10,000,390.600	
US T N/B 0.25 03/15/24	20,260,000.000	20,261,582.710	
US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,147,148.600	
US T N/B 0.25 05/15/24	5,000,000.000	4,995,117.150	
US T N/B 0.25 05/31/25	8,970,000.000	8,876,095.310	
US T N/B 0.25 06/15/23	12,910,000.000	12,936,727.690	
US T N/B 0.25 06/30/25	8,990,000.000	8,887,457.810	
US T N/B 0.25 07/31/25	8,980,000.000	8,868,451.510	
US T N/B 0.25 08/31/25	9,920,000.000	9,785,924.940	
US T N/B 0.25 09/30/25	13,480,000.000	13,284,645.270	
US T N/B 0.25 10/31/25	13,510,000.000	13,298,906.250	
US T N/B 0.25 11/15/23	12,280,000.000	12,295,829.640	
US T N/B 0.375 01/31/26	14,420,000.000	14,229,047.610	
US T N/B 0.375 04/15/24	20,340,000.000	20,401,973.330	
US T N/B 0.375 04/30/25	11,870,000.000	11,815,286.650	
US T N/B 0.375 07/31/27	11,250,000.000	10,839,550.720	
US T N/B 0.375 09/30/27	13,470,000.000	12,936,987.780	
US T N/B 0.375 11/30/25	15,540,000.000	15,366,995.970	
US T N/B 0.375 12/31/25	11,070,000.000	10,935,084.370	
US T N/B 0.5 02/28/26	16,930,000.000	16,789,136.980	
US T N/B 0.5 03/15/23	7,000,000.000	7,045,663.800	
US T N/B 0.5 03/31/25	11,090,000.000	11,101,695.510	
US T N/B 0.5 04/30/27	7,490,000.000	7,307,138.680	
US T N/B 0.5 05/31/27	9,610,000.000	9,358,112.860	
US T N/B 0.5 06/30/27	10,800,000.000	10,503,843.690	
US T N/B 0.5 08/31/27	10,590,000.000	10,266,922.180	
US T N/B 0.5 10/31/27	10,000,000.000	9,663,281.200	
US T N/B 0.625 03/31/27	6,260,000.000	6,161,209.370	
US T N/B 0.625 05/15/30	15,990,000.000	14,958,145.300	
US T N/B 0.625 08/15/30	29,840,000.000	27,814,143.590	
US T N/B 0.625 11/30/27	14,510,000.000	14,118,910.080	
US T N/B 0.625 12/31/27	14,160,000.000	13,758,431.170	
US T N/B 0.75 01/31/28	15,270,000.000	14,937,161.620	
US T N/B 0.75 03/31/26	16,930,000.000	16,973,647.570	
US T N/B 0.75 04/30/26	10,000,000.000	10,019,140.600	
US T N/B 0.875 11/15/30	32,530,000.000	30,942,891.540	
US T N/B 1.125 02/15/31	24,380,000.000	23,668,599.150	
US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	7,982,315.620	
US T N/B 1.125 02/28/27	3,840,000.000	3,890,624.640	
US T N/B 1.125 02/29/28	14,380,000.000	14,406,962.500	
US T N/B 1.125 05/15/40	12,110,000.000	10,319,517.480	
US T N/B 1.125 08/15/40	11,040,000.000	9,372,787.430	
US T N/B 1.25 03/31/28	14,120,000.000	14,244,101.520	
US T N/B 1.25 04/30/28	8,000,000.000	8,064,374.960	
US T N/B 1.25 05/15/50	14,140,000.000	11,320,285.190	
US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,595,562.500	
US T N/B 1.25 08/31/24	8,400,000.000	8,645,109.310	
US T N/B 1.375 01/31/25	7,340,000.000	7,589,158.570	

US T N/B 1.375 02/15/23	7,680,000.000	7,841,699.940	
US T N/B 1.375 06/30/23	8,960,000.000	9,184,699.940	
US T N/B 1.375 08/15/50	14,630,000.000	12,096,038.190	
US T N/B 1.375 08/31/23	7,880,000.000	8,089,928.080	
US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,890,273.430	
US T N/B 1.375 09/30/23	9,820,000.000	10,089,282.750	
US T N/B 1.375 10/15/22	5,500,000.000	5,593,027.330	
US T N/B 1.375 11/15/40	20,540,000.000	18,214,807.690	
US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,175,624.960	
US T N/B 1.5 01/31/27	6,020,000.000	6,228,583.540	
US T N/B 1.5 02/15/30	16,730,000.000	16,925,401.040	
US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,801,867.910	
US T N/B 1.5 03/31/23	7,740,000.000	7,933,500.000	
US T N/B 1.5 08/15/22	4,680,000.000	4,756,781.250	
US T N/B 1.5 08/15/26	11,430,000.000	11,848,802.280	
US T N/B 1.5 09/15/22	8,410,000.000	8,557,175.000	
US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,733,375.000	
US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,300,624.960	
US T N/B 1.5 11/30/24	9,140,000.000	9,482,392.890	
US T N/B 1.625 02/15/26	12,800,000.000	13,366,499.950	
US T N/B 1.625 04/30/23	8,000,000.000	8,225,624.960	
US T N/B 1.625 05/15/26	13,210,000.000	13,790,001.550	
US T N/B 1.625 05/15/31	6,000,000.000	6,091,875.000	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,618,894.510	
US T N/B 1.625 08/15/22	2,920,000.000	2,972,810.910	
US T N/B 1.625 08/15/29	11,760,000.000	12,062,728.020	
US T N/B 1.625 08/31/22	3,930,000.000	4,002,459.370	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,983,991.370	
US T N/B 1.625 10/31/23	9,650,000.000	9,978,703.120	
US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,318,742.160	
US T N/B 1.625 11/15/22	8,330,000.000	8,510,266.360	
US T N/B 1.625 11/15/50	17,120,000.000	15,087,668.700	
US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,536,297.220	
US T N/B 1.625 12/15/22	8,600,000.000	8,795,851.490	
US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,398,239.780	
US T N/B 1.75 05/15/23	10,000,000.000	10,311,718.700	
US T N/B 1.75 05/31/22	2,220,000.000	2,256,205.060	
US T N/B 1.75 06/15/22	3,700,000.000	3,762,582.020	
US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,250,904.640	
US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	7,058,390.590	
US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	2,993,632.000	
US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,358,750.000	
US T N/B 1.75 09/30/22	3,650,000.000	3,728,132.810	
US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	7,141,769.510	
US T N/B 1.75 12/31/24	8,300,000.000	8,688,414.010	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,234,432.000	
US T N/B 1.875 02/15/41	16,620,000.000	16,082,446.870	
US T N/B 1.875 02/15/51	20,240,000.000	18,961,559.220	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	5,194,828.100	

US T N/B 1.875 07/31/22	3,950,000.000	4,030,388.660	
US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,281,054.650	
US T N/B 1.875 08/31/22	8,000,000.000	8,172,500.000	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,030,000.000	7,376,007.810	
US T N/B 1.875 09/30/22	3,270,000.000	3,345,107.810	
US T N/B 1.875 10/31/22	4,000,000.000	4,097,812.480	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,780,000.000	15,248,803.120	
US T N/B 2.0 02/15/25	11,220,000.000	11,860,328.870	
US T N/B 2.0 02/15/50	10,510,000.000	10,140,507.810	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	7,200,588.210	
US T N/B 2.0 05/31/24	8,440,000.000	8,866,945.240	
US T N/B 2.0 06/30/24	6,710,000.000	7,056,246.460	
US T N/B 2.0 08/15/25	14,040,000.000	14,879,109.280	
US T N/B 2.0 10/31/22	2,720,000.000	2,791,081.240	
US T N/B 2.0 11/15/26	10,830,000.000	11,505,605.820	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,354,306.250	
US T N/B 2.125 02/29/24	8,810,000.000	9,261,168.280	
US T N/B 2.125 03/31/24	13,170,000.000	13,860,396.020	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,360,000.000	11,009,928.060	
US T N/B 2.125 05/31/26	7,070,000.000	7,552,748.430	
US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,902,443.350	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	6,517,785.490	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,400,000.000	6,768,499.960	
US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,379,687.440	
US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	7,062,383.550	
US T N/B 2.125 12/31/22	10,620,000.000	10,951,875.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	8,160,000.000	8,593,818.720	
US T N/B 2.25 02/15/27	13,150,000.000	14,139,331.960	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,630,000.000	8,190,328.120	
US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,455,312.480	
US T N/B 2.25 08/15/27	11,540,000.000	12,417,220.240	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,730,000.000	6,863,285.480	
US T N/B 2.25 08/15/49	12,260,000.000	12,487,959.360	
US T N/B 2.25 10/31/24	6,560,000.000	6,969,487.460	
US T N/B 2.25 11/15/24	14,440,000.000	15,349,832.770	
US T N/B 2.25 11/15/25	15,100,000.000	16,187,081.910	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,650,000.000	13,611,103.470	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,414,374.960	
US T N/B 2.25 12/31/24	7,210,000.000	7,678,368.300	
US T N/B 2.375 01/31/23	5,560,000.000	5,765,242.170	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,135,085.890	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,619,892.170	
US T N/B 2.375 05/15/27	15,900,000.000	17,226,035.020	
US T N/B 2.375 05/15/29	13,450,000.000	14,573,810.430	
US T N/B 2.375 08/15/24	15,210,000.000	16,195,679.170	
US T N/B 2.375 11/15/49	11,710,000.000	12,253,417.180	
US T N/B 2.5 01/31/24	10,820,000.000	11,467,509.370	
US T N/B 2.5 01/31/25	5,160,000.000	5,546,395.290	
US T N/B 2.5 02/15/45	9,670,000.000	10,329,146.450	

US T N/B 2.5 02/15/46	6,270,000.000	6,703,511.670	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,990,278.110	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	7,007,962.480	
US T N/B 2.5 05/15/24	15,300,000.000	16,296,292.830	
US T N/B 2.5 05/15/46	6,280,000.000	6,715,183.890	
US T N/B 2.5 08/15/23	10,000,000.000	10,507,031.200	
US T N/B 2.625 01/31/26	7,280,000.000	7,937,474.990	
US T N/B 2.625 02/15/29	14,530,000.000	16,003,432.800	
US T N/B 2.625 02/28/23	5,370,000.000	5,601,371.440	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,788,380.040	
US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,225,516.330	
US T N/B 2.625 12/31/23	7,320,000.000	7,768,921.830	
US T N/B 2.625 12/31/25	6,300,000.000	6,863,062.500	
US T N/B 2.75 02/15/24	16,470,000.000	17,576,578.120	
US T N/B 2.75 02/15/28	15,000,000.000	16,620,703.030	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,823,421.430	
US T N/B 2.75 04/30/23	7,660,000.000	8,039,110.090	
US T N/B 2.75 05/31/23	7,220,000.000	7,591,717.150	
US T N/B 2.75 06/30/25	5,150,000.000	5,610,080.030	
US T N/B 2.75 07/31/23	8,860,000.000	9,348,338.210	
US T N/B 2.75 08/15/42	4,500,000.000	5,016,796.860	
US T N/B 2.75 08/15/47	7,630,000.000	8,555,435.520	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,431,204.270	
US T N/B 2.75 08/31/25	6,430,000.000	7,015,230.430	
US T N/B 2.75 11/15/23	19,530,000.000	20,740,707.270	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,920,000.000	5,480,418.750	
US T N/B 2.75 11/15/47	9,540,000.000	10,697,097.620	
US T N/B 2.875 04/30/25	6,920,000.000	7,555,504.630	
US T N/B 2.875 05/15/28	17,170,000.000	19,178,755.710	
US T N/B 2.875 05/15/43	9,540,000.000	10,847,650.750	
US T N/B 2.875 05/15/49	11,490,000.000	13,245,815.620	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,973,363.250	
US T N/B 2.875 07/31/25	5,270,000.000	5,769,826.560	
US T N/B 2.875 08/15/28	12,860,000.000	14,376,073.370	
US T N/B 2.875 08/15/45	7,480,000.000	8,540,348.410	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,292,938.610	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,430,000.000	10,032,267.500	
US T N/B 2.875 11/15/46	7,030,000.000	8,046,054.680	
US T N/B 2.875 11/30/23	8,670,000.000	9,241,000.720	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,140,000.000	6,749,922.600	
US T N/B 3.0 02/15/47	8,500,000.000	9,959,277.280	
US T N/B 3.0 02/15/48	10,760,000.000	12,638,376.530	
US T N/B 3.0 02/15/49	10,860,000.000	12,804,618.740	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,786,046.870	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,120,000.000	4,799,317.160	
US T N/B 3.0 05/15/47	6,010,000.000	7,046,959.740	
US T N/B 3.0 08/15/48	11,340,000.000	13,340,003.810	
US T N/B 3.0 09/30/25	6,360,000.000	7,011,900.000	
US T N/B 3.0 10/31/25	5,620,000.000	6,202,416.380	

US T N/B 3.0 11/15/44	7,070,000.000	8,223,293.750	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,370,000.000	3,935,001.550	
US T N/B 3.125 02/15/42	4,040,000.000	4,770,356.230	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	5,622,750.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	9,900,000.000	11,905,136.690	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,650,000.000	9,079,892.550	
US T N/B 3.125 11/15/28	15,380,000.000	17,480,931.980	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,780,000.000	4,459,366.380	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,000,000.000	7,397,343.710	
US T N/B 3.375 11/15/48	10,850,000.000	13,660,828.120	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,390,000.000	2,963,786.700	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,280,000.000	6,749,324.990	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,050,000.000	6,436,974.570	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,000,000.000	3,856,640.610	
US T N/B 3.75 11/15/43	6,300,000.000	8,184,339.810	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	3,358,837.500	
US T N/B 4.25 05/15/39	3,000,000.000	4,069,687.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	4,534,393.750	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,890,000.000	2,582,360.130	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,770,000.000	3,837,315.620	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,500,000.000	4,868,007.790	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	3,723,257.790	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,910,000.000	2,604,016.390	
US T N/B 4.5 05/15/38	2,140,000.000	2,967,160.130	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,509,097.620	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	3,968,557.010	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,470,000.000	5,039,903.880	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,450,000.000	2,100,234.370	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,194,062.500	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	3,117,799.200	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,600,000.000	2,082,499.990	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	2,255,712.500	
US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,703,917.940	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,831,874.990	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,390,000.000	2,706,208.170	
アメリカ・ドル 小計	2,187,010,000.000 (239,390,114,600)	2,273,855,682.040 (248,896,242,955)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	5,610,000.000	5,556,144.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	7,480,000.000	7,487,180.800
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	9,620,000.000	9,614,897.530
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	4,870,000.000	4,735,880.200
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,750,000.000	2,582,771.390
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	810,000.000	807,529.500

UK TREASURY 0.375 10/22/30	4,180,000.000	4,021,850.770	
UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,230,000.000	5,258,011.880	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,960,000.000	2,297,533.050	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	3,610,000.000	3,668,727.480	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	6,520,000.000	6,101,635.060	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	3,970,000.000	3,330,830.000	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,000,000.000	4,058,200.000	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	1,240,000.000	1,130,557.600	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,840,000.000	3,895,593.970	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	2,860,000.000	2,931,255.170	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,760,000.000	3,939,201.600	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	4,320,000.000	4,314,821.130	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,170,000.000	3,353,241.200	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	5,480,000.000	5,737,978.660	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	4,480,000.000	4,819,852.800	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	3,460,000.000	3,786,710.140	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,420,000.000	1,691,151.270	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	3,090,000.000	3,424,680.050	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	5,170,000.000	5,927,123.750	
UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,000,000.000	5,106,187.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	5,560,000.000	6,042,096.480	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,750,000.000	2,954,627.500	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	4,920,000.000	5,159,515.440	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,480,000.000	5,033,875.310	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,560,000.000	2,774,223.360	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	4,970,000.000	6,906,590.320	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,750,000.000	6,910,100.960	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	4,690,000.000	8,626,762.550	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,690,000.000	6,039,275.400	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,990,000.000	5,550,675.750	

	UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,190,000.000	6,000,876.100	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	4,910,000.000	6,637,839.790	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,720,000.000	4,090,539.450	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,280,000.000	4,068,304.690	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,190,000.000	4,875,449.260	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,860,000.000	6,350,008.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,110,000.000	5,321,223.670	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,520,000.000	6,471,722.040	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	3,160,000.000	4,525,899.870	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,510,000.000	7,282,223.920	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,100,000.000	5,597,561.900	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,560,000.000	5,590,520.040	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,650,000.000	4,302,795.200	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,022,242.500	
	イギリス・ボンド 小計	198,470,000.000 (30,790,635,800)	238,714,496.300 (37,034,166,956)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	6,060,000.000	6,050,285.820	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	4,270,000.000	4,278,399.090	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	4,560,000.000	4,457,322.480	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	3,230,000.000	3,282,623.160	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,710,000.000	3,446,129.960	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	4,730,000.000	4,878,313.880	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	4,500,000.000	4,737,411.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	4,340,000.000	4,642,736.700	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,620,000.000	5,019,902.580	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	5,070,000.000	5,562,636.690	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	6,420,000.000	8,032,748.940	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	5,570,000.000	5,977,969.080	

