【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10月12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】	投資のソムリエ
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

投資のソムリエ

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

「分配金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1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。）

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・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、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（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には、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10月13日から2022年4月11日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、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、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

＜ファンドの特色＞

1 投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)にマザーファンド*1を通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

●外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ*2を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

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

*2 一部の外貨建資産の通貨については委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

2 基準価額の変動リスク*を年率4%程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

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

※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率4%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

3 年2回決算を行います。

●毎年1月、7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。

運用プロセス

■基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率(0%～100%)を決定します。
- 基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
- 基本配分戦略は月次で行います。

※基本配分戦略に関して、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。

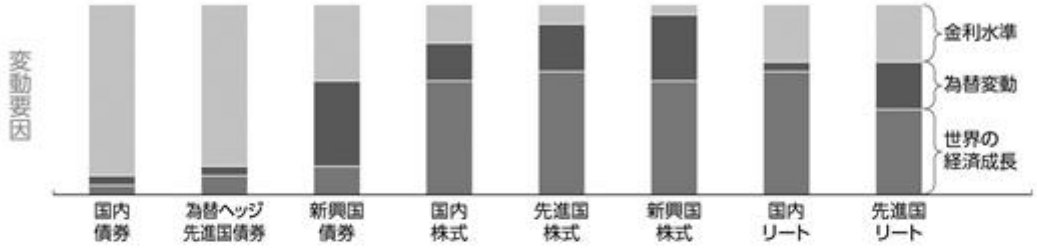
■機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。
- 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率(0%～100%)を変更します。
- 機動的配分戦略は日次で行います。

基本配分戦略
（月次戦略）

当ファンドは、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目し、それぞれの変動要因からファンドが受ける影響が均等になるように配分することで、各時点においてもっとも分散効果が期待できる資産配分比率および通貨配分比率を決定します。

当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

変動要因と値動きへの影響度合い（例）



変動要因からファンドが受ける影響を均等に配分

着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

上記の配分から最適と判断される資産配分比率および通貨配分比率を決定

投資対象資産の基本配分比率

基準価額の変動リスクの目標値年率4%程度

※当ファンドでは、投資対象資産のうち国内債券、為替ヘッジ先進国債券を「安定資産」、それ以外の資産を「リスク性資産」とします。
※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。

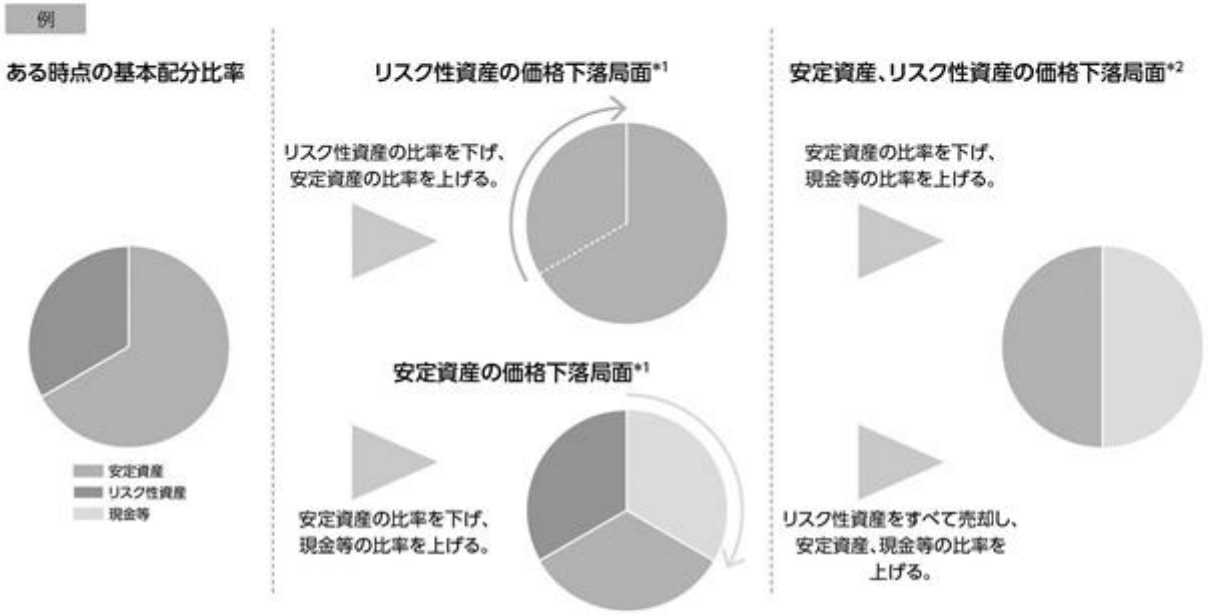
機動的配分戦略（日次戦略）

市場環境に応じて、安定資産、リスク性資産、現金等*の比率を調整します。
※比率の調整は、「安定局面」、下落の危険性が高まった「警戒局面」、下落の危険性が最も高まった「危機局面」の各判定局面に応じて行います。

リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、安定資産、リスク性資産、現金等の比率を調整することで基準価額の下落の抑制をめざします。
*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です。
※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

価格下落局面における配分比率変更のイメージ

例



*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。
*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産をすべて売却し、基本配分比率の8資産の合計額のうち半分を現金等に入れ替えます。
※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合もあります。
※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証するものではありません。
※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

○商品分類表

単位型投信 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 （収益の源泉）
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

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

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

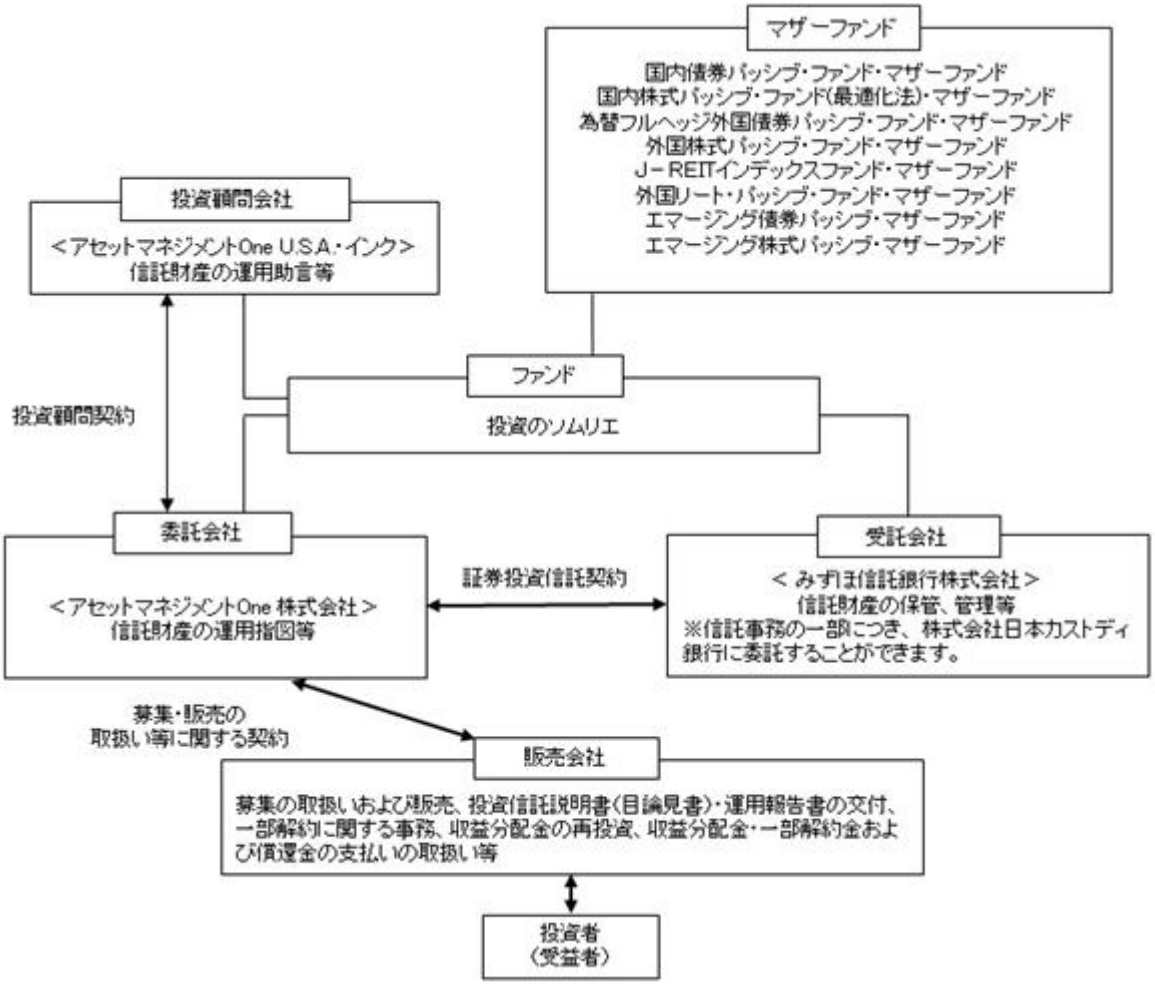
その他資産 （投資信託証券 （資産複合 （債券、株式、 不動産投信） 資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。 (注)商品分類表の投資対象資産は資産複合に分類され、属性区分表の投資対象資産はその他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））に分類されます。
年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。
グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジ又は一部の資産に対円での為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

※上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。
上記以外の商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会ホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

（２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日　信託契約締結、当初設定日、ファンドの運用開始
2013年4月24日　ファンドの名称を「投資のコンシェルジュ」から「投資のソムリエ」に変更
2013年5月17日　投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

・「投資顧問契約」の概要

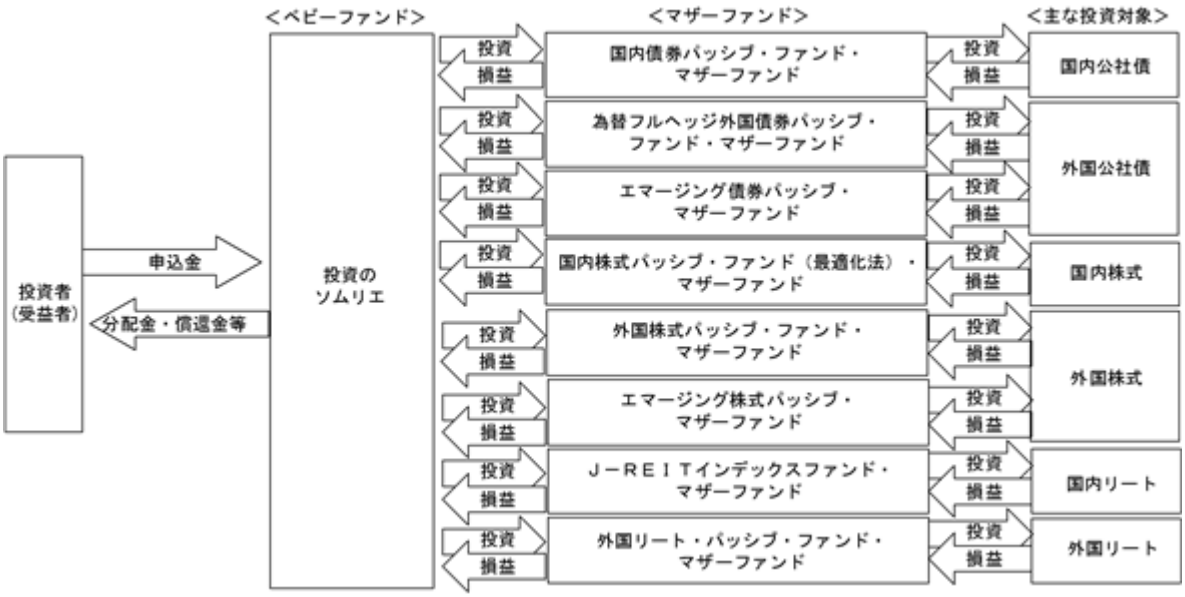
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



※当ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産に投資する場合もあります。

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額

20億円（2021年7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7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】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産に投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

・国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券（リート）に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資し、それぞれの配分比率を適宜変更します。

- 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

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

（それぞれを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ＊を行い、一部または全部の為替リスクを軽減します。

＊一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクを軽減します。

・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、短期金融資産へ投資する場合もあります。

②基準価額の変動リスク＊を年率４％程度に抑えながら、安定的な基準価額の上昇をめざします。

※上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は当ファンドの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、当ファンドが年率４％程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

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

③基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（０％～１００％）を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出した上で、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。
・基本配分戦略は月次で行います。

④機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

・機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（０％～１００％）を変更します。
・機動的配分戦略は日次で行います。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

ロ.デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第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

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

委託会社は、信託金を、主としてアセットマネジメントOne株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結された証券投資信託である国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド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書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．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。）および新株予約権証券

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。

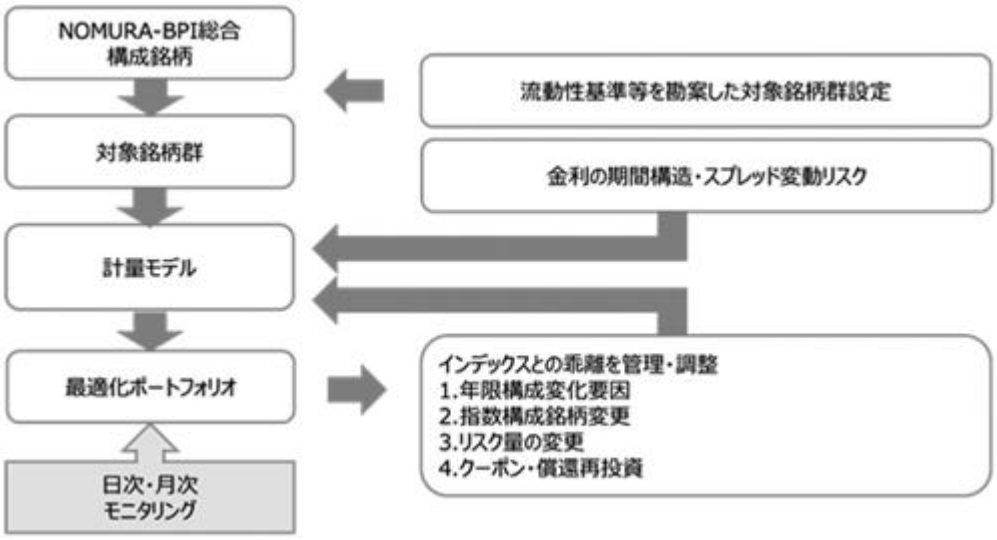
③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。

	※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
運用プロセス	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限構成変化要因　・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更　・クーポン、償還再投資 

主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5.外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 7.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 8.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

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

投資態度	**1.主として東京証券取引所第1部に上場されている株式＊に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。** **3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。** **5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。** **＊東証市場再編に伴い、投資対象に関する記載を変更する約款変更を予定しております。約款変更日の2022年4月4日に「東京証券取引所第1部に上場されている株式」から「わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄」に変更を行う予定です。**

※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよびＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。

②㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止またはＴＯＰＩＸの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

③㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびＴＯＰＩＸの商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

④㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

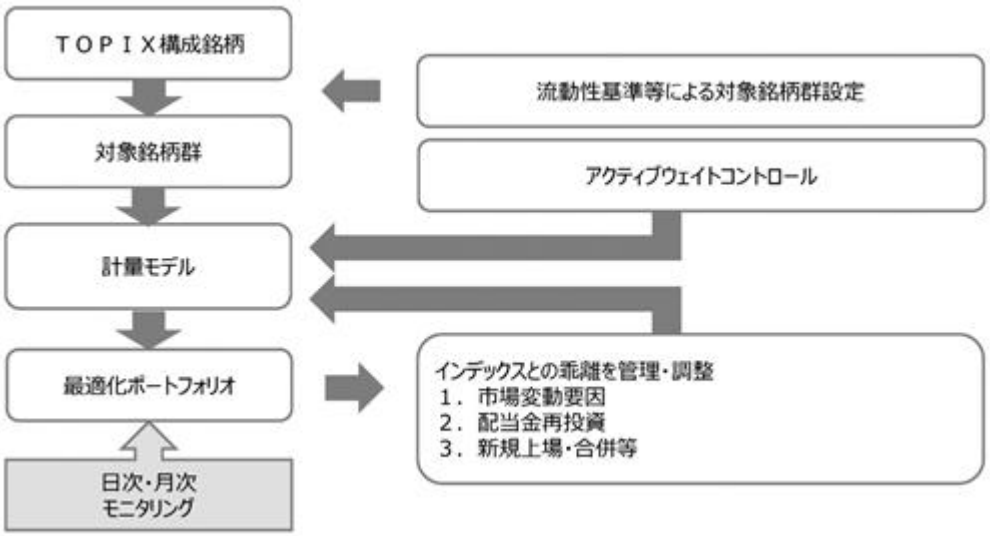
⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

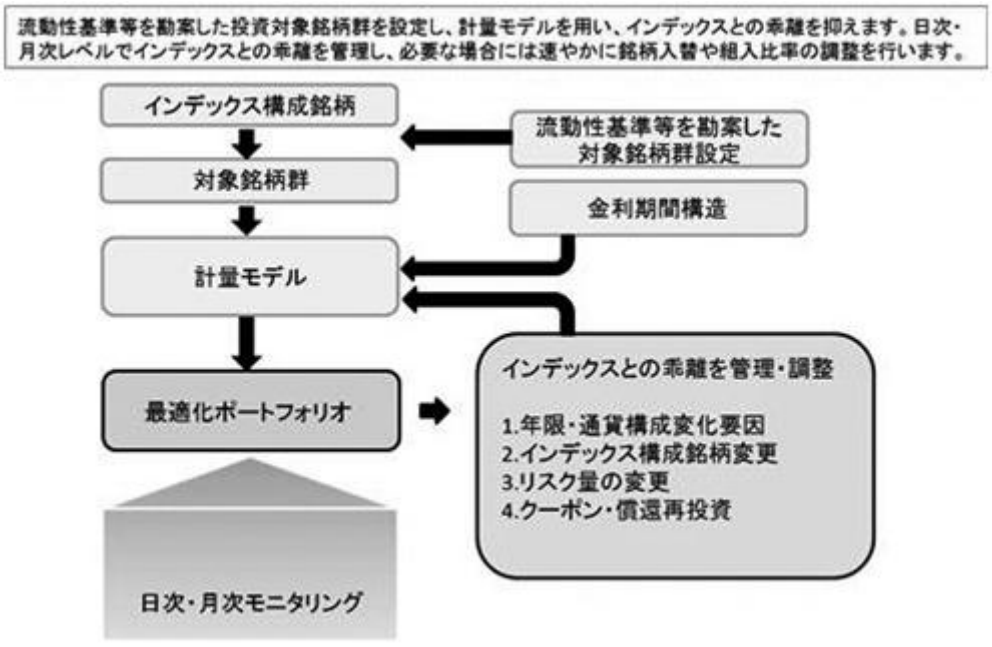
⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

⑦㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

⑧以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

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

ファンド名	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	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。 2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。 ※FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
運用プロセス	

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

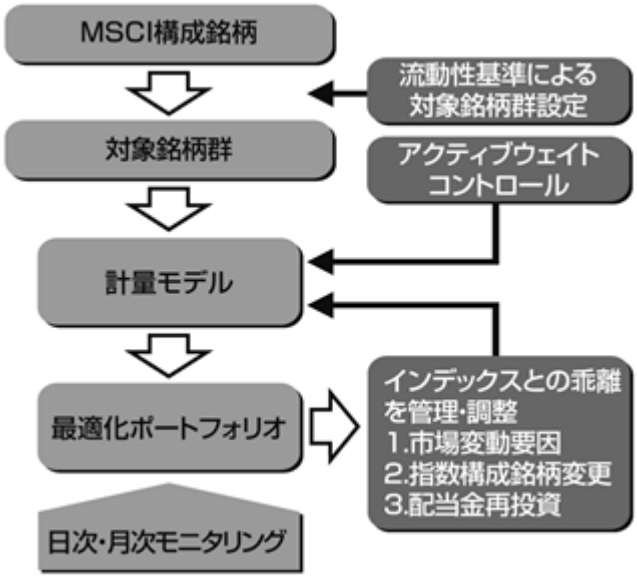
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

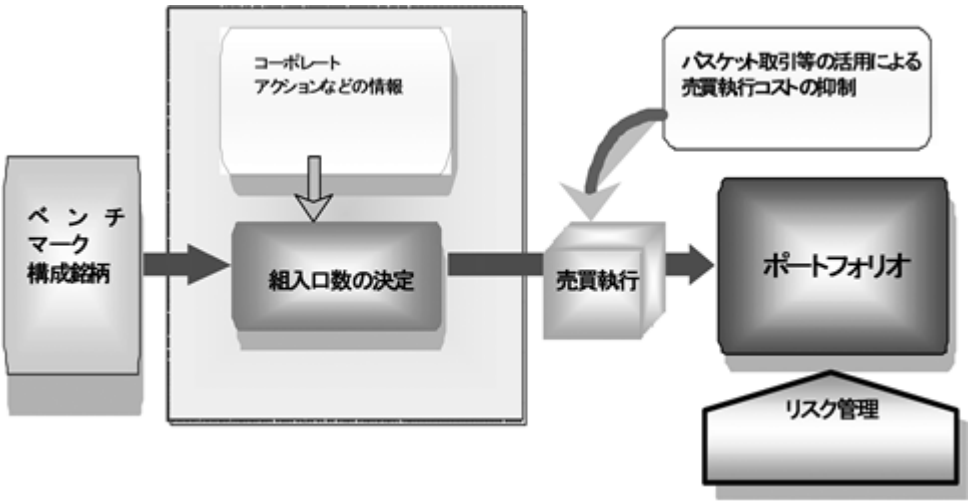
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確

	認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	1.流動性基準による対象銘柄群設定 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、ＭＳＣＩコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低くかつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 

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

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

投資態度	1.東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。 ※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数の商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。 ②㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数の商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数の商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥㈱東京証券取引所は、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者または公衆に対し、当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。 ⑦㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。

運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資は行いません。 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。 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。

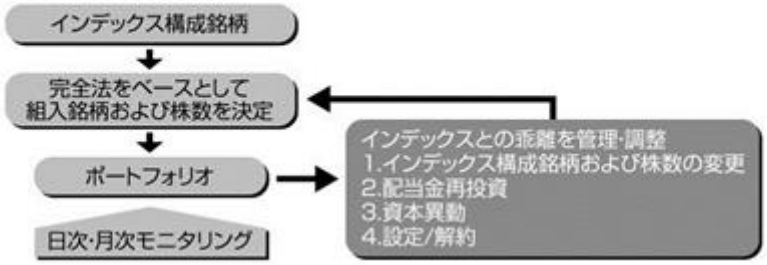
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

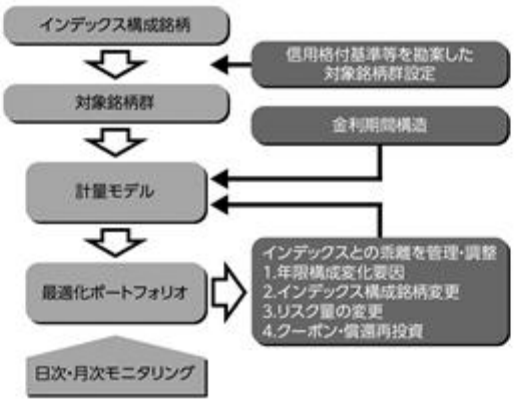
※Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。Standard & Poor’s®およびS&P®は、S&P Globalの一部門であるスタンダード＆プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズLLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®は、ダウ・ジョーンズ・トレードマーク・ホールディングズLLC（「Dow Jones」）の登録商標です。指数に直接投資することはできません。本商品は、SPDJI、Dow Jones、S&P、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

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

	は責任も負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
運用プロセス	ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス（除く日本）」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。 

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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	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。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、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。 ※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。

運用プロセス	信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 
主な投資制限	**1.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。** **2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。** **3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。** **4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。** **5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。** **6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。**

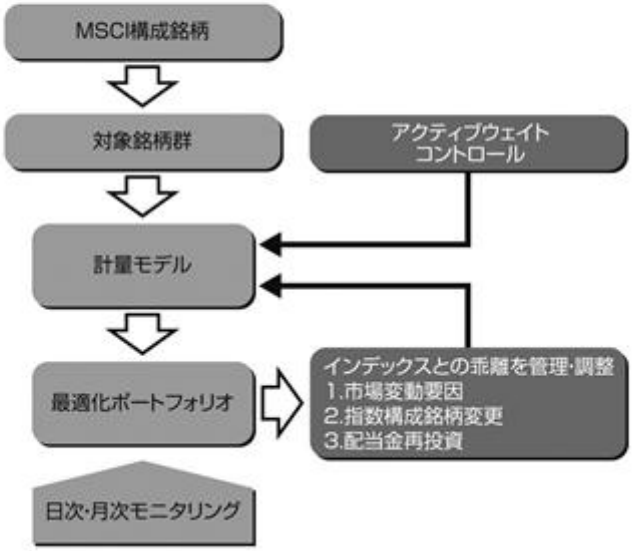
ファンド名	**エマージング株式パッシブ・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。** **（＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。**
主な投資対象	**海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。**

投資態度	**1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。** **2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。**

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

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

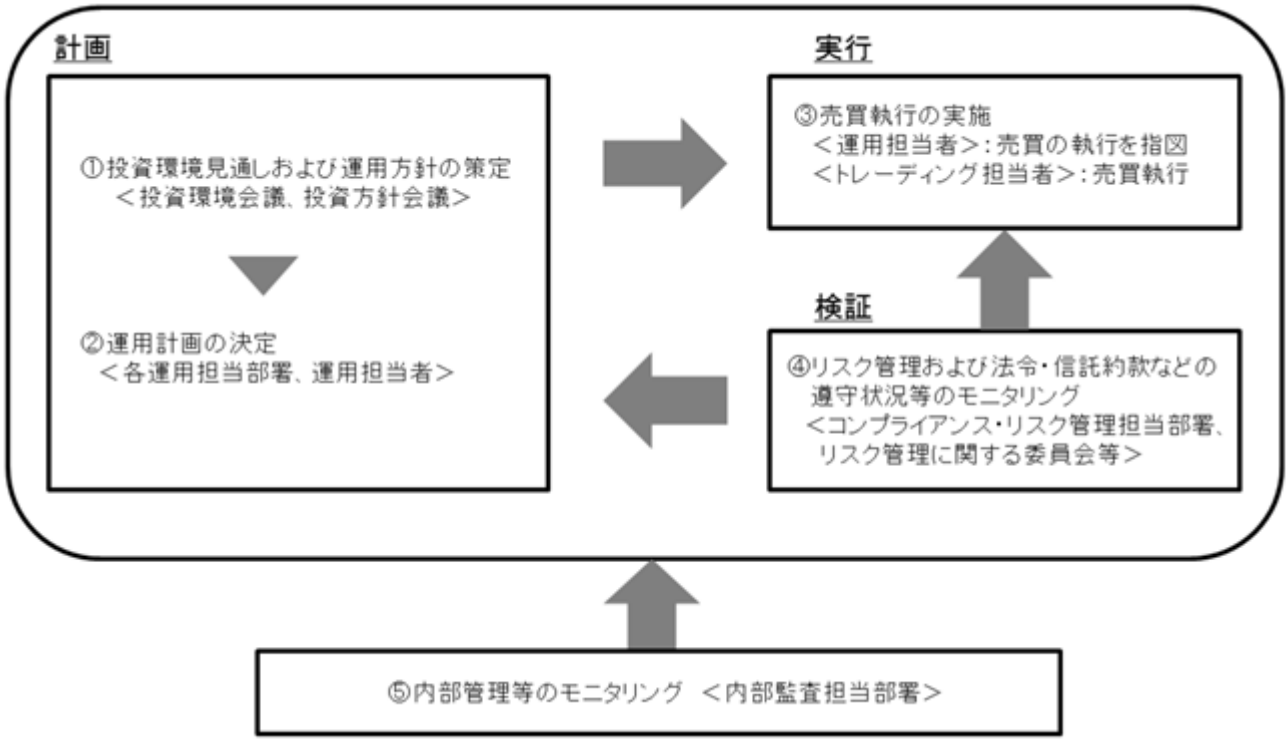
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確

	認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	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。 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.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。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

b．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2021年7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】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月、7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。

②収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

「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】

①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）

②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）

③委託会社は、信託財産に属するマザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券(金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能(市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。)な投資信託証券をいいます。以下同じ。)を除きます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。（約款第17条第3項）

④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）

⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）について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）

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。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑦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。

⑧信用取引の指図および範囲（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書の権利行使により取得する株券
2.株式分割により取得する株券
3.有償増資により取得する株券
4.売出しにより取得する株券
5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券
6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（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

⑨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効率的な運用に資するため、および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。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。

2)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および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行うことの指図をすることができます。

3)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および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行うことの指図をすることができます。

⑩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効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび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)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等を基に算出した価額で評価するものとします。

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

⑪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効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび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)金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

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

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

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

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

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

⑭特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26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。

⑮外国為替予約取引の指図（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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の合計額と売予約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)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。

⑯資金の借入れ（約款第33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。

⑰同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

○資産配分リスク

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

当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。

当ファンドは短期金融債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随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。

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

○金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

○為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。
為替ヘッジを行わない場合、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。
為替ヘッジを行う場合、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、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があり、その場合、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、円と当該代替通貨と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。

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

○流動性リスク

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

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

○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。

当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＞

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

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

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

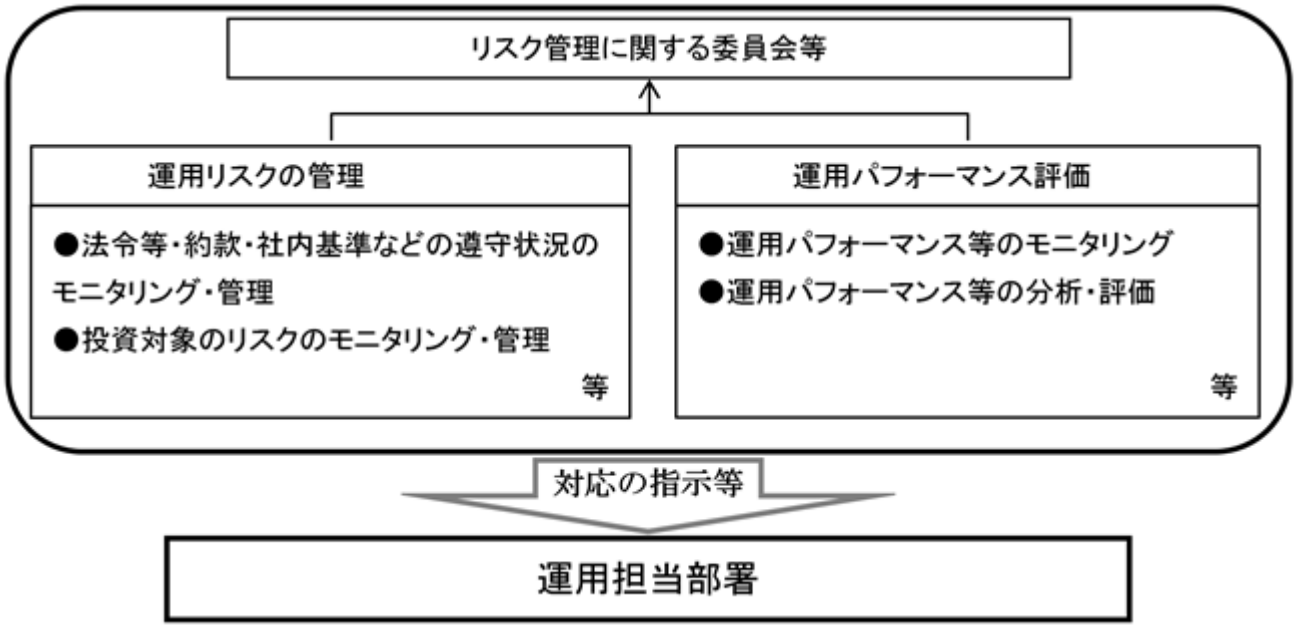
○注意事項

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

＜リスク管理体制＞

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

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



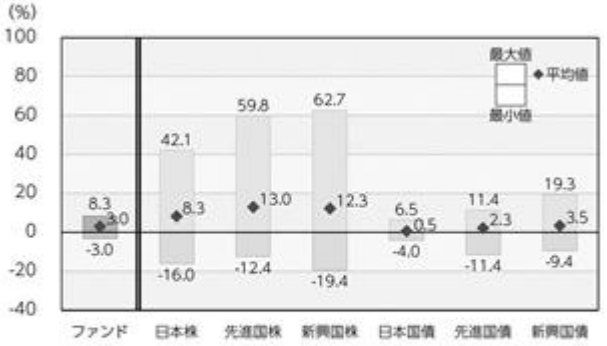
※リスク管理体制は2021年7月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2016年8月～2021年7月