	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	4,900,000.000	7,640,418.100	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	4,450,000.000	5,764,000.450	
イスラエル・シュケル 小計		66,430,000.000 (2,241,102,409)	73,770,897.930 (2,488,757,144)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	6,940,000.000	6,940,591.280	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	4,430,000.000	4,379,143.680	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	5,270,000.000	5,213,372.510	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	7,880,000.000	7,509,089.800	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	8,710,000.000	8,398,855.430	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	5,110,000.000	4,967,060.410	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	6,120,000.000	6,155,283.630	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	4,130,000.000	3,538,997.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,410,000.000	2,455,783.490	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,220,000.000	4,565,829.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	4,270,000.000	4,407,283.060	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	8,040,000.000	8,847,170.150	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,190,000.000	3,436,057.130	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	3,040,000.000	3,325,445.360	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,740,000.000	1,950,850.590	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,420,000.000	4,918,797.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,750,000.000	4,198,746.740	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,760,000.000	6,445,440.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,970,000.000	3,361,911.100	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	5,320,000.000	5,907,631.240	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	6,200,000.000	7,184,109.240		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,150,000.000	2,534,348.390		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,970,000.000	3,718,818.370		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,440,000.000	6,390,299.440		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,890,000.000	3,811,988.290		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	6,290,000.000	7,712,850.830		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	8,510,000.000	9,373,802.440		
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	2,540,000.000	2,698,825.430		
オーストラリア・ドル 小計		134,710,000.000 (11,427,449,300)	144,348,381.030 (12,245,073,163)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	5,650,000.000	5,648,966.050	
	CANADA 0.25 03/01/26	5,260,000.000	5,119,358.120	
	CANADA 0.25 04/01/24	8,430,000.000	8,374,404.150	
	CANADA 0.25 05/01/23	9,340,000.000	9,328,969.460	
	CANADA 0.25 11/01/22	2,450,000.000	2,450,137.200	
	CANADA 0.5 09/01/25	6,690,000.000	6,621,093.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	8,960,000.000	8,253,360.640	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,850,000.000	2,854,343.400	
	CANADA 1.0 09/01/22	3,000,000.000	3,028,947.000	
	CANADA 1.0 09/01/26	3,410,000.000	3,423,715.020	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,200,000.000	2,251,304.000	
	CANADA 1.25 06/01/30	7,990,000.000	7,939,535.160	

	CANADA 1.5 06/01/23	3,110,000.000	3,182,332.380	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,400,000.000	1,445,011.400	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,200,000.000	1,204,287.600	
	CANADA 1.5 09/01/24	2,150,000.000	2,216,024.350	
	CANADA 1.75 03/01/23	4,490,000.000	4,602,990.850	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,370,000.000	2,514,716.940	
	CANADA 2.0 09/01/23	6,220,000.000	6,444,100.380	
	CANADA 2.0 12/01/51	6,910,000.000	6,996,706.680	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,660,000.000	3,838,439.640	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,800,000.000	2,977,094.400	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	2,063,783.650	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,620,000.000	2,775,908.340	
	CANADA 2.75 06/01/22	2,950,000.000	3,022,921.050	
	CANADA 2.75 12/01/48	3,080,000.000	3,626,447.440	
	CANADA 2.75 12/01/64	2,190,000.000	2,664,165.660	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,570,000.000	3,383,142.860	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,960,000.000	2,686,023.200	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,480,000.000	2,170,243.880	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,440,000.000	1,936,229.760	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,240,000.000	3,261,493.760	
カナダ・ドル 小計		122,980,000.000 (11,135,839,000)	128,306,197.420 (11,618,126,176)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	730,000.000	724,160.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,810,000.000	1,852,173.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	1,340,000.000	1,358,686.300	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	930,000.000	968,409.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,450,000.000	1,543,662.750	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,500,000.000	1,596,277.500	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,230,000.000	1,315,116.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	780,000.000	848,246.100	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,250,000.000	1,374,125.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	2,080,000.000	2,454,400.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,280,000.000	1,484,800.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,780,000.000	1,867,398.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,530,000.000	1,712,835.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	2,200,000.000	2,475,770.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,790,000.000	1,931,947.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	820,000.000	848,700.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,540,000.000	1,829,982.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,090,000.000	2,381,555.000		
シンガポール・ドル 小計		26,130,000.000 (2,161,473,600)	28,568,242.650 (2,363,165,032)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	11,990,000.000	11,735,896.860	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	13,480,000.000	14,097,057.760	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	14,910,000.000	15,571,183.950	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	18,290,000.000	19,354,478.000	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	21,900,000.000	22,862,345.130	

	SWEDEN 2.25 06/01/32	6,600,000.000	7,897,956.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	24,440,000.000	27,046,247.370	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	11,420,000.000	16,674,117.020	
	SWEDEN 3.5 06/01/22	13,110,000.000	13,597,862.430	
スウェーデン・クローナ 小計		136,140,000.000 (1,806,577,800)	148,837,144.520 (1,975,068,908)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	6,420,000.000	6,364,854.760	
	DENMARK 0.25 11/15/22	4,700,000.000	4,746,530.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	10,300,000.000	9,249,400.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	17,770,000.000	18,663,280.130	
	DENMARK 0.5 11/15/29	25,320,000.000	26,615,244.600	
	DENMARK 1.5 11/15/23	15,600,000.000	16,384,914.000	
	DENMARK 1.75 11/15/25	16,950,000.000	18,622,287.000	
	DENMARK 4.5 11/15/39	28,760,000.000	50,420,010.150	
デンマーク・クローネ 小計		125,820,000.000 (2,254,694,400)	151,066,520.640 (2,707,112,050)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	9,100,000.000	8,891,155.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	11,960,000.000	11,887,701.800	
	NORWAY 1.5 02/19/26	10,870,000.000	11,070,573.240	
	NORWAY 1.75 02/17/27	9,840,000.000	10,130,260.320	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,570,000.000	10,869,553.800	
	NORWAY 1.75 09/06/29	10,710,000.000	11,003,614.650	
	NORWAY 2.0 04/26/28	9,620,000.000	10,055,786.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	19,260,000.000	19,804,095.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	12,640,000.000	13,391,195.200	
ノルウェー・クローネ 小計		104,570,000.000 (1,383,461,100)	107,103,935.010 (1,416,985,060)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	2,700,000.000	2,548,530.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	7,980,000.000	7,954,917.170	
	POLAND 04/25/23	3,410,000.000	3,386,061.800	
	POLAND 07/25/22	4,910,000.000	4,906,217.560	
	POLAND 1.25 10/25/30	16,800,000.000	16,049,165.310	
	POLAND 2.25 10/25/24	6,870,000.000	7,228,641.480	
	POLAND 2.5 01/25/23	7,660,000.000	7,928,329.000	
	POLAND 2.5 04/25/24	10,950,000.000	11,560,842.450	
	POLAND 2.5 07/25/26	10,300,000.000	10,965,148.240	
	POLAND 2.5 07/25/27	8,290,000.000	8,831,337.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	9,310,000.000	10,102,281.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,743,313.760	
	POLAND 3.25 07/25/25	9,190,000.000	10,036,858.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	7,940,000.000	8,614,264.800	
	POLAND 5.75 04/25/29	120,000.000	157,260.000	
POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,283,840.000		
ポーランド・ズロチ 小計		114,790,000.000 (3,423,600,271)	119,297,008.070 (3,558,021,336)	

マレーシア・リングット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,490,000.000	2,361,194.340	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	3,330,000.000	3,448,296.580	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	5,610,000.000	5,760,014.200	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	3,590,000.000	3,759,894.940	
	MALAYSIA 3.757 04/20/23	3,160,000.000	3,261,489.080	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	3,950,000.000	3,732,760.540	
	MALAYSIA 3.795 09/30/22	2,600,000.000	2,664,644.840	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	3,070,000.000	3,188,403.760	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	5,150,000.000	5,143,603.730	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,390,000.000	2,404,393.530	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	5,910,000.000	6,211,896.970	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,452,676.070	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	4,240,000.000	4,489,013.080	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	4,140,000.000	4,416,702.690	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	2,130,000.000	2,250,226.140	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	7,840,000.000	8,294,832.890	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	2,600,000.000	2,743,343.200	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	4,320,000.000	4,145,679.080	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,480,000.000	2,618,903.800	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	3,000,000.000	3,202,932.900	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,200,000.000	2,286,866.340	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,030,000.000	3,269,437.560	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	3,050,000.000	3,323,072.600	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,400,000.000	2,598,221.040	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	2,000,000.000	2,113,047.400		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,730,000.000	4,025,699.480		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,430,000.000	1,556,742.040		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	3,400,000.000	3,651,083.540		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,970,000.000	2,133,307.480		
マレーシア・リングット 小計		96,580,000.000 (2,567,347,508)	100,508,379.840 (2,671,774,058)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	66,830,000.000	68,827,314.790	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,223,000.000	23,371,471.290	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,893,000.000	66,868,878.990	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	74,714,000.000	73,874,961.780	
	MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	24,139,000.000	24,556,761.590	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	69,445,000.000	73,877,959.050	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	52,700,000.000	57,193,312.670	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	41,418,000.000	43,600,351.680	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	19,311,000.000	20,801,822.680	

	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	57,570,000.000	61,528,444.110	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	58,126,000.000	62,783,572.420	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	98,133,000.000	104,297,715.060	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	67,501,000.000	76,127,006.760	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	48,613,000.000	54,920,677.720	
	メキシコ・ペソ 小計	755,616,000.000 (4,200,167,098)	812,630,250.590 (4,517,086,511)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	2,420,000.000	2,444,062.060	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,960,000.000	1,963,896.670	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	2,800,000.000	2,833,812.800	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,700,000.000	1,737,757.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	670,000.000	611,844.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	2,740,000.000	2,890,941.120	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,630,000.000	2,773,826.810	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	3,340,000.000	3,582,531.410	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	1,230,000.000	1,261,720.580	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,830,000.000	4,085,231.200	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	890,000.000	808,263.290	
	AUSTRIA 07/15/23	2,330,000.000	2,361,105.500	
	AUSTRIA 07/15/24	2,700,000.000	2,751,786.000	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	5,040,000.000	5,431,194.720	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	2,420,000.000	2,954,338.420	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	500,000.000	645,850.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	2,520,000.000	2,715,007.680	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	3,720,000.000	3,931,396.440	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,290,000.000	2,111,300.430	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,960,000.000	2,523,331.440	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,700,000.000	2,700,408.340	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	980,000.000	2,028,317.760	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,260,000.000	5,206,220.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,490,000.000	3,138,099.690	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	360,000.000	507,744.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,990,000.000	2,032,383.020	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	2,190,000.000	2,168,702.250	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	3,100,000.000	3,143,400.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	2,610,000.000	2,663,505.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	1,060,000.000	1,018,993.020	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	2,820,000.000	2,927,817.060	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	1,420,000.000	1,175,489.440	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	4,720,000.000	4,983,064.480	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	3,060,000.000	3,280,656.600	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	4,570,000.000	4,916,406.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	4,270,000.000	4,634,585.410	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	4,340,000.000	4,667,183.920	

BELGIUM 1.0 06/22/31	3,110,000.000	3,418,169.900	
BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,706,943.200	
BELGIUM 1.45 06/22/37	60,000.000	69,167.100	
BELGIUM 1.6 06/22/47	2,770,000.000	3,261,841.200	
BELGIUM 1.7 06/22/50	4,450,000.000	5,360,629.310	
BELGIUM 1.9 06/22/38	2,380,000.000	2,923,308.780	
BELGIUM 2.15 06/22/66	1,340,000.000	1,869,970.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	5,250,000.000	5,564,133.750	
BELGIUM 2.25 06/22/57	370,000.000	513,804.570	
BELGIUM 2.6 06/22/24	4,100,000.000	4,506,344.030	
BELGIUM 3.0 06/22/34	2,140,000.000	2,891,610.800	
BELGIUM 3.75 06/22/45	2,230,000.000	3,697,830.600	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,950,000.000	2,776,739.550	
BELGIUM 4.25 03/28/41	4,270,000.000	7,162,677.340	
BELGIUM 4.25 09/28/22	1,380,000.000	1,468,706.400	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,590,000.000	3,221,993.670	
BELGIUM 5.0 03/28/35	4,010,000.000	6,571,776.470	
BELGIUM 5.5 03/28/28	4,660,000.000	6,536,698.500	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	4,100,000.000	4,224,558.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	4,910,000.000	5,039,457.060	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	6,960,000.000	7,160,587.200	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,000,000.000	1,029,970.000	
BUNDESOBL 04/05/24	6,080,000.000	6,202,110.720	
BUNDESOBL 04/14/23	5,060,000.000	5,126,053.240	
BUNDESOBL 10/07/22	3,790,000.000	3,824,686.080	
BUNDESOBL 10/13/23	3,940,000.000	4,007,216.400	
BUNDESOBL 10/18/24	5,540,000.000	5,671,104.100	
BUNDESSCHAT 0.0 03/10/23	5,570,000.000	5,636,383.260	
BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	2,230,000.000	2,248,999.600	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/22	3,000,000.000	3,030,852.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	7,490,000.000	7,711,554.200	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	4,670,000.000	4,783,574.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	5,640,000.000	5,641,015.200	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,480,000.000	2,457,357.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	9,110,000.000	9,359,978.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,320,000.000	2,395,260.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	5,510,000.000	5,023,522.100	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	6,660,000.000	6,876,117.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,000,000.000	2,062,374.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,650,000.000	8,013,757.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	6,540,000.000	6,881,747.700	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	6,430,000.000	6,763,588.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	7,100,000.000	7,417,938.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	8,490,000.000	8,951,176.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	8,050,000.000	8,594,341.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	8,390,000.000	8,939,721.190	

DEUTSCHLAND 08/15/26	9,270,000.000	9,567,261.090	
DEUTSCHLAND 08/15/29	6,680,000.000	6,886,913.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	4,400,000.000	4,642,897.600	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,350,000.000	6,799,580.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	8,930,000.000	11,195,398.120	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,238,092.300	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	7,790,000.000	8,122,911.100	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	5,390,000.000	5,744,198.460	
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	4,600,000.000	4,724,706.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	9,570,000.000	10,209,898.050	
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	5,280,000.000	5,416,235.610	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	6,230,000.000	6,601,594.580	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	7,690,000.000	11,746,013.600	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	6,680,000.000	10,404,110.680	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,020,000.000	6,639,190.800	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	6,380,000.000	10,378,639.480	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	4,590,000.000	8,071,331.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,380,000.000	3,282,781.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,840,000.000	9,621,049.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,980,000.000	9,410,656.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,340,000.000	8,389,567.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	890,000.000	1,259,465.700	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,393,108.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,215,738.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,402,094.600	
FINLAND 0.0 09/15/24	960,000.000	980,062.080	
FINLAND 0.0 09/15/30	1,280,000.000	1,290,150.400	
FINLAND 0.125 04/15/36	770,000.000	751,947.350	
FINLAND 0.125 04/15/52	940,000.000	817,574.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	1,030,000.000	997,492.170	
FINLAND 0.5 04/15/26	2,170,000.000	2,279,943.050	
FINLAND 0.5 09/15/27	1,620,000.000	1,712,605.680	
FINLAND 0.5 09/15/28	990,000.000	1,047,816.000	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,560,000.000	1,648,645.440	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	1,057,531.720	
FINLAND 0.875 09/15/25	1,360,000.000	1,444,850.400	
FINLAND 09/15/23	2,050,000.000	2,081,554.620	
FINLAND 1.125 04/15/34	1,250,000.000	1,403,711.870	

FINLAND 1.375 04/15/47	980,000.000	1,190,214.900	
FINLAND 1.5 04/15/23	1,400,000.000	1,456,112.000	
FINLAND 1.625 09/15/22	150,000.000	154,358.250	
FINLAND 2.0 04/15/24	1,220,000.000	1,313,820.440	
FINLAND 2.625 07/04/42	1,080,000.000	1,565,011.800	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,470,000.000	1,794,146.760	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,500,000.000	1,784,506.500	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,734,992.160	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	4,660,000.000	4,711,493.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	5,490,000.000	5,578,866.630	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	11,570,000.000	11,821,832.620	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,000,000.000	2,039,000.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	9,260,000.000	9,317,828.700	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	11,680,000.000	11,653,717.420	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	2,400,000.000	2,369,251.200	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	10,210,000.000	10,575,538.420	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	11,200,000.000	11,666,121.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,150,000.000	9,587,177.850	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	12,050,000.000	12,658,994.950	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	3,370,000.000	3,298,138.120	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	2,000,000.000	1,535,860.000	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,360,000.000	1,297,189.760	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	11,660,000.000	12,476,596.440	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	6,860,000.000	6,506,929.520	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	9,680,000.000	10,366,118.400	
FRANCE OAT 03/25/23	10,860,000.000	10,988,028.540	
FRANCE OAT 03/25/24	9,810,000.000	9,979,167.550	
FRANCE OAT 03/25/25	11,000,000.000	11,228,448.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,200,000.000	8,865,840.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	9,000,000.000	9,611,028.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	10,120,000.000	11,336,528.220	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	8,280,000.000	9,271,944.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,910,000.000	14,766,483.820	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	9,140,000.000	10,565,072.240	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	15,040,000.000	15,749,436.800	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	4,810,000.000	6,028,151.740	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	6,940,000.000	8,421,620.600	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	9,090,000.000	9,831,062.250	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	6,760,000.000	8,663,223.920	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	7,080,000.000	7,685,304.600	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	9,150,000.000	9,517,802.550	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	11,550,000.000	14,197,433.250	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	12,790,000.000	15,331,347.420	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,450,000.000	10,025,222.100	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	9,550,000.000	11,412,727.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,510,000.000	6,611,787.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,520,000.000	6,927,930.240	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	6,160,000.000	9,779,344.960	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,620,000.000	12,980,167.480	