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

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

*東証株価指数(TOPIX)は、東証市場再編に伴い、2022年4月4日付で指数の算出要領が変更される予定です。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%（税抜1.40%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.65%	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0.70%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク）に対する投資顧問報酬（当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.2925%）が含まれます。

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①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。

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

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

④マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

※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、ご留意ください。

○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7月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

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

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

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

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

＜収益分配金の課税について＞

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

収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		556,346,670,085	95.85
	内　日本	556,346,670,085	95.85
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		24,067,338,690	4.15
純資産総額		580,414,008,775	100.00

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

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		431,126,621,300	85.41
	内　日本	431,126,621,300	85.41
地方債証券		27,104,973,598	5.37
	内　日本	27,104,973,598	5.37
特殊債券		25,989,937,581	5.15
	内　日本	25,989,937,581	5.15
社債券		19,172,771,990	3.80
	内　日本	18,364,717,990	3.64
	内　フランス	808,054,000	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,404,654,147	0.28
純資産総額		504,798,958,616	100.00

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		380,011,045,030	97.23
	内　日本	380,011,045,030	97.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		10,820,495,389	2.77
純資産総額		390,831,540,419	100.00

その他資産の投資状況

2021年7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）		10,934,700,000	2.80
	内　日本	10,934,700,000	2.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

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7月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券		563,586,236,520	97.38
	内　アメリカ	255,247,963,401	44.11
	内　フランス	57,133,919,203	9.87
	内　イタリア	53,825,991,201	9.30
	内　ドイツ	42,504,298,355	7.34
	内　イギリス	37,101,544,302	6.41
	内　スペイン	33,385,190,850	5.77
	内　ベルギー	13,316,439,802	2.30
	内　オーストラリア	11,478,101,201	1.98
	内　オランダ	11,100,696,626	1.92
	内　カナダ	11,036,966,471	1.91
	内　オーストリア	8,437,551,758	1.46
	内　アイルランド	4,730,160,242	0.82
	内　メキシコ	4,002,313,130	0.69
	内　フィンランド	3,543,736,704	0.61
	内　ポーランド	3,444,154,405	0.60
	内　デンマーク	2,751,631,627	0.48
	内　マレーシア	2,609,476,898	0.45
	内　イスラエル	2,556,073,801	0.44
	内　シンガポール	2,378,488,798	0.41
	内　スウェーデン	1,644,774,337	0.28
	内　ノルウェー	1,356,763,408	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		15,139,733,765	2.62
純資産総額		578,725,970,285	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		562,911,224,302	95.48
	内　アメリカ	391,255,565,752	66.36
	内　イギリス	24,469,651,734	4.15
	内　カナダ	20,429,565,037	3.47
	内　スイス	19,480,845,545	3.30
	内　フランス	18,878,838,866	3.20
	内　ドイツ	16,659,942,391	2.83
	内　オーストラリア	11,505,645,919	1.95
	内　オランダ	11,234,137,642	1.91
	内　アイルランド	10,649,612,742	1.81
	内　スウェーデン	6,579,489,193	1.12
	内　デンマーク	4,769,924,860	0.81
	内　スペイン	4,397,655,109	0.75
	内　香港	4,151,668,950	0.70
	内　イタリア	3,296,848,758	0.56
	内　フィンランド	2,370,820,939	0.40
	内　ジャージィー	2,321,418,864	0.39
	内　シンガポール	1,627,645,242	0.28
	内　ベルギー	1,494,905,528	0.25
	内　バミューダ	1,342,708,026	0.23

	内　ノルウェー	1,071,399,829	0.18
	内　イスラエル	1,060,893,006	0.18
	内　ケイマン諸島	1,029,250,696	0.17
	内　ルクセンブルグ	628,557,314	0.11
	内　ニュージーランド	565,257,423	0.10
	内　オランダ領キュラソー	428,906,416	0.07
	内　オーストリア	348,303,556	0.06
	内　ポルトガル	244,189,502	0.04
	内　リベリア	200,478,121	0.03
	内　パナマ	188,478,056	0.03
	内　マン島	161,958,938	0.03
	内　パプアニューギニア	66,660,348	0.01
投資信託受益証券		1,033,238,454	0.18
	内　オーストラリア	792,272,228	0.13
	内　シンガポール	240,966,226	0.04
投資証券		12,174,817,688	2.07
	内　アメリカ	11,240,239,957	1.91
	内　イギリス	347,497,631	0.06
	内　フランス	300,175,357	0.05
	内　香港	215,894,025	0.04
	内　カナダ	71,010,718	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,457,569,444	2.28
純資産総額		589,576,849,888	100.00

その他資産の投資状況

2021年7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）		13,718,971,440	2.33
	内　アメリカ	10,192,312,420	1.73
	内　ドイツ	2,129,607,952	0.36
	内　イギリス	610,165,449	0.10
	内　カナダ	490,493,289	0.08
	内　オーストラリア	296,392,330	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		223,530,583,850	98.78
	内　日本	223,530,583,850	98.78
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,756,428,314	1.22
純資産総額		226,287,012,164	100.00

その他資産の投資状況

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		2,666,288,500	1.18
	内　日本	2,666,288,500	1.18

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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		7,949,552,209	10.20
	内　オーストラリア	5,097,054,666	6.54
	内　シンガポール	2,852,497,543	3.66
投資証券		69,794,310,213	89.52
	内　アメリカ	58,425,997,058	74.94
	内　イギリス	4,323,042,652	5.54
	内　フランス	1,756,702,811	2.25
	内　カナダ	1,515,960,312	1.94
	内　香港	1,157,279,089	1.48
	内　ベルギー	1,091,037,208	1.40
	内　スペイン	341,372,372	0.44
	内　ニュージーランド	319,965,447	0.41
	内　ドイツ	231,566,239	0.30
	内　ガーンジィ	197,989,976	0.25
	内　オランダ	149,522,782	0.19
	内　韓国	133,239,835	0.17
	内　アイルランド	89,422,520	0.11
	内　イスラエル	47,689,636	0.06
	内　イタリア	13,522,276	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		224,636,388	0.29
純資産総額		77,968,498,810	100.00

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		152,139,102,084	98.32
	内　メキシコ	23,355,393,776	15.09
	内　インドネシア	21,170,382,148	13.68
	内　ロシア	19,975,485,897	12.91
	内　ブラジル	16,303,752,259	10.54
	内　コロンビア	14,064,792,017	9.09
	内　フィリピン	13,545,073,466	8.75
	内　南アフリカ	10,482,243,011	6.77
	内　パナマ	9,738,162,952	6.29
	内　ペルー	8,110,384,813	5.24
	内　ハンガリー	6,127,443,728	3.96
	内　ルーマニア	6,011,087,254	3.88
	内　クロアチア	3,254,900,763	2.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,595,023,392	1.68
純資産総額		154,734,125,476	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7月30日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		51,561,665,388	85.83
	内　ケイマン諸島	11,609,517,161	19.33
	内　台湾	7,343,315,889	12.22
	内　韓国	7,002,270,456	11.66
	内　中国	5,578,117,984	9.29
	内　インド	5,523,357,645	9.19
	内　ブラジル	2,708,003,588	4.51
	内　南アフリカ	1,871,915,000	3.12
	内　サウジアラビア	1,592,883,509	2.65
	内　ロシア	1,492,900,775	2.49
	内　タイ	821,883,257	1.37
	内　メキシコ	705,017,867	1.17
	内　マレーシア	665,381,647	1.11
	内　インドネシア	618,128,761	1.03
	内　香港	590,765,694	0.98
	内　アラブ首長国連邦	391,127,262	0.65
	内　カタール	345,275,895	0.57
	内　ポーランド	340,537,179	0.57
	内　バミューダ	318,705,383	0.53
	内　フィリピン	302,446,910	0.50
	内　クエート	296,026,245	0.49
	内　チリ	225,484,550	0.38
	内　アメリカ	202,262,910	0.34
	内　オランダ	165,040,277	0.27
	内　トルコ	143,187,460	0.24
	内　ルクセンブルグ	130,169,652	0.22
	内　ハンガリー	125,832,130	0.21
	内　キプロス	87,803,791	0.15
	内　ギリシャ	87,267,920	0.15
	内　コロンビア	76,304,289	0.13
	内　チェコ	58,318,625	0.10
	内　ジャージィー	54,498,802	0.09
	内　エジプト	29,176,458	0.05
	内　マン島	16,397,692	0.03
	内　イギリス領バージン諸島	15,591,960	0.03
	内　シンガポール	8,864,864	0.01
	内　ペルー	8,524,617	0.01
	内　パキスタン	7,324,087	0.01
	内　アルゼンチン	2,037,197	0.00
投資信託受益証券		394,410,401	0.66
	内　メキシコ	267,409,063	0.45
	内　ブラジル	127,001,338	0.21
投資証券		46,628,872	0.08
	内　南アフリカ	26,007,523	0.04
	内　メキシコ	20,621,349	0.03

コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,072,110,814	13.44
純資産総額	60,074,815,475	100.00

その他資産の投資状況

2021年7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）		8,094,427,085	13.47
	内　アメリカ	8,094,427,085	13.47

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）資産の種類の内書は、当該資産の発行体又は上場金融商品取引所の国/地域別に表示しています。
（注3）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2021年7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	219,251,266,367	1.4450 316,835,769,781	1.4578 319,624,496,109	－ －	55.07
2	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	17,395,497,058	3.2008 55,681,044,287	3.1172 54,225,243,429	－ －	9.34
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	33,273,125,640	1.3097 43,579,495,576	1.3125 43,670,977,402	－ －	7.52
4	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	18,627,748,264	2.1818 40,643,776,940	2.1668 40,362,604,938	－ －	6.95
5	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	6,272,856,818	5.4478 34,173,896,658	5.4788 34,367,727,934	－ －	5.92
6	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	11,477,374,637	2.5612 29,396,852,033	2.5437 29,194,997,864	－ －	5.03
7	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	14,848,949,235	1.5552 23,094,570,745	1.5595 23,156,936,331	－ －	3.99
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	8,122,059,671	1.4728 11,962,789,994	1.4459 11,743,686,078	－ －	2.02

（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7月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	95.85

合計	95.85

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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	３２５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,700,000,000	101.28 5,772,994,000	101.05 5,760,192,000	0.8 2022/9/20	1.14
2	３５０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	5,410,000,000	101.07 5,468,112,900	101.50 5,491,366,400	0.1 2028/3/20	1.09
3	４２０回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	4,900,000,000	100.38 4,919,106,000	100.34 4,916,660,000	0.1 2023/1/1	0.97
4	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,790,000,000	101.04 4,840,265,400	101.24 4,849,683,400	0.1 2026/12/20	0.96
5	３２９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,750,000,000	102.02 4,845,982,800	101.74 4,832,887,500	0.8 2023/6/20	0.96
6	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,710,000,000	102.28 4,817,604,200	102.24 4,815,739,500	0.4 2025/9/20	0.95
7	３３４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,640,000,000	102.32 4,747,984,600	102.14 4,739,342,400	0.6 2024/6/20	0.94
8	３３３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,630,000,000	102.08 4,726,675,000	101.94 4,719,822,000	0.6 2024/3/20	0.93
9	３３８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,530,000,000	102.01 4,621,158,000	101.98 4,620,056,400	0.4 2025/3/20	0.92
10	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,530,000,000	101.07 4,578,638,100	101.48 4,597,044,000	0.1 2027/12/20	0.91
11	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.99 4,544,722,000	101.13 4,550,850,000	0.1 2026/6/20	0.90
12	３３０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,460,000,000	102.23 4,559,598,700	101.97 4,548,263,400	0.8 2023/9/20	0.90
13	１４７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,500,000,000	100.53 4,524,288,000	100.62 4,528,260,000	0.005 2026/3/20	0.90

14	３４１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,420,000,000	101.91 4,504,548,900	101.91 4,504,775,600	0.3 2025/12/20	0.89
15	３３９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,410,000,000	102.17 4,505,799,400	102.12 4,503,800,700	0.4 2025/6/20	0.89
16	３４８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,390,000,000	101.10 4,438,713,200	101.42 4,452,425,800	0.1 2027/9/20	0.88
17	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,390,000,000	100.99 4,433,772,700	101.18 4,442,153,200	0.1 2026/9/20	0.88
18	３５２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,340,000,000	101.02 4,384,319,000	101.58 4,408,702,200	0.1 2028/9/20	0.87
19	１４５回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,350,000,000	100.96 4,391,930,000	100.99 4,393,369,500	0.1 2025/9/20	0.87
20	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,330,000,000	101.08 4,376,889,400	101.36 4,389,017,900	0.1 2027/6/20	0.87
21	３３５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,300,000,000	102.14 4,392,326,000	102.01 4,386,602,000	0.5 2024/9/20	0.87
22	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,310,000,000	101.01 4,353,921,500	101.60 4,379,003,100	0.1 2028/12/20	0.87
23	３５１回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,300,000,000	101.11 4,347,858,200	101.56 4,367,123,000	0.1 2028/6/20	0.87
24	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,290,000,000	101.08 4,336,693,000	101.30 4,345,941,600	0.1 2027/3/20	0.86
25	３４２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,280,000,000	100.99 4,322,377,000	101.07 4,325,838,800	0.1 2026/3/20	0.86
26	３３２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,180,000,000	101.93 4,260,720,400	101.74 4,252,941,000	0.6 2023/12/20	0.84
27	１４２回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,130,000,000	100.83 4,164,664,900	100.83 4,164,402,900	0.1 2024/12/20	0.82
28	１４４回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,100,000,000	100.90 4,136,977,000	100.95 4,139,196,000	0.1 2025/6/20	0.82
29	３６２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,950,000,000	100.49 3,969,651,000	100.96 3,988,038,500	0.1 2031/3/20	0.79
30	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,940,000,000	100.41 3,956,444,500	101.19 3,986,886,000	0.1 2030/9/20	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7月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	85.41
地方債証券	5.37
特殊債券	5.15
社債券	3.80
合計	99.72

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率（%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	1,478,100	8,442.46 12,478,807,343	9,805.00 14,492,770,500	－ －	3.71
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	913,800	11,772.06 10,757,316,407	11,375.00 10,394,475,000	－ －	2.66
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	143,200	55,531.38 7,952,094,533	60,740.00 8,697,968,000	－ －	2.23
4	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,135,900	9,201.51 10,452,005,351	6,837.00 7,766,148,300	－ －	1.99
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	9,842,600	559.31 5,505,138,493	578.50 5,693,944,100	－ －	1.46
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	998,600	5,127.41 5,120,234,254	5,629.00 5,621,119,400	－ －	1.44
7	任天堂 日本	株式 その他製品	83,600	63,545.89 5,312,436,409	56,400.00 4,715,040,000	－ －	1.21
8	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,674,500	2,822.45 4,726,202,543	2,802.50 4,692,786,250	－ －	1.20
9	信越化学工業 日本	株式 化学	264,200	18,318.38 4,839,717,623	17,750.00 4,689,550,000	－ －	1.20
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,213,600	3,731.65 4,528,740,580	3,682.00 4,468,475,200	－ －	1.14
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	701,000	5,288.26 3,707,076,355	6,258.00 4,386,858,000	－ －	1.12
12	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	284,600	13,532.36 3,851,311,208	15,405.00 4,384,263,000	－ －	1.12

13	日本電産 日本	株式 電気機器	351,300	13,662.03 4,799,472,658	12,240.00 4,299,912,000	－ －	1.10
14	ダイキン工業 日本	株式 機械	185,700	22,598.76 4,196,589,827	22,665.00 4,208,890,500	－ －	1.08
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,148,600	3,183.61 3,656,697,244	3,493.00 4,012,059,800	－ －	1.03
16	村田製作所 日本	株式 電気機器	428,900	9,145.87 3,922,667,120	9,040.00 3,877,256,000	－ －	0.99
17	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	85,500	43,426.62 3,712,976,533	44,920.00 3,840,660,000	－ －	0.98
18	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,148,100	3,419.67 3,926,127,985	3,332.00 3,825,469,200	－ －	0.98
19	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	995,900	3,740.11 3,724,779,995	3,695.00 3,679,850,500	－ －	0.94
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,005,200	3,208.18 3,224,866,941	3,232.00 3,248,806,400	－ －	0.83
21	ファナック 日本	株式 電気機器	128,100	27,575.10 3,532,370,313	24,380.00 3,123,078,000	－ －	0.80
22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,955,100	1,573.18 3,075,725,570	1,565.50 3,060,709,050	－ －	0.78
23	三井物産 日本	株式 卸売業	1,145,800	2,185.54 2,504,198,962	2,499.50 2,863,927,100	－ －	0.73
24	ＳＭＣ 日本	株式 機械	42,600	64,802.39 2,760,582,100	64,800.00 2,760,480,000	－ －	0.71
25	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	562,000	4,506.93 2,532,896,180	4,868.00 2,735,816,000	－ －	0.70
26	三菱商事 日本	株式 卸売業	874,500	2,931.50 2,563,599,669	3,062.00 2,677,719,000	－ －	0.69
27	第一三共 日本	株式 医薬品	1,146,000	3,016.25 3,456,630,998	2,159.50 2,474,787,000	－ －	0.63
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	473,700	5,450.56 2,581,933,659	5,210.00 2,467,977,000	－ －	0.63
29	富士通 日本	株式 電気機器	131,400	16,984.08 2,231,708,357	18,565.00 2,439,441,000	－ －	0.62
30	デンソー 日本	株式 輸送用機器	321,200	7,005.93 2,250,304,787	7,482.00 2,403,218,400	－ －	0.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.23
合計	97.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年7月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	17.97
情報・通信業		8.26
輸送用機器		7.87
化学		6.93
サービス業		5.51
機械		5.36
医薬品		4.92
銀行業		4.79
卸売業		4.74
小売業		4.45
食料品		3.28
陸運業		3.19
精密機器		2.72
建設業		2.29
その他製品		2.25
不動産業		1.93
保険業		1.85
電気・ガス業		1.17
その他金融業		1.09
鉄鋼		0.79
ガラス・土石製品		0.75
証券、商品先物取引業		0.73
非鉄金属		0.71
ゴム製品		0.70
金属製品		0.61
繊維製品		0.49
空運業		0.44
石油・石炭製品		0.41
海運業		0.35
パルプ・紙		0.24
鉱業		0.18
倉庫・運輸関連業		0.18
水産・農林業		0.09
合計		97.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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7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	3,561,709,700	94.86 3,378,893,800	96.78 3,447,206,288	0.875 2030/11/15	0.60
2	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	3,267,181,600	92.92 3,036,181,633	94.86 3,099,355,660	0.625 2030/8/15	0.54
3	US T N/B 0.875 06/30/26 アメリカ	国債証券	2,647,468,200	99.99 2,647,275,252	100.77 2,668,048,107	0.875 2026/6/30	0.46

4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	2,669,366,200	96.86 2,585,739,948	98.78 2,636,937,564	1.125 2031/2/15	0.46
5	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	1,264,669,200	173.01 2,188,034,103	178.88 2,262,245,323	4.5 2041/4/25	0.39
6	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	2,138,339,700	105.77 2,261,795,394	105.76 2,261,544,802	2.75 2023/11/15	0.39
7	US T N/B 0.125 02/28/23 アメリカ	国債証券	2,245,639,900	99.85 2,242,481,967	99.97 2,245,113,565	0.125 2023/2/28	0.39
8	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証券	2,227,026,600	99.84 2,223,546,870	100.15 2,230,506,329	0.375 2024/4/15	0.39
9	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	2,218,267,400	99.57 2,208,822,415	99.88 2,215,667,856	0.25 2024/3/15	0.38
10	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証券	2,216,077,600	94.71 2,099,041,001	98.71 2,187,684,105	1.875 2051/2/15	0.38
11	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	2,298,195,100	93.24 2,143,022,045	95.16 2,187,145,598	0.625 2030/5/15	0.38
12	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,879,943,300	110.99 2,086,663,610	112.39 2,113,026,884	2.875 2028/5/15	0.37
13	US T N/B 1.375 11/15/40 アメリカ	国債証券	2,248,924,600	89.29 2,008,131,522	92.46 2,079,464,599	1.375 2040/11/15	0.36
14	FRANCE OAT 1.5 05/25/31 フランス	国債証券	1,679,720,100	113.89 1,913,039,940	116.52 1,957,288,807	1.5 2031/5/25	0.34
15	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	1,683,956,200	112.98 1,902,541,593	114.55 1,928,984,977	3.125 2028/11/15	0.33
16	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	1,310,207,700	144.40 1,892,006,840	146.35 1,917,533,516	5.5 2029/4/25	0.33
17	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証券	1,803,300,300	106.24 1,916,006,568	106.30 1,917,063,175	2.75 2024/2/15	0.33
18	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	1,740,891,000	107.50 1,871,525,822	108.70 1,892,470,916	2.375 2027/5/15	0.33
19	US T N/B 1.5 02/15/30 アメリカ	国債証券	1,831,767,700	100.78 1,846,078,384	102.64 1,880,209,363	1.5 2030/2/15	0.32
20	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	1,502,770,500	122.38 1,839,107,068	124.77 1,875,045,824	2.5 2030/5/25	0.32
21	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	1,853,665,700	99.49 1,844,324,948	100.32 1,859,748,040	0.75 2026/3/31	0.32
22	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証券	1,853,665,700	98.39 1,823,978,075	99.24 1,839,690,783	0.5 2026/2/28	0.32
23	US T N/B 1.875 02/15/41 アメリカ	国債証券	1,819,723,800	97.32 1,771,031,956	100.64 1,831,523,560	1.875 2041/2/15	0.32
24	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,642,350,000	110.10 1,808,253,001	111.40 1,829,680,545	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	1,790,161,500	99.32 1,777,993,986	99.61 1,783,238,604	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	1,675,197,000	105.95 1,774,989,003	106.11 1,777,606,498	2.5 2024/5/15	0.31
27	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,653,299,000	106.31 1,757,728,075	106.96 1,768,448,678	2.25 2025/11/15	0.31
28	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,590,889,700	109.55 1,742,956,370	111.14 1,768,249,034	2.625 2029/2/15	0.31

29	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,665,342,900	105.90 1,763,702,213	106.07 1,766,499,457	2.375 2024/8/15	0.31
30	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,052,589,900	162.95 1,715,298,395	166.27 1,750,189,645	5.75 2032/10/25	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7月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.38
合計	97.38

（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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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	1,597,566	14,699.55 23,483,515,481	15,946.12 25,474,984,895	－ －	4.32
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	681,800	26,906.30 18,344,719,065	31,368.88 21,387,305,793	－ －	3.63
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	40,745	358,324.73 14,599,941,441	394,155.24 16,059,855,286	－ －	2.72
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	229,029	30,313.96 6,942,777,987	39,232.45 8,985,370,348	－ －	1.52
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	28,694	232,248.53 6,664,139,563	297,325.56 8,531,459,891	－ －	1.45

6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	27,998	233,621.57 6,540,936,993	298,996.38 8,371,300,840	－ －	1.42
7	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	73,128	86,232.28 6,305,994,863	74,163.05 5,423,395,630	－ －	0.92
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	235,800	16,521.54 3,895,781,323	21,527.92 5,076,284,432	－ －	0.86
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	290,618	15,765.04 4,581,605,734	16,751.96 4,868,424,017	－ －	0.83
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	250,084	18,200.45 4,551,642,003	18,851.98 4,714,580,617	－ －	0.80
11	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	161,378	23,273.39 3,755,813,234	27,144.76 4,380,567,208	－ －	0.74
12	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	90,263	36,931.81 3,333,576,790	45,118.63 4,072,543,730	－ －	0.69
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	130,659	27,102.85 3,541,231,686	30,630.92 4,002,205,689	－ －	0.68
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	274,327	12,303.58 3,375,206,233	13,740.64 3,769,429,920	－ －	0.64
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	102,578	30,828.80 3,162,357,163	35,850.31 3,677,453,170	－ －	0.62
16	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	84,411	37,840.82 3,194,181,639	42,570.80 3,593,444,381	－ －	0.61
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	234,237	14,064.67 3,294,466,123	15,271.66 3,577,189,041	－ －	0.61
18	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	173,115	20,491.33 3,547,357,701	19,527.54 3,380,510,346	－ －	0.57
19	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	39,970	64,770.03 2,588,858,218	83,621.69 3,342,359,229	－ －	0.57
20	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術サービス	106,102	32,070.47 3,402,741,390	31,004.28 3,289,616,466	－ －	0.56

21	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	740,316	3,772.58 2,792,901,566	4,235.07 3,135,292,451	－ －	0.53
22	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフトウェア	45,638	54,604.95 2,492,061,022	68,069.93 3,106,575,602	－ －	0.53
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	67,324	37,920.04 2,552,929,063	42,007.45 2,828,110,237	－ －	0.48
24	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	435,455	5,884.20 2,562,307,521	6,362.46 2,770,566,717	－ －	0.47
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	404,291	5,700.70 2,304,744,902	6,452.24 2,608,584,866	－ －	0.44
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	530,884	3,849.44 2,043,610,639	4,685.07 2,487,232,471	－ －	0.42
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	389,600	5,597.30 2,180,710,439	6,246.40 2,433,599,193	－ －	0.41
28	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフトウェア	90,909	25,968.44 2,360,765,729	26,719.93 2,429,082,989	－ －	0.41
29	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	401,554	5,249.86 2,108,102,462	6,029.61 2,421,215,740	－ －	0.41
30	VERIZON COMM INC アメリカ	株式 各種電気通信サービス	392,604	5,970.95 2,344,222,028	6,129.25 2,406,368,145	－ －	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7月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.48
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.07
合計	97.72

（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7月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	7.56
銀行		5.76
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.88
情報技術サービス		4.60
コンピュータ・周辺機器		4.59
医薬品		4.59
半導体・半導体製造装置		4.51
インターネット販売・通信販売		3.26
資本市場		3.21
ヘルスケア機器・用品		3.02

石油・ガス・消耗燃料	2.89
保険	2.88
化学	2.08
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	1.92
ホテル・レストラン・レジャー	1.81
バイオテクノロジー	1.76
電力	1.70
機械	1.70
専門小売り	1.67
自動車	1.62
飲料	1.59
金属・鉱業	1.59
繊維・アパレル・贅沢品	1.58
食品	1.54
航空宇宙・防衛	1.45
娯楽	1.40
各種電気通信サービス	1.35
食品・生活必需品小売り	1.33
ライフサイエンス・ツール／サービス	1.15
コングロマリット	1.13
メディア	1.08
家庭用品	1.06
陸運・鉄道	1.00
各種金融サービス	0.91
電気設備	0.88
専門サービス	0.81
総合公益事業	0.78
通信機器	0.67
航空貨物・物流サービス	0.67
タバコ	0.65
パーソナル用品	0.63
建設関連製品	0.63
電子装置・機器・部品	0.56
複合小売り	0.53
消費者金融	0.49
商業サービス・用品	0.43
不動産管理・開発	0.42
家庭用耐久財	0.37
商社・流通業	0.32
無線通信サービス	0.28
容器・包装	0.28
自動車部品	0.27
建設資材	0.25
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	0.14
ガス	0.14
運送インフラ	0.13
紙製品・林産品	0.11
水道	0.11

販売	0.10
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
海運業	0.08
レジャー用品	0.07
旅客航空輸送業	0.05
合計	95.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7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	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	21,403	708,116.73 15,155,822,503	708,000.00 15,153,324,000	－ －	6.70
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	18,885	688,756.89 13,007,174,053	687,000.00 12,973,995,000	－ －	5.73
3	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	61,161	188,234.56 11,512,614,374	196,500.00 12,018,136,500	－ －	5.31
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	29,919	346,811.48 10,376,252,888	366,000.00 10,950,354,000	－ －	4.84
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	95,284	118,247.02 11,267,049,489	114,500.00 10,910,018,000	－ －	4.82
6	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	61,069	179,491.41 10,961,361,164	174,100.00 10,632,112,900	－ －	4.70
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	26,945	328,857.53 8,861,066,412	326,000.00 8,784,070,000	－ －	3.88
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	37,628	211,642.54 7,963,685,828	209,000.00 7,864,252,000	－ －	3.48
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	18,882	366,479.26 6,919,861,552	373,500.00 7,052,427,000	－ －	3.12
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	42,513	161,239.81 6,854,788,247	161,100.00 6,848,844,300	－ －	3.03
11	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	26,810	207,014.30 5,550,053,490	211,900.00 5,681,039,000	－ －	2.51
12	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	55,545	93,100.58 5,171,271,772	96,600.00 5,365,647,000	－ －	2.37
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,411	437,857.70 5,434,251,953	428,000.00 5,311,908,000	－ －	2.35
14	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	5,842	805,067.99 4,703,207,242	807,000.00 4,714,494,000	－ －	2.08

15	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,463	513,753.39 4,861,648,387	497,500.00 4,707,842,500	－ －	2.08
16	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	23,119	184,072.76 4,255,578,180	201,000.00 4,646,919,000	－ －	2.05
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,521	644,369.82 4,201,935,648	671,000.00 4,375,591,000	－ －	1.93
18	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,020	586,061.14 4,114,149,221	614,000.00 4,310,280,000	－ －	1.90
19	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	12,339	327,193.86 4,037,245,062	332,500.00 4,102,717,500	－ －	1.81
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	57,855	68,149.63 3,942,797,339	66,700.00 3,858,928,500	－ －	1.71
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	83,120	44,401.15 3,690,623,945	43,050.00 3,578,316,000	－ －	1.58
22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	22,207	165,011.71 3,664,415,260	161,100.00 3,577,547,700	－ －	1.58
23	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,620	513,801.53 3,401,366,151	508,000.00 3,362,960,000	－ －	1.49
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,432	163,035.54 3,331,142,217	159,500.00 3,258,904,000	－ －	1.44
25	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	16,601	187,706.28 3,116,111,967	193,800.00 3,217,273,800	－ －	1.42
26	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,993	787,350.91 3,143,892,199	790,000.00 3,154,470,000	－ －	1.39
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	12,898	234,620.67 3,026,137,480	237,300.00 3,060,695,400	－ －	1.35
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,503	351,362.25 2,987,633,290	350,500.00 2,980,301,500	－ －	1.32
29	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	24,701	119,955.57 2,963,022,734	120,400.00 2,974,000,400	－ －	1.31
30	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 日本	投資証券	120,009	22,661.06 2,719,531,589	22,750.00 2,730,204,750	－ －	1.21

（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7月30日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	98.78
合計	98.78

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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	339,424	13,429.90 4,558,433,168	14,002.67 4,752,844,332	－ －	6.10
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	41,106	90,037.59 3,701,085,498	86,100.74 3,539,257,273	－ －	4.54
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	69,875	33,253.84 2,323,612,430	34,140.07 2,385,537,873	－ －	3.06
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	129,261	17,037.37 2,202,267,982	16,477.15 2,129,852,899	－ －	2.73
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	150,455	14,384.63 2,164,240,451	13,786.98 2,074,320,196	－ －	2.66
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	191,229	8,839.03 1,690,280,582	9,605.55 1,836,861,193	－ －	2.36
7	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	63,951	23,243.88 1,486,469,383	25,173.94 1,609,898,688	－ －	2.06
8	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	157,637	8,694.75 1,370,614,531	9,248.62 1,457,924,758	－ －	1.87
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	770,246	1,693.19 1,304,175,678	1,819.34 1,401,347,060	－ －	1.80
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	62,853	20,424.16 1,283,720,273	21,870.62 1,374,634,550	－ －	1.76
11	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	171,169	7,453.72 1,275,846,748	7,688.38 1,316,013,651	－ －	1.69
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	61,288	17,937.06 1,099,326,946	19,022.79 1,165,868,912	－ －	1.50
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	260,153	4,114.76 1,070,468,118	4,449.67 1,157,595,936	－ －	1.48
14	VENTAS INC アメリカ	投資証券	171,933	6,311.78 1,085,204,701	6,529.98 1,122,719,670	－ －	1.44
15	MID AMERICA アメリカ	投資証券	52,475	18,745.16 983,652,537	21,132.66 1,108,936,590	－ －	1.42
16	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,259	19,304.98 989,554,395	21,419.52 1,097,943,621	－ －	1.41
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	29,792	33,771.35 1,006,116,210	36,197.39 1,078,392,762	－ －	1.38
18	LINK REIT 香港	投資証券	953,620	1,095.25 1,044,455,088	1,056.75 1,007,737,935	－ －	1.29
19	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	247,065	3,708.23 916,176,178	4,066.45 1,004,679,594	－ －	1.29
20	SEGRO PLC イギリス	投資証券	549,561	1,672.79 919,303,299	1,825.48 1,003,213,713	－ －	1.29

21	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	171,911	5,338.97 917,828,525	5,574.13 958,255,276	－ －	1.23
22	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	65,135	13,083.74 852,209,936	12,964.71 844,456,444	－ －	1.08
23	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	246,266	3,503.30 862,743,906	3,393.09 835,603,957	－ －	1.07
24	UDR INC アメリカ	投資証券	136,132	5,433.84 739,719,743	6,086.54 828,574,102	－ －	1.06
25	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	44,813	14,846.46 665,314,584	16,286.63 729,853,086	－ －	0.94
26	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	81,647	8,422.07 687,636,776	8,809.56 719,274,586	－ －	0.92
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	77,790	8,409.66 654,187,966	9,119.42 709,399,845	－ －	0.91
28	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	132,242	4,957.50 655,591,016	4,756.24 628,975,430	－ －	0.81
29	MEDICAL PROPERTIES TRUST アメリカ	投資証券	269,140	2,219.54 597,367,559	2,280.67 613,821,327	－ －	0.79
30	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD フランス	投資証券	63,574	10,217.22 649,549,663	9,488.92 603,248,746	－ －	0.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.20
投資証券	89.52
合計	99.71

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年7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	2,956,230,000	124.09 3,668,667,962	127.36 3,765,202,339	5.25 2047/6/23	2.43
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,408,780,000	117.98 2,841,974,119	120.85 2,911,010,630	5.1 2035/3/28	1.88
3	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,299,290,000	109.28 2,512,669,586	104.17 2,395,262,364	5 2045/6/15	1.55
4	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	2,014,616,000	112.65 2,269,595,217	114.03 2,297,468,086	4.75 2026/5/27	1.48

5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,751,840,000	126.79 2,221,302,462	130.29 2,282,638,760	5.625 2042/4/4	1.48
6	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,631,401,000	123.09 2,008,216,966	126.03 2,056,111,779	6.05 2040/1/11	1.33
7	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,751,840,000	112.64 1,973,391,920	113.81 1,993,795,381	4.5 2029/4/22	1.29
8	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,795,636,000	109.14 1,959,828,955	108.73 1,952,529,695	4.875 2023/9/16	1.26
9	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,412,421,000	135.40 1,912,559,276	135.97 1,920,610,075	6.7 2036/1/26	1.24
10	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,259,135,000	149.53 1,882,842,420	152.42 1,919,290,540	7.75 2038/1/17	1.24
11	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,686,146,000	111.49 1,879,969,577	113.67 1,916,810,772	4.375 2029/3/21	1.24
12	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,686,146,000	110.87 1,869,597,370	112.16 1,891,282,522	4.25 2027/6/23	1.22
13	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	1,861,330,000	100.82 1,876,704,585	100.72 1,874,843,255	2.783 2031/1/23	1.21
14	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,313,880,000	135.66 1,782,430,958	137.21 1,802,787,886	5.625 2050/11/18	1.17
15	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,576,656,000	114.38 1,803,450,629	113.17 1,784,388,311	6 2024/1/26	1.15
16	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,751,840,000	99.30 1,739,730,406	100.84 1,766,608,011	3.875 2030/6/12	1.14
17	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,554,758,000	111.97 1,740,907,204	113.40 1,763,095,572	5.875 2025/9/16	1.14
18	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,532,860,000	113.19 1,735,112,117	114.83 1,760,321,095	4.75 2032/4/27	1.14
19	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,620,452,000	107.56 1,743,055,836	108.60 1,759,851,383	4.625 2028/1/13	1.14
20	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,729,942,000	98.71 1,707,671,186	99.92 1,728,609,944	5 2045/1/27	1.12
21	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	985,410,000	162.88 1,605,085,735	168.49 1,660,405,010	7.625 2041/3/29	1.07
22	UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45 メキシコ	国債証券	1,357,676,000	117.75 1,598,758,527	121.72 1,652,644,687	5.55 2045/1/21	1.07
23	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,464,976,200	113.62 1,664,630,185	112.53 1,648,681,285	5.375 2024/3/25	1.07
24	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,532,860,000	104.92 1,608,415,326	106.01 1,624,992,550	4.85 2029/9/30	1.05

25	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,423,370,000	113.18 1,611,084,035	112.09 1,595,579,266	5.75 2023/11/22	1.03
26	COLOMBIA 5.625 02/26/44 コロンビア	国債証券	1,423,370,000	115.58 1,645,175,936	111.19 1,582,758,972	5.625 2044/2/26	1.02
27	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110 メキシコ	国債証券	1,291,982,000	115.80 1,496,214,025	119.85 1,548,505,026	5.75 2110/10/12	1.00
28	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	1,094,900,000	139.72 1,529,808,513	141.28 1,546,956,826	6.375 2034/10/23	1.00
29	INDONESIA 6.75 01/15/44 インドネシア	国債証券	1,040,155,000	145.21 1,510,488,399	148.58 1,545,557,836	6.75 2044/1/15	1.00
30	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,357,676,000	112.08 1,521,798,663	113.76 1,544,553,313	4.15 2027/3/28	1.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年7月30日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.32
合計	98.32

（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7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	2,371.34 3,417,298,077	2,286.52 3,295,073,747	－ －	5.48
2	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	3,187.61 2,829,222,796	2,779.95 2,467,400,874	－ －	4.11
3	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	8,843.66 2,980,314,393	6,932.28 2,336,178,360	－ －	3.89

4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	279,951	7,951.64 2,226,071,808	7,560.29 2,116,513,545	－ －	3.52
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	4,050.05 858,612,427	3,218.15 682,249,072	－ －	1.14
6	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	230,721	2,333.21 538,322,611	2,490.12 574,525,054	－ －	0.96
7	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	25,534	25,922.31 661,900,268	21,475.07 548,344,445	－ －	0.91
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	166,403	2,869.63 477,516,174	3,038.80 505,667,100	－ －	0.84
9	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	199,050	2,006.57 399,409,549	2,393.16 476,358,498	－ －	0.79
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,603,530	91.36 511,961,712	76.22 427,139,720	－ －	0.71
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	8,339.48 423,937,669	7,875.61 400,356,924	－ －	0.67
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	100,287	3,797.49 380,839,000	3,573.90 358,416,110	－ －	0.60
13	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	76,062	3,951.06 300,525,695	4,666.46 354,940,569	－ －	0.59
14	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	32,124	12,871.07 413,470,444	10,909.79 350,466,415	－ －	0.58
15	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	1,517.89 302,061,089	1,755.61 349,367,186	－ －	0.58

16	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	363,500	1,246.42 453,075,235	951.77 345,971,848	－ －	0.58
17	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	47,221	7,159.77 338,091,765	6,947.81 328,083,008	－ －	0.55
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	88,507	3,743.23 331,302,247	3,659.22 323,867,115	－ －	0.54
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	729,225	475.50 346,749,320	435.34 317,462,269	－ －	0.53
20	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	845,400	372.26 314,714,675	364.93 308,512,667	－ －	0.51
21	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	299,985	865.11 259,520,297	1,017.49 305,234,737	－ －	0.51
22	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	36,811.51 266,478,580	42,060.14 304,473,425	－ －	0.51
23	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	351,271	693.20 243,502,527	857.74 301,300,824	－ －	0.50
24	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	160,668	1,696.09 272,508,148	1,818.08 292,107,510	－ －	0.49
25	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	15,867	22,901.45 363,377,342	18,291.39 290,229,634	－ －	0.48
26	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	23,636	11,848.52 280,051,691	11,047.54 261,119,679	－ －	0.43
27	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	14,517.12 374,716,029	10,084.02 260,288,956	－ －	0.43

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	11,363.92 208,005,227	14,211.44 260,126,380	－ －	0.43
29	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	53,622	4,709.03 252,507,913	4,729.78 253,620,477	－ －	0.42
30	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	25,186	8,769.35 220,865,034	9,591.32 241,567,086	－ －	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7月30日現在

種類	投資比率（%）
株式	85.83
投資信託受益証券	0.66
投資証券	0.08
合計	86.56

（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7月30日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	10.91
半導体・半導体製造装置		8.04
インターネット販売・通信販売		7.73
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.80
コンピュータ・周辺機器		5.24
石油・ガス・消耗燃料		4.36
金属・鉱業		4.24
自動車		2.80
化学		2.52
電子装置・機器・部品		2.50
保険		2.24
情報技術サービス		1.93
食品		1.54
不動産管理・開発		1.50
無線通信サービス		1.32
医薬品		1.23
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.08
繊維・アパレル・贅沢品		1.07
食品・生活必需品小売り		1.01
娯楽		1.00
各種電気通信サービス		0.97
飲料		0.96

資本市場	0.91
バイオテクノロジー	0.86
コングロマリット	0.79
建設資材	0.77
ホテル・レストラン・レジャー	0.65
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.62
各種金融サービス	0.61
電力	0.60
貯蓄・抵当・不動産金融	0.60
パーソナル用品	0.55
専門小売り	0.55
電気設備	0.53
海運業	0.51
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.50
ガス	0.50
運送インフラ	0.49
自動車部品	0.49
消費者金融	0.45
機械	0.45
建設・土木	0.43
家庭用耐久財	0.39
複合小売り	0.35
ソフトウェア	0.35
家庭用品	0.34
ヘルスケア機器・用品	0.30
タバコ	0.26
陸運・鉄道	0.25
航空貨物・物流サービス	0.23
商業サービス・用品	0.23
通信機器	0.19
紙製品・林産品	0.17
メディア	0.12
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
旅客航空輸送業	0.10
航空宇宙・防衛	0.10
各種消費者サービス	0.10
水道	0.09
商社・流通業	0.08
レジャー用品	0.06
容器・包装	0.06
エネルギー設備・サービス	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	85.83

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０３０９月	買建	574	11,128,323,620	10,934,700,000	2.80

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7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	422	9,984,327,406	10,192,312,420	1.73

	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep21	買建	398	2,104,855,826	2,129,607,952	0.36
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep21	買建	57	607,290,505	610,165,449	0.10
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep21	買建	23	486,322,646	490,493,289	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep21	買建	20	292,397,846	296,392,330	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7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（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０３０９月	買建	1,241	2,659,393,010	2,666,288,500	1.18

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Sep21	買建	1,146	8,401,219,707	8,094,427,085	13.47

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。
（注2）先物取引の時価は、原則として計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2021年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1特定期間末（2013年1月11日）	50	50	1.0170	1.0170
第2特定期間末（2013年7月11日）	51	51	1.0312	1.0312
第4計算期間末（2014年1月14日）	880	880	1.0440	1.0440

第5計算期間末 (2014年7月11日)	4,155	4,155	1.0597	1.0597
第6計算期間末 (2015年1月13日)	11,244	11,273	1.1340	1.1370
第7計算期間末 (2015年7月13日)	28,752	28,830	1.1117	1.1147
第8計算期間末 (2016年1月12日)	31,162	31,249	1.0760	1.0790
第9計算期間末 (2016年7月11日)	31,925	32,011	1.1223	1.1253
第10計算期間末 (2017年1月11日)	38,014	38,115	1.1200	1.1230
第11計算期間末 (2017年7月11日)	59,334	59,493	1.1175	1.1205
第12計算期間末 (2018年1月11日)	86,417	86,642	1.1513	1.1543
第13計算期間末 (2018年7月11日)	103,558	103,832	1.1324	1.1354
第14計算期間末 (2019年1月11日)	113,879	114,185	1.1159	1.1189
第15計算期間末 (2019年7月11日)	128,732	129,059	1.1819	1.1849
第16計算期間末 (2020年1月14日)	177,243	177,685	1.2017	1.2047
第17計算期間末 (2020年7月13日)	227,606	229,097	1.2217	1.2297
第18計算期間末 (2021年1月12日)	397,433	400,009	1.2341	1.2421
第19計算期間末 (2021年7月12日)	570,151	573,835	1.2382	1.2462
2020年7月末日	244,169	－	1.2239	－
8月末日	269,819	－	1.2198	－
9月末日	307,795	－	1.2258	－
10月末日	329,979	－	1.2205	－
11月末日	351,745	－	1.2340	－
12月末日	385,644	－	1.2407	－
2021年1月末日	417,820	－	1.2322	－
2月末日	444,059	－	1.2184	－
3月末日	495,829	－	1.2273	－
4月末日	517,353	－	1.2254	－
5月末日	539,542	－	1.2268	－
6月末日	565,150	－	1.2384	－
7月末日	580,414	－	1.2400	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000

第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0030
第7計算期間	0.0030
第8計算期間	0.0030
第9計算期間	0.0030
第10計算期間	0.0030
第11計算期間	0.0030
第12計算期間	0.0030
第13計算期間	0.0030
第14計算期間	0.0030
第15計算期間	0.0030
第16計算期間	0.0030
第17計算期間	0.0080
第18計算期間	0.0080
第19計算期間	0.0080

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1特定期間	1.7
第2特定期間	1.4
第4計算期間	1.2
第5計算期間	1.5
第6計算期間	7.3
第7計算期間	△1.7
第8計算期間	△2.9
第9計算期間	4.6
第10計算期間	0.1
第11計算期間	0.0
第12計算期間	3.3
第13計算期間	△1.4
第14計算期間	△1.2
第15計算期間	6.2
第16計算期間	1.9
第17計算期間	2.3
第18計算期間	1.7
第19計算期間	1.0

（注1）収益率は期間騰落率です。
（注2）特定期間の収益率は、各特定期間中の分配金累計額を加算して算出しています。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	50,000,000	0
第2特定期間	0	0
第4計算期間	844,538,323	50,979,041
第5計算期間	3,174,425,855	96,482,762
第6計算期間	6,639,205,080	645,472,921
第7計算期間	16,792,100,733	843,066,957
第8計算期間	5,531,718,781	2,433,705,327

第9計算期間	**2,334,562,803**	**2,849,184,376**
第10計算期間	**8,018,264,356**	**2,525,414,015**
第11計算期間	**23,156,860,002**	**4,001,221,708**
第12計算期間	**31,107,752,180**	**9,142,866,802**
第13計算期間	**22,536,763,057**	**6,150,567,476**
第14計算期間	**17,417,751,561**	**6,817,081,474**
第15計算期間	**23,826,278,649**	**16,952,417,502**
第16計算期間	**54,251,614,296**	**15,683,190,372**
第17計算期間	**56,117,429,412**	**17,311,597,198**
第18計算期間	**156,506,231,236**	**20,752,801,348**
第19計算期間	**164,685,957,575**	**26,269,603,361**

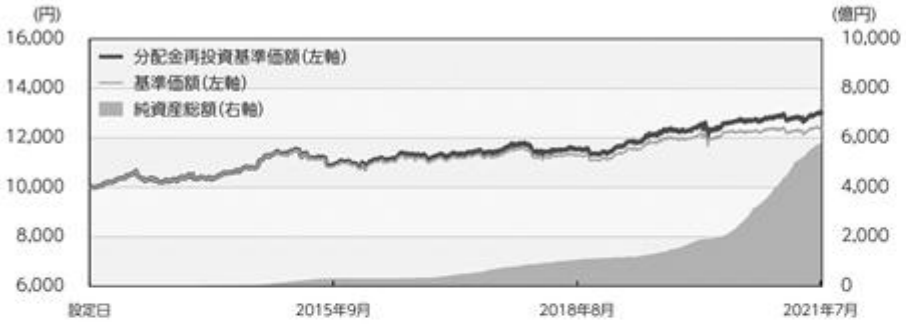
（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1特定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7月30日

基準価額・純資産の推移 《2012年10月26日～2021年7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:2012年10月26日)

分配の推移(税引前)

2019年 7月	30円
2020年 1月	30円
2020年 7月	80円
2021年 1月	80円
2021年 7月	80円
設定来累計	570円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	55.07
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.34
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.52
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.95
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.92
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	5.03
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.99
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.02

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	325回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2022/9/20	1.14
2	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.09
3	420回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2023/1/1	0.97
4	345回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.96
5	329回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.8	2023/6/20	0.96

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.71
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.66
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.23
4	ソフトバンクグループ	株式	日本	情報・通信業	1.99
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.46

○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7月30日

■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	0.60
2	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.54
3	US T N/B 0.875 06/30/26	国債証券	アメリカ	0.875	2026/6/30	0.46
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.46
5	FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	フランス	4.5	2041/4/25	0.39

■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	4.32
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.63
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.72
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	1.52
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.45

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.70
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.73
3	GLP投資法人	投資証券	日本	5.31
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.84
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.82

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.10
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.54
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.06
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.73
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	2.66

○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7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	2.43
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.88
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 4.75 05/27/26	国債証券	ロシア	4.75	2026/5/27	1.48
5	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	国債証券	ロシア	5.625	2042/4/4	1.48

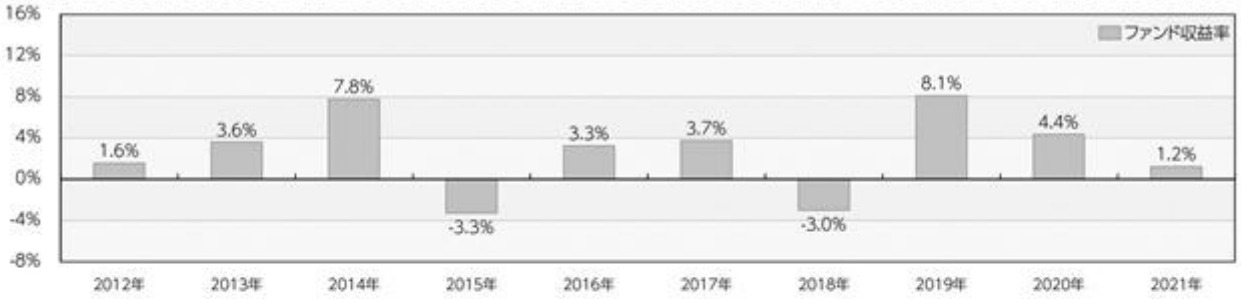
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

※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	5.48
2	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	4.11
3	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	3.89
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.52
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.14

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。
※2012年は設定日から年末までの収益率、および2021年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。
○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

当ファンドでは、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、取得申込者は販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」にしたがい分配金再投資に関する契約を締結します。なお、販売会社によっては、当該契約または規定について同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

「分配金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1万口当たりに換算した基準価額で表示することがあります。)

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

※ただし、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。

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から7月11日まで、7月12日から翌年1月11日までとします。

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

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

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

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

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

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

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

ロ.信託約款の変更等

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

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、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発します。

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、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にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

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

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

・委託会社は、毎年1月11日、7月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の請求があった場合には、これを交付します。

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドの計算期間は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19期計算期間（2021年1月13日から2021年7月12日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【投資のソムリエ】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,052,914,588	29,847,143,073
親投資信託受益証券	391,483,263,149	548,098,196,014
派生商品評価勘定	172,068,920	746,019,510
流動資産合計	404,708,246,657	578,691,358,597
資産合計	404,708,246,657	578,691,358,597
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,727,025,700	188,738,500
未払収益分配金	2,576,395,576	3,683,726,410
未払解約金	560,817,760	894,502,854
未払受託者報酬	86,025,526	134,668,575
未払委託者報酬	2,322,690,285	3,636,052,544
その他未払費用	2,174,830	2,135,981
流動負債合計	7,275,129,677	8,539,824,864
負債合計	7,275,129,677	8,539,824,864
純資産の部		
元本等		
元本	322,049,447,045	460,465,801,259
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	75,383,669,935	109,685,732,474
（分配準備積立金）	11,384,925,367	13,175,778,723
元本等合計	397,433,116,980	570,151,533,733
純資産合計	397,433,116,980	570,151,533,733
負債純資産合計	404,708,246,657	578,691,358,597

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第18期 自　2020年7月14日 至　2021年1月12日	第19期 自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
営業収益		
受取利息	18,891	3,015
有価証券売買等損益	9,975,605,763	14,371,982,865
為替差損益	△1,965,299,190	△4,421,947,030
営業収益合計	8,010,325,464	9,950,038,850
営業費用		
支払利息	4,066,564	4,968,620
受託者報酬	86,025,526	134,668,575
委託者報酬	2,322,690,285	3,636,052,544
その他費用	2,180,770	2,510,601
営業費用合計	2,414,963,145	3,778,200,340
営業利益又は営業損失（△）	5,595,362,319	6,171,838,510
経常利益又は経常損失（△）	5,595,362,319	6,171,838,510
当期純利益又は当期純損失（△）	5,595,362,319	6,171,838,510
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（△）	134,220,204	△29,561,194
期首剰余金又は期首欠損金（△）	41,310,621,330	75,383,669,935
剰余金増加額又は欠損金減少額	35,815,186,255	37,911,322,387
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	35,815,186,255	37,911,322,387
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,626,884,189	6,126,933,142
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,626,884,189	6,126,933,142
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	2,576,395,576	3,683,726,410
期末剰余金又は期末欠損金（△）	75,383,669,935	109,685,732,474

（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19期 自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　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	計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年1月11日及び7月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2021年1月12日、当計算期間末日を2021年7月12日としております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
１．　期首元本額	186,296,017,157円	322,049,447,045円
期中追加設定元本額	156,506,231,236円	164,685,957,575円
期中一部解約元本額	20,752,801,348円	26,269,603,361円
２．　受益権の総数	322,049,447,045口	460,465,801,259口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第18期 自　2020年7月14日 至　2021年1月12日	第19期 自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,119,823,287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（3,341,318,828円）、信託約款に規定される収益調整金（63,998,744,568円）及び分配準備積立金（8,500,178,828円）より分配対象収益は77,960,065,511円（1万口当たり2,420.74円）であり、うち2,576,395,576円（1万口当たり80円）を分配金額としております。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,763,221,824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（3,438,177,880円）、信託約款に規定される収益調整金（96,509,953,751円）及び分配準備積立金（10,658,105,429円）より分配対象収益は113,369,458,884円（1万口当たり2,462.06円）であり、うち3,683,726,410円（1万口当たり80円）を分配金額としております。

（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18期 自　2020年7月14日 至　2021年1月12日	第19期 自　2021年1月13日 至　2021年7月12日

１． 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、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18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（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18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	9,267,327,590	11,507,851,349
合計	9,267,327,590	11,507,851,349

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第18期 2021年1月12日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	82,073,363,700	－	83,800,328,000	△1,726,964,300
イギリス・ポンド	41,639,264,330	－	42,199,550,000	△560,285,670
オーストラリア・ドル	15,696,179,480	－	16,469,530,000	△773,350,520
カナダ・ドル	11,605,938,440	－	11,758,068,000	△152,129,560
ユーロ	13,131,981,450	－	13,373,180,000	△241,198,550

買建	13,324,618,480	－	13,496,626,000	172,007,520
オーストラリア・ドル	2,303,137,200	－	2,400,970,000	97,832,800
カナダ・ドル	3,674,812,800	－	3,718,224,000	43,411,200
ユーロ	7,346,668,480	－	7,377,432,000	30,763,520
合計	95,397,982,180	－	97,296,954,000	△1,554,956,780

種類	第19期 2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	53,222,017,180	－	52,529,410,150	692,607,030
イギリス・ポンド	28,356,421,120	－	28,301,773,970	54,647,150
オーストラリア・ドル	12,460,582,470	－	12,081,977,280	378,605,190
カナダ・ドル	2,850,471,560	－	2,776,240,420	74,231,140
ユーロ	9,554,542,030	－	9,369,418,480	185,123,550
買建	19,145,968,600	－	19,010,642,580	△135,326,020
イギリス・ポンド	17,176,468,860	－	17,082,087,480	△94,381,380
オーストラリア・ドル	974,492,400	－	947,121,600	△27,370,800
ユーロ	995,007,340	－	981,433,500	△13,573,840
合計	72,367,985,780	－	71,540,052,730	557,281,010

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第18期 2021年1月12日現在	第19期 2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2341円 (12,341円)	1.2382円 (12,382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7月12日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	16,950,643,065	54,281,044,287	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	32,541,418,322	42,619,495,576	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	11,266,486,563	28,856,852,033	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	6,272,856,818	34,173,896,658	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	14,848,949,235	23,094,570,745	
	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	217,969,390,852	314,965,769,781	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	7,329,994,593	10,852,789,994	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	17,988,990,853	39,253,776,940	
親投資信託受益証券　合計		325,168,730,301	548,098,196,014	
合計			548,098,196,014	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,946,089,561
国債証券	426,492,683,100
地方債証券	26,894,257,824
特殊債券	25,966,555,375
社債券	19,066,493,310
未収利息	487,539,989
前払費用	260,607,560
流動資産合計	501,114,226,719
資産合計	501,114,226,719
負債の部	
流動負債	
未払金	1,779,490,000
未払解約金	1,119,630,000
流動負債合計	2,899,120,000
負債合計	2,899,120,000
純資産の部	
元本等	
元本	380,394,285,340
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	117,820,821,379
元本等合計	498,215,106,719
純資産合計	498,215,106,719
負債純資産合計	501,114,226,719

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	197,306,195,501円
同期中追加設定元本額	276,468,106,848円
同期中一部解約元本額	93,380,017,009円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	23,042,911,051円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	58,205,108円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	85,026,637円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	18,528,789円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	762,444,247円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	149,488,676円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	24,482,688円
たわらノーロード　国内債券	14,138,281,498円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,870,432,413円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	659,009,703円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,077,867,513円
たわらノーロード　バランス（積極型）	133,979,181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）	50,322,288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）	1,032,135,636円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	1,094,659,034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）	350,082,359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）	128,135,170円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	15,940,274円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	7,991,762円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	38,385,735円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,389,438円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	526,112円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,300,394,933円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	8,446,193,209円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	11,541,004,280円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	4,700,092,508円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,096,709,968円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,236,320,578円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	360,423,278円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	91,048,387円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	2,946,750,943円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	11,576,024円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,064,417,972円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,438,859,401円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	307,531,452円
投資のソムリエ	32,541,418,322円
クルーズコントロール	1,148,879,451円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,702,737,896円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	4,025,527,772円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	573,924,594円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	4,279,923円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	11,122,583円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	4,535,158,253円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	45,906,962,887円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	20,472,952円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,830,866円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	42,959,192円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	65,602,701円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	852,419,295円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	26,167,512,808円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,822,902,454円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	17,160,892円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,507,845円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,449,612円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	99,528,079円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	68,818円
ＤＩＡＭエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	598,662,625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）	726,846,339円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,290,319,095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）	369,786,728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）	584,250,960円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	18,572,458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）	1,032,271,266円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	8,747,700,563円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	812,343,091円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	856,370,636円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	291,849,892円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	5,162,992,260円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	5,175,030,109円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	5,126,419,429円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅤ（適格機関投資家限定）	5,167,905,553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）	976,865,132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）	181,734,833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）	104,852,782円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,643,737円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,538,607円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	45,970,685円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,457,241円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,354,539円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	139,011,046円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,974,703,712円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,464,392,923円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,684,787,849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）	212,578,555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）	207,933,824円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,416,796,840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）	207,888,215円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	11,392,745円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド２ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,675,704,471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）	56,466,864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）	423,619,050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）	672,898,045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）	1,168,050,833円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	327,450,906円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	106,712,438円
Ｏｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドＩ（適格機関投資家限定）	1,078,716,030円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	382,409,178円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	271,259,362円
コア資産形成ファンド	213,359,316円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	43,690,787,790円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	39,450,858,281円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	14,867,046,295円
ＭＨＡＭ動的パッケージ４資産ファンド［適格機関投資家限定］	3,364,296,762円
計	380,394,285,340円
２．　受益権の総数	380,394,285,340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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,105,826,050
地方債証券	17,433,752
特殊債券	18,820,982
社債券	△6,489,210
合計	1,135,591,574

（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7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3097円 (13,097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7月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	４１６回　利付国庫債券（２年）	1,470,000,000	1,473,675,000	
	４１７回　利付国庫債券（２年）	3,000,000,000	3,008,220,000	
	４１８回　利付国庫債券（２年）	400,000,000	401,172,000	
	４１９回　利付国庫債券（２年）	1,400,000,000	1,404,368,000	
	４２０回　利付国庫債券（２年）	4,900,000,000	4,916,219,000	
	４２１回　利付国庫債券（２年）	1,040,000,000	1,043,640,000	
	４２２回　利付国庫債券（２年）	1,600,000,000	1,605,888,000	
	４２３回　利付国庫債券（２年）	3,000,000,000	3,006,690,000	
	４２４回　利付国庫債券（２年）	500,000,000	501,170,000	
	４２５回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	2,004,720,000	
	１３３回　利付国庫債券（５年）	3,290,000,000	3,298,389,500	
	１３４回　利付国庫債券（５年）	2,630,000,000	2,638,310,800	
	１３５回　利付国庫債券（５年）	3,040,000,000	3,051,278,400	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	3,250,000,000	3,263,877,500	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	3,110,000,000	3,125,332,300	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	3,500,000,000	3,520,090,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	3,750,000,000	3,773,737,500	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	3,190,000,000	3,212,074,800	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	3,210,000,000	3,234,139,200	

１４２回　利付国庫債券（５年）	3,730,000,000	3,760,921,700	
１４３回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,127,528,000	
１４４回　利付国庫債券（５年）	4,100,000,000	4,138,950,000	
１４５回　利付国庫債券（５年）	4,350,000,000	4,393,065,000	
１４６回　利付国庫債券（５年）	3,900,000,000	3,940,014,000	
１４７回　利付国庫債券（５年）	4,300,000,000	4,326,316,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	159,393,300	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	885,068,100	
３回　利付国庫債券（４０年）	440,000,000	619,872,000	
４回　利付国庫債券（４０年）	1,020,000,000	1,442,116,800	
５回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	1,284,350,200	
６回　利付国庫債券（４０年）	960,000,000	1,292,256,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,308,222,700	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,210,000,000	1,464,826,000	
９回　利付国庫債券（４０年）	1,730,000,000	1,567,639,500	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,620,000,000	1,717,410,600	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,280,000,000	1,315,430,400	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,300,000,000	1,206,283,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,630,000,000	1,507,798,900	
１４回　利付国庫債券（４０年）	400,000,000	395,696,000	
３２５回　利付国庫債券（１０年）	5,700,000,000	5,762,073,000	
３２６回　利付国庫債券（１０年）	1,020,000,000	1,031,974,800	
３２７回　利付国庫債券（１０年）	1,970,000,000	1,995,964,600	
３２８回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,036,210,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	4,750,000,000	4,834,360,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	4,460,000,000	4,550,047,400	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	1,450,000,000	1,472,910,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	4,480,000,000	4,559,430,400	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	4,030,000,000	4,109,229,800	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	4,640,000,000	4,740,548,800	