FRANCE OAT 4.5 04/25/41	10,430,000.000	18,087,768.580	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,130,000.000	9,841,359.460	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	8,210,000.000	11,907,325.870	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,090,000.000	13,233,370.390	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,862,570.120	
IRISH 0.0 10/18/31	730,000.000	718,490.820	
IRISH 0.2 05/15/27	1,720,000.000	1,770,788.160	
IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,681,088.640	
IRISH 0.4 05/15/35	1,330,000.000	1,331,919.190	
IRISH 0.55 04/22/41	990,000.000	968,893.060	
IRISH 0.9 05/15/28	2,160,000.000	2,325,078.000	
IRISH 1.0 05/15/26	2,740,000.000	2,932,183.600	
IRISH 1.1 05/15/29	2,280,000.000	2,492,869.920	
IRISH 1.3 05/15/33	1,740,000.000	1,955,210.160	
IRISH 1.35 03/18/31	1,420,000.000	1,597,889.080	
IRISH 1.5 05/15/50	1,480,000.000	1,713,347.160	
IRISH 1.7 05/15/37	1,600,000.000	1,899,547.340	
IRISH 10/18/22	160,000.000	161,330.080	
IRISH 2.0 02/18/45	2,060,000.000	2,634,338.300	
IRISH 2.4 05/15/30	2,610,000.000	3,171,972.150	
IRISH 3.4 03/18/24	2,290,000.000	2,542,362.580	
IRISH 3.9 03/20/23	2,320,000.000	2,505,495.600	
IRISH 5.4 03/13/25	2,730,000.000	3,339,909.300	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	4,750,000.000	4,786,575.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,430,000.000	2,422,224.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	3,350,000.000	3,373,450.000	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	4,100,000.000	4,131,772.120	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	5,610,000.000	5,567,925.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	3,710,000.000	3,761,940.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	5,200,000.000	5,292,362.400	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	4,100,000.000	4,190,400.900	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	4,500,000.000	4,589,100.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,880,000.000	2,824,737.120	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,340,000.000	3,418,022.400	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	4,800,000.000	4,977,840.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	3,770,000.000	3,822,640.510	
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	2,500,000.000	2,538,000.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	4,070,000.000	4,165,006.010	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,450,000.000	3,288,540.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	4,210,000.000	4,309,356.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	4,750,000.000	4,864,475.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	5,100,000.000	5,310,630.000	
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	3,050,000.000	3,098,514.820	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	6,030,000.000	6,393,728.390	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,930,000.000	6,295,353.230	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	8,000,000.000	8,260,800.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	3,120,000.000	3,309,199.920	
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,237,534.260	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,690,000.000	4,951,772.350	

ITALY BTPS 1.5 04/30/45	2,130,000.000	2,066,313.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,010,000.000	4,264,423.260	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	5,790,000.000	6,226,566.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	6,410,000.000	6,928,902.320	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	5,570,000.000	6,043,372.020	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	2,000,000.000	1,949,422.000	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,630,000.000	4,909,401.980	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	2,900,000.000	3,035,430.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	3,100,000.000	3,290,340.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,670,000.000	5,030,991.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	5,660,000.000	6,274,975.980	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	5,610,000.000	6,116,246.400	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,980,000.000	6,626,748.960	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	4,540,000.000	5,002,603.300	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	1,365,234.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	3,450,000.000	3,852,270.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	4,130,000.000	4,712,743.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	8,170,000.000	9,521,840.880	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	3,480,000.000	4,002,000.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	10,900,000.000	11,603,605.900	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,550,000.000	3,946,882.900	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,790,000.000	6,325,048.110	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	4,830,000.000	5,818,701.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	2,400,000.000	2,875,440.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	5,660,000.000	6,635,529.300	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	5,030,000.000	6,217,583.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,790,000.000	5,728,250.830	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	4,440,000.000	5,632,638.160	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,980,000.000	5,247,005.140	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	4,170,000.000	5,336,853.570	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	4,000,000.000	5,466,511.200	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	6,860,000.000	8,541,568.460	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	5,300,000.000	5,975,924.900	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	2,660,000.000	3,893,176.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	5,720,000.000	7,909,616.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	5,190,000.000	5,864,162.830	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,500,000.000	7,876,050.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	5,480,000.000	5,988,215.200	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,830,000.000	6,468,385.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	5,660,000.000	7,394,908.860	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	5,560,000.000	8,924,866.930	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,820,000.000	4,550,275.510	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,950,000.000	5,838,495.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,220,000.000	6,657,894.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,020,000.000	4,804,820.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,940,000.000	9,613,982.000	
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,173,673.520	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	5,560,000.000	6,015,808.800	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,690,000.000	5,652,342.000	

ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,453,440.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,729,060.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,970,225.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,079,440.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	4,060,000.000	4,169,924.500	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	2,130,000.000	1,890,100.020	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,340,000.000	3,397,397.900	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	1,280,000.000	1,293,450.240	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	3,530,000.000	3,658,350.800	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,920,000.000	3,044,914.680	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	2,970,000.000	3,125,565.910	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	6,450,000.000	6,795,397.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	4,170,000.000	4,480,435.650	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	3,660,000.000	3,954,534.840	
NETHERLANDS 01/15/24	9,280,000.000	9,453,136.960	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	5,010,000.000	5,270,830.620	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	3,650,000.000	3,955,946.650	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,620,000.000	4,697,424.220	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,920,000.000	6,292,830.880	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,900,000.000	6,684,642.900	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,220,000.000	6,770,568.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,670,000.000	3,728,764.470	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	667,972.630	
SPAIN 0.0 01/31/25	5,920,000.000	6,006,728.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	2,200,000.000	2,229,543.360	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,400,000.000	1,400,980.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	9,700,000.000	9,798,552.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	3,200,000.000	3,242,800.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	4,890,000.000	4,753,960.200	
SPAIN 0.25 07/30/24	4,190,000.000	4,283,960.750	
SPAIN 0.35 07/30/23	5,050,000.000	5,147,641.750	
SPAIN 0.45 10/31/22	4,320,000.000	4,381,907.320	
SPAIN 0.5 04/30/30	5,040,000.000	5,146,394.400	
SPAIN 0.6 10/31/29	5,230,000.000	5,405,916.280	
SPAIN 0.8 07/30/27	5,720,000.000	6,032,312.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	390,000.000	385,123.050	
SPAIN 1.0 10/31/50	4,820,000.000	4,369,334.820	
SPAIN 1.2 10/31/40	4,110,000.000	4,186,396.680	
SPAIN 1.25 10/31/30	6,970,000.000	7,566,632.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	6,490,000.000	7,028,747.880	
SPAIN 1.4 04/30/28	5,310,000.000	5,822,213.220	
SPAIN 1.4 07/30/28	6,200,000.000	6,808,220.000	

	SPAIN 1.45 04/30/29	6,430,000.000	7,095,897.230	
	SPAIN 1.45 10/31/27	5,390,000.000	5,914,721.890	
	SPAIN 1.45 10/31/71	1,460,000.000	1,298,312.300	
	SPAIN 1.5 04/30/27	4,340,000.000	4,764,018.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	5,130,000.000	5,532,222.780	
	SPAIN 1.85 07/30/35	4,900,000.000	5,614,754.170	
	SPAIN 1.95 04/30/26	5,170,000.000	5,738,772.380	
	SPAIN 1.95 07/30/30	5,660,000.000	6,513,405.160	
	SPAIN 2.15 10/31/25	5,460,000.000	6,064,771.440	
	SPAIN 2.35 07/30/33	4,660,000.000	5,601,320.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	3,730,000.000	4,908,302.890	
	SPAIN 2.75 10/31/24	5,470,000.000	6,068,975.940	
	SPAIN 2.9 10/31/46	4,920,000.000	6,666,391.870	
	SPAIN 3.45 07/30/66	3,750,000.000	5,811,075.000	
	SPAIN 3.8 04/30/24	5,470,000.000	6,150,012.330	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,260,000.000	7,869,380.800	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,600,000.000	5,145,943.640	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,310,000.000	6,423,887.180	
	SPAIN 4.7 07/30/41	4,850,000.000	8,042,173.000	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,840,000.000	4,380,537.600	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,720,000.000	7,903,640.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	5,630,000.000	7,746,880.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	3,530,000.000	6,399,787.630	
	SPAIN 5.4 01/31/23	5,480,000.000	6,015,941.800	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,510,000.000	8,669,483.590	
	SPAIN 5.9 07/30/26	5,590,000.000	7,370,135.500	
	SPAIN 6.0 01/31/29	820,000.000	1,190,320.200	
	ユーロ 小計	1,500,460,000.000 (200,026,322,600)	1,734,833,586.860 (231,270,665,464)	
国債証券 合計		512,808,785,485.600 (512,808,785,486)	562,762,244,813 (562,762,244,813)	
合計			562,762,244,813 (562,762,244,813)	

(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 246銘柄	43.61	44.23
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	6.49	6.58
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.44	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券 28銘柄	2.15	2.18
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	2.04	2.06
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.41	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券 9銘柄	0.35	0.35
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.47	0.48
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.25	0.25

ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	0.62	0.63
マレーシア・リングgit	国債証券	29銘柄	0.47	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券	14銘柄	0.79	0.80
ユーロ	国債証券	337銘柄	40.52	41.10

(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6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	89,270,474
コール・ローン	990,010,502
投資信託受益証券	8,574,656,259
投資証券	71,596,680,453
派生商品評価勘定	41,013
未収入金	119,009,830
未収配当金	61,188,163
流動資産合計	81,430,856,694
資産合計	
81,430,856,694	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	583
未払金	241,125,261
未払解約金	878,215,000
流動負債合計	1,119,340,844
負債合計	
1,119,340,844	
純資産の部	
元本等	
元本	51,655,828,732
剰余金	
剰余金又は欠損金()	28,655,687,118
元本等合計	80,311,515,850
純資産合計	
80,311,515,850	
負債純資産合計	
81,430,856,694	

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12月12日 至 2021年6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6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	42,845,368,442円
同期中追加設定元本額	59,857,724,577円
同期中一部解約元本額	51,047,264,287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)	77,402,471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)	47,731,947円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,251,144円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	12,122,460円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	15,398,098円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	44,427,031円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	26,820,444円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,761,793円
たわらノーロード 先進国リート	8,888,217,814円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,451,386,056円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	340,523,804円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,594,089,364円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,926,272円

たわらノーロード バランス(標準型)	269,589,574円
たわらノーロード バランス(積極型)	516,912,700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)	49,567,435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)	101,626,667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)	213,784,499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)	2,979,507円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,515,122円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,059,668円
One DC 先進国リートインデックスファンド	639,744,095円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,528,218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	55,686,198円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	216,499,129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)	473,479,123円
投資のソムリエ	14,503,667,660円
投資のソムリエ<DC年金>	770,759,716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	506,580,878円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,243,003,250円
ワールドアセットバランス(基本コース)	631,670,857円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,025,831,537円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	18,688,512円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,882,940円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,780,454円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	47,262,288円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,857,665,588円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	166,826,703円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	13,778,837円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	6,843,270円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,456,862円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	477,053,365円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	156,378,403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)	152,689,862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)	136,134,551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)	186,993,439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)	136,201,588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)	94,419,783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)	149,262,841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)	551,341,810円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	365,019,674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)	249,192,963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)	128,259,992円
D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	302,046,550円
D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,176,747,403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)	554,879,654円
計	51,655,828,732円
2. 受益権の総数	51,655,828,732口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月12日 至 2021年6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	2021年6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	2021年6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	706,826,063	
投資証券	10,598,017,503	
合計	11,304,843,566	

(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2021年6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	2021年6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	144,632,136	-	144,672,566	40,430
アメリカ・ドル	98,505,630	-	98,511,390	5,760
イギリス・ポンド	6,204,958	-	6,205,444	486
オーストラリア・ドル	28,809,663	-	28,842,200	32,537
カナダ・ドル	1,810,616	-	1,810,922	306
シンガポール・ドル	2,481,141	-	2,481,483	342
ユーロ	3,998,928	-	3,999,387	459
香港・ドル	2,821,200	-	2,821,740	540
合計	144,632,136	-	144,672,566	40,430

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,5547円 (15,547円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2021年6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	354,400.000	271,116.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	658,400.000	497,092.000		
		PRIME US REIT	211,400.000	181,804.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,296,900.000	950,012.000 (103,988,314)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	196,651.000	629,283.200		
		APN INDUSTRIA REIT	73,145.000	235,526.900		
		ARENA REIT	159,242.000	554,162.160		
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	176,463.000	545,270.670		
		BWP TRUST	239,518.000	1,041,903.300		
		CENTURIA CAPITAL GROUP	229,128.000	625,519.440		
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	212,974.000	792,263.280		
		CENTURIA OFFICE REIT	179,274.000	426,672.120		
		CHARTER HALL GROUP	220,887.000	3,339,811.440		
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	275,052.000	1,353,255.840		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	253,057.000	986,922.300		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	154,369.000	543,378.880		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	865,185.000	795,970.200		
		DEXUS	513,628.000	5,624,226.600		
GDI PROPERTY GROUP		247,876.000	285,057.400			
GOODMAN GROUP	800,556.000	16,579,514.760				
GPT GROUP	920,233.000	4,536,748.690				
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	136,670.000	549,413.400				
HOME CONSORTIUM LTD	85,980.000	459,133.200				

	HOMECO DAILY NEEDS REIT	147,473.000	216,047.940	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,965.000	247,043.100	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	145,145.000	853,452.600	
	IRONGATE GROUP	256,148.000	388,064.220	
	MIRVAC GROUP	1,862,202.000	5,549,361.960	
	NATIONAL STORAGE REIT	516,215.000	1,068,565.050	
	RURAL FUNDS GROUP	160,193.000	398,880.570	
	SCENTRE GROUP	2,456,782.000	7,149,235.620	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	527,166.000	1,365,359.940	
	STOCKLAND	1,128,820.000	5,486,065.200	
	VICINITY CENTRES	1,870,308.000	3,151,468.980	
	WAYPOINT REIT LTD	382,777.000	1,025,842.360	
	オーストラリア・ドル 小計	15,467,082.000	66,803,421.320 (5,666,934,231)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	216,895.000	310,159.850	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	529,680.000	431,689.200	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,495,960.000	4,443,001.200	
	ASCOTT TRUST	891,616.000	918,364.480	
	CAPITALAND CHINA TRUST	450,180.000	625,750.200	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,140,009.000	4,622,419.440	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	365,200.000	456,500.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	103,194.000	
	ESR REIT	1,148,730.000	470,979.300	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	491,500.000	292,442.500	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	608,800.000	164,376.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	653,500.000	1,581,470.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	377,100.000	205,519.500	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,297,664.000	1,855,659.520	
	IREIT GLOBAL	214,500.000	141,570.000	
	KEPPEL DC REIT	620,300.000	1,600,374.000	
	KEPPEL REIT	951,500.000	1,132,285.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	422,200.000	331,427.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,759,100.000	179,341.500	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,028,200.000	2,210,630.000	

		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	913,120.000	2,538,473.600	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,370,620.000	2,782,358.600	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	1,019,000.000	1,080,140.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	1,120,355.000	453,743.770	
		PARKWAY LIFE REIT	179,000.000	787,600.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313,200.000	134,676.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	208,100.000	192,492.500	
		SPH REIT	471,900.000	412,912.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	656,800.000	367,808.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	1,046,090.000	1,558,674.100	
	シンガポール・ドル 小計		24,088,219.000	32,386,031.760 (2,678,972,547)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	131,740.000	305,636.800	
	ユーロ 小計		131,740.000	305,636.800 (40,744,442)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	703,000.000	5,954,410.000	
	香港・ドル 小計		703,000.000	5,954,410.000 (84,016,725)	
投資信託受益証券 合計			41,686,941	8,574,656,259 (8,574,656,259)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	42,275.000	956,260.500	
		AGREE REALTY CORP	30,689.000	2,262,393.080	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,220.000	657,091.600	
		ALEXANDER'S INC.	989.000	280,697.980	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	60,665.000	11,754,450.400	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,008.000	882,586.880	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	65,000.000	3,165,500.000	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	50,312.000	459,851.680	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	127,151.000	4,991,948.260	
		AMERICOLD REALTY TRUST	119,402.000	4,712,796.940	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	70,339.000	3,519,763.560	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	68,881.000	524,184.410	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	100,663.000	1,627,720.710	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27,874.000	378,807.660	

AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,412.000	14,255,999.920	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,643.000	107,175.010	
BOSTON PROPERTIES INC	67,702.000	8,306,358.380	
BRANDYWINE REALTY TRUST	83,055.000	1,245,825.000	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	140,188.000	3,379,932.680	
BROADSTONE NET LEASE INC	17,381.000	431,744.040	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	17,653.000	327,992.740	
BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	68,018.000	
CAMDEN PROPERTY TRUST	46,198.000	6,238,577.920	
CARETRUST REIT INC	46,858.000	1,120,843.360	
CENTERSPACE	6,060.000	457,105.800	
CHATHAM LODGING TRUST	22,362.000	306,583.020	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	12,476.000	118,896.280	
CITY OFFICE REIT INC	20,935.000	268,177.350	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	40,433.700	
COLONY CAPITAL INC	238,549.000	1,917,933.960	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	56,177.000	1,072,980.700	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,481.000	530,338.600	
COREPOINT LODGING INC	19,106.000	198,129.220	
CORESITE REALTY CORP	20,353.000	2,807,696.350	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	54,438.000	1,642,938.840	
COUSINS PROPERTIES INC	71,720.000	2,838,677.600	
CTO REALTY GROUTH INC	2,965.000	165,150.500	
CUBESMART	94,451.000	4,381,581.890	
CYRUSONE INC	56,983.000	4,681,153.450	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	102,730.000	1,061,200.900	
DIGITAL REALTY TRUST INC	133,789.000	21,933,368.660	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	112,836.000	455,857.440	
DOUGLAS EMMETT INC	77,840.000	2,850,500.800	
DUKE REALTY TRUST	178,456.000	8,865,694.080	
EAST GROUP	18,728.000	3,201,926.160	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	37,693.000	820,576.610	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	63,868.000	818,149.080	
EPR PROPERTIES	36,185.000	1,935,897.500	
EQUINIX INC	42,564.000	35,029,746.360	
EQUITY COMMONWEALTH	58,986.000	1,661,635.620	

EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	80,277.000	6,133,162.800	
EQUITY RESIDENTIAL	163,583.000	13,217,506.400	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	55,392.000	1,578,118.080	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	31,026.000	9,743,405.040	
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,023.000	10,030,740.680	
FARMLAND PARTNERS INC	11,176.000	145,735.040	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	33,020.000	4,029,100.400	
FIRST INDUSTRIAL RT	60,986.000	3,280,436.940	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	37,210.000	1,077,601.600	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,648.000	261,228.800	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	103,548.000	4,953,736.320	
GEO GROUP INC	57,104.000	402,583.200	
GETTY REALTY CORP	16,951.000	567,688.990	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16,822.000	382,027.620	
GLADSTONE LAND CORP	11,352.000	285,616.320	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	21,116.000	332,154.680	
GLOBAL NET LEASE INC	41,546.000	825,103.560	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	67,604.000	2,191,721.680	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	103,264.000	3,047,320.640	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	257,187.000	8,986,113.780	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618.000	196,424.760	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	50,220.000	2,437,176.600	
HOST HOTELS & RESORTS INC	333,992.000	6,015,195.920	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	72,997.000	2,184,800.210	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	46,758.000	867,828.480	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	29,984.000	791,877.440	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	11,572.000	2,213,260.720	
INVITATION HOMES INC	270,742.000	10,274,658.900	
IRON MOUNTAIN INC	136,588.000	6,337,683.200	
JBG SMITH PROPERTIES	53,549.000	1,862,969.710	
KILROY REALTY CORP	50,045.000	3,655,787.250	
KIMCO REALTY	204,567.000	4,496,382.660	
KITE REALTY GROUP TRUST	40,874.000	939,693.260	
LEXINGTON REALTY TRUST	134,546.000	1,750,443.460	

LIFE STORAGE INC	35,667.000	3,829,565.790	
LTC PROPERTIES INC	17,932.000	706,520.800	
MACK CALI	39,452.000	706,190.800	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	274,618.000	6,003,149.480	
MID AMERICA	54,609.000	9,367,081.770	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	48,171.000	942,224.760	
NATIONAL HEALTH INVS INC	21,934.000	1,479,009.620	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	82,875.000	4,143,750.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	31,184.000	1,543,608.000	
NETSTREIT CORP	10,996.000	260,605.200	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	37,108.000	267,548.680	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,397.000	590,549.600	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	22,164.000	694,841.400	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	109,600.000	4,137,400.000	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,856.000	225,624.320	
PARAMOUNT GROUP INC	80,717.000	930,667.010	
PARK HOTELS & RESORTS INC	114,216.000	2,424,805.680	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	63,751.000	1,523,648.900	
PHYSICIANS REALTY TRUST	101,976.000	1,993,630.800	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	60,484.000	1,225,405.840	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,046.000	263,398.740	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	24,152.000	268,811.760	
PROLOGIS INC	352,488.000	44,512,184.640	
PS BUSINESS PARKS	9,737.000	1,567,559.630	
PUBLIC STORAGE	72,371.000	21,383,459.370	
QTS REALTY TRUST INC	31,224.000	2,440,780.080	
REALTY INCOME CORP	178,161.000	12,663,683.880	
REGENCY CENTERS CORP	74,742.000	5,086,940.520	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	57,754.000	1,074,801.940	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	104,353.000	1,308,586.620	
RETAIL VALUE INC	8,794.000	188,631.300	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	62,108.000	3,669,340.640	
RLJ LODGING TRUST	80,253.000	1,288,060.650	
RPT REALTY	37,794.000	522,313.080	

	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,601.000	2,081,528.250	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	102,053.000	1,829,810.290	
	SAFEHOLD INC	6,652.000	507,547.600	
	SAUL CENTERS INC	6,198.000	286,471.560	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	15,650.000	295,785.000	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	80,633.000	1,113,541.730	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	156,339.000	21,033,849.060	
	SITE CENTERS CORP	81,132.000	1,274,583.720	
	SL GREEN	33,480.000	2,851,491.600	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	55,455.000	2,823,768.600	
	STAG INDUSTRIAL INC	74,750.000	2,889,835.000	
	STORE CAPITAL CORP	113,425.000	4,143,415.250	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	48,846.000	491,879.220	
	SUN COMMUNITIES INC	53,284.000	9,462,172.720	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	104,791.000	1,380,097.470	
	TANGER FACTORY OUTLET	42,759.000	814,131.360	
	TERRENO REALTY CORP	33,200.000	2,209,460.000	
	THE MACERICH COMPANY	56,800.000	984,912.000	
	UDR INC	141,365.000	7,095,109.350	
	UMH PROPERTIES INC	18,196.000	417,234.280	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,995.000	432,779.050	
	URBAN EDGE PROPERTIES	53,765.000	1,080,676.500	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	14,440.000	283,457.200	
	VENTAS INC	178,824.000	10,316,356.560	
	VEREIT INC	108,406.000	5,341,163.620	
	VICI PROPERTIES INC	256,254.000	8,412,818.820	
	VORNADO REALTY TRUST	74,163.000	3,728,915.640	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,926.000	50,225.560	
	WASHINGTON REIT	41,358.000	1,095,987.000	
	WEINGARTEN REALTY INVST	58,118.000	1,956,251.880	
	WELLTOWER INC	198,702.000	15,725,276.280	
	WHITESTONE REIT	17,850.000	153,331.500	
	WP CAREY INC	83,075.000	6,442,466.250	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	55,593.000	1,137,432.780	
アメリカ・ドル	小計	10,348,856.000	546,592,280.320 (59,829,991,004)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	83,963.000	79,345.030	
	ASSURA PLC	1,298,317.000	971,141.110	
	BIG YELLOW GROUP PLC	77,686.000	1,006,033.700	

BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	370,408.000	337,071.280	
BRITISH LAND CO PLC	448,426.000	2,274,416.670	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	397,993.000	683,353.980	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	294,033.000	341,078.280	
CUSTODIAN REIT PLC	202,920.000	200,890.800	
DERWENT LONDON PLC	52,817.000	1,868,665.460	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	281,997.000	242,517.420	
GCP STUDENT LIVING PLC	210,196.000	371,206.130	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	123,471.000	926,032.500	
HAMMERSON PLC	1,976,821.000	848,056.200	
HOME REIT PLC	100,813.000	111,398.360	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	153,417.000	169,679.200	
INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	1,848.320	
LAND SECURITIES GROUP PLC	359,727.000	2,552,622.790	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	441,639.000	1,040,501.480	
LXI REIT PLC	241,153.000	350,154.150	
NEWRIVER REIT PLC	139,604.000	127,737.660	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	257,572.000	228,208.790	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	644,643.000	999,196.650	
REGIONAL REIT LTD	206,337.000	177,656.150	
SAFESTORE HOLDINGS LTD	102,439.000	971,633.910	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	255,156.000	116,606.290	
SEGRE PLC	567,786.000	6,115,055.220	
SHAFTESBURY PLC	147,578.000	910,556.260	
STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	127,689.200	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	371,767.000	434,967.390	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	177,390.000	187,323.840	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	810,128.000	1,633,218.040	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	347,914.000	280,766.590	
UNITE GROUP PLC	188,027.000	2,209,317.250	
WORKSPACE GROUP PLC	63,229.000	567,164.130	
イギリス・ポンド 小計	11,805,998.000	29,463,110.230 (4,570,906,921)	

イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	85,363.000	1,486,169.830	
イスラエル・シュケル 小計		85,363.000	1,486,169.830 (50,137,871)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	29,143.000	1,337,663.700	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,111.000	354,976.510	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,088.000	86,473.600	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,875.000	441,198.750	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	40,179.000	2,287,390.470	
	CHOICE PROPERTIES REIT	78,312.000	1,144,138.320	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	44,246.000	458,831.020	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	21,592.000	400,531.600	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,180.000	406,224.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	39,203.000	575,108.010	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	12,866.000	301,836.360	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	52,733.000	956,576.620	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,761.000	1,216,306.400	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	68,761.000	1,140,744.990	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	31,544.000	513,536.320	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,752.000	494,297.440	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,825.000	197,680.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	146,168.490	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	43,997.000	575,480.760	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	93,986.160	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	72,829.000	1,592,770.230	
	SLATE GROCERY REIT	10,657.000	134,065.060	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	62,707.260	
SMARTCENTRES REIT	34,723.000	1,037,870.470		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	37,879.000	631,064.140		
TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	22,019.000	166,463.640		

	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,145.000	424,444.650	
カナダ・ドル 小計		822,248.000	17,178,534.970 (1,555,516,342)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	388,009.000	607,234.080	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	520,345.000	1,201,996.950	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	742,461.000	883,528.590	
	PRECINCT PROPERTIES	532,144.000	862,073.280	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	180,112.000	551,142.720	
ニュージーランド・ドル 小計		2,363,071.000	4,105,975.620 (323,181,341)	
ユーロ	AEDIFICA	16,007.000	1,706,346.200	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	86,245.000	1,335,072.600	
	ALTAREA	1,643.000	298,040.200	
	BEFIMMO	12,822.000	468,003.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	12,034.000	327,926.500	
	CARMILA SA	21,853.000	288,459.600	
	COFINIMMO SA	13,482.000	1,760,749.200	
	COVIVIO	23,313.000	1,897,678.200	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	18,210.000	417,009.000	
	GECINA SA	25,876.000	3,490,672.400	
	HAMBORNER REIT AG	32,106.000	296,338.380	
	HIBERNIA REIT PLC	306,848.000	383,560.000	
	ICADE	14,971.000	1,137,047.450	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,287.000	116,825.940	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	121,285.000	1,161,303.870	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,415.000	255,688.250	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	214,307.000	345,034.270	
	KLEPIERRE	95,503.000	2,390,440.090	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,656.000	149,065.840	
	MERCIALYS	19,022.000	207,720.240	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	158,630.000	1,506,350.480	
	MONTEA SCA	4,725.000	485,730.000	
	NSI NV	8,112.000	283,514.400	
	RETAIL ESTATES	5,045.000	362,231.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	65,804.000	5,302,486.320	
	VASTNED RETAIL	9,724.000	253,310.200	
WAREHOUSES DE PAUW	65,116.000	2,094,130.560		
WERELDHAVE NV	18,894.000	290,967.600		
XIOR STUDENT HOUSING NV	8,239.000	411,126.100		

ユーロ 小計		1,443,174.000	29,422,827.890 (3,922,357,186)	
韓国・ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,958.000	55,466,060.000	
	JR REIT XXVII	56,222.000	294,603,280.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17,860.000	111,625,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	54,509.000	334,140,170.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	39,843.000	201,605,580.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,635.000	167,879,250.000	
韓国・ウォン 小計		198,027.000	1,165,319,340.000 (115,017,019)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	937,070.000	4,319,892.700	
	LINK REIT	986,820.000	75,837,117.000	
	PROSPERITY REIT	597,000.000	1,767,120.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	451,000.000	2,052,050.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	761,000.000	3,165,760.000	
香港・ドル 小計		3,732,890.000	87,141,939.700 (1,229,572,769)	
投資証券 合計		30,799,627	71,596,680,453 (71,596,680,453)	
合計			80,171,336,712 (80,171,336,712)	

(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	0.13	-	74.76
	投資証券 152銘柄	-	74.50	
イギリス・ポンド	投資証券 34銘柄	-	5.69	5.70
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.06	0.06
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	7.06	-	7.07
カナダ・ドル	投資証券 27銘柄	-	1.94	1.94
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 30銘柄	3.34	-	3.34
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.40	0.40
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	0.05	-	4.94
	投資証券 29銘柄	-	4.88	
韓国・ウォン	投資証券 6銘柄	-	0.14	0.14
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.10	-	1.64
	投資証券 5銘柄	-	1.53	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,819,692,946
コール・ローン	132,050,479
株式	54,910,869,631
投資信託受益証券	383,170,336
投資証券	50,968,475
派生商品評価勘定	228,629,189
未収入金	1,303,806
未収配当金	116,970,308
差入委託証拠金	2,966,682,172
流動資産合計	61,610,337,342
資産合計	
61,610,337,342	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	115,793
未払金	7,186
未払解約金	31,056,000
流動負債合計	31,178,979
負債合計	
31,178,979	
純資産の部	
元本等	
元本	40,143,019,383
剰余金	
剰余金又は欠損金()	21,436,138,980
元本等合計	61,579,158,363
純資産合計	
61,579,158,363	
負債純資産合計	
61,610,337,342	

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12月12日 至 2021年6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6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	53,984,941,006円
同期中追加設定元本額	25,319,617,780円
同期中一部解約元本額	39,161,539,403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 >	7,491,219,960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)	307,673,767円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,613,207円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	7,436,367円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,517,069円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,954,016円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	16,639,321円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,162,523円
たわらノーロード 新興国株式	7,587,715,071円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,049,516,885円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,568,875,965円
たわらノーロード バランス(堅実型)	14,737,239円
たわらノーロード バランス(標準型)	52,994,421円
たわらノーロード バランス(積極型)	85,042,029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)	804,520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)	91,615,336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)	196,725,655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)	123,766,117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)	208,286,863円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	260,417円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	2,902,756円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,224,873円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	3,056,506円
たわらノーロード 全世界株式	62,074,195円
One DC 新興国株式インデックスファンド	219,465,444円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	376,788,021円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	329,145,943円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	373,034,779円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	763,735,835円
投資のソムリエ	7,155,196,558円
クルーズコントロール	559,683,863円
投資のソムリエ<DC年金>	381,583,357円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	320,081,299円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	11,169,619円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	28,686,536円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	286,156,130円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,972,920,518円
ワールドアセットバランス(基本コース)	904,352,237円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,938,450,268円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	18,481,879円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,869,554円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,708,159円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	27,779,329円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,605,236,860円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	271,417,883円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	10,763,413円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	6,679,213円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,444,774円
エマージング株式パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	16,292,083円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	180,720,260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)	294,511,568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)	148,848,923円
計	40,143,019,383円

2. 受益権の総数

40,143,019,383口

（金融商品に関する注記）

1．金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月12日 至 2021年6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	2021年6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	2021年6月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	543,919,730	
投資信託受益証券	25,868,063	
投資証券	862,937	
合計	570,650,730	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年4月20日から2021年6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	2021年6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	24,731,907	-	24,690,279	41,628
カタル・リアル	24,498,019	-	24,456,791	41,228
サウジアラビア・リアル	233,888	-	233,488	400
買建	24,731,907	-	24,946,737	214,830
アメリカ・ドル	24,731,907	-	24,946,737	214,830
合計	49,463,814	-	49,637,016	256,458

（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6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	5,986,022,601	-	6,214,279,539	228,256,938
合計	5,986,022,601	-	6,214,279,539	228,256,938

(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。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年6月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5340円 (15,340円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年6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	30,150	37.380	1,127,007.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	8,898	10.840	96,454.320	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	6.320	153,007.200	
	CREDICORP LTD	4,299	125.350	538,879.650	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	35,762	9.480	339,023.760	
	NETEASE INC-ADR	23,636	113.110	2,673,467.960	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,518	66.980	302,615.640	
	YPF SA ADR	4,248	5.720	24,298.560	
	LUKOIL SPON ADR	25,186	91.420	2,302,504.120	
	GAZPROM PAO ADR	351,271	7.666	2,692,843.480	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	72,118	3.155	227,532.290	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.948	91,375.820	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	56,784	4.966	281,989.340	
	51JOB INC ADR	2,101	74.170	155,831.170	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	7,085	31.800	225,303.000	
	NOVATEK PJSC GDR	5,500	219.100	1,205,050.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	15,867	190.210	3,018,062.070	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	10,730	36.780	394,649.400	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	38,025	36.270	1,379,166.750	
ROSNEFT OIL CO GDR	58,131	7.436	432,262.110		

NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	92,139	9.730	896,512.470	
SEVERSTAL GDR	15,471	23.480	363,259.080	
TATNEFT ADR	15,024	43.320	650,839.680	
VTB BANK OJSC GDR	112,000	1.408	157,696.000	
MAGNIT PJSC GDR	16,621	15.260	253,636.460	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	27,011	22.180	599,103.980	
21VIANET GROUP INC ADR	4,106	22.010	90,373.060	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	31.070	765,191.960	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	6,853	23.180	158,852.540	
YANDEX NV	18,499	69.820	1,291,600.180	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,716	43.880	75,298.080	
SBERBANK ADR	160,668	17.465	2,806,066.620	
PHOSAGRO PJSC GDR	8,308	21.500	178,622.000	
ADECOAGRO SA	5,000	11.430	57,150.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	10,775	55.880	602,107.000	
JOYY INC-ADR	3,647	73.700	268,783.900	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	3,303	67.450	222,787.350	
GDS HOLDINGS LTD ADR	5,777	77.770	449,277.290	
ZAI LAB LTD ADR	4,538	172.840	784,347.920	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	7,502	73.820	553,797.640	
HUYA INC ADR	4,204	15.930	66,969.720	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	38.900	226,125.700	
BILIBILI INC ADR	9,699	112.210	1,088,324.790	
NIO INC ADR	76,062	42.760	3,252,411.120	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	40,897	15.780	645,354.660	
AUTOHOME INC ADR	4,265	71.470	304,819.550	
UP FINTECH HOLDING LTD ADR	5,517	25.720	141,897.240	
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	7,360	8.030	59,100.800	
GAOTU TECHEDU INC ADR	4,275	16.140	68,998.500	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNOLOGY CO LTD ADR	7,893	12.540	98,978.220	
I-MAB ADR	2,148	73.330	157,512.840	
WEIBO CORP ADR	3,003	49.740	149,369.220	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	35.780	104,155.580	
BURNING ROCK BIOTECH LTD ADR	2,868	29.300	84,032.400	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	3,000	9.150	27,450.000	
KE HOLDINGS INC ADR	21,054	47.140	992,485.560	
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	16.050	101,692.800	
DADA NEXUS LTD ADR	4,179	30.990	129,507.210	