３３５回　利付国庫債券（１０年）	4,300,000,000	4,387,419,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,942,009,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	3,210,000,000	3,258,792,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	4,530,000,000	4,620,600,000	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	4,410,000,000	4,504,241,700	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	4,710,000,000	4,816,116,300	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	4,420,000,000	4,504,819,800	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	4,280,000,000	4,325,368,000	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,549,140,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	4,390,000,000	4,440,397,200	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	4,790,000,000	4,847,671,600	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,290,000,000	4,344,011,100	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	4,330,000,000	4,386,939,500	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,390,000,000	4,450,186,900	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	4,530,000,000	4,593,148,200	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	5,410,000,000	5,488,336,800	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	4,000,000,000	4,060,120,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,340,000,000	4,406,011,400	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	4,110,000,000	4,173,129,600	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	3,710,000,000	3,765,983,900	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	3,810,000,000	3,864,749,700	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	3,640,000,000	3,689,431,200	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	3,760,000,000	3,809,406,400	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	3,650,000,000	3,696,136,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	3,910,000,000	3,955,512,400	

３６０回　利付国庫債券（１０年）	3,940,000,000	3,981,685,200	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	3,800,000,000	3,835,834,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	3,550,000,000	3,579,181,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	135,777,400	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	121,128,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	254,384,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	248,678,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	238,732,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	297,182,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	285,050,500	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	184,560,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	436,583,800	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	338,182,000	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	313,346,400	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	350,022,600	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	514,632,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	361,440,800	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	436,227,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	402,200,200	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	385,702,900	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	466,753,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	361,276,200	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	432,484,800	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	824,296,200	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	838,351,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	1,045,814,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,158,996,200	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,176,560,000	

３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	953,481,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,306,308,700	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,530,094,200	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,604,400,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,760,000,000	2,294,600,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,970,000,000	2,577,075,200	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,760,000,000	2,273,462,400	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,280,000,000	1,631,065,600	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,582,669,400	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	1,328,610,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,080,000,000	1,359,288,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,726,035,600	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,070,000,000	1,349,473,300	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,080,000,000	1,363,467,600	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,170,000,000	1,425,925,800	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,792,679,700	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,566,343,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,240,000,000	1,487,231,200	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,511,886,600	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,337,175,000	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,085,761,000	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,310,000,000	1,295,498,300	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,000,000,000	1,011,150,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,216,067,500	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,289,222,800	

５６回　利付国庫債券（３０年）	1,230,000,000	1,297,416,300	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,100,000,000	1,159,455,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,579,905,000	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	1,151,304,000	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	1,108,702,300	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,140,000,000	1,168,226,400	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,110,000,000	1,078,520,400	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,133,076,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,280,000,000	1,205,196,800	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,110,000,000	1,043,388,900	
６６回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	927,917,100	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,250,000,000	1,234,775,000	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,280,000,000	1,262,745,600	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,385,207,000	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,353,292,800	
５９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,261,400	
６４回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,329,900	
６５回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	62,971,200	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,727,500	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,729,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,747,600	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	492,926,800	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	408,025,000	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,088,000	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	194,896,800	

７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	75,275,200	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	43,162,400	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	270,135,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	54,225,000	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	97,961,400	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	435,884,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	153,148,800	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	76,951,000	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	186,122,800	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	651,708,100	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	133,681,200	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	133,116,000	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	660,741,000	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	11,149,400	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	526,935,800	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	123,899,600	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,300,963,200	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	414,895,800	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	755,136,900	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	629,585,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	135,928,800	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	755,475,600	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	182,147,200	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	857,752,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	959,438,500	

１０１回　利付国庫債券（２０年）	130,000,000	152,024,600	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	587,930,000	
１０３回　利付国債（２０年）	160,000,000	187,019,200	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	127,036,800	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	742,220,800	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	583,480,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	699,180,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	793,713,900	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	404,054,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	514,764,800	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	543,770,600	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	868,856,200	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,378,540,800	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	969,805,800	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	428,821,200	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	633,742,200	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,270,111,400	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	655,954,500	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	547,070,600	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	767,860,200	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	929,205,900	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	665,195,700	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,258,110,000	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	713,256,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	726,780,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	607,899,600	

１２７回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	874,894,600	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,624,614,500	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	893,714,400	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	1,410,000,000	1,662,657,900	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	923,541,600	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,324,292,200	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,130,000,000	1,336,032,900	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	1,100,000,000	1,303,896,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	634,359,600	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	768,312,600	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	942,040,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	1,040,000,000	1,202,063,200	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	1,073,354,800	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,990,000,000	2,348,797,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,550,000,000	1,833,572,500	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,074,843,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,380,000,000	1,620,009,600	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,057,756,700	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	2,555,769,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,180,000,000	2,596,903,200	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,693,546,400	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,040,000,000	2,388,758,400	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,200,000,000	2,580,182,000	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	2,310,000,000	2,683,434,600	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,660,135,400	

	１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	2,446,162,500	
	１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,220,000,000	2,559,771,000	
	１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,090,000,000	2,383,289,700	
	１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,160,000,000	2,404,166,400	
	１５６回　利付国庫債券（２０年）	1,950,000,000	2,001,343,500	
	１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,230,000,000	2,221,927,400	
	１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,090,000,000	2,172,805,800	
	１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,930,000,000	2,033,428,700	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,710,000,000	1,826,126,100	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,790,000,000	1,883,115,800	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,520,000,000	1,597,793,600	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	1,720,000,000	1,806,481,600	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,354,305,200	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	1,810,000,000	1,866,834,000	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,730,000,000	1,840,097,200	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,790,251,200	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,580,000,000	1,597,143,000	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,850,000,000	1,834,386,000	
	１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,590,000,000	1,573,702,500	
	１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,640,000,000	1,620,172,400	
	１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,460,000,000	1,466,365,600	
	１７３回　利付国庫債券（２０年）	1,920,000,000	1,925,068,800	
	１７４回　利付国庫債券（２０年）	1,850,000,000	1,851,646,500	
	１７５回　利付国庫債券（２０年）	1,760,000,000	1,791,732,800	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	1,880,000,000	1,910,813,200	
国債証券　合計		400,465,000,000	426,492,683,100	

地方債証券	７１９回　東京都公募公債	200,000,000	202,886,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	305,031,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	407,080,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	100,129,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	111,369,500	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	402,244,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	247,588,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	131,304,000	
	１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	102,977,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	107,756,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	109,029,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	224,040,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	335,904,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	116,612,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	117,839,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	100,205,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	404,008,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	100,429,000	
	２９回１号　宮城県公募公債　１０年	100,000,000	101,544,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	251,267,500	
	１９４回　神奈川県公募公債	300,000,000	303,399,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	304,815,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,949,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	202,092,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	134,743,000	
	１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	116,080,000	
	１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	357,072,000	
	１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	117,573,000	
	３６４回　大阪府公募公債	300,000,000	302,835,000	
	３６８回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	101,274,000	
	３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	305,688,000	
	４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,952,000	
	４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,901,000	
	４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	201,240,000	

１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	234,208,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	112,768,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	103,192,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	355,666,500	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	110,494,364	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	202,376,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	203,300,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	100,873,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	134,298,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	309,711,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	326,106,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	107,603,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	103,926,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	100,593,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	200,960,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	108,177,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	108,993,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	213,508,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	109,113,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	348,819,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	132,167,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	304,803,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	182,838,000	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	102,040,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	200,998,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	101,464,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	102,283,000	
２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	101,713,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	407,388,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	215,290,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	118,379,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	116,512,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	350,049,000	

１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	112,197,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	203,622,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	101,178,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	202,224,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	100,506,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	108,207,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	114,827,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	118,550,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	348,621,000	
２４年度７回　千葉県公募公債	300,000,000	303,195,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	203,542,000	
２５年度６回　千葉県公募公債	100,000,000	101,753,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,423,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	111,037,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	111,808,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	101,588,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	101,751,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	201,836,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	116,598,000	
１１５回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,024,000	
１１８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,287,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,455,000	
１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,045,000	
１２７回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,544,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,659,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,769,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,010,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,884,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	612,696,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	511,055,000	

１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,066,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,429,600	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,642,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,145,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,649,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,239,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,605,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,188,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,257,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	100,999,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	101,767,000	
２５年度２回　島根県公募公債	106,000,000	107,675,860	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	101,720,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	101,166,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	201,358,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	232,026,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	458,518,500	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	116,462,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	112,789,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	112,901,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	238,628,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	234,826,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	101,813,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	304,383,000	
２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	407,084,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	129,981,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	114,975,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	116,517,000	
２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	203,084,000	
２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	101,572,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	311,589,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	201,934,000	

	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	114,593,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	116,465,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	210,406,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	97,837,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	101,537,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	208,426,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	303,765,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	105,655,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	101,672,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	101,558,000	
地方債証券　合計		25,545,330,000	26,894,257,824	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	216,546,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	215,538,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	302,577,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,046,000	
	１９回　政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,143,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	222,000,000	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	271,470,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,105,000	
	９６回　高速道路機構債	700,000,000	706,559,000	
	１０１回　日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,224,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	101,538,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,057,000	
	１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,514,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,543,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	120,949,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	127,308,000	
	１６９回　高速道路機構債	100,000,000	111,955,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	198,524,000	
	２１０回　高速道路機構債	100,000,000	104,203,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,424,000	
	１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	124,879,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	581,030,000	

１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,229,000	
１７０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,927,000	
１７７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,137,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,182,000	
１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	504,985,000	
１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,820,000	
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	437,993,700	
２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,678,950	
２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,724,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,889,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,786,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	336,657,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	508,175,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,111,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,776,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	235,758,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,417,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,554,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	805,792,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,466,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,852,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	194,134,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	657,590,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	229,354,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	351,741,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	352,821,000	

１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	119,049,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	323,106,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	234,438,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	116,180,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	233,202,000	
４０回　地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,989,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,888,000	
４４回　政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	405,180,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,207,000	
５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	509,085,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	552,146,240	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	116,391,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,079,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,442,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	226,918,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	351,303,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	401,340,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,379,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	104,540,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,870,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,899,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,406,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	233,154,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,047,380	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	109,130,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	107,977,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	214,494,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	198,522,000	

１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	111,890,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	101,618,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	233,598,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	416,160,500	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,638,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	320,487,500	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	111,124,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,050,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,559,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,546,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,877,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	31,911,000	32,316,588	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	22,502,000	22,942,814	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	33,927,000	34,595,022	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	36,051,000	37,039,157	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	12,015,000	12,373,767	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	57,800,000	59,140,381	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,557,000	35,467,922	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,835,000	58,045,585	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,787,000	12,055,861	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,772,000	20,985,012	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	120,945,000	129,763,099	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	187,992,000	198,780,860	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,172,000	27,640,249	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,532,000	24,830,260	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,934,000	31,555,225	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,413,000	33,136,003	

６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,545,000	40,631,440	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,016,000	89,187,735	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,055,000	38,882,182	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,544,000	45,365,445	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,056,000	45,939,394	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,046,000	50,104,771	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,202,000	52,037,385	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,815,000	57,082,000	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,380,000	64,313,156	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,573,000	67,094,575	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,832,000	238,603,503	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,434,000	81,636,488	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,226,000	81,481,536	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,070,000	81,271,850	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	249,690,000	253,135,722	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	250,053,000	253,328,694	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,314,000	171,559,103	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,965,000	256,941,469	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	254,172,000	257,242,397	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	439,305,000	446,733,647	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,832,000	90,439,264	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	298,323,000	302,317,544	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,345,000	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,229,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	100,123,000	
３４２回　利附信金中金債（５年）	100,000,000	100,140,000	

	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	400,244,000	
	７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	101,599,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	116,798,000	
	１８回　国際協力機構債券	100,000,000	101,664,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	200,294,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	300,285,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	300,255,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	507,020,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,687,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,214,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	201,070,000	
特殊債券　合計		24,378,593,000	25,966,555,375	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	303,114,000	
	２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,472,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,247,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,932,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	100,072,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	400,176,000	
	３４４回　東京交通債券	100,000,000	102,627,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	101,711,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	98,214,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	100,270,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	201,692,000	
	５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	101,753,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	102,132,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	302,913,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	202,730,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,863,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	102,123,000	
	１２回　セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,780,000	
	１４回　セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,942,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	302,937,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	200,152,000	
	４９回　住友化学社債	100,000,000	102,276,000	

１９回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,545,000	
６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	102,096,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	304,020,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	101,651,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	101,059,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	201,842,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	101,714,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	101,276,000	
１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	203,182,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	203,436,000	
２６回　トヨタ自動車	200,000,000	200,326,000	
９４回　丸紅社債	100,000,000	101,307,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	104,025,000	
４７回　住友商事社債	100,000,000	101,705,000	
４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	102,130,000	
５７回　東京三菱銀行社債	300,000,000	308,334,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	112,084,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	110,232,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,994,000	
１０回　セブン銀行社債	100,000,000	101,186,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	302,784,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	405,404,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,840,000	
４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	202,696,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	302,619,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	201,770,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	305,421,000	
５０回　野村ホールディングス社債	100,000,000	100,087,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	106,990,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	101,116,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	202,192,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	107,923,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	101,175,000	
２１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,377,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	323,592,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	217,132,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	116,911,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	236,048,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	114,351,000	

１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,762,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,171,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,455,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	313,173,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	116,340,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,383,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,368,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,625,000	
９回　東海旅客鉄道社債	110,000,000	112,247,300	
１１回　東海旅客鉄道社債	300,000,000	304,863,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	209,658,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,793,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	113,581,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	133,572,000	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	96,622,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	203,198,000	
５１８回　中部電力社債	200,000,000	200,430,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	104,451,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	103,539,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	304,980,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	202,338,000	
３７７回　中国電力社債	400,000,000	408,988,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	101,272,000	
３０１回　北陸電力社債	100,000,000	101,863,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	104,629,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	104,315,000	
４７１回　東北電力社債	400,000,000	410,760,000	
４８８回　東北電力社債	100,000,000	100,892,000	
５２５回　東北電力社債	200,000,000	200,996,000	
２５３回　四国電力社債	200,000,000	203,676,000	
４２４回　九州電力社債	200,000,000	205,502,000	
４２６回　九州電力社債	400,000,000	410,392,000	
４２８回　九州電力社債	100,000,000	102,607,000	
４６６回　九州電力社債	100,000,000	102,410,000	
３２１回　北海道電力社債	261,000,000	268,154,010	
３４０回　北海道電力社債	300,000,000	305,322,000	
３５０回　北海道電力社債	200,000,000	205,616,000	
１３回　電源開発社債	200,000,000	215,242,000	
３８回　電源開発社債	300,000,000	306,645,000	
５４回　電源開発社債	100,000,000	101,418,000	
２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	305,580,000	
４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	204,188,000	
５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	100,019,000	
５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	96,420,000	
１８回　大阪ガス社債	100,000,000	102,082,000	
３０回　大阪瓦斯社債	100,000,000	101,046,000	
２７回　ＮＴＴデータ社債	200,000,000	203,096,000	
５回　ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,096,000	

	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	203,694,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	207,324,000	
社債券　合計		18,591,000,000	19,066,493,310	
合計			498,419,989,609	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,151,559,802
株式	390,836,860,540
派生商品評価勘定	16,970,240
未収入金	32,222,584
未収配当金	411,350,881
前払金	85,952,000
差入委託証拠金	376,740,000
流動資産合計	400,911,656,047
資産合計	400,911,656,047
負債の部	
流動負債	
未払解約金	531,566,000
流動負債合計	531,566,000
負債合計	531,566,000
純資産の部	
元本等	
元本	125,027,618,245
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	275,352,471,802
元本等合計	400,380,090,047
純資産合計	400,380,090,047
負債純資産合計	400,911,656,047

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	104,131,508,084円
同期中追加設定元本額	66,237,772,333円
同期中一部解約元本額	45,341,662,172円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	638,707,013円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	2,751,539,482円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	6,801,168,320円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	17,807,259,600円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,436,726,433円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,203,380円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	12,388,917円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	11,430,432円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	28,863,380円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	21,768,510円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	15,095,593円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,065,876,218円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	804,262,507円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	30,882,023円
たわらノーロード　バランス（標準型）	187,456,934円
たわらノーロード　バランス（積極型）	287,180,584円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	2,212,375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）	123,083,901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）	291,070,839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）	199,668,217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）	285,143,158円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	647,447円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,808,515円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	16,212,960円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,445,906円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,083,472円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	34,240,725,007円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,011,265,097円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,353,144,978円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,497,163,456円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	330,695,046円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,126,818,055円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,095,150,957円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	31,447,514円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,023,706,018円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	18,322,288円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	302,674,443円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	281,189,463円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	502,891,013円
投資のソムリエ	16,950,643,065円
クルーズコントロール	466,515,120円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	885,241,507円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	287,321,539円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	430,444,520円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	5,192,490円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	13,570,602円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	491,370,494円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,969,476,714円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	27,147,702円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	13,059,857円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,650,838円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	61,188,009円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	136,203,297円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,075,376,269円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	263,259,339円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	20,598,174円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	9,974,549円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,477,428円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	33,560,966円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	91,224円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	78,660,950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）	95,654,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	68,715,256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）	48,500,722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）	76,838,015円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	243,059,805円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	88,868,794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）	87,327,181円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	445,024,006円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	36,402,733円

日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	220,053,523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）	128,594,604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）	62,088,694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）	107,563,107円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,903,404円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,114,940円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,537,351円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,985,304円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,035,929円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,989,175円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	610,743,140円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	673,460,189円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,920,690,751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）	58,052,580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）	34,120,030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）	328,980,745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）	85,204,299円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,555,801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）	411,282,270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）	23,151,048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）	86,804,876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）	206,870,261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）	287,247,274円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,840,143円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	18,743,216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）	321,266,809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）	992,662,363円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,314,318,490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）	52,594,563円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	20,462,695円
コア資産形成ファンド	16,425,966円
ＭＨＡＭトピックスファンド	645,976,041円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	69,950,091円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,961,129,299円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,153,424,042円
計	125,027,618,245円
２．　受益権の総数	125,027,618,245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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	4,062,599,737
合計	4,062,599,737

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2021年2月9日から2021年7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	7,823,907,100	－	7,841,010,000	17,102,900
合計	7,823,907,100	－	7,841,010,000	17,102,900

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2023円 (32,023円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2021年7月12日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	6,700	2,912.00	19,510,400	
日本水産	183,700	537.00	98,646,900	
マルハニチロ	30,800	2,379.00	73,273,200	
ホウスイ	900	940.00	846,000	
雪国まいたけ	15,900	1,682.00	26,743,800	
カネコ種苗	5,800	1,467.00	8,508,600	
サカタのタネ	23,600	3,755.00	88,618,000	
ホクト	16,800	1,937.00	32,541,600	
ホクリヨウ	2,900	823.00	2,386,700	
ヒノキヤグループ	4,800	2,383.00	11,438,400	
ショーボンドホールディングス	28,300	4,740.00	134,142,000	
ミライト・ホールディングス	68,800	2,073.00	142,622,400	
タマホーム	12,200	2,336.00	28,499,200	
サンヨーホームズ	2,800	721.00	2,018,800	
日本アクア	7,800	536.00	4,180,800	
ファーストコーポレーション	6,100	786.00	4,794,600	

ベステラ	3,700	1,470.00	5,439,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	38,300	232.00	8,885,600	
キャンディル	3,400	582.00	1,978,800	
スペースバリューホールディングス	24,000	740.00	17,760,000	
住石ホールディングス	34,100	128.00	4,364,800	
日鉄鉱業	4,600	5,910.00	27,186,000	
三井松島ホールディングス	8,300	1,015.00	8,424,500	
ＩＮＰＥＸ	728,300	813.00	592,107,900	
石油資源開発	26,100	1,912.00	49,903,200	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	9,400	1,319.00	12,398,600	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,180.00	4,484,000	
第一カッター興業	4,800	1,350.00	6,480,000	
明豊ファシリティワークス	6,500	874.00	5,681,000	
安藤・間	126,900	860.00	109,134,000	
東急建設	58,200	813.00	47,316,600	
コムシスホールディングス	70,200	3,085.00	216,567,000	
ビーアールホールディングス	23,200	477.00	11,066,400	
高松コンストラクショングループ	12,600	2,049.00	25,817,400	
東建コーポレーション	6,100	10,340.00	63,074,000	
ソネック	2,000	1,016.00	2,032,000	
ヤマウラ	8,700	911.00	7,925,700	
オリエンタル白石	66,400	281.00	18,658,400	
大成建設	142,400	3,790.00	539,696,000	
大林組	457,400	914.00	418,063,600	
清水建設	428,900	891.00	382,149,900	
飛島建設	12,900	1,089.00	14,048,100	
長谷工コーポレーション	149,700	1,506.00	225,448,200	
松井建設	18,400	798.00	14,683,200	
錢高組	1,400	4,065.00	5,691,000	
鹿島建設	335,100	1,439.00	482,208,900	
不動テトラ	11,200	1,850.00	20,720,000	
大末建設	6,100	987.00	6,020,700	
鉄建建設	9,200	1,894.00	17,424,800	
西松建設	32,500	3,660.00	118,950,000	
三井住友建設	110,400	492.00	54,316,800	
大豊建設	10,100	4,275.00	43,177,500	
前田建設工業	114,600	973.00	111,505,800	
佐田建設	8,800	482.00	4,241,600	
ナカノフドー建設	12,100	422.00	5,106,200	
奥村組	25,000	2,979.00	74,475,000	
東鉄工業	19,700	2,363.00	46,551,100	
イチケン	3,000	1,868.00	5,604,000	
富士ピー・エス	6,200	550.00	3,410,000	
淺沼組	5,400	4,685.00	25,299,000	
戸田建設	190,000	774.00	147,060,000	
熊谷組	21,000	2,854.00	59,934,000	
北野建設	2,500	2,333.00	5,832,500	
植木組	3,700	1,456.00	5,387,200	
矢作建設工業	20,300	731.00	14,839,300	
ピーエス三菱	15,100	619.00	9,346,900	

日本ハウスホールディングス	32,300	404.00	13,049,200	
大東建託	50,100	13,060.00	654,306,000	
新日本建設	19,500	859.00	16,750,500	
ＮＩＰＰＯ	37,800	3,140.00	118,692,000	
東亜道路工業	2,800	4,635.00	12,978,000	
前田道路	28,300	2,205.00	62,401,500	
日本道路	4,500	8,000.00	36,000,000	
東亜建設工業	12,400	2,497.00	30,962,800	
日本国土開発	45,000	585.00	26,325,000	
若築建設	8,300	1,672.00	13,877,600	
東洋建設	51,400	580.00	29,812,000	
五洋建設	194,400	772.00	150,076,800	
世紀東急工業	21,900	873.00	19,118,700	
福田組	5,200	4,940.00	25,688,000	
日本ドライケミカル	3,500	1,800.00	6,300,000	
住友林業	107,500	2,037.00	218,977,500	
日本基礎技術	14,500	572.00	8,294,000	
巴コーポレーション	20,300	381.00	7,734,300	
大和ハウス工業	422,500	3,381.00	1,428,472,500	
ライト工業	26,300	1,905.00	50,101,500	
積水ハウス	496,000	2,293.00	1,137,328,000	
日特建設	12,200	770.00	9,394,000	
北陸電気工事	8,000	1,295.00	10,360,000	
ユアテック	26,200	737.00	19,309,400	
日本リーテック	9,400	1,685.00	15,839,000	
四電工	2,100	3,005.00	6,310,500	
中電工	21,000	2,301.00	48,321,000	
関電工	74,600	895.00	66,767,000	
きんでん	93,600	1,836.00	171,849,600	
東京エネシス	15,200	959.00	14,576,800	
トーエネック	4,600	3,785.00	17,411,000	
住友電設	13,000	2,307.00	29,991,000	
日本電設工業	25,000	1,936.00	48,400,000	
協和エクシオ	69,200	2,747.00	190,092,400	
新日本空調	12,200	2,112.00	25,766,400	
日本工営	8,800	3,080.00	27,104,000	
九電工	32,300	3,645.00	117,733,500	
三機工業	32,500	1,448.00	47,060,000	
日揮ホールディングス	152,500	1,028.00	156,770,000	
中外炉工業	4,800	1,933.00	9,278,400	
ヤマト	14,800	816.00	12,076,800	
太平電業	10,300	2,677.00	27,573,100	
高砂熱学工業	41,400	1,918.00	79,405,200	
三晃金属工業	1,900	2,375.00	4,512,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	47,200	1,796.00	84,771,200	
朝日工業社	2,800	3,210.00	8,988,000	
明星工業	29,800	745.00	22,201,000	
大氣社	22,100	3,415.00	75,471,500	
ダイダン	10,300	2,618.00	26,965,400	
日比谷総合設備	15,200	1,838.00	27,937,600	

ニップン	43,300	1,582.00	68,500,600	
日清製粉グループ本社	165,300	1,674.00	276,712,200	
日東富士製粉	900	6,930.00	6,237,000	
昭和産業	12,600	3,045.00	38,367,000	
鳥越製粉	13,200	791.00	10,441,200	
中部飼料	18,100	1,153.00	20,869,300	
フィード・ワン	20,100	745.00	14,974,500	
東洋精糖	2,100	1,198.00	2,515,800	
日本甜菜製糖	7,900	1,659.00	13,106,100	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	12,000	1,864.00	22,368,000	
塩水港精糖	17,600	222.00	3,907,200	
日新製糖	5,700	1,703.00	9,707,100	
ＬＩＦＵＬＬ	48,700	345.00	16,801,500	
ミクシィ	35,400	2,807.00	99,367,800	
ジェイエイシーリクルートメント	9,200	1,814.00	16,688,800	
日本Ｍ＆Ａセンター	228,500	3,110.00	710,635,000	
メンバーズ	3,900	3,410.00	13,299,000	
中広	1,400	360.00	504,000	
ＵＴグループ	20,100	3,425.00	68,842,500	
アイティメディア	4,700	2,079.00	9,771,300	
タケエイ	15,800	1,734.00	27,397,200	
Ｅ・Ｊホールディングス	5,300	1,095.00	5,803,500	
夢真ビーネックスグループ	34,700	1,314.00	45,595,800	
コシダカホールディングス	37,100	628.00	23,298,800	
アルトナー	3,300	846.00	2,791,800	
パソナグループ	15,200	2,338.00	35,537,600	
ＣＤＳ	2,900	1,550.00	4,495,000	
リンクアンドモチベーション	25,500	878.00	22,389,000	
ＧＣＡ	18,100	1,091.00	19,747,100	
エス・エム・エス	47,200	3,375.00	159,300,000	
サニーサイドアップグループ	5,000	738.00	3,690,000	
パーソルホールディングス	139,500	2,290.00	319,455,000	
リニカル	7,900	989.00	7,813,100	
クックパッド	43,500	253.00	11,005,500	
エスクリ	4,700	479.00	2,251,300	
アイ・ケイ・ケイ	6,700	680.00	4,556,000	
森永製菓	34,400	3,675.00	126,420,000	
中村屋	2,900	3,840.00	11,136,000	
江崎グリコ	40,300	4,215.00	169,864,500	
名糖産業	6,700	1,591.00	10,659,700	
井村屋グループ	8,300	2,335.00	19,380,500	
不二家	9,400	2,222.00	20,886,800	
山崎製パン	109,700	1,551.00	170,144,700	
第一屋製パン	3,300	939.00	3,098,700	
モロゾフ	2,100	5,350.00	11,235,000	
亀田製菓	8,500	4,595.00	39,057,500	
寿スピリッツ	14,200	7,700.00	109,340,000	
カルビー	66,600	2,578.00	171,694,800	
森永乳業	26,800	5,980.00	160,264,000	
六甲バター	10,000	1,533.00	15,330,000	

ヤクルト本社	100,500	6,460.00	649,230,000	
明治ホールディングス	96,900	6,800.00	658,920,000	
雪印メグミルク	35,300	2,092.00	73,847,600	
プリマハム	20,500	2,976.00	61,008,000	
日本ハム	56,000	4,325.00	242,200,000	
林兼産業	4,000	582.00	2,328,000	
丸大食品	14,800	1,729.00	25,589,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	13,200	3,355.00	44,286,000	
柿安本店	4,800	2,509.00	12,043,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	94,800	731.00	69,298,800	
学情	4,800	1,338.00	6,422,400	
スタジオアリス	6,800	2,542.00	17,285,600	
クロスキャット	3,500	974.00	3,409,000	
シミックホールディングス	6,700	1,571.00	10,525,700	
エプコ	3,300	875.00	2,887,500	
システナ	51,200	2,207.00	112,998,400	
ＮＪＳ	3,300	1,930.00	6,369,000	
デジタルアーツ	8,300	8,370.00	69,471,000	
日鉄ソリューションズ	21,300	3,505.00	74,656,500	
綜合警備保障	55,600	5,020.00	279,112,000	
キューブシステム	7,500	1,024.00	7,680,000	
いちご	162,100	364.00	59,004,400	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,200	1,963.00	4,318,600	
日本駐車場開発	155,700	168.00	26,157,600	
コア	6,100	1,446.00	8,820,600	
カカクコム	103,100	3,240.00	334,044,000	
アイロムグループ	4,800	2,019.00	9,691,200	
セントケア・ホールディング	10,300	985.00	10,145,500	
サイネックス	2,800	700.00	1,960,000	
ルネサンス	9,300	1,337.00	12,434,100	
ディップ	21,600	3,545.00	76,572,000	
ＳＢＳホールディングス	10,900	3,305.00	36,024,500	
デジタルホールディングス	9,600	2,233.00	21,436,800	
新日本科学	16,800	1,031.00	17,320,800	
キャリアデザインセンター	2,900	1,078.00	3,126,200	
ベネフィット・ワン	51,000	3,435.00	175,185,000	
エムスリー	245,900	7,807.00	1,919,741,300	
ツカダ・グローバルホールディング	12,200	385.00	4,697,000	
ブラス	1,500	520.00	780,000	
アウトソーシング	80,000	2,138.00	171,040,000	
ウェルネット	14,400	525.00	7,560,000	
ワールドホールディングス	4,800	3,190.00	15,312,000	
ディー・エヌ・エー	59,000	2,264.00	133,576,000	
博報堂ＤＹホールディングス	193,800	1,726.00	334,498,800	
ぐるなび	24,300	544.00	13,219,200	
タカミヤ	17,400	525.00	9,135,000	
ジャパンベストレスキューシステム	10,900	953.00	10,387,700	
ファンコミュニケーションズ	38,200	398.00	15,203,600	
ライク	3,500	2,147.00	7,514,500	
ビジネス・ブレークスルー	6,300	418.00	2,633,400	

エスプール	35,800	1,033.00	36,981,400	
ＷＤＢホールディングス	6,500	3,050.00	19,825,000	
手間いらず	1,800	6,390.00	11,502,000	
ティア	8,700	469.00	4,080,300	
ＣＤＧ	1,500	1,590.00	2,385,000	
アドウェイズ	22,000	824.00	18,128,000	
バリューコマース	9,400	3,115.00	29,281,000	
インフォマート	141,100	938.00	132,351,800	
サッポロホールディングス	50,100	2,344.00	117,434,400	
アサヒグループホールディングス	320,000	5,106.00	1,633,920,000	
キリンホールディングス	621,000	2,111.50	1,311,241,500	
宝ホールディングス	108,300	1,368.00	148,154,400	
オエノンホールディングス	42,400	378.00	16,027,200	
養命酒製造	4,700	1,823.00	8,568,100	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	111,800	1,749.00	195,538,200	
サントリー食品インターナショナル	98,000	4,155.00	407,190,000	
ダイドーグループホールディングス	8,500	5,000.00	42,500,000	
伊藤園	44,600	6,650.00	296,590,000	
キーコーヒー	14,800	2,136.00	31,612,800	
ユニカフェ	4,700	996.00	4,681,200	
ジャパンフーズ	1,800	1,225.00	2,205,000	
日清オイリオグループ	18,800	3,060.00	57,528,000	
不二製油グループ本社	35,800	2,540.00	90,932,000	
かどや製油	1,100	4,080.00	4,488,000	
Ｊ－オイルミルズ	13,800	1,863.00	25,709,400	
ローソン	36,100	5,320.00	192,052,000	
サンエー	10,900	4,155.00	45,289,500	
カワチ薬品	10,100	2,196.00	22,179,600	
エービーシー・マート	22,300	6,410.00	142,943,000	
ハードオフコーポレーション	6,700	777.00	5,205,900	
高千穂交易	5,800	1,148.00	6,658,400	
アスクル	23,600	1,634.00	38,562,400	
ゲオホールディングス	19,400	1,228.00	23,823,200	
アダストリア	19,800	1,979.00	39,184,200	
ジーフット	9,700	416.00	4,035,200	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,600	425.00	1,105,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,691.00	3,382,000	
伊藤忠食品	2,900	5,320.00	15,428,000	
くら寿司	16,600	4,175.00	69,305,000	
キャンドゥ	6,700	1,913.00	12,817,100	
エレマテック	11,600	1,253.00	14,534,800	
アイケイ	2,900	775.00	2,247,500	
パルグループホールディングス	12,800	1,704.00	21,811,200	
ＪＡＬＵＸ	4,000	1,801.00	7,204,000	
エディオン	60,800	1,093.00	66,454,400	
あらた	11,600	4,310.00	49,996,000	
サーラコーポレーション	29,700	613.00	18,206,100	
ワッツ	6,500	914.00	5,941,000	
トーメンデバイス	1,900	4,105.00	7,799,500	