	JD.COM INC ADR	50,835	71.850	3,652,494.750	
	AGORA INC ADR	3,131	44.660	139,830.460	
	LI AUTO INC ADR	28,419	27.000	767,313.000	
	XPENG INC ADR	19,389	38.610	748,609.290	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	2,945	57.840	170,338.800	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	11,272	12.050	135,827.600	
	GLOBANT SA	2,498	213.710	533,847.580	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	110,946	213.070	23,639,264.220	
	MOMO INC SPON ADR	7,793	15.440	120,323.920	
	BAOZUN INC-SPN ADR	4,490	35.590	159,799.100	
	PINDUODUO INC ADR	25,812	123.200	3,180,038.400	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	24,702	69.130	1,707,649.260	
	IQIYI INC ADR	15,440	14.980	231,291.200	
	POLYUS PJSC GDR	4,381	104.000	455,624.000	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	3,761	30.760	115,688.360	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	26,312	31.610	831,722.320	
	BEIGENE LTD ADR	2,729	352.990	963,309.710	
アメリカ・ドル	小計	1,974,832		74,138,784.730 (8,115,231,377)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	5.580	637,621.020	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	94,296	5.020	473,365.920	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	107,147	22.040	2,361,519.880	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	176,404	7.470	1,317,737.880	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	251,763	16.940	4,264,865.220	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	187,397	4.060	760,831.820	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	224,384	3.810	854,903.040	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	138,597	13.700	1,898,778.900	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	159,897	4.400	703,546.800	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,454,154		13,273,170.480 (396,204,139)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	22,906	16.600	380,239.600	
イギリス・ポンド	小計	22,906		380,239.600 (58,990,372)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	166,403	2,183.000	363,257,749.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	51,564	483.550	24,933,772.200	
	ASIAN PAINTS LTD	23,101	2,950.600	68,161,810.600	
	EICHER MOTORS LTD	8,743	2,705.050	23,650,252.150	

GRASIM INDUSTRIES LTD	13,338	1,492.500	19,906,965.000	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	52,399	806.950	42,283,373.050	
SHREE CEMENT LTD	581	28,225.800	16,399,189.800	
ICICI BANK LTD	299,985	640.400	192,110,394.000	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	37,298	298.450	11,131,588.100	
STATE BANK OF INDIA LTD	106,595	432.250	46,075,688.750	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,949	696.600	7,627,073.400	
TATA STEEL LTD	37,523	1,114.450	41,817,507.350	
TATA MOTORS LTD	101,027	344.750	34,829,058.250	
JSW STEEL LTD	50,822	705.800	35,870,167.600	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	37,935	707.700	26,846,599.500	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	6,300	3,576.300	22,530,690.000	
NESTLE INDIA LTD	2,001	17,556.100	35,129,756.100	
GAIL INDIA LTD	83,449	163.500	13,643,911.500	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32,663	1,799.550	58,778,701.650	
VEDANTA LTD	48,843	271.550	13,263,316.650	
AXIS BANK LTD	134,205	744.250	99,882,071.250	
TITAN COMPANY LTD	21,618	1,738.650	37,586,135.700	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	155,474	123.950	19,271,002.300	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	6,531	1,703.650	11,126,538.150	
BHARAT ELECTRONICS LTD	82,654	152.050	12,567,540.700	
LUPIN LTD	12,780	1,228.800	15,704,064.000	
ACC LTD	3,592	2,030.300	7,292,837.600	
BAJAJ FINANCE LTD	16,003	6,086.400	97,400,659.200	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	100,287	2,561.900	256,925,265.300	
INFOSYS LTD	199,050	1,424.300	283,506,915.000	
WIPRO LTD	81,673	554.250	45,267,260.250	
MRF LTD	96	82,172.150	7,888,526.400	
INDIAN OIL CORP LTD	125,755	115.950	14,581,292.250	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	47,777	2,378.800	113,651,927.600	
TRENT LTD	9,385	876.900	8,229,706.500	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	4,770	3,325.700	15,863,589.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	64,008	968.550	61,994,948.400	
DABUR INDIA LTD	39,316	559.950	22,014,994.200	
HERO MOTOCORP LTD	7,629	3,009.000	22,955,661.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,269.300	14,425,940.100	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,250	5,292.050	38,367,362.500	
IPCA LABORATORIES LTD	2,666	2,038.450	5,434,507.700	
BHARTI AIRTEL LTD	144,412	545.150	78,726,201.800	

UNITED SPIRITS LTD	15,017	644.350	9,676,203.950	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	51,875	676.050	35,070,093.750	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,146	4,372.550	35,618,792.300	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,114	7,199.900	58,419,988.600	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,868	964.000	18,188,752.000	
HAVELLS INDIA LTD	11,619	1,023.800	11,895,532.200	
INDRAPRASTHA GAS LTD	11,498	537.650	6,181,899.700	
BIOCON LTD	21,917	414.750	9,090,075.750	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	67,610	246.700	16,679,387.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	9,353	1,470.000	13,748,910.000	
PETRONET LNG LTD	52,703	232.600	12,258,717.800	
CIPLA LTD/INDIA	30,575	974.200	29,786,165.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	41,053	1,519.700	62,388,244.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,327	6,709.650	35,742,305.550	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	53,622	3,216.800	172,491,249.600	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,203	1,612.000	27,731,236.000	
NTPC LTD	295,091	118.500	34,968,283.500	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,327	2,195.950	11,697,825.650	
YES BANK LTD	714,850	14.650	10,472,552.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	34,517	341.550	11,789,281.350	
BHARAT FORGE LTD	18,024	758.350	13,668,500.400	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	97,347	385.400	37,517,533.800	
ITC LTD	175,871	209.300	36,809,800.300	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,676	2,132.250	18,499,401.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	31,183	838.700	26,153,182.100	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,521	2,859.800	7,209,555.800	
SIEMENS INDIA LTD	3,637	2,092.250	7,609,513.250	
INFO EDGE INDIA LTD	4,882	4,732.550	23,104,309.100	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,093	885.750	16,025,874.750	
TECH MAHINDRA LTD	38,981	1,064.900	41,510,866.900	
MARICO LTD	26,696	495.550	13,229,202.800	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	30,221.250	11,423,632.500	
DLF LTD	33,709	313.650	10,572,827.850	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	143,220	241.650	34,609,113.000	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,292	846.750	26,496,501.000	
REC LTD	45,037	163.300	7,354,542.100	
BAJAJ FINSERV LTD	2,329	11,993.100	27,931,929.900	
BAJAJ AUTO LTD	3,052	4,179.900	12,757,054.800	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,592	3,207.500	17,936,340.000	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,965	1,482.050	7,358,378.250	
COAL INDIA LTD	100,287	156.500	15,694,915.500	

	INDUS TOWERS LTD	37,374	254.350	9,506,076.900	
	PI INDUSTRIES LTD	4,133	2,832.750	11,707,755.750	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	2,748	4,034.850	11,087,767.800	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	23,447	1,233.500	28,921,874.500	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	48,563	689.250	33,472,047.750	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,425	3,077.750	7,463,543.750	
	BANDHAN BANK LTD	38,990	320.300	12,488,497.000	
	ADANI TOTAL GAS LTD	16,897	1,594.050	26,934,662.850	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,249	565.750	15,416,121.750	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	12,184	1,103.750	13,448,090.000	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	12,556	809.100	10,159,059.600	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	16,803	1,589.900	26,715,089.700	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,810	3,194.500	28,143,545.000	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	11,517	1,501.650	17,294,503.050	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	19,044	581.400	11,072,181.600	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	4,893	1,787.450	8,745,992.850	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	24,046	997.550	23,987,087.300	
インド・ルビー	小計	5,026,543		3,722,844,880.100 (5,621,495,769)	
インドネシ ア・ルビア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,420.000	1,383,514,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,470,900	865.000	1,272,328,500.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	84,801	22,600.000	1,916,502,600.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,250.000	2,205,625,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	480,500	5,300.000	2,546,650,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,306,700	5,400.000	7,056,180,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,139,900	3,480.000	10,926,852,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	386,800	7,000.000	2,707,600,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	33,600.000	1,088,640,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	67,800	11,650.000	789,870,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	8,500.000	1,621,800,000.000	
	BANK MANDIRI	1,183,100	6,200.000	7,335,220,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,422,100	4,300.000	14,715,030,000.000	

	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	344,300	5,675.000	1,953,902,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,005,700	1,440.000	1,448,208,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	149,800	10,325.000	1,546,685,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	616,700	33,100.000	20,412,770,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,210.000	1,130,261,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,150.000	1,344,750,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	3,070.000	1,637,231,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,245.000	2,139,283,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	425,600	2,820.000	1,200,192,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	18,583,201		88,379,095,100.000 (680,519,032)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	102.990	909,607.680	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	15.390	83,106.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	49.880	149,640.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	13.230	158,760.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	1,800	123.640	222,552.000	
	UNISPLENDOUR CORP LTD	7,540	22.360	168,594.400	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	8.250	134,475.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	13.710	261,861.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	28.400	113,600.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	187.630	225,156.000	
	JOYOUNG CO LTD	5,100	36.590	186,609.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,400	34.040	558,256.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	21.010	157,575.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	900	411.450	370,305.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	21.900	226,227.000	
	YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	18.410	121,506.000	

MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	71.100	376,830.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	18.350	108,265.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	18.530	353,923.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	3.850	91,630.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	24.440	161,304.000	
GEM CO LTD	29,100	9.750	283,725.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	64.390	444,291.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	7.000	130,200.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	2,400	95.010	228,024.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	26.200	224,481.600	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	43.660	257,768.640	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	31.350	218,196.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	1,900	29.460	55,974.000	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	78.250	211,275.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	26.050	171,930.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	49.050	166,770.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	46.640	237,864.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	18.070	27,105.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	15.760	40,976.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	76.680	352,728.000	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD	12,400	36.780	456,072.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	10.330	113,630.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	22.390	188,076.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,800	63.910	1,073,688.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	4,800	183.000	878,400.000	

ADDSINO CO LTD	10,200	19.020	194,004.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	15.440	172,928.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	7.460	234,244.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	14.330	80,248.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	5.610	80,223.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	15.730	42,942.900	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	20.310	52,806.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	38.280	298,584.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	17.850	896,962.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	26.010	156,060.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	142.310	455,392.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	30.450	108,706.500	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	15.840	236,016.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.800	149,860.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	8.770	75,422.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	12,480	87.010	1,085,884.800	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	80.030	44,816.800	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	30.860	212,934.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.350	242,570.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	36.750	180,075.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.080	154,224.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	11.680	245,280.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	46.000	345,000.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	40.810	204,050.000	

WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	26.070	172,062.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	4,800	266.710	1,280,208.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	62.700	695,970.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	7.910	118,254.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.690	153,813.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	2,400	30.070	72,168.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	17.050	101,277.000	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,800	38.620	146,756.000	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	6.050	96,800.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	113.020	237,342.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	10.150	370,272.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	12.260	175,318.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	40.380	1,237,808.520	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.960	191,400.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	9.730	432,985.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	14.190	282,381.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	21.400	511,460.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	8.460	32,148.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	61.390	828,765.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.510	262,797.000	
GOERTEK INC	8,700	37.780	328,686.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.950	169,335.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	19,100	41.110	785,201.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	27.060	395,076.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	7.500	355,500.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.500	212,250.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	8.060	303,056.000	

CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	12,400	23.290	288,796.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.400	190,680.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	8,200	33.850	277,570.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	112.700	428,260.000	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUSTRY GROUP	10,700	27.360	292,752.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	33,408	31.290	1,045,336.320	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	4,800	234.750	1,126,800.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,000	303.050	4,242,700.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	7.460	155,168.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	6.400	151,680.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,600	5.940	746,064.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	65,300	11.210	732,013.000	
MIDEA GROUP CO LTD	14,100	75.400	1,063,140.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	10.980	186,660.000	
PING AN BANK CO LTD	61,400	24.200	1,485,880.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	53,580	14.360	769,408.800	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	180,400	4.690	846,076.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,300	25.650	1,059,345.000	
ZTE CORP	24,300	33.110	804,573.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	9.900	282,150.000	
WEICHAI POWER CO LTD	17,000	17.400	295,800.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	50.500	212,100.000	
GF SECURITIES CO LTD	52,200	15.610	814,842.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	12.120	255,732.000	
BYD CO LTD	7,700	214.110	1,648,647.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	7.920	270,072.000	

GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	30	100.700	3,021.000	
LOMON BILLIONS GROUP CO LTD	11,000	35.650	392,150.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	9.420	121,518.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	48.860	141,694.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	26.180	209,440.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,500	228.200	342,300.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	12.010	43,236.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	21.930	121,711.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	232.450	278,940.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	13.140	204,984.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	44.260	292,116.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	68.810	41,286.000	
NINESTAR CORP	5,700	26.710	152,247.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	13.900	97,578.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.300	111,540.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	14.670	176,040.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	58.500	393,120.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	112.680	180,288.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	394.000	197,000.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	10.930	165,043.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	19.770	104,781.000	
SF HOLDING CO LTD	15,000	71.100	1,066,500.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	7.100	167,560.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	52.390	340,535.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	8.440	538,387.600	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	32.140	437,104.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	5,000	79.610	398,050.000	

SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	118.110	347,243.400	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	16,400	27.230	446,572.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	122.900	380,990.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	13.130	295,425.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	56.870	88,717.200	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	38.940	202,488.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	81.400	256,410.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	179.500	592,350.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	128.110	345,897.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	81.500	252,650.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	151.990	319,179.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	6.810	160,716.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	100.000	432,000.000	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	15.230	144,685.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	39.800	119,400.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	30.520	238,056.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	92.750	77,910.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	72.590	195,993.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	2,080	70.030	145,662.400	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	91.130	121,202.900	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	123.230	160,199.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	71.120	213,360.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	163.790	327,580.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	10.860	137,922.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	13.530	365,310.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	143.640	272,916.000	

NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	9.140	89,572.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	12.560	180,864.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,600	486.100	2,236,060.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	25.870	137,111.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.860	152,830.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	264.750	317,700.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	106.550	432,593.000	
SG MICRO CORP	600	291.780	175,068.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	8,500	434.630	3,694,355.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	141.600	483,705.600	
WUXI APPTTEC CO LTD	10,872	149.800	1,628,625.600	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,500	93.020	325,570.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	600	463.000	277,800.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	14.210	515,823.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	193.410	638,253.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.630	557,814.770	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	285.170	1,083,646.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.990	515,109.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.270	185,459.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	175.280	157,752.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	5.790	1,005,723.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.380	579,426.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	94.800	578,280.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	800	100.100	80,080.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	225.000	135,000.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.910	544,519.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	5.200	1,101,360.000	

AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.320	911,008.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.100	260,400.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.580	192,818.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	34.640	346,400.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	20.430	316,665.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	73,900	56.350	4,164,265.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	42,100	70.010	2,947,421.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	68,800	22.030	1,515,664.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	97,800	10.230	1,000,494.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	4.670	645,394.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	23,900	19.950	476,805.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,400	2,238.480	9,849,312.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.880	617,320.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	25.660	1,449,790.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	33.200	1,019,240.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	4.730	181,159.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	75,500	20.320	1,534,160.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	78,100	6.740	526,394.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	109,700	3.820	419,054.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	75,800	11.900	902,020.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	6.320	523,928.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	16,300	39.410	642,383.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.920	432,468.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	70,500	7.940	559,770.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	48.430	678,020.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	19.860	665,310.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	4.120	32,136.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	2,300	42.460	97,658.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	13.050	588,555.000	

JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	25,152	73.000	1,836,096.000	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	26,700	21.430	572,181.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	55,000	16.190	890,450.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	156,800	5.300	831,040.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	48.900	728,610.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	28.250	785,350.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	27,000	29.320	791,640.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	6.790	69,937.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	65.600	518,240.000	
GEMDALE CORP	10,600	10.640	112,784.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	29.610	654,381.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	10,300	114.160	1,175,848.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	11.070	1,026,189.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	9.630	659,655.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	9.650	304,940.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	25,100	30.430	763,793.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.540	135,292.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,300	313.460	2,288,258.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	600	109.570	65,742.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	25,000	3.990	99,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	95,100	5.140	488,814.000	
AIR CHINA LTD	28,400	8.410	238,844.000	
TBEA CO LTD	26,700	11.710	312,657.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	163,800	3.010	493,038.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	3.850	324,555.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	36,100	17.140	618,754.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	48.850	161,205.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	30.360	209,484.000	

SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.100	174,930.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	25.140	208,662.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	12.950	191,660.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	13.810	66,288.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	11.980	283,926.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	27,900	21.680	604,872.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	10.470	304,677.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	16.730	127,148.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	54,900	25.030	1,374,147.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	60,200	5.450	328,090.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	9.140	298,878.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	9.830	277,206.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	20.010	190,495.200	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	31.240	237,424.000	
BBMG CORP	54,200	2.740	148,508.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	5.400	158,760.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	14.960	278,256.000	
YUTONG BUS CO LTD	12,500	13.400	167,500.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	5.250	202,650.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	20.230	32,368.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	10.670	160,252.730	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	12.950	99,715.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	5,640	88.960	501,734.400	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	35.300	573,625.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.310	206,337.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.930	172,870.000	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,800	56.210	101,178.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	8.160	154,224.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	7.470	191,232.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	54.150	249,090.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.460	142,128.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	6.030	237,582.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	8.310	162,876.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	406.880	732,384.000	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	12.400	111,600.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	2,700	487.310	1,315,737.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	18.820	22,584.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	26,300	5.270	138,601.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	12.440	311,000.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	7.530	195,027.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	66.410	205,871.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	10.300	232,780.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.800	99,560.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	32.750	176,850.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	10.370	130,662.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.220	186,600.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	45.550	191,310.000	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LTD	6,400	18.990	121,536.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	21.100	123,013.000	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	11,900	11.850	141,015.000	

JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	13.910	164,138.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	22.720	102,240.000	
TONGWEI CO LTD	10,300	35.600	366,680.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,430	49.850	71,285.500	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	174.590	436,475.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	60.330	319,749.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	21.070	117,992.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	34.400	415,896.000	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	16.110	430,878.060	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	2,224	79.530	176,874.720	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	4,000	12.140	48,560.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	23.700	372,090.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	117.880	200,396.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	57.400	281,260.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	12,800	103.650	1,326,720.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	208.770	375,786.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	12.290	397,593.790	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	13,224	136.160	1,800,579.840	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	55.100	275,500.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	17.440	20,928.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	57.660	334,428.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	11.140	147,048.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	54,300	17.320	940,476.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	5.080	303,276.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	63.620	216,308.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	6.080	100,320.000	

	BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	7.690	700,559.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	15.490	365,564.000	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	900	43.870	39,483.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	78.110	111,697.300	
	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	23.070	46,140.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	127.260	152,712.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	78.880	118,320.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.740	421,008.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	50,800	14.020	712,216.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	386.580	309,264.000	
	TOLY BREAD CO LTD	5,040	32.900	165,816.000	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	60.650	173,459.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	60.700	178,458.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	9.720	188,568.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	4,200	62.180	261,156.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	17.650	282,400.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	83.750	502,500.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	5.850	170,820.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	45.280	484,496.000	
	オフショア・人民元 小計	8,194,539		156,467,698.470 (2,682,325,755)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	250,492	17.850	4,471,282.200	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	90,299	5.334	481,654.860	
	OOREDOO QSC	40,049	6.978	279,461.920	
	QATAR FUEL QSC	28,478	17.840	508,047.520	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24,605	16.470	405,244.350	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.470	483,235.160	
	INDUSTRIES QATAR QSC	90,288	12.800	1,155,686.400	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,819	17.300	1,311,668.700	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	138,961	3.026	420,495.980	
	MASRAF AL RAYAN	242,381	4.437	1,075,444.490	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.121	432,099.320	

	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	251,921	1.922	484,192.160	
カタール・リアル 小計		1,422,770		11,508,513.060 (341,342,497)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	254,684	0.750	191,013.000	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	126,248	0.591	74,612.560	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	418,385	0.839	351,025.010	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	58,560	0.921	53,933.760	
	MABANEE CO KPSC	53,293	0.722	38,477.540	
	BOUBYAN BANK KSCP	83,909	0.700	58,736.300	
クウェート・ディナール 小計		995,079		767,798.170 (279,954,569)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	23,125	23,560.000	544,825,000.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,385.000	670,733,550.000	
	BANCOLOMBIA SA	12,950	28,100.000	363,895,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	28,300.000	994,150,700.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	4,847	19,740.000	95,679,780.000	
コロンビア・ペソ 小計		357,281		2,669,284,030.000 (81,202,289)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	15,478	74.000	1,145,372.000	
	JARIR MARKETING CO	4,004	209.600	839,238.400	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	83.200	345,696.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	18,500	33.550	620,675.000	
	SAUDI BRITISH BANK	44,520	31.350	1,395,702.000	
	AL RAJHI BANK	70,298	105.600	7,423,468.800	
	ARAB NATIONAL BANK	34,464	22.400	771,993.600	
	BANK ALBILAD	26,491	36.950	978,842.450	
	BANK AL-JAZIRA	35,440	18.300	648,552.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,102	36.900	1,369,063.800	
	RIYAD BANK	73,924	26.250	1,940,505.000	
	SAUDI TELECOM CO	36,286	134.400	4,876,838.400	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	12,050	119.600	1,441,180.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	50,439	124.600	6,284,699.400	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	65.100	421,652.700	
	SAUDI ELECTRICITY CO	45,963	24.440	1,123,335.720	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	18,628	36.600	681,784.800	
	SAVOLA GROUP	14,538	42.900	623,680.200	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	18.940	426,680.320		

	ALMARAI CO JSC	16,575	62.500	1,035,937.500	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	11.760	332,937.360	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,278	28.200	459,039.600	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	80.300	674,118.500	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	39,276	17.660	693,614.160	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	10.520	326,235.720	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	21.880	234,487.960	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	21,818	14.740	321,597.320	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,968	122.000	362,096.000	
	ALINMA BANK	61,501	20.180	1,241,090.180	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	130.200	457,783.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,062	57.100	1,545,240.200	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	45.900	390,884.400	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	186.200	628,797.400	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	121,247	35.400	4,292,143.800	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,712	166.800	452,361.600	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	124,979	53.900	6,736,368.100	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,099,544		53,543,693.590 (1,565,082,164)	
タイ・パーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	121.000	3,351,700.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	36,300	35.500	1,288,650.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	103,600	11.200	1,160,320.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	34,200	53.000	1,812,600.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	43,200	104.000	4,492,800.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	509,355	3.180	1,619,748.900	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	12,400	183.500	2,275,400.000	
	SHIN CORP PCL	99,500	64.500	6,417,750.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	163,400	27.250	4,452,650.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	69,700	173.500	12,092,950.000	

HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	493,920	14.500	7,161,840.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	14,300	574.000	8,208,200.000	
PTT PCL	578,800	40.750	23,586,100.000	
THAI UNION GROUP PCL- NVDR	147,100	18.400	2,706,640.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	32,500	71.500	2,323,750.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	722,300	8.350	6,031,205.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	47,350	424.000	20,076,400.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	259,800	65.000	16,887,000.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	93,800	55.250	5,182,450.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	510,600	22.800	11,641,680.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	134.000	5,333,200.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	169,510	33.000	5,593,830.000	
THAI OIL PCL NVDR	83,100	57.750	4,799,025.000	
CP ALL PCL NVDR	356,700	61.750	22,026,225.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	356,100	9.750	3,471,975.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	70,645	120.000	8,477,400.000	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	69,922	42.250	2,954,204.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	147,408	61.000	8,991,888.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	76,000	63.000	4,788,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	645,000	8.550	5,514,750.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	44.750	2,532,850.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	34.750	6,842,275.000	
OSOTSPA PCL NVDR	120,500	37.000	4,458,500.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	19.800	2,084,940.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	5.050	1,785,680.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	91,933	37.250	3,424,504.250	
SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	56.000	5,062,400.000	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	30,300	74.750	2,264,925.000	
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	36,600	42.500	1,555,500.000	

	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	30.250	5,947,150.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	132.500	3,471,500.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	62.250	3,803,475.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	75.500	3,707,050.000	
タイ・パーツ 小計		7,429,143		261,661,080.650 (921,047,004)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,704	794.500	4,531,828.000	
	CEZ	7,596	637.500	4,842,450.000	
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	78.800	2,126,733.200	
チェコ・コルナ 小計		40,289		11,501,011.200 (60,438,964)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,631,383	38.900	141,260,798.700	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,773	32,355.000	89,720,415.000	
	BANCO DE CHILE	2,874,683	72.660	208,874,466.780	
	EMPRESAS CMPC SA	60,153	1,700.000	102,260,100.000	
	EMPRESAS COPEC SA	23,509	7,140.000	167,854,260.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	6,581.000	69,633,561.000	
	ENEL AMERICAS SA	835,617	96.600	80,720,602.200	
	COLBUN SA	580,423	108.000	62,685,684.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,180	34,000.000	278,120,000.000	
	FALABELLA SA	48,873	3,140.000	153,461,220.000	
	CENCOSUD SA	81,121	1,421.800	115,337,837.800	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,280.100	37,418,603.100	
	ENEL CHILE SA	1,469,615	42.050	61,797,310.750	
チリ・ペソ 小計		9,656,142		1,569,144,859.330 (238,243,264)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	5.520	1,318,380.240	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	15.700	704,898.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	19.060	1,833,305.160	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	179.500	837,906.000	
	KOC HOLDING AS	53,770	19.390	1,042,600.300	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	8.180	736,200.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	62,654	16.500	1,033,791.000	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	114,153	8.480	968,017.440	
	TURKIYE IS BANKASI	66,205	5.340	353,534.700	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,201	103.100	639,323.100	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,755	62.700	1,740,238.500	
トルコ・リラ 小計		805,327		11,208,195.040 (145,548,500)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	8,393	8,110.000	68,067,230.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	26,296	2,388.000	62,794,848.000	
	OTP BANK NYRT	13,167	16,680.000	219,625,560.000	
ハンガリー・フォロント 小計		47,856		350,487,638.000 (135,288,579)	
パキスタン・ルビー	LUCKY CEMENT LTD	7,000	914.890	6,404,230.000	
	MCB BANK LTD	12,400	165.600	2,053,440.000	
	HABIB BANK LTD	19,300	134.510	2,596,043.000	
パキスタン・ルビー 小計		38,700		11,053,713.000 (7,848,136)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	425,500	37.700	16,041,350.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	94,330	40.850	3,853,380.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	107,520	85.100	9,149,952.000	
	AYALA CORP	17,253	808.500	13,949,050.500	
	GLOBE TELECOM INC	1,420	1,820.000	2,584,400.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	46,120	150.000	6,918,000.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	60.000	11,979,000.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	14,940	203.600	3,041,784.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	61,575	49.100	3,023,332.500	
	BDO UNIBANK INC	125,723	109.000	13,703,807.000	
	PLDT INC	5,260	1,310.000	6,890,600.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	590,375	37.450	22,109,543.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	54,840	145.000	7,951,800.000	
	SM INVESTMENTS CORP	13,953	1,009.000	14,078,577.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	4.060	3,661,714.000	
MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	277.600	4,916,296.000		
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	600.000	3,960,600.000		
フィリピン・ペソ 小計		2,684,670		147,813,187.250 (338,699,137)	
ブラジル・リアル	BRF SA	29,692	27.950	829,891.400	
	VALE SA	230,721	111.830	25,801,529.430	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	79,000	6.230	492,170.000	
	RAIA DROGASIL SA	70,100	27.990	1,962,099.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	11,250	45.110	507,487.500	

CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	45.320	892,804.000	
BANCO DO BRASIL SA	52,000	35.500	1,846,000.000	
ITAUSA SA	272,560	11.920	3,248,915.200	
LOJAS AMERICANAS SA	53,174	22.530	1,198,010.220	
GERDAU SA	69,130	32.140	2,221,838.200	
PETROLEO BRASILEIRO SA	214,810	29.530	6,343,339.300	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	39,200	26.780	1,049,776.000	
PETROLEO BRASILEIRO SA	279,912	28.680	8,027,876.160	
CCR SA	65,320	13.910	908,601.200	
WEG SA	100,244	33.930	3,401,278.920	
BANCO BRADESCO SA PRAF	292,193	28.150	8,225,232.950	
BANCO BRADESCO SA	78,457	24.150	1,894,736.550	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,106	44.830	1,887,611.980	
BRADESPAR SA	10,200	70.230	716,346.000	
SUZANO SA	45,075	58.700	2,645,902.500	
CPFL ENERGIA SA	20,700	29.860	618,102.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	284,247	33.140	9,419,945.580	
B2W CIA DIGITAL	9,400	68.120	640,328.000	
BRASKEM SA	12,300	59.460	731,358.000	
ENGIE BRASIL SA	16,587	41.690	691,512.030	
ALPARGATAS SA	8,500	48.220	409,870.000	
LOCALIZA RENT A CAR	36,389	65.400	2,379,840.600	
LOJAS RENNER SA	57,237	47.620	2,725,625.940	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	37,904	20.480	776,273.920	
COSAN SA	57,600	25.510	1,469,376.000	
TOTVS SA	23,600	35.800	844,880.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	62,400	25.160	1,569,984.000	
JBS SA	63,900	29.310	1,872,909.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	56,717	13.720	778,157.240	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	17,998	38.290	689,143.420	
HYPERA SA	18,200	36.320	661,024.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	367,348	16.000	5,877,568.000	
MAGAZINE LUIZA SA	177,700	20.280	3,603,756.000	
TELEFONICA BRASIL SA	32,628	47.160	1,538,736.480	
VIA VAREJO S/A	68,300	14.560	994,448.000	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	42,300	24.700	1,044,810.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	31,600	86.900	2,746,040.000	

	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	59,100	15.580	920,778.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	23.590	705,341.000	
	AMBEV SA	277,195	19.320	5,355,407.400	
	NATURA &CO HOLDING SA	54,400	56.640	3,081,216.000	
	TIM SA	25,700	13.060	335,642.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,800	70.070	1,037,036.000	
	RUMO SA	80,500	21.090	1,697,745.000	
ブラジル・リアル 小計		4,099,994		129,318,300.120 (2,798,305,764)	
ポーランド・ズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	8,662	197.400	1,709,878.800	
	BANK PEKAO SA	9,730	99.080	964,048.400	
	ORANGE POLSKA SA	30,783	6.760	208,093.080	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	18,695	82.780	1,547,572.100	
	LPP SA	67	11,060.000	741,020.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,600	261.000	417,600.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	174.000	806,142.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	53,609	40.130	2,151,329.170	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	88,535	6.426	568,925.910	
	CYFROWY POLSAT SA	12,239	30.560	374,023.840	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	10.395	542,535.840	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	37,670	38.590	1,453,685.300	
	DINO POLSKA SA	2,109	271.700	573,015.300	
ALLEGRO.EU SA	21,992	58.400	1,284,332.800		
ポーランド・ズロチ 小計		342,516		13,342,202.540 (397,929,857)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	81,400	2.930	238,502.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	358,900	4.620	1,658,118.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.240	997,672.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	6.310	566,133.200	
	RHB BANK BHD	83,480	5.360	447,452.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.980	252,966.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	262,700	4.800	1,260,960.000	
	GENTING BHD	107,200	5.150	552,080.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	25,256	18.100	457,133.600	

	HONG LEONG BANK BHD	34,908	18.840	657,666.720	
	IOI CORP BHD	190,813	4.020	767,068.260	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	22,600	21.800	492,680.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	25.900	300,440.000	
	MALAYAN BANKING BHD	254,375	8.180	2,080,787.500	
	MISC BHD	100,880	6.870	693,045.600	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	134.800	552,680.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	18.560	858,585.600	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	18.820	419,686.000	
	PETRONAS GAS BHD	39,600	16.000	633,600.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	219,800	2.990	657,202.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	6.090	362,355.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	139,650	9.930	1,386,724.500	
	QL RESOURCES BHD	50,950	5.950	303,152.500	
	DIALOG GROUP BHD	233,944	2.940	687,795.360	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	849,850	4.200	3,569,370.000	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	3.620	299,736.000	
	SUPERMAX CORP BHD	74,571	3.820	284,861.220	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.270	316,665.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	107,200	8.420	902,624.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	3.820	649,782.000	
	MAXIS BHD	130,800	4.510	589,908.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	136,200	8.090	1,101,858.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	113,100	5.390	609,609.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	35,700	4.300	153,510.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	157,600	5.130	808,488.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	93,400	4.230	395,082.000	
	マレーシア・リンギット 小計	4,797,757		26,965,979.860 (716,825,856)	
メキシコ・ペ ソ	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,000	44.740	3,802,900.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,615	218.710	2,321,606.650	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	162.600	2,904,036.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	65.230	2,276,527.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	154,000	131.630	20,271,020.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	53,025	54.770	2,904,179.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,635	297.360	2,270,343.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	86,300	36.720	3,168,936.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,040	366.460	4,412,178.400	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	184,252	91.660	16,888,538.320	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,954,178	15.920	31,110,513.760	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	96,600	20.600	1,989,960.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	23,100	111.800	2,582,580.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	307,300	65.210	20,039,033.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,410	224.970	5,491,517.700	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	19.310	1,492,663.000	
	BECLÉ SAB DE CV	38,400	53.240	2,044,416.000	
メキシコ・ペソ	小計	3,166,915		125,970,948.680 (700,222,115)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,162	15.120	199,009.440	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.857	155,922.580	
	OPAP SA	11,246	13.700	154,070.200	
	JUMBO SA	3,560	15.560	55,393.600	
ユーロ	小計	213,038		564,395.820 (75,239,607)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,472	130,500.000	192,096,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,774	25,350.000	44,970,900.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,068	115,500.000	238,854,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,915	215,500.000	412,682,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	1,858	49,500.000	91,971,000.000	
	COWAY CO LTD	3,621	78,700.000	284,972,700.000	
	KT&G CORP	7,210	83,900.000	604,919,000.000	
	S-1 CORPORATION	794	82,400.000	65,425,600.000	
	CJ CORP	1,001	111,000.000	111,111,000.000	
	KAKAO CORP	18,304	133,500.000	2,443,584,000.000	
	CJ ENM CO LTD	299	166,600.000	49,813,400.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	37,200.000	92,888,400.000	
	KMW CO LTD	1,334	54,100.000	72,169,400.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,372	328,000.000	778,016,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	11,262	9,670.000	108,903,540.000	
	NCSOFT CORPORATION	993	849,000.000	843,057,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,606	15,750.000	230,044,500.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	8,781	23,400.000	205,475,400.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	566	1,532,000.000	867,112,000.000		

LG CHEM LTD	2,677	807,000.000	2,160,339,000.000	
LG CHEM LTD	499	370,000.000	184,630,000.000	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	715,000.000	72,930,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	26,101	42,450.000	1,107,987,450.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	15,510	43,900.000	680,889,000.000	
S-OIL CORP	2,460	103,500.000	254,610,000.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	6,526	43,750.000	285,512,500.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	4,410.000	89,311,320.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,368	45,200.000	107,033,600.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	1,996	144,500.000	288,422,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,117	267,000.000	298,239,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,675	99,400.000	166,495,000.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,505	139,000.000	348,195,000.000	
HYUNDAI MOBIS	3,978	287,000.000	1,141,686,000.000	
SK HYNIX INC	32,124	123,000.000	3,951,252,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,534	55,800.000	252,997,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	115,500.000	174,982,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	8,132	236,000.000	1,919,152,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,533	50,700.000	229,823,100.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,371	10,650.000	195,651,150.000	
KIA CORPORATION	15,661	89,200.000	1,396,961,200.000	
KOREA ZINC CO LTD	465	435,500.000	202,507,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	15,823	26,000.000	411,398,000.000	
KOREAN AIR CO LTD	10,084	33,900.000	341,847,600.000	
CJ LOGISTICS	451	165,000.000	74,415,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	209,500.000	251,190,500.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,020	81,400.000	83,028,000.000	
HLB INC	4,888	33,350.000	163,014,800.000	
LG ELECTRONICS INC	6,395	150,000.000	959,250,000.000	
LG CORP	4,786	98,100.000	469,506,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	12,900.000	118,202,700.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,631	42,650.000	197,512,150.000	
NAVER CORP	7,239	373,500.000	2,703,766,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,241	105,500.000	236,425,500.000	
AMOREPACIFIC GROUP	1,094	77,700.000	85,003,800.000	

KANGWON LAND INC	3,615	28,350.000	102,485,250.000	
POSCO	4,393	334,000.000	1,467,262,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,811	21,250.000	187,233,750.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,244	610,000.000	1,978,840,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,503	175,000.000	613,025,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	324,000.000	132,840,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	279,951	81,000.000	22,676,031,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	26,770	6,990.000	187,122,300.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	47,221	73,900.000	3,489,631,900.000	
SHINSEGAE CO LTD	272	305,000.000	82,960,000.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	75,600.000	118,162,800.000	
YUHAN CORP	4,055	64,800.000	262,764,000.000	
HANON SYSTEMS	10,146	17,300.000	175,525,800.000	
GS HOLDINGS CORP	2,879	47,700.000	137,328,300.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,712	22,950.000	337,640,400.000	
CELLTRION INC	5,715	265,500.000	1,517,332,500.000	
HANA FINANCIAL GROUP	18,154	46,000.000	835,084,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,132	189,500.000	214,514,000.000	
CELLTRION PHARM INC	988	137,700.000	136,047,600.000	
LOTTE SHOPPING CO	538	121,500.000	65,367,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,275	81,500.000	348,412,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	1,954	281,500.000	550,051,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,022	269,500.000	814,429,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	466	465,000.000	216,690,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	9,792	6,600.000	64,627,200.000	
LG INNOTEK CO LTD	764	210,000.000	160,440,000.000	
SK HOLDINGS CO LTD	1,893	281,500.000	532,879,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	23,443	57,200.000	1,340,939,600.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,664	34,500.000	126,408,000.000	
HANMI PHARM CO LTD	287	328,000.000	94,136,000.000	
FILA HOLDINGS CORP	2,517	55,500.000	139,693,500.000	
SEEGENE INC	1,958	61,900.000	121,200,200.000	
E-MART CO LTD	1,007	160,000.000	161,120,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	3,856	53,300.000	205,524,800.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	2,305	72,900.000	168,034,500.000	
BGF RETAIL CO LTD	344	187,500.000	64,500,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,760	118,500.000	208,560,000.000	

	SK CHEMICALS CO LTD	409	264,000.000	107,976,000.000	
	NETMARBLE CORP	901	144,500.000	130,194,500.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	32,854	11,400.000	374,535,600.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,169	121,000.000	141,449,000.000	
	HYBE CO LTD	620	272,500.000	168,950,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,198	188,000.000	413,224,000.000	
	ALTEOGEN INC	1,059	74,900.000	79,319,100.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,017	140,500.000	704,888,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	991	855,000.000	847,305,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	61,500.000	127,920,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,922	48,900.000	142,885,800.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,096	117,100.000	596,741,600.000	
韓国・ウォン 小計		881,537		73,212,466,510.000 (7,226,070,445)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	16.580	1,110,860.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	9.510	855,900.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	48,000	5.240	251,520.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	109.400	700,160.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	74,000	43.200	3,196,800.000	
	BEIJING ENTERPRISES	21,500	27.550	592,325.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	180,000	2.870	516,600.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	244,000	17.820	4,348,080.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	11.320	792,400.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	27,400	35.450	971,330.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	43,500	53.050	2,307,675.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	7.300	1,036,600.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	543,600	12.240	6,653,664.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	229,120	19.560	4,481,587.200	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	188,888	36.400	6,875,523.200	
	CITIC LTD	351,000	9.070	3,183,570.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	96,000	5.290	507,840.000	
	LENOVO GROUP LTD	442,000	9.250	4,088,500.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,166,000	3.440	4,011,040.000	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	13.800	1,526,142.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,453,200	4.140	6,016,248.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	49,000	15.920	780,080.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	161,000	27.900	4,491,900.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	47,100	142.700	6,721,170.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	208,000	6.780	1,410,240.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	62,000	6.470	401,140.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	63,200	9.230	583,336.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	110,000	11.660	1,282,600.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	4.260	621,960.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	87,000	28.300	2,462,100.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	11.480	1,107,820.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	44,000	9.780	430,320.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	184,800	29.300	5,414,640.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	42.700	1,900,150.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	356,000	22.000	7,832,000.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	2.620	565,920.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	49.050	2,746,800.000	
BYD CO LTD	45,000	212.000	9,540,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	7.240	854,320.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	540,000	1.050	567,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	4.540	1,278,427.680	
MMG LTD	184,000	3.870	712,080.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	6.310	441,700.000	
CHINA YOUZAN LTD	580,000	1.570	910,600.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	417,788	7.480	3,125,054.240	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	5.600	756,000.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	91,200	10.160	926,592.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	196,000	23.450	4,596,200.000	

CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	424,000	15.840	6,716,160.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	329,000	11.300	3,717,700.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	156,000	17.320	2,701,920.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	16.800	2,140,992.000	
TINGYI HOLDING CORP	106,000	14.720	1,560,320.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	28,000	86.500	2,422,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	188,000	11.440	2,150,720.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	238,000	5.040	1,199,520.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	87,333	71.050	6,205,009.650	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	68,000	6.660	452,880.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	633,250	8.470	5,363,627.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	165,000	45.950	7,581,750.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	337,000	600.500	202,368,500.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	363,500	80.950	29,425,325.000	
LI NING CO LTD	134,000	72.700	9,741,800.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	260,000	3.030	787,800.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	1.240	854,657.600	
CHINA POWER INTERNATIONAL	439,000	1.680	737,520.000	
AIR CHINA / HONG KONG	76,000	6.130	465,880.000	
ZTE CORP	44,288	22.700	1,005,337.600	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	206,000	17.480	3,600,880.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	127,500	19.200	2,448,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	414,205	5.190	2,149,723.950	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	5.670	625,117.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,500	53.900	2,236,850.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	5,603,530	6.240	34,966,027.200	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	49,100	188.300	9,245,530.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	140,000	7.560	1,058,400.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	44,000	10.820	476,080.000	
MINTH GROUP LTD	32,000	34.600	1,107,200.000	

SSY GROUP LTD	28,000	5.180	145,040.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	84,000	11.000	924,000.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	242,000	9.850	2,383,700.000	
BANK OF CHINA LTD	4,475,200	2.820	12,620,064.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	67,500	22.650	1,528,875.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	8.990	539,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	9.640	956,288.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	226,970	69.200	15,706,324.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,276,235	5.010	16,413,937.350	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	49,500	7.920	392,040.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	17.140	916,990.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.490	584,924.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	33,000	26.250	866,250.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	38.550	1,206,615.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	453,142	9.570	4,336,568.940	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	4.870	1,154,190.000	
CHINA CITIC BANK-H	417,800	4.160	1,738,048.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65,000	11.900	773,500.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,400	190.600	8,272,040.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	64,000	153.800	9,843,200.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	25.900	518,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	11.740	1,984,388.720	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	2.870	861,000.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	7.490	636,650.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	4.020	651,240.000	
KINGSOFT CORP LTD	60,000	54.050	3,243,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	16.860	590,100.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	168,000	4.080	685,440.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	8.690	964,590.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	29,000	50.200	1,455,800.000	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	320,000	5.880	1,881,600.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	150,800	26.150	3,943,420.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	110,000	11.220	1,234,200.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	22.500	2,070,000.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	83,500	6.000	501,000.000	
SINOPHARM GROUP CO	86,000	26.100	2,244,600.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	112,000	7.890	883,680.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	178,527	7.020	1,253,259.540	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	11.040	1,661,520.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	7.680	829,440.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	3.260	645,480.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	210,000	12.300	2,583,000.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	30,100	17.360	522,536.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	155,000	29.400	4,557,000.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	61,200	8.600	526,320.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	8.910	801,900.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	106,500	46.350	4,936,275.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	43,100	28.150	1,213,265.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	364,656	4.050	1,476,856.800	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	125,000	3.340	417,500.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	31,000	12.940	401,140.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	44,000	19.980	879,120.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	3.220	805,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,447,000	2.800	4,051,600.000	

ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	30,000	62.300	1,869,000.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	8.230	847,690.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	33,000	69.500	2,293,500.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	20.500	2,234,500.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	118,000	8.100	955,800.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	93,600	7.100	664,560.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	461,000	2.900	1,336,900.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	25,500	60.450	1,541,475.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	226,000	6.840	1,545,840.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	106,500	4.690	499,485.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	72,000	12.780	920,160.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	438,000	5.410	2,369,580.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	26,000	53.500	1,391,000.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	68,000	33.350	2,267,800.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	88,000	79.100	6,960,800.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.840	445,280.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	22,600	88.150	1,992,190.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	18.420	957,840.000	
PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LTD	55,000	2.250	123,750.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	15.160	568,500.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	23,750	36.850	875,187.500	
CHINA TOWER CORP LTD	2,594,000	1.080	2,801,520.000	
XIAOMI CORP	845,400	28.150	23,798,010.000	
WUXI APPTec CO LTD	18,912	171.200	3,237,734.400	
WEIMOB INC	105,000	17.560	1,843,800.000	
MEITUAN	212,000	298.000	63,176,000.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	44,400	20.400	905,760.000	

HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	67,000	39.600	2,653,200.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	298,000	14.100	4,201,800.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	70,000	87.650	6,135,500.000	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD	42,000	19.420	815,640.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.640	1,090,600.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	24,000	40.450	970,800.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	12.520	1,289,560.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	34.200	3,505,500.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	58.950	341,910.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	78,000	18.460	1,439,880.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	27,000	15.000	405,000.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	4,000	335.000	1,340,000.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	62,000	12.000	744,000.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	66,000	33.100	2,184,600.000	
CHINA FEIHE LTD	215,000	19.320	4,153,800.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,700	182.500	1,405,250.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	72,000	46.700	3,362,400.000	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	72.850	1,129,175.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	27.650	1,382,500.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	16,200	204.600	3,314,520.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	113,200	30.850	3,492,220.000	
AKESO INC	20,000	64.850	1,297,000.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	42,000	22.500	945,000.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	38.850	971,250.000	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	20.150	826,150.000	
NONGFU SPRING CO LTD	19,000	43.200	820,800.000	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	72,000	3.170	228,240.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	12,750	107.000	1,364,250.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	23,000	43.900	1,009,700.000	

	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	4,600	165.000	759,000.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	92,661	25.500	2,362,855.500	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	28,000	40.200	1,125,600.000	
	CGN POWER CO LTD	450,000	1.710	769,500.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	10.500	716,100.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	52.400	2,494,240.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	48,400	11.440	553,696.000	
	3SBIO INC	90,500	10.080	912,240.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	5.400	507,600.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	1.020	470,220.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	86.900	2,467,960.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	25.700	873,800.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.710	690,015.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	7.510	480,640.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	8.020	521,300.000	
	BOC AVIATION LTD	10,700	67.950	727,065.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	40.600	1,380,400.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	54,000	16.680	900,720.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	68,800	21.300	1,465,440.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	199,000	124.000	24,676,000.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	176,000	6.160	1,084,160.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	13,400	106.700	1,429,780.000	
	香港・ドル 小計	49,751,845		823,821,896.070 (11,624,126,949)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	31,000	292.500	9,067,500.000	
	ACER INC	202,532	31.700	6,420,264.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	42,554	385.500	16,404,567.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,616	516.000	14,765,856.000	
	ASIA CEMENT CORP	145,928	50.600	7,383,956.800	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	19,000	207.500	3,942,500.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	469,267	9.520	4,467,421.840	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	62,000	116.000	7,192,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	38,000	172.000	6,536,000.000	

UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	74,000	129.000	9,546,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	160,858	85.100	13,689,015.800	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	43,760	179.000	7,833,040.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	244,761	16.700	4,087,508.700	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	84,169	46.500	3,913,858.500	
CHINA STEEL CORP	707,058	36.150	25,560,146.700	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	88,973	24.400	2,170,941.200	
ADVANTECH CO LTD	20,675	325.500	6,729,712.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	213,304	22.850	4,873,996.400	
DELTA ELECTRONICS INC	113,663	295.000	33,530,585.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	52,000	79.500	4,134,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	204,427	114.500	23,406,891.500	
AU OPTRONICS CORP	537,194	22.750	12,221,163.500	
TAIWAN MOBILE CO LTD	90,800	103.500	9,397,800.000	
EVERGREEN MARINE CORP	155,820	113.500	17,685,570.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	168,824	31.950	5,393,926.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,768	237.000	5,159,016.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	11,322	624.000	7,064,928.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	35,285	515.000	18,171,775.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	227,633	105.500	24,015,281.500	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	209,594	86.600	18,150,840.400	
GIANT MANUFACTURING	16,151	322.000	5,200,622.000	
MEDIATEK INC	88,507	998.000	88,329,986.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	392,936	73.800	28,998,676.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	466,944	18.300	8,545,075.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	14,000	576.000	8,064,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	89,000	65.600	5,838,400.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	585,146	25.500	14,921,223.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	460,941	54.700	25,213,472.700	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	882,403	12.450	10,985,917.350	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	652,448	25.850	16,865,780.800	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	729,225	110.500	80,579,362.500	

MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	621,495	33.100	20,571,484.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	3,070.000	19,095,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	528,058	15.100	7,973,675.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	733,061	9.730	7,132,683.530	
INVENTEC CO LTD	120,005	25.350	3,042,126.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	140,845	65.300	9,197,178.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	553,443	13.650	7,554,496.950	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,072,048	22.500	24,121,080.000	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	596,977	22.100	13,193,191.700	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,560	105.500	3,962,580.000	
NAN YA PLASTICS CORP	301,828	85.800	25,896,842.400	
WISTRON CORP	157,916	30.250	4,776,959.000	
POU CHEN CORP	157,990	37.350	5,900,926.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	279,297	73.100	20,416,610.700	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	35,392	264.500	9,361,184.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	64,480	109.500	7,060,560.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	6,658	488.000	3,249,104.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,589	52.300	2,436,604.700	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	43,588	64.200	2,798,349.600	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	62,899	53.800	3,383,966.200	
TAIWAN CEMENT CORP	307,171	51.500	15,819,306.500	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,441,083	599.000	863,208,717.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	705,525	51.500	36,334,537.500	
WAN HAI LINES LTD	35,000	159.000	5,565,000.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	180,000	33.500	6,030,000.000	
YAGEO CORP	22,160	500.000	11,080,000.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	94,000	110.500	10,387,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	79,000	29.400	2,322,600.000	
INNOLUX CORPORATION	536,345	21.150	11,343,696.750	
WPG HOLDINGS CO LTD	118,203	50.400	5,957,431.200	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	14,000	348.500	4,879,000.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,475	391.500	6,449,962.500	

	PEGATRON CORP	103,554	73.000	7,559,442.000	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	1,010.000	8,080,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	15,000	358.000	5,370,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,470	204.500	15,024,615.000	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	9,000	232.500	2,092,500.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,435.000	2,870,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	29,385	101.000	2,967,885.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	540,954	21.000	11,360,034.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	217,993	45.000	9,809,685.000	
	WIWYNN CORP	4,000	928.000	3,712,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	196,903	116.500	22,939,199.500	
	SILERGY CORP	5,000	3,240.000	16,200,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	12,000	868.000	10,416,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	406.000	2,842,000.000	
	台湾・ドル 小計	19,222,056		1,928,204,196.670 (7,621,227,087)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	251.500	1,801,494.500	
	BIDVEST GROUP LTD	16,200	200.370	3,245,994.000	
	CLICKS GROUP LTD	16,368	259.830	4,252,897.440	
	DISCOVERY LTD	21,137	139.040	2,938,888.480	
	GOLD FIELDS LTD	52,869	149.320	7,894,399.080	
	REMGRO LTD	26,000	123.250	3,204,500.000	
	NORTHAM PLATINUM LTD	22,064	218.250	4,815,468.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	28,537	63.520	1,812,670.240	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,115	155.830	2,199,540.450	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,906	1,722.300	8,449,603.800	
	MTN GROUP LTD	100,234	108.430	10,868,372.620	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	24,940	297.990	7,431,870.600	
	FIRSTRAND LTD	300,251	57.140	17,156,342.140	
	NASPERS LTD	25,534	2,931.840	74,861,602.560	
	NEDBANK GROUP LTD	15,999	174.590	2,793,265.410	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,205	1,673.680	5,364,144.400	
	SASOL LTD	33,596	237.000	7,962,252.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	31,242	156.840	4,899,995.280	
	MR PRICE GROUP LTD	17,459	228.500	3,989,381.500	
	STANDARD BANK GROUP LTD	78,636	137.710	10,828,963.560	
	SPAR GROUP LTD/THE	9,414	189.760	1,786,400.640	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	54,219	55.270	2,996,684.130	

ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	25,010	166.000	4,151,660.000	
ABSA GROUP LTD	39,186	147.490	5,779,543.140	
TIGER BRANDS LTD	6,370	218.000	1,388,660.000	
SANLAM LTD	117,098	64.330	7,532,914.340	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	47,214	242.290	11,439,480.060	
KUMBA IRON ORE LTD	3,173	613.650	1,947,111.450	
RMI HOLDINGS	35,836	33.310	1,193,697.160	
VODACOM GROUP PTY LTD	38,342	135.900	5,210,677.800	
NEPI ROCKCASTLE PLC	22,185	97.950	2,173,020.750	
OLD MUTUAL LTD	304,247	13.900	4,229,033.300	
REINET INVESTMENTS SCA	7,743	284.670	2,204,199.810	
MULTICHOICE GROUP LTD	19,199	133.480	2,562,682.520	
SIBANYE STILLWATER LTD	167,996	64.300	10,802,142.800	
BID CORP LTD	20,642	309.900	6,396,955.800	
南アフリカ・ランド 小計	1,758,329		258,566,509.760 (2,081,460,404)	
合計	144,066,963		54,910,869,631 (54,910,869,631)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年6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	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	16,700.000	2,017,527.000	
		BANCO INTER SA	13,500.000	899,100.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,700.000	986,699.000	
		ENERGISA SA	15,800.000	771,514.000	
		KLABIN SA	31,400.000	810,120.000	
		SUL AMERICA SA	875.000	30,143.750	
	ブラジル・リアル 小計		99,975.000	5,515,103.750 (119,340,779)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	906,975.000	14,892,529.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,557,312.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	114,700.000	19,504,735.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	157,800.000	9,004,068.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	6,900.000	504,666.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,221,575.000	47,463,310.500 (263,829,557)	
投資信託受益証券 合計		1,321,550	383,170,336 (383,170,336)		
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	173,900.000	4,055,348.000	
	メキシコ・ペソ 小計		173,900.000	4,055,348.000 (22,542,057)	