ハローズ	5,300	2,785.00	14,760,500	
ＪＰホールディングス	39,800	273.00	10,865,400	
フジオフードグループ本社	12,400	1,305.00	16,182,000	
あみやき亭	2,900	2,945.00	8,540,500	
東京エレクトロン　デバイス	4,800	5,410.00	25,968,000	
ひらまつ	23,200	210.00	4,872,000	
フィールズ	13,000	536.00	6,968,000	
双日	792,000	338.00	267,696,000	
アルフレッサ　ホールディングス	148,800	1,716.00	255,340,800	
大黒天物産	4,600	6,320.00	29,072,000	
ハニーズホールディングス	11,300	1,213.00	13,706,900	
ファーマライズホールディングス	3,800	736.00	2,796,800	
キッコーマン	105,000	7,110.00	746,550,000	
味の素	348,300	2,879.50	1,002,929,850	
ブルドックソース	6,700	2,355.00	15,778,500	
キユーピー	81,600	2,486.00	202,857,600	
ハウス食品グループ本社	54,800	3,450.00	189,060,000	
カゴメ	59,800	2,899.00	173,360,200	
焼津水産化学工業	6,000	964.00	5,784,000	
アリアケジャパン	13,800	7,030.00	97,014,000	
ピエトロ	1,400	1,721.00	2,409,400	
エバラ食品工業	2,900	2,634.00	7,638,600	
やまみ	1,200	1,921.00	2,305,200	
ニチレイ	69,800	2,951.00	205,979,800	
横浜冷凍	38,000	900.00	34,200,000	
東洋水産	75,200	4,235.00	318,472,000	
イートアンドホールディングス	5,000	1,955.00	9,775,000	
大冷	1,800	2,004.00	3,607,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,300	742.00	6,158,600	
日清食品ホールディングス	57,500	7,920.00	455,400,000	
永谷園ホールディングス	7,300	2,169.00	15,833,700	
一正蒲鉾	5,000	932.00	4,660,000	
フジッコ	16,100	1,930.00	31,073,000	
ロック・フィールド	16,000	1,523.00	24,368,000	
日本たばこ産業	785,100	2,120.00	1,664,412,000	
ケンコーマヨネーズ	9,100	1,548.00	14,086,800	
わらべや日洋ホールディングス	9,600	2,380.00	22,848,000	
なとり	8,500	1,941.00	16,498,500	
イフジ産業	2,800	954.00	2,671,200	
ピックルスコーポレーション	3,300	3,425.00	11,302,500	
ファーマフーズ	13,800	2,960.00	40,848,000	
北の達人コーポレーション	51,000	478.00	24,378,000	
ユーグレナ	72,900	1,073.00	78,221,700	
紀文食品	8,600	1,331.00	11,446,600	
スター・マイカ・ホールディングス	7,500	1,197.00	8,977,500	
ＳＲＥホールディングス	2,100	7,390.00	15,519,000	
ＡＤワークスグループ	27,600	157.00	4,333,200	
片倉工業	19,400	1,490.00	28,906,000	
グンゼ	10,500	4,670.00	49,035,000	
ヒューリック	305,200	1,275.00	389,130,000	

神栄	1,700	1,250.00	2,125,000	
ラサ商事	7,900	902.00	7,125,800	
アルペン	11,000	3,050.00	33,550,000	
ハブ	4,700	700.00	3,290,000	
ラクーンホールディングス	10,300	2,357.00	24,277,100	
クオールホールディングス	19,300	1,512.00	29,181,600	
アルコニックス	15,300	1,475.00	22,567,500	
神戸物産	99,100	3,845.00	381,039,500	
ソリトンシステムズ	7,100	1,584.00	11,246,400	
ジンズホールディングス	9,700	8,170.00	79,249,000	
ビックカメラ	85,400	1,135.00	96,929,000	
ＤＣＭホールディングス	88,800	1,084.00	96,259,200	
ペッパーフードサービス	14,000	430.00	6,020,000	
ハイパー	2,600	544.00	1,414,400	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	204,300	2,639.00	539,147,700	
東京一番フーズ	2,600	593.00	1,541,800	
ＤＤホールディングス	5,700	524.00	2,986,800	
あい　ホールディングス	20,400	2,167.00	44,206,800	
ディーブイエックス	4,700	1,000.00	4,700,000	
きちりホールディングス	4,200	596.00	2,503,200	
アークランドサービスホールディングス	12,200	2,223.00	27,120,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	171,500	1,025.00	175,787,500	
ドトール・日レスホールディングス	23,000	1,759.00	40,457,000	
マツモトキヨシホールディングス	59,300	4,850.00	287,605,000	
ブロンコビリー	7,500	2,402.00	18,015,000	
ＺＯＺＯ	84,800	3,535.00	299,768,000	
トレジャー・ファクトリー	4,300	994.00	4,274,200	
物語コーポレーション	7,600	7,390.00	56,164,000	
ココカラファイン	12,800	8,180.00	104,704,000	
三越伊勢丹ホールディングス	251,200	823.00	206,737,600	
東洋紡	56,500	1,319.00	74,523,500	
ユニチカ	42,200	336.00	14,179,200	
富士紡ホールディングス	6,700	3,870.00	25,929,000	
日清紡ホールディングス	89,000	944.00	84,016,000	
倉敷紡績	13,200	1,958.00	25,845,600	
ダイワボウホールディングス	65,600	2,015.00	132,184,000	
シキボウ	8,200	942.00	7,724,400	
日東紡績	21,500	3,210.00	69,015,000	
トヨタ紡織	42,600	2,238.00	95,338,800	
マクニカ・富士エレホールディングス	34,300	2,617.00	89,763,100	
Ｈａｍｅｅ	3,400	1,479.00	5,028,600	
ラクト・ジャパン	6,300	2,755.00	17,356,500	
ウエルシアホールディングス	75,900	3,375.00	256,162,500	
クリエイトＳＤホールディングス	21,000	3,200.00	67,200,000	
グリムス	4,100	1,971.00	8,081,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25,400	754.00	19,151,600	
八洲電機	11,200	970.00	10,864,000	
メディアスホールディングス	8,300	1,046.00	8,681,800	

レスターホールディングス	15,200	1,950.00	29,640,000	
ジューテックホールディングス	2,900	1,038.00	3,010,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	18,600	402.00	7,477,200	
大光	6,100	685.00	4,178,500	
ＯＣＨＩホールディングス	4,300	1,282.00	5,512,600	
ＴＯＫＡＩホールディングス	69,900	913.00	63,818,700	
黒谷	4,000	905.00	3,620,000	
ミサワ	2,800	699.00	1,957,200	
ティーライフ	2,100	1,556.00	3,267,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,100	730.00	1,533,000	
エー・ピーホールディングス	2,200	500.00	1,100,000	
三洋貿易	14,300	1,264.00	18,075,200	
チムニー	4,500	1,420.00	6,390,000	
シュッピン	10,000	1,070.00	10,700,000	
ビューティガレージ	2,500	4,470.00	11,175,000	
オイシックス・ラ・大地	18,900	4,250.00	80,325,000	
ウイン・パートナーズ	10,400	1,015.00	10,556,000	
ネクステージ	24,700	2,170.00	53,599,000	
ジョイフル本田	42,200	1,376.00	58,067,200	
鳥貴族ホールディングス	4,100	1,866.00	7,650,600	
ホットランド	10,700	1,331.00	14,241,700	
すかいらーくホールディングス	180,100	1,514.00	272,671,400	
ＳＦＰホールディングス	7,100	1,501.00	10,657,100	
綿半ホールディングス	10,800	1,238.00	13,370,400	
日本毛織	47,200	981.00	46,303,200	
ダイトウボウ	20,600	102.00	2,101,200	
トーア紡コーポレーション	5,000	444.00	2,220,000	
ダイドーリミテッド	20,100	176.00	3,537,600	
ヨシックスホールディングス	2,900	2,350.00	6,815,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	42,000	1,019.00	42,798,000	
三栄建築設計	5,800	2,044.00	11,855,200	
野村不動産ホールディングス	82,500	2,779.00	229,267,500	
三重交通グループホールディングス	29,400	472.00	13,876,800	
サムティ	20,200	2,297.00	46,399,400	
ディア・ライフ	20,300	476.00	9,662,800	
コーセーアールイー	4,500	660.00	2,970,000	
日本商業開発	9,000	1,719.00	15,471,000	
プレサンスコーポレーション	23,600	1,551.00	36,603,600	
フィル・カンパニー	2,800	2,695.00	7,546,000	
ＴＨＥグローバル社	7,700	226.00	1,740,200	
ハウスコム	1,500	1,235.00	1,852,500	
日本管理センター	7,500	1,300.00	9,750,000	
サンセイランディック	4,300	874.00	3,758,200	
エストラスト	1,500	676.00	1,014,000	
フージャースホールディングス	23,600	747.00	17,629,200	
オープンハウス	45,300	5,320.00	240,996,000	
東急不動産ホールディングス	391,000	655.00	256,105,000	
飯田グループホールディングス	120,000	2,670.00	320,400,000	
イーグランド	2,800	1,033.00	2,892,400	

ムゲンエステート	9,400	509.00	4,784,600	
帝国繊維	16,100	2,115.00	34,051,500	
日本コークス工業	123,400	101.00	12,463,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,300	1,762.00	12,862,600	
ミタチ産業	3,600	808.00	2,908,800	
ＢＥＥＮＯＳ	6,700	3,530.00	23,651,000	
あさひ	10,700	1,359.00	14,541,300	
日本調剤	8,700	1,670.00	14,529,000	
コスモス薬品	14,800	16,220.00	240,056,000	
シップヘルスケアホールディングス	50,600	2,709.00	137,075,400	
トーエル	6,700	827.00	5,540,900	
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	2,744.00	15,915,200	
オンリー	3,000	474.00	1,422,000	
セブン&アイ・ホールディングス	562,000	5,088.00	2,859,456,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	66,600	983.00	65,467,800	
明治電機工業	3,800	1,407.00	5,346,600	
ツルハホールディングス	31,400	12,550.00	394,070,000	
デリカフーズホールディングス	6,400	652.00	4,172,800	
スターティアホールディングス	2,800	2,017.00	5,647,600	
サンマルクホールディングス	11,700	1,603.00	18,755,100	
フェリシモ	3,000	1,693.00	5,079,000	
トリドールホールディングス	35,600	1,904.00	67,782,400	
帝人	134,500	1,649.00	221,790,500	
東レ	1,034,500	723.00	747,943,500	
クラレ	224,900	1,018.00	228,948,200	
旭化成	947,000	1,210.50	1,146,343,500	
サカイオーベックス	3,700	3,100.00	11,470,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	13,000	686.00	8,918,000	
稲葉製作所	8,300	1,536.00	12,748,800	
宮地エンジニアリンググループ	4,700	2,456.00	11,543,200	
トーカロ	37,200	1,416.00	52,675,200	
アルファ	5,500	1,135.00	6,242,500	
ＳＵＭＣＯ	184,500	2,713.00	500,548,500	
川田テクノロジーズ	2,900	3,725.00	10,802,500	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	4,700	6,250.00	29,375,000	
ジェイテックコーポレーション	1,000	3,270.00	3,270,000	
信和	7,800	706.00	5,506,800	
ビーロット	6,900	573.00	3,953,700	
ファーストブラザーズ	2,900	1,078.00	3,126,200	
ハウスドゥ	7,100	1,007.00	7,149,700	
シーアールイー	3,500	1,587.00	5,554,500	
プロパティエージェント	2,500	2,559.00	6,397,500	
ケイアイスター不動産	4,500	5,220.00	23,490,000	
アグレ都市デザイン	2,700	1,000.00	2,700,000	
グッドコムアセット	6,800	1,458.00	9,914,400	
ジェイ・エス・ビー	2,800	3,905.00	10,934,000	
テンポイノベーション	4,000	895.00	3,580,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	870.00	2,001,000	
住江織物	2,800	2,039.00	5,709,200	

日本フエルト	6,900	442.00	3,049,800	
イチカワ	1,500	1,346.00	2,019,000	
エコナックホールディングス	22,100	90.00	1,989,000	
日東製網	1,500	1,524.00	2,286,000	
芦森工業	2,800	1,188.00	3,326,400	
アツギ	11,300	622.00	7,028,600	
ウイルプラスホールディングス	2,500	1,038.00	2,595,000	
ＪＭホールディングス	10,900	2,134.00	23,260,600	
コメダホールディングス	31,500	2,084.00	65,646,000	
サツドラホールディングス	1,900	2,011.00	3,820,900	
アレンザホールディングス	10,500	1,258.00	13,209,000	
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,863.00	6,893,100	
バロックジャパンリミテッド	10,400	819.00	8,517,600	
クスリのアオキホールディングス	14,400	7,300.00	105,120,000	
ダイニック	4,600	754.00	3,468,400	
共和レザー	8,200	716.00	5,871,200	
ピーバンドットコム	1,900	787.00	1,495,300	
力の源ホールディングス	5,900	619.00	3,652,100	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	84,000	4,240.00	356,160,000	
アセンテック	3,400	1,205.00	4,097,000	
セーレン	35,300	2,163.00	76,353,900	
ソトー	5,000	804.00	4,020,000	
東海染工	1,500	1,138.00	1,707,000	
小松マテーレ	23,400	929.00	21,738,600	
ワコールホールディングス	35,600	2,544.00	90,566,400	
ホギメディカル	19,300	3,455.00	66,681,500	
クラウディアホールディングス	2,900	286.00	829,400	
ＴＳＩホールディングス	43,200	379.00	16,372,800	
マツオカコーポレーション	4,600	1,658.00	7,626,800	
ワールド	18,600	1,463.00	27,211,800	
ＴＩＳ	143,200	2,913.00	417,141,600	
ＪＮＳホールディングス	6,700	600.00	4,020,000	
グリー	87,900	607.00	53,355,300	
GMOペパボ	900	4,620.00	4,158,000	
コーエーテクモホールディングス	36,800	5,130.00	188,784,000	
三菱総合研究所	6,300	4,170.00	26,271,000	
ボルテージ	3,500	469.00	1,641,500	
電算	1,100	2,321.00	2,553,100	
ＡＧＳ	7,500	883.00	6,622,500	
ファインデックス	12,200	1,208.00	14,737,600	
ブレインパッド	3,400	4,800.00	16,320,000	
ＫＬａｂ	26,300	638.00	16,779,400	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	19,000	1,071.00	20,349,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,500	3,325.00	8,312,500	
ネクソン	361,800	2,325.00	841,185,000	
アイスタイル	44,300	494.00	21,884,200	
エムアップホールディングス	3,500	3,470.00	12,145,000	
エイチーム	9,900	1,522.00	15,067,800	

エニグモ	13,600	1,440.00	19,584,000	
テクノスジャパン	10,900	611.00	6,659,900	
ｅｎｉｓｈ	6,300	582.00	3,666,600	
コロプラ	46,900	815.00	38,223,500	
オルトプラス	7,200	414.00	2,980,800	
ブロードリーフ	70,900	521.00	36,938,900	
クロス・マーケティンググループ	6,900	667.00	4,602,300	
デジタルハーツホールディングス	6,500	1,551.00	10,081,500	
システム情報	10,700	929.00	9,940,300	
メディアドゥ	5,300	4,730.00	25,069,000	
じげん	35,300	455.00	16,061,500	
ブイキューブ	7,600	2,458.00	18,680,800	
エンカレッジ・テクノロジ	2,800	644.00	1,803,200	
サイバーリンクス	4,700	1,532.00	7,200,400	
ディー・エル・イー	9,700	427.00	4,141,900	
フィックスターズ	15,300	840.00	12,852,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	5,800	1,957.00	11,350,600	
オプティム	10,100	2,133.00	21,543,300	
セレス	4,700	3,240.00	15,228,000	
ＳＨＩＦＴ	7,000	20,680.00	144,760,000	
特種東海製紙	8,700	4,525.00	39,367,500	
ティーガイア	15,300	2,007.00	30,707,100	
セック	2,000	2,665.00	5,330,000	
日本アジアグループ	12,100	960.00	11,616,000	
テクマトリックス	22,100	1,889.00	41,746,900	
プロシップ	4,200	1,423.00	5,976,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	34,400	2,077.00	71,448,800	
GMOペイメントゲートウェイ	27,300	14,090.00	384,657,000	
ザッパラス	5,800	516.00	2,992,800	
システムリサーチ	4,200	2,248.00	9,441,600	
インターネットイニシアティブ	37,900	3,675.00	139,282,500	
さくらインターネット	15,100	617.00	9,316,700	
ヴィンクス	3,900	949.00	3,701,100	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,900	4,695.00	13,615,500	
ＳＲＡホールディングス	7,600	2,742.00	20,839,200	
システムインテグレータ	3,900	654.00	2,550,600	
朝日ネット	11,900	689.00	8,199,100	
ｅＢＡＳＥ	16,900	844.00	14,263,600	
アバント	15,300	1,672.00	25,581,600	
アドソル日進	4,800	2,239.00	10,747,200	
ＯＤＫソリューションズ	2,600	794.00	2,064,400	
フリービット	8,500	784.00	6,664,000	
コムチュア	13,200	2,441.00	32,221,200	
サイバーコム	2,700	1,460.00	3,942,000	
アステリア	10,300	834.00	8,590,200	
アイル	7,900	1,390.00	10,981,000	
王子ホールディングス	643,000	642.00	412,806,000	
日本製紙	63,000	1,253.00	78,939,000	

三菱製紙	21,700	352.00	7,638,400	
北越コーポレーション	102,800	600.00	61,680,000	
中越パルプ工業	5,700	1,271.00	7,244,700	
巴川製紙所	4,100	797.00	3,267,700	
大王製紙	69,100	1,838.00	127,005,800	
阿波製紙	3,700	402.00	1,487,400	
マークラインズ	5,900	2,951.00	17,410,900	
メディカル・データ・ビジョン	16,300	2,071.00	33,757,300	
ｇｕｍｉ	19,600	769.00	15,072,400	
ショーケース	3,000	712.00	2,136,000	
モバイルファクトリー	3,000	1,141.00	3,423,000	
テラスカイ	4,700	2,410.00	11,327,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,400	1,916.00	12,262,400	
ＰＣＩホールディングス	5,300	1,164.00	6,169,200	
パイプドＨＤ	2,900	2,280.00	6,612,000	
アイビーシー	2,600	950.00	2,470,000	
ネオジャパン	2,800	1,471.00	4,118,800	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	2,900	3,310.00	9,599,000	
ラクス	43,200	3,415.00	147,528,000	
ランドコンピュータ	1,900	1,108.00	2,105,200	
ダブルスタンダード	1,800	5,560.00	10,008,000	
オープンドア	8,800	2,336.00	20,556,800	
マイネット	4,100	695.00	2,849,500	
アカツキ	5,800	3,415.00	19,807,000	
ベネフィットジャパン	900	1,982.00	1,783,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	3,500	3,715.00	13,002,500	
カナミックネットワーク	13,100	627.00	8,213,700	
ノムラシステムコーポレーション	6,400	298.00	1,907,200	
レンゴー	147,300	916.00	134,926,800	
トーモク	8,700	1,937.00	16,851,900	
ザ・パック	10,900	2,754.00	30,018,600	
チェンジ	26,300	2,754.00	72,430,200	
シンクロ・フード	9,000	369.00	3,321,000	
オークネット	7,500	1,414.00	10,605,000	
キャピタル・アセット・プランニング	1,800	999.00	1,798,200	
セグエグループ	3,400	1,082.00	3,678,800	
エイトレッド	2,800	2,286.00	6,400,800	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,400	897.00	2,152,800	
マクロミル	29,900	842.00	25,175,800	
ビーグリー	2,800	1,536.00	4,300,800	
オロ	4,500	3,860.00	17,370,000	
ユーザーローカル	4,300	2,004.00	8,617,200	
テモナ	2,900	1,109.00	3,216,100	
ニーズウェル	2,800	631.00	1,766,800	
サインポスト	3,100	789.00	2,445,900	
昭和電工	108,300	3,265.00	353,599,500	
住友化学	1,124,000	571.00	641,804,000	
住友精化	6,700	3,680.00	24,656,000	
日産化学	78,900	5,350.00	422,115,000	

ラサ工業	4,700	1,846.00	8,676,200	
クレハ	12,400	6,650.00	82,460,000	
多木化学	5,600	5,210.00	29,176,000	
テイカ	10,300	1,310.00	13,493,000	
石原産業	25,400	1,115.00	28,321,000	
片倉コープアグリ	2,900	1,214.00	3,520,600	
日本曹達	20,100	3,240.00	65,124,000	
東ソー	220,700	1,995.00	440,296,500	
トクヤマ	42,300	2,266.00	95,851,800	
セントラル硝子	27,100	2,157.00	58,454,700	
東亞合成	87,500	1,153.00	100,887,500	
大阪ソーダ	14,800	2,424.00	35,875,200	
関東電化工業	33,500	1,007.00	33,734,500	
デンカ	52,200	3,700.00	193,140,000	
イビデン	70,200	6,070.00	426,114,000	
信越化学工業	264,200	18,310.00	4,837,502,000	
日本カーバイド工業	5,000	1,291.00	6,455,000	
電算システムホールディングス	4,600	3,000.00	13,800,000	
堺化学工業	10,100	1,871.00	18,897,100	
第一稀元素化学工業	14,500	1,793.00	25,998,500	
エア・ウォーター	145,600	1,659.00	241,550,400	
日本酸素ホールディングス	117,400	2,359.00	276,946,600	
日本化学工業	3,900	3,135.00	12,226,500	
東邦アセチレン	2,500	1,187.00	2,967,500	
日本パーカライジング	71,900	1,136.00	81,678,400	
高圧ガス工業	22,700	676.00	15,345,200	
チタン工業	1,800	1,858.00	3,344,400	
四国化成工業	19,300	1,319.00	25,456,700	
戸田工業	2,900	2,649.00	7,682,100	
ステラ　ケミファ	7,600	2,839.00	21,576,400	
保土谷化学工業	4,200	3,955.00	16,611,000	
日本触媒	26,000	5,280.00	137,280,000	
大日精化工業	12,200	2,325.00	28,365,000	
カネカ	36,900	4,530.00	167,157,000	
協和キリン	146,800	3,990.00	585,732,000	
三菱瓦斯化学	143,100	2,341.00	334,997,100	
三井化学	123,500	3,680.00	454,480,000	
ＪＳＲ	143,300	3,565.00	510,864,500	
東京応化工業	24,600	7,170.00	176,382,000	
大阪有機化学工業	13,200	3,730.00	49,236,000	
三菱ケミカルホールディングス	955,200	942.30	900,084,960	
ＫＨネオケム	23,500	2,556.00	60,066,000	
ダイセル	191,900	928.00	178,083,200	
住友ベークライト	22,600	4,895.00	110,627,000	
積水化学工業	299,400	1,918.00	574,249,200	
日本ゼオン	129,000	1,482.00	191,178,000	
アイカ工業	39,600	3,915.00	155,034,000	
宇部興産	71,900	2,237.00	160,840,300	
積水樹脂	23,500	2,148.00	50,478,000	
タキロンシーアイ	31,300	602.00	18,842,600	

旭有機材	8,200	1,356.00	11,119,200	
ニチバン	7,600	1,775.00	13,490,000	
リケンテクノス	34,400	589.00	20,261,600	
大倉工業	6,700	2,442.00	16,361,400	
積水化成品工業	19,300	610.00	11,773,000	
群栄化学工業	2,900	2,491.00	7,223,900	
タイガースポリマー	8,200	479.00	3,927,800	
ミライアル	4,600	1,283.00	5,901,800	
ダイキアクシス	5,200	841.00	4,373,200	
ダイキョーニシカワ	29,900	700.00	20,930,000	
竹本容器	5,000	993.00	4,965,000	
森六ホールディングス	7,700	2,294.00	17,663,800	
恵和	2,000	3,485.00	6,970,000	
日本化薬	88,400	1,093.00	96,621,200	
カーリットホールディングス	14,200	746.00	10,593,200	
ＥＰＳホールディングス	2,400	1,795.00	4,308,000	
ソルクシーズ	5,400	958.00	5,173,200	
レッグス	3,000	2,631.00	7,893,000	
プレステージ・インターナショナル	52,200	734.00	38,314,800	
フェイス	4,500	714.00	3,213,000	
プロトコーポレーション	16,600	1,368.00	22,708,800	
アミューズ	7,600	2,378.00	18,072,800	
野村総合研究所	248,600	3,640.00	904,904,000	
ドリームインキュベータ	4,400	989.00	4,351,600	
サイバネットシステム	10,300	687.00	7,076,100	
クイック	8,600	1,213.00	10,431,800	
ＴＡＣ	7,600	232.00	1,763,200	
ＣＥホールディングス	7,500	566.00	4,245,000	
日本システム技術	2,700	1,507.00	4,068,900	
電通グループ	156,600	4,005.00	627,183,000	
インテージホールディングス	17,800	1,580.00	28,124,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,700	1,000.00	6,700,000	
東邦システムサイエンス	3,600	956.00	3,441,600	
ぴあ	3,400	3,545.00	12,053,000	
イオンファンタジー	5,300	2,154.00	11,416,200	
ソースネクスト	67,700	314.00	21,257,800	
シーティーエス	15,800	835.00	13,193,000	
ネクシィーズグループ	4,500	919.00	4,135,500	
インフォコム	13,100	2,887.00	37,819,700	
メディカルシステムネットワーク	12,700	746.00	9,474,200	
日本精化	10,300	1,607.00	16,552,100	
扶桑化学工業	11,200	4,255.00	47,656,000	
トリケミカル研究所	12,400	3,140.00	38,936,000	
ＨＥＲＯＺ	4,000	2,158.00	8,632,000	
ラクスル	15,700	5,820.00	91,374,000	
ＩＰＳ	2,700	2,985.00	8,059,500	
ＦＩＧ	15,700	280.00	4,396,000	
システムサポート	4,200	1,345.00	5,649,000	
ＡＤＥＫＡ	65,800	2,123.00	139,693,400	
日油	54,000	5,780.00	312,120,000	

ミヨシ油脂	5,300	1,278.00	6,773,400	
新日本理化	23,200	269.00	6,240,800	
ハリマ化成グループ	10,800	885.00	9,558,000	
イーソル	7,600	1,056.00	8,025,600	
アルテリア・ネットワークス	15,900	1,927.00	30,639,300	
ＥＤＵＬＡＢ	1,200	5,370.00	6,444,000	
東海ソフト	1,700	1,515.00	2,575,500	
ウイングアーク１ｓｔ	7,600	2,140.00	16,264,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,700	2,161.00	5,834,700	
サーバーワークス	1,000	4,010.00	4,010,000	
東名	900	1,063.00	956,700	
ヴィッツ	600	2,038.00	1,222,800	
トビラシステムズ	1,200	1,310.00	1,572,000	
Ｓａｎｓａｎ	12,600	8,720.00	109,872,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	900	1,644.00	1,479,600	
ギフティ	8,400	3,695.00	31,038,000	
花王	349,400	6,802.00	2,376,618,800	
第一工業製薬	4,800	3,220.00	15,456,000	
石原ケミカル	3,500	2,154.00	7,539,000	
日華化学	5,200	1,329.00	6,910,800	
ニイタカ	2,900	2,091.00	6,063,900	
三洋化成工業	8,500	5,370.00	45,645,000	
ベース	1,400	5,380.00	7,532,000	
武田薬品工業	1,213,600	3,698.00	4,487,892,800	
アステラス製薬	1,264,700	1,918.50	2,426,326,950	
大日本住友製薬	107,900	2,215.00	238,998,500	
塩野義製薬	183,300	5,824.00	1,067,539,200	
わかもと製薬	17,500	329.00	5,757,500	
日本新薬	41,400	8,770.00	363,078,000	
ビオフェルミン製薬	2,800	2,993.00	8,380,400	
中外製薬	456,300	4,238.00	1,933,799,400	
科研製薬	24,900	4,795.00	119,395,500	
エーザイ	160,900	10,530.00	1,694,277,000	
理研ビタミン	13,900	1,597.00	22,198,300	
ロート製薬	69,600	3,020.00	210,192,000	
小野薬品工業	335,100	2,524.50	845,959,950	
久光製薬	42,400	5,390.00	228,536,000	
有機合成薬品工業	11,200	386.00	4,323,200	
持田製薬	20,200	3,725.00	75,245,000	
参天製薬	254,000	1,541.00	391,414,000	
扶桑薬品工業	4,700	2,237.00	10,513,900	
日本ケミファ	1,400	2,249.00	3,148,600	
ツムラ	48,700	3,470.00	168,989,000	
日医工	41,400	862.00	35,686,800	
テルモ	447,400	4,412.00	1,973,928,800	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	38,900	2,832.00	110,164,800	
キッセイ薬品工業	26,000	2,219.00	57,694,000	
生化学工業	26,000	1,111.00	28,886,000	
栄研化学	25,800	2,170.00	55,986,000	

日水製薬	5,800	1,006.00	5,834,800	
鳥居薬品	9,200	2,444.00	22,484,800	
ＪＣＲファーマ	41,200	3,660.00	150,792,000	
東和薬品	21,000	2,549.00	53,529,000	
富士製薬工業	10,000	1,144.00	11,440,000	
ゼリア新薬工業	26,600	2,083.00	55,407,800	
第一三共	1,146,000	2,309.00	2,646,114,000	
キョーリン製薬ホールディングス	32,300	1,804.00	58,269,200	
大幸薬品	17,800	965.00	17,177,000	
ダイト	9,400	3,465.00	32,571,000	
大塚ホールディングス	303,400	4,390.00	1,331,926,000	
大正製薬ホールディングス	34,500	6,020.00	207,690,000	
ペプチドリーム	76,100	4,910.00	373,651,000	
大日本塗料	16,200	857.00	13,883,400	
日本ペイントホールディングス	588,700	1,381.00	812,994,700	
関西ペイント	160,400	2,783.00	446,393,200	
神東塗料	11,300	193.00	2,180,900	
中国塗料	34,400	872.00	29,996,800	
日本特殊塗料	10,800	1,110.00	11,988,000	
藤倉化成	19,600	515.00	10,094,000	
太陽ホールディングス	10,700	5,120.00	54,784,000	
ＤＩＣ	60,200	2,763.00	166,332,600	
サカタインクス	31,300	1,020.00	31,926,000	
東洋インキＳＣホールディングス	30,100	1,965.00	59,146,500	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11,500	853.00	9,809,500	
アルプス技研	12,500	1,999.00	24,987,500	
サニックス	18,800	351.00	6,598,800	
ダイオーズ	2,800	1,044.00	2,923,200	
日本空調サービス	15,300	725.00	11,092,500	
オリエンタルランド	148,200	16,090.00	2,384,538,000	
フォーカスシステムズ	9,400	986.00	9,268,400	
ダスキン	32,300	2,568.00	82,946,400	
パーク２４	77,100	2,067.00	159,365,700	
明光ネットワークジャパン	17,800	588.00	10,466,400	
ファルコホールディングス	6,700	1,684.00	11,282,800	
クレスコ	9,700	1,910.00	18,527,000	
フジ・メディア・ホールディングス	148,200	1,243.00	184,212,600	
秀英予備校	2,900	414.00	1,200,600	
田谷	1,800	556.00	1,000,800	
ラウンドワン	47,600	1,425.00	67,830,000	
リゾートトラスト	63,900	1,868.00	119,365,200	
オービック	45,300	20,800.00	942,240,000	
ジャストシステム	20,200	6,510.00	131,502,000	
ＴＤＣソフト	12,700	1,032.00	13,106,400	
Ｚホールディングス	1,966,500	559.70	1,100,650,050	
ビー・エム・エル	18,100	3,905.00	70,680,500	
トレンドマイクロ	76,300	5,820.00	444,066,000	
りらいあコミュニケーションズ	21,100	1,384.00	29,202,400	
ＩＤホールディングス	8,200	927.00	7,601,400	
リソー教育	70,400	333.00	23,443,200	