	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	235,102.000	3,531,232.040	
	南アフリカ・ランド 小計		235,102.000	3,531,232.040 (28,426,418)	
投資証券	合計		409,002	50,968,475 (50,968,475)	
合計				434,138,811 (434,138,811)	

(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 75銘柄	13.18	-	-	14.66
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 9銘柄	0.64	-	-	0.72
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.10	-	-	0.11
インド・ルピー	株式 101銘柄	9.13	-	-	10.16
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.11	-	-	1.23
オフショア・人民元	株式 350銘柄	4.36	-	-	4.85
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.55	-	-	0.62
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.45	-	-	0.51
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.13	-	-	0.15
サウジアラビア・リアル	株式 36銘柄	2.54	-	-	2.83
タイ・バーツ	株式 43銘柄	1.50	-	-	1.66
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.10	-	-	0.11
チリ・ペソ	株式 13銘柄	0.39	-	-	0.43
トルコ・リラ	株式 11銘柄	0.24	-	-	0.26
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.22	-	-	0.24
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 17銘柄	0.55	-	-	0.61
ブラジル・レアル	株式 49銘柄 投資信託受益証 券 6銘柄	4.54 -	- 0.19	- -	5.27
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.65	-	-	0.72
マレーシア・リングgit	株式 36銘柄	1.16	-	-	1.30
メキシコ・ペソ	株式 17銘柄 投資信託受益証 券 5銘柄 投資証券 1銘柄	1.14 - -	- 0.43 -	- - 0.04	1.78
ユーロ	株式 5銘柄	0.12	-	-	0.14
韓国・ウォン	株式 103銘柄	11.73	-	-	13.06

香港・ドル	株式	212銘柄	18.88	-	-	21.00
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.38	-	-	13.77
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.38	-	-	3.81
	投資証券	1銘柄	-	-	0.05	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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6月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	466,789,655
コール・ローン	95,757,148
国債証券	156,934,295,258
未収利息	1,439,872,649
前払費用	542,861,858
流動資産合計	159,479,576,568
資産合計	159,479,576,568
負債の部	
流動負債	
未払解約金	6,158,000
流動負債合計	6,158,000
負債合計	6,158,000
純資産の部	
元本等	
元本	73,908,082,217
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	85,565,336,351
元本等合計	159,473,418,568
純資産合計	159,473,418,568
負債純資産合計	159,479,576,568

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12月12日 至 2021年6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. 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6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	67,307,282,350円
同期中追加設定元本額	61,166,206,266円
同期中一部解約元本額	54,565,406,399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）	192,890,284円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,111,621,563円
たわらノーロード バランス（堅実型）	84,291,328円
たわらノーロード バランス（標準型）	223,062,166円
たわらノーロード バランス（積極型）	91,468,087円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	776,679円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	1,550,170円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	6,158,974円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,155,388円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	1,621,295円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	56,976,910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）	261,925,126円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	538,395,377円
投資のソムリエ	17,758,988,007円
クルーズコントロール	392,699,211円
投資のソムリエ<DC年金>	943,872,481円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	189,864,595円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	3,159,789円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	8,039,671円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	760,071,039円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,875,874,631円
ワールドアセットバランス（基本コース）	660,079,906円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,107,571,845円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	18,419,946円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	8,836,412円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	7,174,105円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	46,252,538円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	4,270,240,470円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	191,729,381円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	14,554,122円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	6,746,207円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,421,715円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	23,889,929,635円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	446,932,272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)	3,697,993,032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)	754,715,573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)	208,052,616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)	105,153,968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)	5,894,996,446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	73,908,082,217円
2. 受益権の総数	73,908,082,217口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月12日 至 2021年6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	2021年6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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年6月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	1,581,947,983	
合計	1,581,947,983	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年4月20日から2021年6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)

2021年6月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1577円 (21,577円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

2021年6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 2.875 06/06/25	10,000,000.000	10,334,400.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	16,000,000.000	16,346,560.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	11,000,000.000	11,865,700.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	14,800,000.000	16,187,426.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	14,000,000.000	13,787,620.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	15,800,000.000	16,179,911.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	13,100,000.000	14,454,802.000	

BRAZIL 5.625 02/21/47	10,600,000.000	11,625,921.000	
BRAZIL 6.0 04/07/26	11,800,000.000	13,870,015.000	
BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	10,686,789.500	
BRAZIL 8.25 01/20/34	10,200,000.000	14,163,720.000	
BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,940,480.000	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	8,936,595.000	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	13,000,000.000	12,882,350.000	
COLOMBIA 4.0 02/26/24	8,100,000.000	8,620,627.500	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	7,000,000.000	6,719,930.000	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	12,000,000.000	13,213,740.000	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	12,000,000.000	13,255,080.000	
COLOMBIA 5.0 06/15/45	21,000,000.000	22,597,890.000	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	7,700,700.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	14,000,000.000	16,055,900.000	
COLOMBIA 6.125 01/18/41	12,000,000.000	14,360,880.000	
COLOMBIA 7.375 09/18/37	10,400,000.000	13,872,872.000	
CROATIA 5.5 04/04/23	12,400,000.000	13,540,800.000	
CROATIA 6.0 01/26/24	14,400,000.000	16,444,800.000	
HUNGARY 5.375 02/21/23	10,358,000.000	11,244,965.890	
HUNGARY 5.375 03/25/24	13,380,000.000	15,175,676.280	
HUNGARY 5.75 11/22/23	13,000,000.000	14,677,169.000	
HUNGARY 7.625 03/29/41	9,000,000.000	14,720,112.000	
INDONESIA 2.85 02/14/30	7,000,000.000	7,288,163.330	
INDONESIA 3.375 04/15/23	6,700,000.000	7,064,525.090	
INDONESIA 3.4 09/18/29	5,000,000.000	5,425,050.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	7,200,000.000	7,908,306.330	
INDONESIA 3.7 10/30/49	4,000,000.000	4,170,971.960	
INDONESIA 3.85 07/18/27	5,600,000.000	6,255,760.000	
INDONESIA 3.85 10/15/30	10,000,000.000	11,176,826.400	
INDONESIA 4.1 04/24/28	7,000,000.000	7,909,453.720	
INDONESIA 4.125 01/15/25	9,800,000.000	10,854,382.000	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	7,902,055.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	7,000,000.000	7,972,195.000	
INDONESIA 4.35 01/11/48	7,000,000.000	7,861,367.780	
INDONESIA 4.45 04/15/70	5,000,000.000	5,749,525.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	10,800,000.000	12,451,320.000	
INDONESIA 4.75 02/11/29	7,000,000.000	8,249,745.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	8,400,000.000	10,294,575.810	
INDONESIA 5.25 01/17/42	9,300,000.000	11,507,646.640	
INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,143,680.000	
INDONESIA 5.875 01/15/24	10,200,000.000	11,575,470.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	6,200,000.000	8,465,451.230	
INDONESIA 6.75 01/15/44	9,500,000.000	13,889,300.010	
INDONESIA 7.75 01/17/38	11,500,000.000	17,294,677.500	
PANAMA 2.252 09/29/32	13,000,000.000	12,650,820.000	
PANAMA 3.16 01/23/30	10,000,000.000	10,535,000.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	7,200,000.000	7,870,392.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	8,100,000.000	8,985,127.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	12,000,000.000	13,510,560.000	

PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	10,491,981.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	12,900,000.000	17,399,520.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	5,800,000.000	7,245,824.000	
PERU 2.392 01/23/26	7,000,000.000	7,206,570.000	
PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	17,189,210.000	
PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,105,700.000	
PERU 4.125 08/25/27	9,300,000.000	10,366,431.000	
PERU 5.625 11/18/50	12,000,000.000	15,876,240.000	
PERU 6.55 03/14/37	9,000,000.000	12,171,600.000	
PERU 7.35 07/21/25	8,300,000.000	10,172,480.000	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	6,000,000.000	6,300,862.200	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	6,000,000.000	5,795,080.800	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	11,000,000.000	11,950,400.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	8,000,000.000	8,603,314.720	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	9,000,000.000	10,250,844.210	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	9,800,000.000	10,852,716.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,574,150.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	6,800,000.000	8,586,202.780	
PHILIPPINES 5.5 03/30/26	10,600,000.000	12,904,454.310	
PHILIPPINES 6.375 01/15/32	7,600,000.000	10,484,503.540	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	10,000,000.000	14,240,750.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	12,045,817.880	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	7,800,000.000	12,460,881.730	
ROMANIA 3.0 02/14/31	11,000,000.000	11,391,600.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	12,000,000.000	12,418,440.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	7,600,000.000	8,419,660.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	7,600,000.000	9,136,233.600	
ROMANIA 6.125 01/22/44	11,400,000.000	15,440,650.200	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,440,000.000	12,041,239.130	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	15,400,000.000	17,256,408.400	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	15,400,000.000	17,463,600.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	3,800,000.000	3,923,545.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	18,400,000.000	20,962,476.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	16,400,000.000	17,850,924.400	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	23,000,000.000	27,394,840.000	

RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	29,000,000.000	36,289,092.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	18,000,000.000	23,040,900.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	8,200,000.000	10,910,042.600	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	13,200,000.000	13,818,552.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	14,000,000.000	15,042,930.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	10,400,000.000	11,413,906.400	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	8,200,000.000	8,419,678.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	13,000,000.000	13,371,800.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,155,790.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	9,400,000.000	10,838,059.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	14,200,000.000	16,186,920.800	
SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,388,324.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	11,000,000.000	11,442,640.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	10,200,000.000	11,308,026.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	11,200,000.000	12,311,208.000	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	7,000,000.000	7,849,310.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	2,418,000.000	2,619,334.770	
UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	12,000,000.000	13,668,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	14,109,526.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	10,000,000.000	10,611,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	16,000,000.000	18,220,880.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	13,000,000.000	14,038,700.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	11,400,000.000	12,320,835.000	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	14,000,000.000	16,051,000.000	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	10,000,000.000	11,396,300.000	

	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	12,400,000.000	15,024,832.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	11,800,000.000	14,179,352.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	14,900,000.000	18,756,492.500	
	UNITED MEXICAN STATES 6.75 09/27/34	10,200,000.000	13,529,280.000	
	アメリカ・ドル 小計	1,244,996,000.000 (136,277,262,160)	1,433,713,642.040 (156,934,295,258)	
国債証券 合計		136,277,262,160 (136,277,262,160)	156,934,295,258 (156,934,295,258)	
合計			156,934,295,258 (156,934,295,258)	

(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 120銘柄	98.41	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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2021年6月30日現在

資産総額	9,660,833,264円
負債総額	82,635,501円
純資産総額(-)	9,578,197,763円
発行済数量	8,084,348,997口
1口当たり純資産額(/)	1.1848円

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2021年6月30日現在

資産総額	30,561,279,567円
負債総額	245,687,457円
純資産総額(-)	30,315,592,110円
発行済数量	27,682,660,734口
1口当たり純資産額(/)	1.0951円

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	575,899,503,573円
負債総額	192,828,251円
純資産総額(-)	575,706,675,322円
発行済数量	106,564,047,524口
1口当たり純資産額(/)	5.4024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6月30日現在

資産総額	581,083,477,929円
負債総額	2,875,087,122円
純資産総額(-)	578,208,390,807円
発行済数量	403,515,132,043口
1口当たり純資産額(/)	1.4329円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	77,607,489,742円
負債総額	208,974,994円
純資産総額(-)	77,398,514,748円
発行済数量	50,884,148,053口
1口当たり純資産額(/)	1.5211円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	62,810,230,102円
負債総額	640,848円
純資産総額(-)	62,809,589,254円
発行済数量	40,575,301,368口
1口当たり純資産額(/)	1.5480円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年6月30日現在

資産総額	160,887,116,799円
負債総額	831,833,000円
純資産総額(-)	160,055,283,799円
発行済数量	73,364,969,602口
1口当たり純資産額(/)	2.1816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6月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2021年6月30日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年6月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,450,767,809,461
追加型株式投資信託	832	15,901,915,328,451
単位型公社債投資信託	29	62,455,496,430
単位型株式投資信託	213	1,310,125,137,088
合計	1,100	18,725,263,771,430

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 財務諸表の金額は、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第36期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,702,906	3,730,283
未払金	4,803,140	7,337,541
未払収益分配金	966	846
未払償還金	9,999	9,999
未払手数料	4,582,140	6,889,193
その他未払金	210,034	437,502
未払費用	6,673,320	9,713,972
未払法人税等	4,090,268	4,199,922
未払消費税等	1,338,183	2,106,617
賞与引当金	1,373,328	1,789,597
役員賞与引当金	65,290	76,410
流動負債計	22,046,438	28,954,345
固定負債		
退職給付引当金	2,118,947	2,292,486
時効後支払損引当金	174,139	157,945
固定負債計	2,293,087	2,450,431
負債合計	24,339,526	31,404,777
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	19,552,957	19,552,957
資本準備金	2,428,478	2,428,478
その他資本剰余金	17,124,479	17,124,479
利益剰余金	49,674,383	51,800,187
利益準備金	123,293	123,293
その他利益剰余金	49,551,090	51,676,893
別途積立金	31,680,000	31,680,000
繰越利益剰余金	17,871,090	19,996,893
株主資本計	71,227,341	73,353,144
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	7	6
評価・換算差額等計	7	6
純資産合計	71,227,333	73,353,137
負債・純資産合計	95,566,859	104,757,915

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	17,871,090	49,674,383	71,227,341
当期変動額									
剰余金の配当							12,000,000	12,000,000	12,000,000
当期純利益							14,125,803	14,125,803	14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,125,803	2,125,803	2,125,803
当期末残高	2,000,000	2,428,478	17,124,479	19,552,957	123,293	31,680,000	19,996,893	51,800,187	73,353,144

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	7	7	71,227,333
当期変動額			
剰余金の配当			12,000,000
当期純利益			14,125,803
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	1	1	1
当期変動額合計	1	1	2,125,804
当期末残高	6	6	73,353,137

重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(千円)

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

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

(千円)

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

(株主資本等変動計算書関係)

第35期(自2019年4月1日至2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	11,280,000	282,000	2019年3月31日	2019年6月21日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種 類株式					

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

発行済株式の種類	当事業年度期首 株式数(株)	当事業年度 増加株式数(株)	当事業年度 減少株式数(株)	当事業年度末 株式数(株)
普通株式	24,490	-	-	24,490
A種種類株式	15,510	-	-	15,510
合計	40,000	-	-	40,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2021年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総 額(千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280,000	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業を営んでおります。資金運用については、短期的な預金等に限定しております。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	36,734,502	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	25,670,526	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	16,804,456	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	5,814,654	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,990	1,990	-
資産計	85,026,130	85,026,130	-
(1) 未払手数料	6,889,193	6,889,193	-
負債計	6,889,193	6,889,193	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (千円)	1年超5年以内 (千円)	5年超10年以内 (千円)	10年超 (千円)
(1) 現金・預金	36,734,502	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670,526	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804,456	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814,654	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1,990	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
投資信託	996	-	3

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(千円)

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

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

(千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 4.42%	1.00% ~ 3.76%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度103,477千円、当事業年度100,806千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第35期	第36期
	(2020年3月31日現在)	(2021年3月31日現在)
	(千円)	(千円)
繰延税金資産		
未払事業税	221,053	260,377
未払事業所税	10,778	10,711
賞与引当金	420,513	547,974
未払法定福利費	78,439	92,748
未払給与	10,410	8,535
受取負担金	47,781	-
運用受託報酬	331,395	1,410,516
資産除去債務	14,116	18,079
減価償却超過額(一括償却資産)	50,942	25,808
減価償却超過額	82,684	51,986
繰延資産償却超過額(税法上)	323,132	301,965
退職給付引当金	648,821	701,959
時効後支払損引当金	53,321	48,362
ゴルフ会員権評価損	7,360	7,360
関係会社株式評価損	166,740	166,740
投資有価証券評価損	28,976	28,976
その他	11,532	5,283
その他有価証券評価差額金	3	2
繰延税金資産小計	2,508,004	3,676,823
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	2,508,004	3,676,823
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	2,508,004	3,676,823

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

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

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

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

(2) 損益計算書項目

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益	- 千円	- 千円
営業利益	8,954,439千円	8,823,626千円
経常利益	8,954,439千円	8,823,626千円
税引前当期純利益	9,111,312千円	8,823,626千円
当期純利益	7,536,465千円	7,288,834千円
1株当たり当期純利益	188,411円64銭	182,220円85銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811,241千円	3,811,241千円
顧客関連資産の償却額	5,149,555千円	5,016,672千円

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	5,793,912	未払 手数料	1,112,061
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	10,294,840	未払 手数料	1,231,431

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の 兼任等	事業上 の関係				
親会社 の子会社	株式会社 みずほ銀行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435,839	未払 手数料	1,457,765
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767,199	未払 手数料	2,524,882

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資信託の販売代行手数料は、一般的取引条件を勘案した個別契約により決定しております。

(注2) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には、消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ
 (東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	1,780,683円32銭	1,833,828円44銭
1株当たり当期純利益金額	375,125円27銭	353,145円08銭

(注1) 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	15,005,011千円	14,125,803千円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

(注1) A種種類株式は、剰余金の配当請求権及び残余財産分配請求権について普通株式と同等の権利を有しているため、1株当たり情報の算定上、普通株式に含めて計算しています。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常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

2021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。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

(3) 投資顧問会社

a. 名称

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社

b. 資本金の額

2021年3月末日現在 200百万円

c. 事業の内容

日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【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」と称して使用する場合があります。

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

独立監査人の監査報告書

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

2021年7月21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」に掲げられているワールドアセットバランス(基本コース)の2020年12月12日から2021年6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、ワールドアセットバランス(基本コース)の2021年6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。

独立監査人の監査報告書

2021年7月21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」に掲げられているワールドアセットバランス(リスク抑制コース)の2020年12月12日から2021年6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、ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)の2021年6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。