日本オラクル	29,100	8,230.00	239,493,000	
早稲田アカデミー	5,300	934.00	4,950,200	
アルファシステムズ	3,700	3,750.00	13,875,000	
フューチャー	17,500	1,954.00	34,195,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,200	1,460.00	13,432,000	
ＳＢテクノロジー	5,000	3,030.00	15,150,000	
トーセ	3,900	802.00	3,127,800	
ユー・エス・エス	156,100	1,889.00	294,872,900	
オービックビジネスコンサルタント	14,800	6,510.00	96,348,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	65,400	3,460.00	226,284,000	
アイティフォー	18,800	786.00	14,776,800	
東京個別指導学院	12,300	619.00	7,613,700	
東計電算	2,200	4,545.00	9,999,000	
サイバーエージェント	343,400	2,329.00	799,778,600	
楽天グループ	649,500	1,328.00	862,536,000	
エックスネット	2,800	1,031.00	2,886,800	
クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,713.00	12,162,300	
モーニングスター	15,300	470.00	7,191,000	
テー・オー・ダブリュー	24,900	321.00	7,992,900	
大塚商会	77,500	5,830.00	451,825,000	
サイボウズ	16,800	2,537.00	42,621,600	
山田コンサルティンググループ	8,200	1,200.00	9,840,000	
セントラルスポーツ	5,000	2,450.00	12,250,000	
パラカ	3,600	1,700.00	6,120,000	
電通国際情報サービス	17,700	4,735.00	83,809,500	
ＡＣＣＥＳＳ	17,400	887.00	15,433,800	
デジタルガレージ	23,500	4,990.00	117,265,000	
イーエムシステムズ	23,600	839.00	19,800,400	
ウェザーニューズ	4,200	5,610.00	23,562,000	
ＣＩＪ	9,900	846.00	8,375,400	
ビジネスエンジニアリング	1,400	3,185.00	4,459,000	
日本エンタープライズ	14,300	213.00	3,045,900	
WOWOW	6,700	2,468.00	16,535,600	
スカラ	12,800	775.00	9,920,000	
インテリジェント　ウェイブ	8,500	597.00	5,074,500	
フルキャストホールディングス	12,300	2,300.00	28,290,000	
エン・ジャパン	24,800	3,920.00	97,216,000	
あすか製薬ホールディングス	16,700	965.00	16,115,500	
サワイグループホールディングス	32,100	4,730.00	151,833,000	
富士フイルムホールディングス	256,600	8,190.00	2,101,554,000	
コニカミノルタ	295,800	612.00	181,029,600	
資生堂	290,200	8,000.00	2,321,600,000	
ライオン	189,600	1,973.00	374,080,800	
高砂香料工業	9,100	2,708.00	24,642,800	
マンダム	30,400	1,989.00	60,465,600	
ミルボン	19,400	6,180.00	119,892,000	
ファンケル	53,000	3,570.00	189,210,000	
コーセー	27,300	17,580.00	479,934,000	
コタ	9,300	1,414.00	13,150,200	
シーボン	1,500	1,978.00	2,967,000	

ポーラ・オルビスホールディングス	62,200	2,878.00	179,011,600	
ノエビアホールディングス	12,500	5,660.00	70,750,000	
アジュバンコスメジャパン	3,500	1,036.00	3,626,000	
新日本製薬	2,800	2,085.00	5,838,000	
エステー	9,500	1,721.00	16,349,500	
アグロ　カネショウ	5,500	1,409.00	7,749,500	
コニシ	24,000	1,615.00	38,760,000	
長谷川香料	25,300	2,514.00	63,604,200	
星光ＰＭＣ	8,500	935.00	7,947,500	
小林製薬	40,900	9,390.00	384,051,000	
荒川化学工業	12,200	1,190.00	14,518,000	
メック	10,000	3,320.00	33,200,000	
日本高純度化学	3,900	2,901.00	11,313,900	
タカラバイオ	38,100	2,913.00	110,985,300	
ＪＣＵ	16,600	3,725.00	61,835,000	
新田ゼラチン	9,400	635.00	5,969,000	
ＯＡＴアグリオ	2,800	1,401.00	3,922,800	
デクセリアルズ	40,600	2,379.00	96,587,400	
アース製薬	11,000	6,470.00	71,170,000	
北興化学工業	13,600	1,075.00	14,620,000	
大成ラミック	4,700	2,748.00	12,915,600	
クミアイ化学工業	60,200	854.00	51,410,800	
日本農薬	26,100	513.00	13,389,300	
富士興産	4,400	1,089.00	4,791,600	
ニチレキ	17,500	1,351.00	23,642,500	
ユシロ化学工業	8,300	1,195.00	9,918,500	
ビーピー・カストロール	5,200	1,343.00	6,983,600	
富士石油	35,500	261.00	9,265,500	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,500	1,091.00	6,000,500	
出光興産	161,800	2,622.00	424,239,600	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,194,600	470.50	1,032,559,300	
コスモエネルギーホールディングス	46,200	2,542.00	117,440,400	
テスホールディングス	8,500	2,084.00	17,714,000	
横浜ゴム	84,500	2,285.00	193,082,500	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	76,500	2,225.00	170,212,500	
ブリヂストン	388,000	4,960.00	1,924,480,000	
住友ゴム工業	131,000	1,500.00	196,500,000	
藤倉コンポジット	13,200	488.00	6,441,600	
オカモト	9,100	4,165.00	37,901,500	
アキレス	10,300	1,388.00	14,296,400	
フコク	5,500	930.00	5,115,000	
ニッタ	15,200	2,700.00	41,040,000	
クリエートメディック	5,000	985.00	4,925,000	
住友理工	28,300	724.00	20,489,200	
三ツ星ベルト	17,700	1,827.00	32,337,900	
バンドー化学	25,800	919.00	23,710,200	
ＡＧＣ	134,000	4,665.00	625,110,000	
日本板硝子	74,600	606.00	45,207,600	
石塚硝子	2,700	1,877.00	5,067,900	
有沢製作所	20,300	891.00	18,087,300	

日本山村硝子	6,400	920.00	5,888,000	
日本電気硝子	54,000	2,509.00	135,486,000	
オハラ	6,000	1,444.00	8,664,000	
住友大阪セメント	26,300	3,000.00	78,900,000	
太平洋セメント	83,400	2,487.00	207,415,800	
リソルホールディングス	1,000	3,985.00	3,985,000	
日本ヒューム	13,800	733.00	10,115,400	
日本コンクリート工業	30,900	318.00	9,826,200	
三谷セキサン	6,700	4,345.00	29,111,500	
アジアパイルホールディングス	22,700	455.00	10,328,500	
東海カーボン	142,400	1,498.00	213,315,200	
日本カーボン	8,200	4,095.00	33,579,000	
東洋炭素	8,600	2,781.00	23,916,600	
ノリタケカンパニーリミテド	8,300	4,295.00	35,648,500	
ＴＯＴＯ	104,200	5,790.00	603,318,000	
日本碍子	160,100	1,848.00	295,864,800	
日本特殊陶業	110,800	1,618.00	179,274,400	
ダントーホールディングス	9,200	330.00	3,036,000	
ＭＡＲＵＷＡ	4,800	11,050.00	53,040,000	
品川リフラクトリーズ	3,300	3,965.00	13,084,500	
黒崎播磨	2,600	4,795.00	12,467,000	
ヨータイ	10,500	1,330.00	13,965,000	
イソライト工業	6,500	682.00	4,433,000	
東京窯業	19,200	319.00	6,124,800	
ニッカトー	6,700	687.00	4,602,900	
フジミインコーポレーテッド	12,000	4,845.00	58,140,000	
クニミネ工業	4,600	1,184.00	5,446,400	
エーアンドエーマテリアル	2,800	1,013.00	2,836,400	
ニチアス	36,900	2,816.00	103,910,400	
日本製鉄	688,200	1,828.50	1,258,373,700	
神戸製鋼所	264,100	704.00	185,926,400	
中山製鋼所	20,800	396.00	8,236,800	
合同製鐵	7,700	1,634.00	12,581,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	417,400	1,292.00	539,280,800	
東京製鐵	56,500	1,070.00	60,455,000	
共英製鋼	16,100	1,402.00	22,572,200	
大和工業	30,500	3,600.00	109,800,000	
東京鐵鋼	5,600	1,581.00	8,853,600	
大阪製鐵	7,600	1,114.00	8,466,400	
淀川製鋼所	19,600	2,332.00	45,707,200	
丸一鋼管	46,800	2,660.00	124,488,000	
モリ工業	4,300	2,328.00	10,010,400	
大同特殊鋼	23,500	5,330.00	125,255,000	
日本高周波鋼業	4,800	385.00	1,848,000	
日本冶金工業	11,200	2,280.00	25,536,000	
山陽特殊製鋼	17,500	1,577.00	27,597,500	
愛知製鋼	8,300	3,060.00	25,398,000	
日立金属	136,100	2,130.00	289,893,000	
日本金属	3,500	952.00	3,332,000	

大平洋金属	9,700	1,681.00	16,305,700	
新日本電工	93,300	300.00	27,990,000	
栗本鐵工所	6,700	1,690.00	11,323,000	
虹　技	1,500	1,111.00	1,666,500	
日本鋳鉄管	1,700	1,244.00	2,114,800	
日本製鋼所	43,700	2,809.00	122,753,300	
三菱製鋼	10,800	1,097.00	11,847,600	
日亜鋼業	21,800	291.00	6,343,800	
日本精線	2,000	4,530.00	9,060,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,300	1,240.00	7,812,000	
大紀アルミニウム工業所	21,600	1,146.00	24,753,600	
日本軽金属ホールディングス	39,300	1,877.00	73,766,100	
三井金属鉱業	38,800	3,050.00	118,340,000	
東邦亜鉛	8,200	1,875.00	15,375,000	
三菱マテリアル	95,100	2,246.00	213,594,600	
住友金属鉱山	184,300	4,405.00	811,841,500	
ＤＯＷＡホールディングス	36,200	4,280.00	154,936,000	
古河機械金属	23,800	1,257.00	29,916,600	
エス・サイエンス	58,400	38.00	2,219,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,300	780.00	11,934,000	
東邦チタニウム	26,000	1,021.00	26,546,000	
ＵＡＣＪ	21,800	2,872.00	62,609,600	
ＣＫサンエツ	2,800	3,035.00	8,498,000	
古河電気工業	45,100	2,766.00	124,746,600	
住友電気工業	503,100	1,595.50	802,696,050	
フジクラ	174,500	560.00	97,720,000	
昭和電線ホールディングス	14,100	1,824.00	25,718,400	
東京特殊電線	1,800	2,597.00	4,674,600	
タツタ電線	25,200	557.00	14,036,400	
カナレ電気	2,800	1,677.00	4,695,600	
平河ヒューテック	7,900	1,205.00	9,519,500	
リョービ	17,500	1,521.00	26,617,500	
アーレスティ	18,000	485.00	8,730,000	
アサヒホールディングス	54,000	2,265.00	122,310,000	
東洋製罐グループホールディングス	91,700	1,427.00	130,855,900	
ホッカンホールディングス	7,300	1,413.00	10,314,900	
コロナ	8,200	930.00	7,626,000	
横河ブリッジホールディングス	24,800	2,079.00	51,559,200	
駒井ハルテック	2,800	1,699.00	4,757,200	
高田機工	1,000	2,734.00	2,734,000	
三和ホールディングス	136,100	1,348.00	183,462,800	
文化シヤッター	42,700	1,171.00	50,001,700	
三協立山	18,500	865.00	16,002,500	
アルインコ	9,500	1,023.00	9,718,500	
東洋シヤッター	2,900	639.00	1,853,100	
ＬＩＸＩＬ	198,600	2,954.00	586,664,400	
日本フイルコン	10,400	519.00	5,397,600	
ノーリツ	29,800	1,859.00	55,398,200	
長府製作所	14,800	2,048.00	30,310,400	
リンナイ	28,000	10,530.00	294,840,000	

ユニプレス	24,200	967.00	23,401,400	
ダイニチ工業	6,700	758.00	5,078,600	
日東精工	18,600	595.00	11,067,000	
三洋工業	1,500	1,897.00	2,845,500	
岡部	29,800	658.00	19,608,400	
ジーテクト	18,000	1,544.00	27,792,000	
東プレ	27,000	1,566.00	42,282,000	
高周波熱錬	27,400	577.00	15,809,800	
東京製綱	10,500	1,117.00	11,728,500	
サンコール	12,700	455.00	5,778,500	
モリテックスチール	11,000	476.00	5,236,000	
パイオラックス	21,300	1,515.00	32,269,500	
エイチワン	14,300	747.00	10,682,100	
日本発条	143,600	863.00	123,926,800	
中央発條	5,000	1,406.00	7,030,000	
アドバネクス	1,900	1,283.00	2,437,700	
三浦工業	62,400	4,965.00	309,816,000	
タクマ	48,900	1,714.00	83,814,600	
テクノプロ・ホールディングス	84,000	2,735.00	229,740,000	
アトラグループ	3,000	331.00	993,000	
インターワークス	4,300	415.00	1,784,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,800	14,460.00	83,868,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,000	3,005.00	27,045,000	
ファーストロジック	2,800	790.00	2,212,000	
三機サービス	2,800	1,077.00	3,015,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,500	921.00	7,828,500	
デザインワン・ジャパン	4,400	245.00	1,078,000	
イー・ガーディアン	6,100	2,814.00	17,165,400	
リブセンス	7,500	220.00	1,650,000	
ジャパンマテリアル	43,100	1,352.00	58,271,200	
ベクトル	17,700	945.00	16,726,500	
ウチヤマホールディングス	7,000	372.00	2,604,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	10,300	1,196.00	12,318,800	
キャリアリンク	4,500	2,093.00	9,418,500	
ＩＢＪ	11,600	1,155.00	13,398,000	
アサンテ	5,000	1,764.00	8,820,000	
バリューＨＲ	5,600	1,677.00	9,391,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	11,600	5,660.00	65,656,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,397.00	7,264,400	
ＥＲＩホールディングス	3,400	654.00	2,223,600	
アビスト	2,200	2,988.00	6,573,600	
シグマクシス	7,500	2,359.00	17,692,500	
ウィルグループ	10,300	1,010.00	10,403,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	20,300	250.00	5,075,000	
メドピア	10,700	4,445.00	47,561,500	
レアジョブ	1,900	1,700.00	3,230,000	
リクルートホールディングス	998,600	5,709.00	5,701,007,400	
エラン	19,300	1,273.00	24,568,900	

ツガミ	29,800	1,658.00	49,408,400	
オークマ	16,800	5,480.00	92,064,000	
芝浦機械	15,200	2,569.00	39,048,800	
アマダ	211,100	1,141.00	240,865,100	
アイダエンジニアリング	37,800	966.00	36,514,800	
滝澤鉄工所	4,700	1,123.00	5,278,100	
ＦＵＪＩ	57,700	2,577.00	148,692,900	
牧野フライス製作所	16,900	4,400.00	74,360,000	
オーエスジー	71,300	2,067.00	147,377,100	
ダイジェット工業	1,100	1,313.00	1,444,300	
旭ダイヤモンド工業	38,400	523.00	20,083,200	
ＤＭＧ森精機	91,200	1,848.00	168,537,600	
ソディック	31,600	1,032.00	32,611,200	
ディスコ	19,600	33,250.00	651,700,000	
日東工器	6,800	1,878.00	12,770,400	
日進工具	11,300	1,468.00	16,588,400	
パンチ工業	12,200	630.00	7,686,000	
冨士ダイス	7,800	669.00	5,218,200	
土木管理総合試験所	6,700	399.00	2,673,300	
ネットマーケティング	6,800	401.00	2,726,800	
日本郵政	1,055,100	921.50	972,274,650	
ベルシステム２４ホールディングス	23,400	1,792.00	41,932,800	
鎌倉新書	14,100	1,007.00	14,198,700	
ＳＭＮ	2,900	797.00	2,311,300	
一蔵	2,000	413.00	826,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,700	986.00	2,662,200	
エアトリ	8,900	2,783.00	24,768,700	
アトラエ	8,500	2,311.00	19,643,500	
ストライク	5,000	3,780.00	18,900,000	
ソラスト	34,300	1,411.00	48,397,300	
セラク	4,300	2,176.00	9,356,800	
インソース	13,400	2,557.00	34,263,800	
豊田自動織機	118,200	9,420.00	1,113,444,000	
豊和工業	7,900	820.00	6,478,000	
ＯＫＫ	5,900	440.00	2,596,000	
石川製作所	3,100	1,544.00	4,786,400	
東洋機械金属	10,300	509.00	5,242,700	
津田駒工業	2,800	881.00	2,466,800	
エンシュウ	2,900	862.00	2,499,800	
島精機製作所	21,400	1,915.00	40,981,000	
オプトラン	18,200	2,412.00	43,898,400	
ＮＣホールディングス	3,700	1,235.00	4,569,500	
イワキ	9,400	913.00	8,582,200	
フリュー	14,200	1,376.00	19,539,200	
ヤマシンフィルタ	29,100	727.00	21,155,700	
日阪製作所	18,300	832.00	15,225,600	
やまびこ	28,000	1,238.00	34,664,000	
平田機工	6,700	6,510.00	43,617,000	
ペガサスミシン製造	15,600	478.00	7,456,800	
マルマエ	5,200	2,142.00	11,138,400	

タツモ	6,100	1,727.00	10,534,700	
ナブテスコ	85,000	4,215.00	358,275,000	
三井海洋開発	15,700	1,978.00	31,054,600	
レオン自動機	14,100	1,387.00	19,556,700	
ＳＭＣ	42,600	67,860.00	2,890,836,000	
ホソカワミクロン	4,800	6,190.00	29,712,000	
ユニオンツール	5,300	4,080.00	21,624,000	
オイレス工業	20,200	1,607.00	32,461,400	
日精エー・エス・ビー機械	4,700	4,830.00	22,701,000	
サトーホールディングス	19,000	2,725.00	51,775,000	
技研製作所	12,800	4,860.00	62,208,000	
日本エアーテック	4,700	1,260.00	5,922,000	
カワタ	3,900	882.00	3,439,800	
日精樹脂工業	11,200	1,374.00	15,388,800	
オカダアイヨン	4,600	1,339.00	6,159,400	
ワイエイシイホールディングス	5,800	1,105.00	6,409,000	
小松製作所	661,000	2,731.50	1,805,521,500	
住友重機械工業	83,600	3,115.00	260,414,000	
日立建機	68,300	3,305.00	225,731,500	
日工	21,900	692.00	15,154,800	
巴工業	5,900	2,290.00	13,511,000	
井関農機	14,600	1,480.00	21,608,000	
ＴＯＷＡ	13,900	2,258.00	31,386,200	
丸山製作所	2,900	1,774.00	5,144,600	
北川鉄工所	6,700	1,672.00	11,202,400	
シンニッタン	17,700	250.00	4,425,000	
ローツェ	6,500	9,600.00	62,400,000	
タカキタ	5,200	612.00	3,182,400	
クボタ	766,300	2,272.50	1,741,416,750	
荏原実業	6,800	2,843.00	19,332,400	
東洋エンジニアリング	16,300	722.00	11,768,600	
三菱化工機	4,700	2,532.00	11,900,400	
月島機械	26,800	1,194.00	31,999,200	
帝国電機製作所	10,300	1,245.00	12,823,500	
東京機械製作所	5,500	830.00	4,565,000	
新東工業	34,700	803.00	27,864,100	
澁谷工業	12,800	3,180.00	40,704,000	
アイチコーポレーション	25,400	855.00	21,717,000	
小森コーポレーション	37,100	824.00	30,570,400	
鶴見製作所	11,200	1,715.00	19,208,000	
住友精密工業	2,500	2,910.00	7,275,000	
日本ギア工業	7,100	322.00	2,286,200	
酒井重工業	2,500	2,653.00	6,632,500	
荏原製作所	60,400	5,450.00	329,180,000	
石井鐵工所	1,400	3,050.00	4,270,000	
西島製作所	15,100	875.00	13,212,500	
北越工業	15,300	1,085.00	16,600,500	
ダイキン工業	185,700	22,025.00	4,090,042,500	
オルガノ	4,700	6,100.00	28,670,000	
トーヨーカネツ	5,400	2,435.00	13,149,000	

栗田工業	79,000	5,550.00	438,450,000	
椿本チエイン	20,600	3,270.00	67,362,000	
大同工業	5,900	1,123.00	6,625,700	
日機装	47,100	1,145.00	53,929,500	
木村化工機	12,200	863.00	10,528,600	
レイズネクスト	24,700	1,181.00	29,170,700	
アネスト岩田	24,700	1,050.00	25,935,000	
ダイフク	80,400	10,000.00	804,000,000	
サムコ	3,400	3,240.00	11,016,000	
加藤製作所	7,800	993.00	7,745,400	
油研工業	2,100	1,756.00	3,687,600	
タダノ	70,400	1,151.00	81,030,400	
フジテック	50,400	2,474.00	124,689,600	
ＣＫＤ	33,600	2,306.00	77,481,600	
キトー	12,400	1,682.00	20,856,800	
平和	40,500	2,018.00	81,729,000	
理想科学工業	11,200	1,759.00	19,700,800	
ＳＡＮＫＹＯ	34,400	2,878.00	99,003,200	
日本金銭機械	16,200	618.00	10,011,600	
マースグループホールディングス	9,400	1,624.00	15,265,600	
フクシマガリレイ	10,100	4,485.00	45,298,500	
オーイズミ	6,300	386.00	2,431,800	
ダイコク電機	6,700	921.00	6,170,700	
竹内製作所	24,300	2,904.00	70,567,200	
アマノ	38,100	2,866.00	109,194,600	
ＪＵＫＩ	20,700	797.00	16,497,900	
サンデンホールディングス	17,600	333.00	5,860,800	
蛇の目ミシン工業	13,100	753.00	9,864,300	
ブラザー工業	178,000	2,246.00	399,788,000	
マックス	20,200	1,837.00	37,107,400	
モリタホールディングス	23,400	1,624.00	38,001,600	
グローリー	37,400	2,374.00	88,787,600	
新晃工業	13,800	1,934.00	26,689,200	
大和冷機工業	23,200	1,066.00	24,731,200	
セガサミーホールディングス	132,700	1,494.00	198,253,800	
日本ピストンリング	5,500	1,284.00	7,062,000	
リケン	6,700	2,603.00	17,440,100	
ＴＰＲ	19,700	1,499.00	29,530,300	
ツバキ・ナカシマ	28,200	1,698.00	47,883,600	
ホシザキ	45,900	9,420.00	432,378,000	
大豊工業	12,200	941.00	11,480,200	
日本精工	299,500	917.00	274,641,500	
ＮＴＮ	336,800	292.00	98,345,600	
ジェイテクト	139,800	1,147.00	160,350,600	
不二越	13,900	4,320.00	60,048,000	
ミネベアミツミ	251,300	3,125.00	785,312,500	
日本トムソン	39,900	662.00	26,413,800	
ＴＨＫ	90,900	3,425.00	311,332,500	
ユーシン精機	9,700	829.00	8,041,300	
前澤給装工業	10,200	1,063.00	10,842,600	

イーグル工業	18,300	1,124.00	20,569,200	
前澤工業	8,800	692.00	6,089,600	
日本ピラー工業	15,000	2,293.00	34,395,000	
キッツ	45,600	774.00	35,294,400	
日立製作所	701,000	6,729.00	4,717,029,000	
東芝	288,700	4,935.00	1,424,734,500	
三菱電機	1,459,100	1,484.50	2,166,033,950	
富士電機	87,800	5,230.00	459,194,000	
東洋電機製造	5,900	1,157.00	6,826,300	
安川電機	157,000	5,760.00	904,320,000	
シンフォニア　テクノロジー	19,200	1,282.00	24,614,400	
明電舎	24,800	2,241.00	55,576,800	
オリジン	3,100	1,344.00	4,166,400	
山洋電気	6,800	7,760.00	52,768,000	
デンヨー	12,600	2,005.00	25,263,000	
ベイカレント・コンサルティング	9,100	35,750.00	325,325,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,900	2,995.00	8,685,500	
アイモバイル	4,800	1,573.00	7,550,400	
キャリアインデックス	5,800	935.00	5,423,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	5,700	1,227.00	6,993,900	
船場	2,000	833.00	1,666,000	
グレイステクノロジー	13,800	1,574.00	21,721,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	40,200	2,561.00	102,952,200	
フルテック	2,100	1,369.00	2,874,900	
グリーンズ	4,300	614.00	2,640,200	
ツナググループ・ホールディングス	1,800	342.00	615,600	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	4,300	589.00	2,532,700	
ソウルドアウト	3,000	1,773.00	5,319,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,500	601.00	1,502,500	
ウェルビー	4,400	1,362.00	5,992,800	
エル・ティー・エス	900	4,080.00	3,672,000	
ミダック	5,800	4,340.00	25,172,000	
日総工産	11,000	834.00	9,174,000	
キュービーネットホールディングス	6,700	1,672.00	11,202,400	
ＲＰＡホールディングス	15,800	779.00	12,308,200	
三櫻工業	20,200	1,186.00	23,957,200	
マキタ	190,300	5,500.00	1,046,650,000	
東芝テック	15,900	4,650.00	73,935,000	
芝浦メカトロニクス	2,800	7,880.00	22,064,000	
マブチモーター	40,300	4,225.00	170,267,500	
日本電産	351,300	13,115.00	4,607,299,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,500	787.00	5,902,500	
トレックス・セミコンダクター	8,200	3,000.00	24,600,000	
東光高岳	7,300	1,353.00	9,876,900	
ダブル・スコープ	24,700	650.00	16,055,000	
宮越ホールディングス	4,600	1,119.00	5,147,400	
ダイヘン	16,000	4,800.00	76,800,000	
ヤーマン	23,700	1,350.00	31,995,000	

ＪＶＣケンウッド	126,000	235.00	29,610,000	
ミマキエンジニアリング	14,000	788.00	11,032,000	
Ｉ－ＰＥＸ	6,800	2,384.00	16,211,200	
日新電機	34,700	1,364.00	47,330,800	
大崎電気工業	29,000	629.00	18,241,000	
オムロン	121,500	9,370.00	1,138,455,000	
日東工業	21,300	1,882.00	40,086,600	
ＩＤＥＣ	19,800	2,253.00	44,609,400	
正興電機製作所	4,400	1,741.00	7,660,400	
不二電機工業	2,800	1,290.00	3,612,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	52,300	2,803.00	146,596,900	
サクサホールディングス	3,300	1,338.00	4,415,400	
メルコホールディングス	4,800	5,650.00	27,120,000	
テクノメディカ	3,300	1,611.00	5,316,300	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,700	2,794.00	10,337,800	
日本電気	185,300	5,660.00	1,048,798,000	
富士通	131,400	21,165.00	2,781,081,000	
沖電気工業	59,300	1,024.00	60,723,200	
岩崎通信機	5,500	942.00	5,181,000	
電気興業	6,800	2,253.00	15,320,400	
サンケン電気	17,100	5,490.00	93,879,000	
ナカヨ	2,500	1,430.00	3,575,000	
アイホン	8,300	2,041.00	16,940,300	
ルネサスエレクトロニクス	698,500	1,213.00	847,280,500	
セイコーエプソン	180,600	1,957.00	353,434,200	
ワコム	105,500	710.00	74,905,000	
アルバック	26,700	5,600.00	149,520,000	
アクセル	6,300	882.00	5,556,600	
ＥＩＺＯ	12,500	4,935.00	61,687,500	
ジャパンディスプレイ	430,800	35.00	15,078,000	
日本信号	34,500	926.00	31,947,000	
京三製作所	31,600	424.00	13,398,400	
能美防災	19,400	2,126.00	41,244,400	
ホーチキ	10,700	1,178.00	12,604,600	
星和電機	7,200	515.00	3,708,000	
エレコム	33,600	2,086.00	70,089,600	
パナソニック	1,555,900	1,327.50	2,065,457,250	
シャープ	194,000	1,785.00	346,290,000	
アンリツ	87,700	2,048.00	179,609,600	
富士通ゼネラル	44,800	2,924.00	130,995,200	
ソニーグループ	913,800	11,485.00	10,494,993,000	
ＴＤＫ	70,500	13,500.00	951,750,000	
帝国通信工業	6,700	1,123.00	7,524,100	
タムラ製作所	53,300	956.00	50,954,800	
アルプスアルパイン	119,100	1,151.00	137,084,100	
池上通信機	4,800	835.00	4,008,000	
日本電波工業	12,300	905.00	11,131,500	
鈴木	6,500	950.00	6,175,000	
日本トリム	2,900	3,800.00	11,020,000	

ローランド　ディー．ジー．	8,800	2,708.00	23,830,400	
フォスター電機	15,600	949.00	14,804,400	
ＳＭＫ	3,600	2,450.00	8,820,000	
ヨコオ	10,900	2,554.00	27,838,600	
ティアック	7,700	124.00	954,800	
ホシデン	39,600	1,025.00	40,590,000	
ヒロセ電機	22,500	16,580.00	373,050,000	
日本航空電子工業	33,600	1,844.00	61,958,400	
ＴＯＡ	17,300	857.00	14,826,100	
マクセルホールディングス	29,100	1,282.00	37,306,200	
古野電気	18,600	1,031.00	19,176,600	
ユニデンホールディングス	3,500	2,592.00	9,072,000	
スミダコーポレーション	12,400	1,224.00	15,177,600	
アイコム	6,200	2,404.00	14,904,800	
リオン	6,200	2,762.00	17,124,400	
本多通信工業	12,000	486.00	5,832,000	
横河電機	145,900	1,668.00	243,361,200	
新電元工業	5,800	4,490.00	26,042,000	
アズビル	98,600	4,580.00	451,588,000	
東亜ディーケーケー	7,500	813.00	6,097,500	
日本光電工業	60,200	3,335.00	200,767,000	
チノー	4,600	1,492.00	6,863,200	
共和電業	16,400	385.00	6,314,000	
日本電子材料	5,300	1,796.00	9,518,800	
堀場製作所	28,800	7,170.00	206,496,000	
アドバンテスト	108,300	9,680.00	1,048,344,000	
小野測器	5,300	581.00	3,079,300	
エスペック	13,000	2,236.00	29,068,000	
キーエンス	143,200	58,470.00	8,372,904,000	
日置電機	6,700	7,120.00	47,704,000	
シスメックス	113,800	13,100.00	1,490,780,000	
日本マイクロニクス	25,600	1,444.00	36,966,400	
メガチップス	14,800	3,325.00	49,210,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,900	3,930.00	27,117,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12,800	439.00	5,619,200	
澤藤電機	1,500	2,146.00	3,219,000	
デンソー	321,200	7,519.00	2,415,102,800	
原田工業	6,200	911.00	5,648,200	
コーセル	17,800	1,024.00	18,227,200	
イリソ電子工業	12,400	5,320.00	65,968,000	
オプテックスグループ	24,300	1,810.00	43,983,000	
千代田インテグレ	6,500	1,771.00	11,511,500	
アイ・オー・データ機器	5,300	1,010.00	5,353,000	
レーザーテック	63,900	22,230.00	1,420,497,000	
スタンレー電気	102,200	3,120.00	318,864,000	
岩崎電気	5,300	1,993.00	10,562,900	
ウシオ電機	74,800	2,087.00	156,107,600	
岡谷電機産業	10,700	375.00	4,012,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	14,400	341.00	4,910,400	
エノモト	4,000	1,732.00	6,928,000	

日本セラミック	14,900	2,919.00	43,493,100	
遠藤照明	8,200	729.00	5,977,800	
古河電池	10,500	1,508.00	15,834,000	
双信電機	7,400	543.00	4,018,200	
山一電機	9,500	1,630.00	15,485,000	
図研	9,500	3,405.00	32,347,500	
日本電子	26,600	6,630.00	176,358,000	
カシオ計算機	117,400	1,898.00	222,825,200	
ファナック	128,100	27,535.00	3,527,233,500	
日本シイエムケイ	32,000	422.00	13,504,000	
エンプラス	6,700	3,495.00	23,416,500	
大真空	4,800	3,740.00	17,952,000	
ローム	60,700	10,220.00	620,354,000	
浜松ホトニクス	104,500	6,660.00	695,970,000	
三井ハイテック	14,400	6,160.00	88,704,000	
新光電気工業	48,900	3,990.00	195,111,000	
京セラ	222,300	6,833.00	1,518,975,900	
協栄産業	1,800	1,435.00	2,583,000	
太陽誘電	64,700	5,500.00	355,850,000	
村田製作所	428,900	9,113.00	3,908,565,700	
双葉電子工業	25,400	791.00	20,091,400	
日東電工	88,100	8,290.00	730,349,000	
北陸電気工業	5,800	1,030.00	5,974,000	
東海理化電機製作所	38,300	1,754.00	67,178,200	
ニチコン	46,000	1,182.00	54,372,000	
日本ケミコン	15,000	2,636.00	39,540,000	
ＫＯＡ	20,300	1,635.00	33,190,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	48,600	530.00	25,758,000	
日立造船	115,600	792.00	91,555,200	
三菱重工業	228,900	3,236.00	740,720,400	
川崎重工業	113,400	2,391.00	271,139,400	
ＩＨＩ	98,000	2,551.00	249,998,000	
名村造船所	45,600	187.00	8,527,200	
サノヤスホールディングス	19,000	158.00	3,002,000	
スプリックス	3,900	1,200.00	4,680,000	
マネジメントソリューションズ	6,700	2,889.00	19,356,300	
プロレド・パートナーズ	1,900	2,797.00	5,314,300	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	1,100	649.00	713,900	
テノ．ホールディングス	1,000	1,184.00	1,184,000	
フロンティア・マネジメント	2,600	1,140.00	2,964,000	
ピアラ	900	1,043.00	938,700	
コプロ・ホールディングス	1,800	1,376.00	2,476,800	
ギークス	1,900	1,888.00	3,587,200	
カーブスホールディングス	38,300	982.00	37,610,600	
フォーラムエンジニアリング	9,300	935.00	8,695,500	
日本車輌製造	5,200	2,107.00	10,956,400	
三菱ロジスネクスト	19,400	1,023.00	19,846,200	
近畿車輌	2,000	1,188.00	2,376,000	
ＦＰＧ	48,600	746.00	36,255,600	
島根銀行	5,200	617.00	3,208,400	

じもとホールディングス	9,900	642.00	6,355,800	
全国保証	37,300	4,930.00	183,889,000	
めぶきフィナンシャルグループ	745,900	237.00	176,778,300	
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,500	1,506.00	14,307,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18,000	1,524.00	27,432,000	
九州フィナンシャルグループ	294,100	394.00	115,875,400	
かんぽ生命保険	178,200	1,980.00	352,836,000	
ゆうちょ銀行	407,800	928.00	378,438,400	
富山第一銀行	35,100	278.00	9,757,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	875,600	401.00	351,115,600	
ジェイリース	4,100	1,265.00	5,186,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	95,700	628.00	60,099,600	
イントラスト	3,900	677.00	2,640,300	
日本モーゲージサービス	7,200	1,012.00	7,286,400	
ＣＡＳＡ	3,900	989.00	3,857,100	
アルヒ	21,300	1,425.00	30,352,500	
プレミアグループ	6,700	3,465.00	23,215,500	
日産自動車	1,720,300	586.00	1,008,095,800	
いすゞ自動車	387,200	1,494.00	578,476,800	
トヨタ自動車	1,478,100	9,815.00	14,507,551,500	
日野自動車	182,100	967.00	176,090,700	
三菱自動車工業	539,500	309.00	166,705,500	
エフテック	10,500	839.00	8,809,500	
レシップホールディングス	5,800	569.00	3,300,200	
ＧＭＢ	2,900	1,238.00	3,590,200	
ファルテック	2,900	727.00	2,108,300	
武蔵精密工業	32,500	2,366.00	76,895,000	
日産車体	21,300	733.00	15,612,900	
新明和工業	41,300	961.00	39,689,300	
極東開発工業	25,200	1,571.00	39,589,200	
トピー工業	12,700	1,282.00	16,281,400	
ティラド	4,800	2,668.00	12,806,400	
曙ブレーキ工業	68,400	172.00	11,764,800	
タチエス	22,500	1,395.00	31,387,500	
ＮＯＫ	70,600	1,356.00	95,733,600	
フタバ産業	36,400	531.00	19,328,400	
ＫＹＢ	16,600	3,745.00	62,167,000	
市光工業	22,100	693.00	15,315,300	
大同メタル工業	30,100	597.00	17,969,700	
プレス工業	73,500	358.00	26,313,000	
ミクニ	19,600	310.00	6,076,000	
太平洋工業	30,600	1,192.00	36,475,200	
河西工業	20,600	397.00	8,178,200	
アイシン	106,700	4,735.00	505,224,500	
マツダ	457,400	1,061.00	485,301,400	
今仙電機製作所	12,700	702.00	8,915,400	
本田技研工業	1,148,600	3,565.00	4,094,759,000	

スズキ	289,400	4,730.00	1,368,862,000	
ＳＵＢＡＲＵ	418,100	2,149.00	898,496,900	
安永	6,900	1,155.00	7,969,500	
ヤマハ発動機	206,200	2,837.00	584,989,400	
小糸製作所	87,500	6,580.00	575,750,000	
ＴＢＫ	15,100	414.00	6,251,400	
エクセディ	20,100	1,638.00	32,923,800	
ミツバ	23,100	794.00	18,341,400	
豊田合成	47,100	2,645.00	124,579,500	
愛三工業	24,100	874.00	21,063,400	
盟和産業	2,000	1,002.00	2,004,000	
日本プラスト	13,000	705.00	9,165,000	
ヨロズ	12,900	1,206.00	15,557,400	
エフ・シー・シー	23,800	1,569.00	37,342,200	
新家工業	3,600	1,587.00	5,713,200	
シマノ	54,700	28,460.00	1,556,762,000	
テイ・エス　テック	67,800	1,652.00	112,005,600	
三十三フィナンシャルグループ	12,700	1,382.00	17,551,400	
第四北越フィナンシャルグループ	23,400	2,429.00	56,838,600	
ひろぎんホールディングス	212,800	588.00	125,126,400	
マーキュリアホールディングス	5,200	737.00	3,832,400	
ダイレクトマーケティングミックス	7,000	3,930.00	27,510,000	
ポピンズホールディングス	3,500	4,640.00	16,240,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	5,800	5,440.00	31,552,000	
ジャムコ	9,100	1,101.00	10,019,100	
小野建	13,000	1,305.00	16,965,000	
はるやまホールディングス	7,400	641.00	4,743,400	
南陽	2,700	2,006.00	5,416,200	
ノジマ	25,400	2,782.00	70,662,800	
佐鳥電機	9,400	818.00	7,689,200	
カッパ・クリエイト	20,200	1,460.00	29,492,000	
エコートレーディング	3,000	661.00	1,983,000	
伯東	8,700	1,523.00	13,250,100	
コンドーテック	11,200	1,011.00	11,323,200	
中山福	8,700	435.00	3,784,500	
ライトオン	10,800	723.00	7,808,400	
ナガイレーベン	19,300	2,572.00	49,639,600	
三菱食品	16,000	2,826.00	45,216,000	
良品計画	165,300	2,093.00	345,972,900	
三城ホールディングス	18,300	269.00	4,922,700	
松田産業	10,400	2,201.00	22,890,400	
第一興商	27,300	4,350.00	118,755,000	
メディパルホールディングス	143,800	2,163.00	311,039,400	
アドヴァングループ	14,800	924.00	13,675,200	
ＳＰＫ	6,600	1,377.00	9,088,200	
萩原電気ホールディングス	5,300	2,267.00	12,015,100	
アルビス	4,600	2,324.00	10,690,400	
アズワン	10,300	15,050.00	155,015,000	
スズデン	4,400	1,472.00	6,476,800	
尾家産業	3,600	1,235.00	4,446,000	

シモジマ	8,000	1,079.00	8,632,000	
ドウシシャ	13,900	1,722.00	23,935,800	
小津産業	2,900	1,950.00	5,655,000	
コナカ	17,700	350.00	6,195,000	
高速	7,600	1,468.00	11,156,800	
ハウス　オブ　ローゼ	1,400	1,653.00	2,314,200	
Ｇ－７ホールディングス	7,000	3,455.00	24,185,000	
たけびし	4,400	1,559.00	6,859,600	
イオン北海道	19,400	1,053.00	20,428,200	
コジマ	24,500	684.00	16,758,000	
ヒマラヤ	5,200	1,059.00	5,506,800	
コーナン商事	20,300	3,785.00	76,835,500	
ネットワンシステムズ	58,500	3,815.00	223,177,500	
エコス	5,200	1,913.00	9,947,600	
ワタミ	19,400	965.00	18,721,000	
マルシェ	3,700	501.00	1,853,700	
リックス	2,900	1,517.00	4,399,300	
システムソフト	32,500	256.00	8,320,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	287,500	2,409.00	692,587,500	
丸文	13,000	642.00	8,346,000	
西松屋チェーン	31,600	1,399.00	44,208,400	
ゼンショーホールディングス	77,100	2,820.00	217,422,000	
ハピネット	12,200	1,493.00	18,214,600	
幸楽苑ホールディングス	9,400	1,529.00	14,372,600	
ハークスレイ	2,700	976.00	2,635,200	
橋本総業ホールディングス	2,600	2,766.00	7,191,600	
日本ライフライン	46,300	1,400.00	64,820,000	
サイゼリヤ	21,400	2,680.00	57,352,000	
タカショー	9,400	870.00	8,178,000	
ＶＴホールディングス	54,200	459.00	24,877,800	
マルカ	4,700	2,510.00	11,797,000	
アルゴグラフィックス	11,200	3,545.00	39,704,000	
魚力	4,300	2,092.00	8,995,600	
ＩＤＯＭ	48,600	691.00	33,582,600	
日本エム・ディ・エム	8,300	2,252.00	18,691,600	
ポプラ	3,400	263.00	894,200	
フジ・コーポレーション	7,400	1,266.00	9,368,400	
ユナイテッドアローズ	16,700	2,121.00	35,420,700	
進和	8,600	2,247.00	19,324,200	
エスケイジャパン	3,000	482.00	1,446,000	
ダイトロン	6,200	1,980.00	12,276,000	
ハイデイ日高	20,700	1,875.00	38,812,500	
シークス	18,400	1,438.00	26,459,200	
京都きもの友禅	8,200	261.00	2,140,200	
コロワイド	47,800	2,028.00	96,938,400	
ピーシーデポコーポレーション	16,700	491.00	8,199,700	
田中商事	3,700	669.00	2,475,300	
オーハシテクニカ	7,500	1,543.00	11,572,500	
壱番屋	10,300	4,965.00	51,139,500	

白銅	4,600	2,188.00	10,064,800	
トップカルチャー	5,200	350.00	1,820,000	
ＰＬＡＮＴ	3,600	719.00	2,588,400	
スギホールディングス	28,500	7,790.00	222,015,000	
ダイコー通産	1,200	1,298.00	1,557,600	
薬王堂ホールディングス	6,300	2,311.00	14,559,300	
島津製作所	187,600	4,400.00	825,440,000	
ＪＭＳ	12,400	813.00	10,081,200	
クボテック	3,200	320.00	1,024,000	
長野計器	10,600	1,052.00	11,151,200	
ブイ・テクノロジー	6,700	5,150.00	34,505,000	
スター精密	22,600	1,698.00	38,374,800	
東京計器	9,200	1,068.00	9,825,600	
愛知時計電機	1,400	4,305.00	6,027,000	
インターアクション	7,200	2,473.00	17,805,600	
オーバル	13,100	289.00	3,785,900	
東京精密	24,600	4,950.00	121,770,000	
マニー	58,100	2,591.00	150,537,100	
ニコン	222,600	1,096.00	243,969,600	
トプコン	73,500	1,627.00	119,584,500	
オリンパス	807,100	2,226.00	1,796,604,600	
理研計器	13,000	2,743.00	35,659,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	25,200	10,310.00	259,812,000	
キヤノン電子	13,900	1,694.00	23,546,600	
タムロン	12,000	2,457.00	29,484,000	
ＨＯＹＡ	284,600	15,030.00	4,277,538,000	
シード	6,400	774.00	4,953,600	
ノーリツ鋼機	13,100	2,554.00	33,457,400	
エー・アンド・デイ	12,300	991.00	12,189,300	
朝日インテック	153,400	2,835.00	434,889,000	
キヤノン	724,700	2,505.00	1,815,373,500	
リコー	371,200	1,226.00	455,091,200	
シチズン時計	184,500	417.00	76,936,500	
リズム	3,700	777.00	2,874,900	
大研医器	11,900	551.00	6,556,900	
メニコン	22,300	7,840.00	174,832,000	
シンシア	1,400	608.00	851,200	
中本パックス	3,600	1,760.00	6,336,000	
スノーピーク	8,600	3,605.00	31,003,000	
パラマウントベッドホールディングス	28,200	2,008.00	56,625,600	
トランザクション	7,800	1,300.00	10,140,000	
粧美堂	3,600	419.00	1,508,400	
ニホンフラッシュ	12,500	1,258.00	15,725,000	
前田工繊	16,100	3,610.00	58,121,000	
永大産業	20,300	299.00	6,069,700	
アートネイチャー	14,300	692.00	9,895,600	
バンダイナムコホールディングス	120,800	7,411.00	895,248,800	
アイフィスジャパン	3,800	682.00	2,591,600	
共立印刷	26,300	140.00	3,682,000	
ＳＨＯＥＩ	13,700	4,255.00	58,293,500	

フランスベッドホールディングス	19,100	935.00	17,858,500	
マーベラス	22,300	767.00	17,104,100	
パイロットコーポレーション	25,900	3,835.00	99,326,500	
萩原工業	8,300	1,451.00	12,043,300	
エイベックス	25,100	1,746.00	43,824,600	
トッパン・フォームズ	26,300	1,082.00	28,456,600	
フジシールインターナショナル	29,800	2,250.00	67,050,000	
タカラトミー	65,400	957.00	62,587,800	
廣済堂	10,000	861.00	8,610,000	
エステールホールディングス	4,700	649.00	3,050,300	
レック	17,500	1,146.00	20,055,000	
タカノ	5,500	657.00	3,613,500	
三光合成	15,300	443.00	6,777,900	
プロネクサス	12,700	1,044.00	13,258,800	
ホクシン	10,300	158.00	1,627,400	
ウッドワン	4,300	1,213.00	5,215,900	
大建工業	10,000	2,104.00	21,040,000	
きもと	23,000	280.00	6,440,000	
凸版印刷	221,500	1,810.00	400,915,000	
大日本印刷	172,900	2,448.00	423,259,200	
共同印刷	4,600	2,740.00	12,604,000	
ＮＩＳＳＨＡ	29,800	1,609.00	47,948,200	
光村印刷	1,000	1,642.00	1,642,000	
藤森工業	13,100	4,190.00	54,889,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	7,200	1,819.00	13,096,800	
前澤化成工業	9,500	1,262.00	11,989,000	
未来工業	5,200	1,700.00	8,840,000	
アシックス	129,100	2,590.00	334,369,000	
ツツミ	3,500	2,390.00	8,365,000	
ウェーブロックホールディングス	4,800	697.00	3,345,600	
ＪＳＰ	8,600	1,648.00	14,172,800	
ニチハ	20,200	2,900.00	58,580,000	
ローランド	11,200	5,440.00	60,928,000	
エフピコ	26,800	4,110.00	110,148,000	
小松ウオール工業	4,600	2,057.00	9,462,200	
ヤマハ	86,800	6,050.00	525,140,000	
河合楽器製作所	3,900	4,075.00	15,892,500	
クリナップ	14,000	550.00	7,700,000	
ピジョン	93,600	3,265.00	305,604,000	
天馬	10,900	2,629.00	28,656,100	
オリバー	2,900	3,780.00	10,962,000	
兼松サステック	900	1,800.00	1,620,000	
キングジム	12,700	892.00	11,328,400	
象印マホービン	39,300	1,610.00	63,273,000	
リンテック	31,400	2,407.00	75,579,800	
信越ポリマー	22,700	1,046.00	23,744,200	
東リ	37,700	241.00	9,085,700	
イトーキ	28,400	357.00	10,138,800	
任天堂	83,600	63,720.00	5,326,992,000	
三菱鉛筆	23,900	1,461.00	34,917,900	

松風	6,700	2,050.00	13,735,000	
タカラスタンダード	30,100	1,600.00	48,160,000	
コクヨ	69,800	1,807.00	126,128,600	
ナカバヤシ	14,900	600.00	8,940,000	
ニフコ	53,600	3,945.00	211,452,000	
立川ブラインド工業	6,500	1,332.00	8,658,000	
グローブライド	6,700	4,900.00	32,830,000	
オカムラ	50,300	1,516.00	76,254,800	
バルカー	12,200	2,168.00	26,449,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,400	1,600.00	2,240,000	
伊藤忠商事	1,005,200	3,245.00	3,261,874,000	
丸紅	1,416,800	966.20	1,368,912,160	
スクロール	20,200	856.00	17,291,200	
高島	2,000	1,844.00	3,688,000	
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,832.00	24,732,000	
三陽商会	7,600	1,061.00	8,063,600	
長瀬産業	80,800	1,681.00	135,824,800	
ナイガイ	4,700	343.00	1,612,100	
蝶理	9,200	1,774.00	16,320,800	
豊田通商	144,000	5,240.00	754,560,000	
オンワードホールディングス	87,000	352.00	30,624,000	
三共生興	22,000	570.00	12,540,000	
兼松	57,500	1,464.00	84,180,000	
美津濃	14,600	2,610.00	38,106,000	
ツカモトコーポレーション	2,100	1,426.00	2,994,600	
ルックホールディングス	4,800	1,440.00	6,912,000	
三井物産	1,145,800	2,562.50	2,936,112,500	
日本紙パルプ商事	7,500	3,680.00	27,600,000	
東京エレクトロン	85,500	46,710.00	3,993,705,000	
カメイ	18,600	1,185.00	22,041,000	
東都水産	1,700	5,070.00	8,619,000	
ＯＵＧホールディングス	2,200	2,872.00	6,318,400	
スターゼン	10,200	2,168.00	22,113,600	
セイコーホールディングス	20,400	2,403.00	49,021,200	
山善	56,100	1,018.00	57,109,800	
椿本興業	2,100	3,420.00	7,182,000	
住友商事	906,900	1,495.50	1,356,268,950	
日本ユニシス	49,900	3,480.00	173,652,000	
内田洋行	5,800	4,950.00	28,710,000	
三菱商事	874,500	3,104.00	2,714,448,000	
第一実業	6,500	4,410.00	28,665,000	
キヤノンマーケティングジャパン	35,600	2,596.00	92,417,600	
西華産業	7,500	1,653.00	12,397,500	
佐藤商事	12,500	1,129.00	14,112,500	
菱洋エレクトロ	10,900	2,604.00	28,383,600	
東京産業	14,100	630.00	8,883,000	
ユアサ商事	14,800	3,080.00	45,584,000	
神鋼商事	3,000	2,391.00	7,173,000	
トルク	7,200	235.00	1,692,000	
阪和興業	28,600	3,120.00	89,232,000	

正栄食品工業	9,400	3,915.00	36,801,000	
カナデン	12,200	1,066.00	13,005,200	
菱電商事	10,500	1,653.00	17,356,500	
ニプロ	108,600	1,363.00	148,021,800	
フルサト工業	7,600	1,966.00	14,941,600	
岩谷産業	34,400	6,380.00	219,472,000	
ナイス	5,800	1,992.00	11,553,600	
ニチモウ	1,700	2,080.00	3,536,000	
極東貿易	3,600	2,635.00	9,486,000	
アステナホールディングス	18,900	608.00	11,491,200	
兼松エレクトロニクス	7,900	3,695.00	29,190,500	
三愛石油	35,500	1,392.00	49,416,000	
稲畑産業	34,400	1,683.00	57,895,200	
ＧＳＩクレオス	6,700	963.00	6,452,100	
明和産業	13,300	473.00	6,290,900	
クワザワホールディングス	5,300	619.00	3,280,700	
キムラタン	72,800	24.00	1,747,200	
ヤマエ久野	10,400	1,196.00	12,438,400	
ゴールドウイン	23,500	6,300.00	148,050,000	
ユニ・チャーム	309,600	4,482.00	1,387,627,200	
デサント	24,500	2,982.00	73,059,000	
キング	6,000	483.00	2,898,000	
ワキタ	28,300	1,022.00	28,922,600	
ヤマトインターナショナル	13,000	341.00	4,433,000	
東邦ホールディングス	46,100	1,892.00	87,221,200	
サンゲツ	38,700	1,611.00	62,345,700	
ミツウロコグループホールディングス	20,900	1,316.00	27,504,400	
シナネンホールディングス	5,300	3,150.00	16,695,000	
伊藤忠エネクス	32,300	993.00	32,073,900	
サンリオ	40,300	2,012.00	81,083,600	
サンワ　テクノス	9,400	1,290.00	12,126,000	
リョーサン	15,900	2,158.00	34,312,200	
新光商事	19,700	781.00	15,385,700	
トーホー	6,700	1,585.00	10,619,500	
三信電気	7,900	2,154.00	17,016,600	
東陽テクニカ	15,300	1,115.00	17,059,500	
モスフードサービス	20,200	3,170.00	64,034,000	
加賀電子	13,000	2,944.00	38,272,000	
三益半導体工業	11,200	2,584.00	28,940,800	
都築電気	5,200	1,619.00	8,418,800	
ソーダニッカ	14,300	555.00	7,936,500	
立花エレテック	10,900	1,470.00	16,023,000	
木曽路	18,900	2,415.00	45,643,500	
ＳＲＳホールディングス	18,300	815.00	14,914,500	
千趣会	26,300	374.00	9,836,200	
タカキュー	10,500	134.00	1,407,000	
リテールパートナーズ	17,500	1,200.00	21,000,000	
ケーヨー	26,800	851.00	22,806,800	
上新電機	16,900	2,662.00	44,987,800	
日本瓦斯	70,800	1,838.00	130,130,400	

ロイヤルホールディングス	25,300	2,065.00	52,244,500	
東天紅	1,000	1,128.00	1,128,000	
いなげや	16,100	1,467.00	23,618,700	
チヨダ	15,100	883.00	13,333,300	
ライフコーポレーション	14,200	3,390.00	48,138,000	
リンガーハット	18,000	2,339.00	42,102,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,500	646.00	12,597,000	
テンアライド	12,600	337.00	4,246,200	
ＡＯＫＩホールディングス	29,000	673.00	19,517,000	
オークワ	22,600	1,095.00	24,747,000	
コメリ	22,100	2,616.00	57,813,600	
青山商事	32,500	749.00	24,342,500	
しまむら	16,800	10,120.00	170,016,000	
はせがわ	6,600	276.00	1,821,600	
高島屋	104,500	1,264.00	132,088,000	
松屋	31,900	1,028.00	32,793,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	68,100	949.00	64,626,900	
近鉄百貨店	5,600	3,165.00	17,724,000	
丸井グループ	121,600	2,090.00	254,144,000	
クレディセゾン	84,000	1,347.00	113,148,000	
アクシアル　リテイリング	12,200	3,825.00	46,665,000	
井筒屋	6,700	232.00	1,554,400	
イオン	552,900	2,929.00	1,619,444,100	
イズミ	29,100	4,095.00	119,164,500	
フォーバル	5,200	959.00	4,986,800	
平和堂	26,600	2,052.00	54,583,200	
フジ	17,500	1,946.00	34,055,000	
ヤオコー	16,300	6,230.00	101,549,000	
ゼビオホールディングス	17,400	1,005.00	17,487,000	
ケーズホールディングス	123,000	1,243.00	152,889,000	
ＰＡＬＴＡＣ	23,000	5,350.00	123,050,000	
三谷産業	19,300	385.00	7,430,500	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,300	760.00	5,548,000	
日産東京販売ホールディングス	17,800	242.00	4,307,600	
新生銀行	117,400	1,466.00	172,108,400	
あおぞら銀行	85,800	2,485.00	213,213,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	9,842,600	593.10	5,837,646,060	
りそなホールディングス	1,659,500	420.80	698,317,600	
三井住友トラスト・ホールディングス	272,200	3,558.00	968,487,600	
三井住友フィナンシャルグループ	995,900	3,769.00	3,753,547,100	
千葉銀行	479,900	652.00	312,894,800	
群馬銀行	296,200	349.00	103,373,800	
武蔵野銀行	21,400	1,695.00	36,273,000	
千葉興業銀行	37,100	257.00	9,534,700	
筑波銀行	59,300	172.00	10,199,600	
七十七銀行	45,400	1,171.00	53,163,400	
青森銀行	11,200	2,113.00	23,665,600	
秋田銀行	8,700	1,411.00	12,275,700	
山形銀行	16,000	860.00	13,760,000	
岩手銀行	9,400	1,716.00	16,130,400	

東邦銀行	128,800	212.00	27,305,600	
東北銀行	7,100	1,010.00	7,171,000	
みちのく銀行	9,200	914.00	8,408,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	129,800	1,876.00	243,504,800	
静岡銀行	350,400	831.00	291,182,400	
十六銀行	18,100	1,953.00	35,349,300	
スルガ銀行	125,800	326.00	41,010,800	
八十二銀行	324,000	359.00	116,316,000	
山梨中央銀行	16,700	825.00	13,777,500	
大垣共立銀行	28,500	1,870.00	53,295,000	
福井銀行	12,500	1,396.00	17,450,000	
北國銀行	13,800	2,132.00	29,421,600	
清水銀行	6,100	1,542.00	9,406,200	
富山銀行	2,500	2,257.00	5,642,500	
滋賀銀行	28,600	1,934.00	55,312,400	
南都銀行	20,800	1,874.00	38,979,200	
百五銀行	130,200	310.00	40,362,000	
京都銀行	51,400	4,955.00	254,687,000	
紀陽銀行	51,200	1,502.00	76,902,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	95,400	806.00	76,892,400	
山陰合同銀行	90,900	547.00	49,722,300	
中国銀行	123,900	870.00	107,793,000	
鳥取銀行	4,700	1,118.00	5,254,600	
伊予銀行	190,900	546.00	104,231,400	
百十四銀行	15,200	1,511.00	22,967,200	
四国銀行	20,300	702.00	14,250,600	
阿波銀行	21,900	2,051.00	44,916,900	
大分銀行	8,300	1,703.00	14,134,900	
宮崎銀行	9,000	2,004.00	18,036,000	
佐賀銀行	8,300	1,372.00	11,387,600	
沖縄銀行	13,200	2,548.00	33,633,600	
琉球銀行	31,500	716.00	22,554,000	
セブン銀行	480,300	234.00	112,390,200	
みずほフィナンシャルグループ	1,955,100	1,586.50	3,101,766,150	
高知銀行	5,000	807.00	4,035,000	
山口フィナンシャルグループ	179,600	633.00	113,686,800	
芙蓉総合リース	15,200	7,080.00	107,616,000	
みずほリース	22,100	3,605.00	79,670,500	
東京センチュリー	33,400	6,000.00	200,400,000	
ＳＢＩホールディングス	176,400	2,630.00	463,932,000	
日本証券金融	61,000	824.00	50,264,000	
アイフル	240,800	371.00	89,336,800	
日本アジア投資	10,700	279.00	2,985,300	
長野銀行	4,800	1,087.00	5,217,600	
名古屋銀行	11,700	2,522.00	29,507,400	
北洋銀行	217,100	239.00	51,886,900	
愛知銀行	4,800	2,831.00	13,588,800	
中京銀行	5,200	1,430.00	7,436,000	
大光銀行	4,400	1,319.00	5,803,600	
愛媛銀行	20,300	766.00	15,549,800	

トマト銀行	5,600	1,032.00	5,779,200	
京葉銀行	61,600	411.00	25,317,600	
栃木銀行	68,900	172.00	11,850,800	
北日本銀行	4,600	1,628.00	7,488,800	
東和銀行	25,000	497.00	12,425,000	
福島銀行	16,300	237.00	3,863,100	
大東銀行	7,100	613.00	4,352,300	
リコーリース	11,300	3,460.00	39,098,000	
イオンフィナンシャルサービス	88,000	1,382.00	121,616,000	
アコム	289,500	470.00	136,065,000	
ジャックス	15,900	2,575.00	40,942,500	
オリエントコーポレーション	388,500	148.00	57,498,000	
オリックス	873,700	1,890.50	1,651,729,850	
三菱ＨＣキャピタル	496,700	600.00	298,020,000	
ジャフコ　グループ	20,600	6,460.00	133,076,000	
九州リースサービス	7,800	649.00	5,062,200	
トモニホールディングス	111,000	297.00	32,967,000	
大和証券グループ本社	1,077,800	575.80	620,597,240	
野村ホールディングス	2,196,600	552.20	1,212,962,520	
岡三証券グループ	122,700	422.00	51,779,400	
丸三証券	42,900	621.00	26,640,900	
東洋証券	47,000	158.00	7,426,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	153,100	393.00	60,168,300	
光世証券	3,500	588.00	2,058,000	
水戸証券	38,100	300.00	11,430,000	
いちよし証券	28,400	592.00	16,812,800	
松井証券	70,600	819.00	57,821,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	253,900	4,341.00	1,102,179,900	
日本取引所グループ	388,500	2,509.50	974,940,750	
マネックスグループ	129,100	719.00	92,822,900	
極東証券	19,300	835.00	16,115,500	
岩井コスモホールディングス	14,900	1,673.00	24,927,700	
藍澤證券	26,000	1,060.00	27,560,000	
フィデアホールディングス	139,700	122.00	17,043,400	
池田泉州ホールディングス	165,000	160.00	26,400,000	
アニコム　ホールディングス	40,500	899.00	36,409,500	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	349,600	3,309.00	1,156,826,400	
マネーパートナーズグループ	15,700	226.00	3,548,200	
スパークス・グループ	66,000	254.00	16,764,000	
小林洋行	3,100	268.00	830,800	
第一生命ホールディングス	708,000	1,962.00	1,389,096,000	
東京海上ホールディングス	473,700	5,139.00	2,434,344,300	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,700	1,106.00	7,410,200	
イー・ギャランティ	16,600	2,376.00	39,441,600	
アサックス	7,900	684.00	5,403,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	5,900	2,162.00	12,755,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	429,900	1,407.00	604,869,300	
アドバンスクリエイト	5,900	980.00	5,782,000	

三井不動産	655,500	2,686.00	1,760,673,000	
三菱地所	944,800	1,781.50	1,683,161,200	
平和不動産	24,700	3,805.00	93,983,500	
東京建物	141,700	1,648.00	233,521,600	
ダイビル	37,300	1,439.00	53,674,700	
京阪神ビルディング	24,900	1,432.00	35,656,800	
住友不動産	323,500	3,842.00	1,242,887,000	
太平洋興発	6,300	641.00	4,038,300	
テーオーシー	28,800	677.00	19,497,600	
東京楽天地	2,700	4,150.00	11,205,000	
レオパレス２１	102,900	151.00	15,537,900	
スターツコーポレーション	17,000	2,898.00	49,266,000	
フジ住宅	16,700	634.00	10,587,800	
空港施設	15,300	588.00	8,996,400	
明和地所	6,800	630.00	4,284,000	
ゴールドクレスト	13,000	1,680.00	21,840,000	
リログループ	76,100	2,474.00	188,271,400	
エスリード	5,800	1,600.00	9,280,000	
日神グループホールディングス	21,400	466.00	9,972,400	
日本エスコン	26,200	773.00	20,252,600	
タカラレーベン	61,100	346.00	21,140,600	
ＡＶＡＮＴＩＡ	8,200	910.00	7,462,000	
イオンモール	71,900	1,678.00	120,648,200	
毎日コムネット	4,200	731.00	3,070,200	
ファースト住建	6,200	1,169.00	7,247,800	
ランド	666,300	12.00	7,995,600	
カチタス	35,600	3,260.00	116,056,000	
東祥	8,900	1,961.00	17,452,900	
トーセイ	20,000	1,199.00	23,980,000	
穴吹興産	3,000	1,982.00	5,946,000	
サンフロンティア不動産	17,600	1,098.00	19,324,800	
エフ・ジェー・ネクスト	14,300	1,037.00	14,829,100	
インテリックス	3,100	710.00	2,201,000	
ランドビジネス	5,500	330.00	1,815,000	
サンネクスタグループ	4,600	985.00	4,531,000	
グランディハウス	10,000	431.00	4,310,000	
東武鉄道	152,000	2,925.00	444,600,000	
相鉄ホールディングス	50,200	2,211.00	110,992,200	
東急	367,900	1,582.00	582,017,800	
京浜急行電鉄	187,200	1,391.00	260,395,200	
小田急電鉄	233,500	2,842.00	663,607,000	
京王電鉄	81,600	6,560.00	535,296,000	
京成電鉄	109,100	3,645.00	397,669,500	
富士急行	19,800	5,170.00	102,366,000	
新京成電鉄	3,500	2,114.00	7,399,000	
東日本旅客鉄道	256,800	8,099.00	2,079,823,200	
西日本旅客鉄道	130,100	6,516.00	847,731,600	
東海旅客鉄道	121,100	17,185.00	2,081,103,500	
西武ホールディングス	175,900	1,350.00	237,465,000	
鴻池運輸	23,500	1,222.00	28,717,000	

西日本鉄道	40,400	2,757.00	111,382,800	
ハマキョウレックス	11,200	3,220.00	36,064,000	
サカイ引越センター	6,700	5,780.00	38,726,000	
近鉄グループホールディングス	137,900	4,000.00	551,600,000	
阪急阪神ホールディングス	184,000	3,505.00	644,920,000	
南海電気鉄道	65,600	2,407.00	157,899,200	
京阪ホールディングス	61,700	3,365.00	207,620,500	
神戸電鉄	3,400	3,530.00	12,002,000	
名古屋鉄道	113,500	2,050.00	232,675,000	
山陽電気鉄道	10,100	1,938.00	19,573,800	
アルプス物流	9,500	948.00	9,006,000	
トランコム	4,200	8,500.00	35,700,000	
日本通運	48,000	8,240.00	395,520,000	
ヤマトホールディングス	193,600	3,370.00	652,432,000	
山九	35,400	5,000.00	177,000,000	
日新	11,000	1,505.00	16,555,000	
丸運	9,100	273.00	2,484,300	
丸全昭和運輸	11,200	3,285.00	36,792,000	
センコーグループホールディングス	76,400	1,082.00	82,664,800	
トナミホールディングス	2,900	5,180.00	15,022,000	
ニッコンホールディングス	46,500	2,418.00	112,437,000	
日本石油輸送	1,000	2,588.00	2,588,000	
福山通運	17,700	4,130.00	73,101,000	
セイノーホールディングス	103,400	1,402.00	144,966,800	
エスライン	3,600	910.00	3,276,000	
神奈川中央交通	2,900	3,560.00	10,324,000	
日立物流	30,400	4,500.00	136,800,000	
丸和運輸機関	29,100	1,533.00	44,610,300	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	14,200	1,605.00	22,791,000	
日本郵船	115,500	5,270.00	608,685,000	
商船三井	82,100	4,980.00	408,858,000	
川崎汽船	42,600	3,550.00	151,230,000	
ＮＳユナイテッド海運	6,800	2,278.00	15,490,400	
明治海運	13,100	473.00	6,196,300	
飯野海運	64,600	428.00	27,648,800	
共栄タンカー	2,800	864.00	2,419,200	
九州旅客鉄道	106,700	2,593.00	276,673,100	
ＳＧホールディングス	261,200	3,015.00	787,518,000	
日本航空	336,500	2,471.00	831,491,500	
ＡＮＡホールディングス	372,900	2,724.00	1,015,779,600	
パスコ	2,800	1,530.00	4,284,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,000	2,749.00	8,247,000	
シルバーライフ	2,800	2,059.00	5,765,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,999.00	2,398,800	
一家ダイニングプロジェクト	1,000	592.00	592,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,400	4,095.00	26,208,000	
コーア商事ホールディングス	8,000	665.00	5,320,000	
国際紙パルプ商事	31,200	259.00	8,080,800	
ナルミヤ・インターナショナル	2,900	1,119.00	3,245,100	

ブックオフグループホールディングス	8,300	972.00	8,067,600	
ギフト	1,200	2,416.00	2,899,200	
三菱倉庫	47,800	3,330.00	159,174,000	
三井倉庫ホールディングス	14,800	2,595.00	38,406,000	
住友倉庫	49,900	1,589.00	79,291,100	
澁澤倉庫	7,600	2,137.00	16,241,200	
ヤマタネ	6,400	1,538.00	9,843,200	
東陽倉庫	20,700	316.00	6,541,200	
乾汽船	9,000	1,224.00	11,016,000	
日本トランスシティ	30,800	557.00	17,155,600	
ケイヒン	2,100	1,367.00	2,870,700	
中央倉庫	7,900	1,017.00	8,034,300	
川西倉庫	2,700	1,158.00	3,126,600	
安田倉庫	12,200	954.00	11,638,800	
ファイズホールディングス	2,600	799.00	2,077,400	
東洋埠頭	3,600	1,481.00	5,331,600	
宇徳	10,400	532.00	5,532,800	
上組	77,000	2,312.00	178,024,000	
サンリツ	2,900	762.00	2,209,800	
キムラユニティー	4,200	1,305.00	5,481,000	
キユーソー流通システム	3,400	1,690.00	5,746,000	
近鉄エクスプレス	26,300	2,546.00	66,959,800	
東海運	9,300	310.00	2,883,000	
エーアイテイー	8,700	1,098.00	9,552,600	
内外トランスライン	4,800	1,937.00	9,297,600	
ショーエイコーポレーション	3,000	964.00	2,892,000	
日本コンセプト	4,600	1,832.00	8,427,200	
ＴＢＳホールディングス	95,000	1,735.00	164,825,000	
日本テレビホールディングス	119,200	1,277.00	152,218,400	
朝日放送グループホールディングス	15,200	706.00	10,731,200	
テレビ朝日ホールディングス	44,400	1,743.00	77,389,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	94,300	412.00	38,851,600	
テレビ東京ホールディングス	10,500	2,148.00	22,554,000	
日本ＢＳ放送	4,800	1,099.00	5,275,200	
ビジョン	17,800	1,083.00	19,277,400	
スマートバリュー	3,600	677.00	2,437,200	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	13,700	2,815.00	38,565,500	
ワイヤレスゲート	5,200	434.00	2,256,800	
コネクシオ	8,500	1,564.00	13,294,000	
日本通信	108,800	221.00	24,044,800	
クロップス	2,800	887.00	2,483,600	
日本電信電話	1,674,500	2,882.00	4,825,909,000	
ＫＤＤＩ	1,148,100	3,492.00	4,009,165,200	
ソフトバンク	1,301,100	1,470.00	1,912,617,000	
光通信	16,900	20,610.00	348,309,000	
エムティーアイ	14,100	689.00	9,714,900	
GMOインターネット	51,300	2,997.00	153,746,100	
ファイバーゲート	4,700	1,481.00	6,960,700	

アイドママーケティングコミュニケーション	3,600	402.00	1,447,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	37,100	4,300.00	159,530,000	
学研ホールディングス	19,300	1,334.00	25,746,200	
ゼンリン	26,300	1,151.00	30,271,300	
昭文社ホールディングス	5,400	490.00	2,646,000	
インプレスホールディングス	12,300	246.00	3,025,800	
東京電力ホールディングス	1,236,900	329.00	406,940,100	
中部電力	446,400	1,336.00	596,390,400	
関西電力	552,900	1,047.00	578,886,300	
中国電力	210,700	1,017.00	214,281,900	
北陸電力	133,600	610.00	81,496,000	
東北電力	341,500	861.00	294,031,500	
四国電力	121,100	754.00	91,309,400	
九州電力	322,100	842.00	271,208,200	
北海道電力	136,400	514.00	70,109,600	
沖縄電力	28,500	1,421.00	40,498,500	
電源開発	115,900	1,624.00	188,221,600	
エフオン	8,900	980.00	8,722,000	
イーレックス	21,300	2,937.00	62,558,100	
レノバ	24,600	4,885.00	120,171,000	
東京瓦斯	280,500	2,058.50	577,409,250	
大阪瓦斯	264,200	2,024.00	534,740,800	
東邦瓦斯	71,700	5,560.00	398,652,000	
北海道瓦斯	8,000	1,585.00	12,680,000	
広島ガス	30,800	377.00	11,611,600	
西部ガスホールディングス	16,600	2,515.00	41,749,000	
静岡ガス	41,500	1,064.00	44,156,000	
メタウォーター	16,700	2,048.00	34,201,600	
アイネット	7,300	1,460.00	10,658,000	
松竹	9,400	12,690.00	119,286,000	
東宝	84,500	4,640.00	392,080,000	
エイチ・アイ・エス	21,500	2,600.00	55,900,000	
東映	4,700	20,290.00	95,363,000	
ラックランド	3,900	2,702.00	10,537,800	
エヌ・ティ・ティ・データ	381,400	1,754.00	668,975,600	
共立メンテナンス	23,100	3,875.00	89,512,500	
イチネンホールディングス	14,800	1,237.00	18,307,600	
建設技術研究所	9,100	2,345.00	21,339,500	
スペース	9,400	900.00	8,460,000	
長　大	5,600	1,945.00	10,892,000	
アインホールディングス	20,600	6,650.00	136,990,000	
燦ホールディングス	5,800	1,239.00	7,186,200	
ピー・シー・エー	2,000	3,885.00	7,770,000	
スバル興業	900	8,170.00	7,353,000	
東京テアトル	5,700	1,258.00	7,170,600	
タナベ経営	2,800	1,422.00	3,981,600	
ビジネスブレイン太田昭和	4,800	1,762.00	8,457,600	
ナガワ	4,500	8,710.00	39,195,000	
東京都競馬	9,100	4,540.00	41,314,000	

常磐興産	5,800	1,434.00	8,317,200	
カナモト	24,700	2,564.00	63,330,800	
ＤＴＳ	29,700	2,722.00	80,843,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	61,200	5,280.00	323,136,000	
シーイーシー	15,200	1,637.00	24,882,400	
カプコン	122,900	3,095.00	380,375,500	
西尾レントオール	12,800	3,075.00	39,360,000	
アイ・エス・ビー	6,500	1,532.00	9,958,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	75,800	26.00	1,970,800	
日本空港ビルデング	49,500	5,230.00	258,885,000	
トランス・コスモス	13,500	3,115.00	42,052,500	
乃村工藝社	59,800	885.00	52,923,000	
ジャステック	9,200	1,243.00	11,435,600	
ＳＣＳＫ	32,800	6,830.00	224,024,000	
藤田観光	5,700	2,308.00	13,155,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6,400	1,318.00	8,435,200	
日本管財	15,200	2,567.00	39,018,400	
トーカイ	13,900	2,426.00	33,721,400	
白洋舎	900	2,234.00	2,010,600	
セコム	137,400	8,521.00	1,170,785,400	
日本システムウエア	4,700	2,324.00	10,922,800	
セントラル警備保障	6,700	3,070.00	20,569,000	
アイネス	14,100	1,408.00	19,852,800	
丹青社	26,200	882.00	23,108,400	
メイテック	17,000	6,210.00	105,570,000	
ＴＫＣ	24,200	3,360.00	81,312,000	
富士ソフト	15,300	5,680.00	86,904,000	
応用地質	16,400	1,304.00	21,385,600	
船井総研ホールディングス	28,500	2,497.00	71,164,500	
ＮＳＤ	46,200	1,853.00	85,608,600	
進学会ホールディングス	6,000	424.00	2,544,000	
丸紅建材リース	1,000	1,895.00	1,895,000	
オオバ	9,700	826.00	8,012,200	
コナミホールディングス	52,100	6,300.00	328,230,000	
いであ	3,000	1,807.00	5,421,000	
学究社	4,200	1,363.00	5,724,600	
ベネッセホールディングス	51,200	2,753.00	140,953,600	
イオンディライト	17,100	3,640.00	62,244,000	
ナック	6,700	915.00	6,130,500	
福井コンピュータホールディングス	6,500	4,305.00	27,982,500	
ダイセキ	23,400	4,895.00	114,543,000	
ステップ	5,200	1,675.00	8,710,000	
日鉄物産	10,300	4,470.00	46,041,000	
泉州電業	3,900	3,850.00	15,015,000	
元気寿司	4,000	2,546.00	10,184,000	
トラスコ中山	32,700	2,824.00	92,344,800	
ヤマダホールディングス	481,600	502.00	241,763,200	
オートバックスセブン	53,100	1,545.00	82,039,500	

モリト	10,800	615.00	6,642,000	
アークランドサカモト	22,500	1,474.00	33,165,000	
ニトリホールディングス	57,200	19,695.00	1,126,554,000	
グルメ杵屋	10,500	969.00	10,174,500	
愛眼	9,800	226.00	2,214,800	
ケーユーホールディングス	7,300	960.00	7,008,000	
吉野家ホールディングス	47,100	2,142.00	100,888,200	
加藤産業	20,600	3,380.00	69,628,000	
北恵	3,800	972.00	3,693,600	
イノテック	8,200	1,367.00	11,209,400	
イエローハット	27,000	2,054.00	55,458,000	
松屋フーズホールディングス	6,800	3,610.00	24,548,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,700	1,476.00	14,317,200	
ＪＫホールディングス	13,000	815.00	10,595,000	
サガミホールディングス	19,500	1,024.00	19,968,000	
日伝	12,200	2,192.00	26,742,400	
関西スーパーマーケット	10,800	992.00	10,713,600	
ミロク情報サービス	14,300	1,725.00	24,667,500	
北沢産業	9,100	251.00	2,284,100	
杉本商事	7,300	2,291.00	16,724,300	
因幡電機産業	38,200	2,637.00	100,733,400	
王将フードサービス	9,500	5,840.00	55,480,000	
プレナス	16,300	2,075.00	33,822,500	
ミニストップ	10,800	1,393.00	15,044,400	
アークス	27,300	2,218.00	60,551,400	
バローホールディングス	29,400	2,206.00	64,856,400	
東テク	4,800	2,818.00	13,526,400	
ミスミグループ本社	179,900	3,985.00	716,901,500	
藤久	3,000	729.00	2,187,000	
アルテック	10,800	318.00	3,434,400	
ベルク	7,000	5,180.00	36,260,000	
大　庄	8,000	1,067.00	8,536,000	
タキヒヨー	4,800	1,893.00	9,086,400	
ファーストリテイリング	19,200	80,610.00	1,547,712,000	
ソフトバンクグループ	1,135,900	7,540.00	8,564,686,000	
蔵王産業	2,500	1,508.00	3,770,000	
スズケン	60,700	3,350.00	203,345,000	
サンドラッグ	54,000	3,485.00	188,190,000	
サックスバー　ホールディングス	12,600	617.00	7,774,200	
ジェコス	10,300	897.00	9,239,100	
ヤマザワ	3,000	1,705.00	5,115,000	
やまや	2,900	2,315.00	6,713,500	
グローセル	15,900	440.00	6,996,000	
ベルーナ	30,700	932.00	28,612,400	
合計	154,536,300		390,836,860,540	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,847,008,053
コール・ローン	2,528,751,272
国債証券	562,189,324,148
派生商品評価勘定	3,902,123,888
未収利息	2,224,309,408
前払費用	772,446,358
流動資産合計	573,463,963,127
資産合計	573,463,963,127
負債の部	
流動負債	
未払金	36,570,967
未払解約金	71,383,000
流動負債合計	107,953,967
負債合計	107,953,967
純資産の部	
元本等	
元本	396,794,639,282
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	176,561,369,878
元本等合計	573,356,009,160
純資産合計	573,356,009,160
負債純資産合計	573,463,963,127

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	360,398,711,566円
同期中追加設定元本額	331,997,310,320円
同期中一部解約元本額	295,601,382,604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＞	6,833,924,752円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	554,088,450円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,361,147,279円
たわらノーロード　バランス（積極型）	634,357,803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）	33,530,463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）	992,293,139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）	1,132,668,831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）	388,540,615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）	200,258,070円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	6,243,931円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	9,617,017円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	55,144,731円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	8,945,580円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,517,529円
投資のソムリエ	217,969,390,852円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	11,378,036,261円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,550,550,479円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	66,306,674,346円
ワールドアセットバランス（基本コース）	2,903,825,850円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	9,313,753,297円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	151,790,375円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	73,023,364円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	62,054,494円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	494,716,428円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	22,276,128,387円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,387,886,300円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	118,322,541円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	55,775,532円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	47,633,777円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	508,322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）	19,936,236,402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）	6,546,455,172円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	5,722,466,214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）	609,579,821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）	51,477,127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）	386,178,010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）	766,717,416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）	1,064,836,048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）	2,117,710,070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）	2,222,164,083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）	2,940,401,092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）	118,069,032円
計	396,794,639,282円
２．　受益権の総数	396,794,639,282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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	4,125,238,494
合計	4,125,238,494

（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6月23日から2021年7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	567,278,375,511	－	563,376,251,623	3,902,123,888
アメリカ・ドル	257,873,328,974	－	255,967,034,045	1,906,294,929
イギリス・ポンド	36,412,151,424	－	36,360,640,559	51,510,865
イスラエル・シュケル	2,648,735,218	－	2,614,767,204	33,968,014
オーストラリア・ドル	11,647,284,703	－	11,514,200,122	133,084,581
カナダ・ドル	11,212,781,462	－	11,065,318,135	147,463,327
シンガポール・ドル	2,444,248,577	－	2,413,462,486	30,786,091
スウェーデン・クローナ	1,681,632,117	－	1,665,033,610	16,598,507
デンマーク・クローネ	2,785,745,181	－	2,768,705,973	17,039,208
ノルウェー・クローネ	1,435,410,251	－	1,412,459,181	22,951,070

ポーランド・ズロチ	3,564,924,915	－	3,517,596,247	47,328,668
マレーシア・リンギット	2,566,053,336	－	2,539,377,940	26,675,396
メキシコ・ペソ	4,137,323,824	－	4,116,486,422	20,837,402
ユーロ	228,868,755,529	－	227,421,169,699	1,447,585,830
合計	567,278,375,511	－	563,376,251,623	3,902,123,888

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4450円 (14,450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7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	13,000,000.000	12,936,015.560	
		US T N/B 0.125 01/31/23	11,630,000.000	11,622,276.860	
		US T N/B 0.125 02/15/24	16,350,000.000	16,266,972.570	
		US T N/B 0.125 02/28/23	20,510,000.000	20,492,374.100	
		US T N/B 0.125 03/31/23	15,000,000.000	14,981,835.900	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,618,875.410	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,982,070.290	
		US T N/B 0.125 07/31/22	11,110,000.000	11,112,603.850	
		US T N/B 0.125 08/15/23	8,310,000.000	8,290,848.020	
		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	12,594,478.120	
		US T N/B 0.125 10/15/23	13,940,000.000	13,894,803.870	
		US T N/B 0.125 10/31/22	7,910,000.000	7,909,690.950	
		US T N/B 0.125 11/30/22	8,450,000.000	8,446,369.110	

		US T N/B 0.125 12/15/23	10,000,000.000	9,960,937.500	
		US T N/B 0.125 12/31/22	10,000,000.000	9,994,921.800	
		US T N/B 0.25 03/15/24	20,260,000.000	20,209,350.000	
		US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,140,162.500	
		US T N/B 0.25 05/15/24	5,000,000.000	4,981,445.300	
		US T N/B 0.25 05/31/25	8,970,000.000	8,849,815.990	
		US T N/B 0.25 06/15/23	12,910,000.000	12,920,085.930	
		US T N/B 0.25 06/30/25	8,990,000.000	8,862,875.730	
		US T N/B 0.25 07/31/25	8,980,000.000	8,843,195.260	
		US T N/B 0.25 08/31/25	9,920,000.000	9,758,412.410	
		US T N/B 0.25 09/30/25	13,480,000.000	13,249,892.080	
		US T N/B 0.25 10/31/25	13,510,000.000	13,266,714.350	
		US T N/B 0.25 11/15/23	12,280,000.000	12,271,845.210	
		US T N/B 0.375 01/31/26	14,420,000.000	14,197,503.850	
		US T N/B 0.375 04/15/24	20,340,000.000	20,346,356.250	
		US T N/B 0.375 04/30/25	11,870,000.000	11,782,134.220	
		US T N/B 0.375 07/31/27	11,250,000.000	10,857,568.270	
		US T N/B 0.375 09/30/27	13,470,000.000	12,963,822.580	
		US T N/B 0.375 11/30/25	10,540,000.000	10,395,486.690	
		US T N/B 0.375 12/31/25	11,070,000.000	10,910,003.840	
		US T N/B 0.5 02/28/26	16,930,000.000	16,753,425.340	
		US T N/B 0.5 03/15/23	7,000,000.000	7,039,375.000	
		US T N/B 0.5 03/31/25	11,090,000.000	11,069,422.830	
		US T N/B 0.5 04/30/27	7,490,000.000	7,310,064.430	
		US T N/B 0.5 05/31/27	9,610,000.000	9,361,866.710	
		US T N/B 0.5 06/30/27	10,800,000.000	10,511,859.340	
		US T N/B 0.5 08/31/27	10,590,000.000	10,284,710.090	
		US T N/B 0.5 10/31/27	10,000,000.000	9,682,421.800	
		US T N/B 0.625 03/31/27	6,260,000.000	6,162,187.500	
		US T N/B 0.625 05/15/30	20,990,000.000	19,806,032.800	
		US T N/B 0.625 08/15/30	29,840,000.000	28,075,243.590	
		US T N/B 0.625 11/30/27	14,510,000.000	14,147,816.760	
		US T N/B 0.625 12/31/27	14,160,000.000	13,789,959.410	
		US T N/B 0.75 01/31/28	15,270,000.000	14,981,301.550	
		US T N/B 0.75 03/31/26	16,930,000.000	16,937,274.480	
		US T N/B 0.75 04/30/26	15,000,000.000	15,001,171.800	
		US T N/B 0.875 06/30/26	24,180,000.000	24,286,731.970	
		US T N/B 0.875 11/15/30	32,530,000.000	31,235,153.420	
		US T N/B 1.125 02/15/31	24,380,000.000	23,897,161.650	
		US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	7,954,015.950	
		US T N/B 1.125 02/28/27	3,840,000.000	3,889,874.680	
		US T N/B 1.125 02/29/28	14,380,000.000	14,441,788.990	
		US T N/B 1.125 05/15/40	12,110,000.000	10,634,093.750	
		US T N/B 1.125 08/15/40	11,040,000.000	9,666,037.430	
		US T N/B 1.25 03/31/28	14,120,000.000	14,276,643.750	
		US T N/B 1.25 04/30/28	8,000,000.000	8,085,312.480	
		US T N/B 1.25 05/15/50	14,140,000.000	11,791,158.220	
		US T N/B 1.25 06/30/28	12,000,000.000	12,109,687.440	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,576,203.100	

		US T N/B 1.25 08/31/24	8,400,000.000	8,615,906.200	
		US T N/B 1.375 01/31/25	7,340,000.000	7,559,053.120	
		US T N/B 1.375 02/15/23	7,680,000.000	7,829,099.980	
		US T N/B 1.375 06/30/23	8,960,000.000	9,163,699.950	
		US T N/B 1.375 08/15/50	14,630,000.000	12,591,515.190	
		US T N/B 1.375 08/31/23	7,880,000.000	8,069,920.290	
		US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,886,562.500	
		US T N/B 1.375 09/30/23	9,820,000.000	10,062,047.570	
		US T N/B 1.375 10/15/22	5,500,000.000	5,587,226.530	
		US T N/B 1.375 11/15/40	20,540,000.000	18,782,867.080	
		US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,164,062.480	
		US T N/B 1.5 01/31/27	6,020,000.000	6,222,234.370	
		US T N/B 1.5 02/15/30	16,730,000.000	17,039,766.320	
		US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,784,008.530	
		US T N/B 1.5 03/31/23	7,740,000.000	7,914,150.000	
		US T N/B 1.5 08/15/22	4,680,000.000	4,751,114.050	
		US T N/B 1.5 08/15/26	11,430,000.000	11,833,175.300	
		US T N/B 1.5 09/15/22	8,410,000.000	8,547,319.480	
		US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,709,037.500	
		US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,272,812.480	
		US T N/B 1.5 11/30/24	9,140,000.000	9,452,759.370	
		US T N/B 1.625 02/15/26	12,800,000.000	13,317,999.990	
		US T N/B 1.625 04/30/23	8,000,000.000	8,202,500.000	
		US T N/B 1.625 05/15/26	13,210,000.000	13,749,752.260	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,000,000.000	9,222,539.040	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,606,524.170	
		US T N/B 1.625 08/15/22	2,920,000.000	2,968,704.660	
		US T N/B 1.625 08/15/29	11,760,000.000	12,127,959.330	
		US T N/B 1.625 08/31/22	3,930,000.000	3,996,318.750	
		US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,975,784.370	
		US T N/B 1.625 10/31/23	9,650,000.000	9,949,677.660	
		US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,309,179.660	
		US T N/B 1.625 11/15/22	8,330,000.000	8,494,647.610	
		US T N/B 1.625 11/15/50	17,120,000.000	15,693,556.120	
		US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,527,792.940	
		US T N/B 1.625 12/15/22	8,600,000.000	8,782,078.080	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,383,541.380	
		US T N/B 1.75 05/15/23	10,000,000.000	10,280,859.300	
		US T N/B 1.75 06/30/22	5,160,000.000	5,242,842.140	
		US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	7,030,664.040	
		US T N/B 1.75 07/15/22	2,940,000.000	2,989,497.630	
		US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,326,250.000	
		US T N/B 1.75 09/30/22	3,650,000.000	3,723,000.000	
		US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	7,180,851.520	
		US T N/B 1.75 12/31/24	8,300,000.000	8,656,640.620	
		US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,228,584.370	
		US T N/B 1.875 02/15/41	16,620,000.000	16,545,988.960	
		US T N/B 1.875 02/15/51	20,240,000.000	19,704,746.720	
		US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	5,181,951.520	

		US T N/B 1.875 07/31/22	3,950,000.000	4,024,216.780	
		US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,267,968.750	
		US T N/B 1.875 08/31/22	8,000,000.000	8,158,124.960	
		US T N/B 1.875 08/31/24	7,030,000.000	7,345,251.560	
		US T N/B 1.875 09/30/22	3,270,000.000	3,340,637.100	
		US T N/B 1.875 10/31/22	4,000,000.000	4,090,312.480	
		US T N/B 2.0 02/15/23	14,780,000.000	15,206,079.610	
		US T N/B 2.0 02/15/25	11,220,000.000	11,806,420.250	
		US T N/B 2.0 02/15/50	13,510,000.000	13,534,803.410	
		US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	7,172,451.520	
		US T N/B 2.0 05/31/24	8,440,000.000	8,831,998.410	
		US T N/B 2.0 06/30/24	6,710,000.000	7,026,103.870	
		US T N/B 2.0 08/15/25	14,040,000.000	14,815,490.530	
		US T N/B 2.0 10/31/22	2,720,000.000	2,786,406.240	
		US T N/B 2.0 11/15/26	10,830,000.000	11,484,876.560	
		US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,325,664.750	
		US T N/B 2.125 02/29/24	8,810,000.000	9,223,656.980	
		US T N/B 2.125 03/31/24	13,170,000.000	13,800,205.030	
		US T N/B 2.125 05/15/25	10,360,000.000	10,966,626.470	
		US T N/B 2.125 05/31/26	7,070,000.000	7,529,273.760	
		US T N/B 2.125 06/30/22	3,820,000.000	3,894,907.790	
		US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	6,489,345.680	
		US T N/B 2.125 09/30/24	6,400,000.000	6,741,999.990	
		US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,348,437.440	
		US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	7,038,413.230	
		US T N/B 2.125 12/31/22	10,620,000.000	10,929,473.370	
		US T N/B 2.25 01/31/24	8,160,000.000	8,561,306.180	
		US T N/B 2.25 02/15/27	13,150,000.000	14,131,113.210	
		US T N/B 2.25 03/31/26	7,630,000.000	8,163,801.890	
		US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,419,374.960	
		US T N/B 2.25 08/15/27	11,540,000.000	12,415,867.870	
		US T N/B 2.25 08/15/46	6,730,000.000	7,084,902.300	
		US T N/B 2.25 08/15/49	12,260,000.000	12,942,920.230	
		US T N/B 2.25 10/31/24	6,560,000.000	6,945,143.700	
		US T N/B 2.25 11/15/24	14,440,000.000	15,291,170.270	
		US T N/B 2.25 11/15/25	15,100,000.000	16,116,300.660	
		US T N/B 2.25 11/15/27	12,650,000.000	13,619,009.720	
		US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,385,937.440	
		US T N/B 2.25 12/31/24	7,210,000.000	7,645,134.740	
		US T N/B 2.375 01/31/23	5,560,000.000	5,751,776.520	
		US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,110,390.590	
		US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,608,021.850	
		US T N/B 2.375 05/15/27	15,900,000.000	17,214,855.410	
		US T N/B 2.375 05/15/29	13,450,000.000	14,630,027.270	
		US T N/B 2.375 05/15/51	3,720,000.000	4,048,260.900	
		US T N/B 2.375 08/15/24	15,210,000.000	16,127,947.220	
		US T N/B 2.375 11/15/49	11,710,000.000	12,703,977.690	
		US T N/B 2.5 01/31/24	10,820,000.000	11,422,285.120	
		US T N/B 2.5 01/31/25	5,160,000.000	5,522,006.240	

		US T N/B 2.5 02/15/45	7,670,000.000	8,439,396.870	
		US T N/B 2.5 02/15/46	6,270,000.000	6,912,185.120	
		US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,964,187.500	
		US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,987,750.000	
		US T N/B 2.5 05/15/24	15,300,000.000	16,227,562.500	
		US T N/B 2.5 05/15/46	6,280,000.000	6,924,435.380	
		US T N/B 2.5 08/15/23	10,000,000.000	10,472,265.600	
		US T N/B 2.625 01/31/26	7,280,000.000	7,901,928.060	
		US T N/B 2.625 02/15/29	14,530,000.000	16,061,325.700	
		US T N/B 2.625 02/28/23	5,370,000.000	5,586,058.560	
		US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,768,652.720	
		US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,194,306.240	
		US T N/B 2.625 12/31/23	7,320,000.000	7,737,468.750	
		US T N/B 2.625 12/31/25	6,300,000.000	6,833,777.320	
		US T N/B 2.75 02/15/24	16,470,000.000	17,501,304.950	
		US T N/B 2.75 02/15/28	15,000,000.000	16,628,320.190	
		US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,791,725.740	
		US T N/B 2.75 04/30/23	7,660,000.000	8,007,692.140	
		US T N/B 2.75 05/31/23	7,220,000.000	7,566,052.280	
		US T N/B 2.75 06/30/25	5,150,000.000	5,582,921.870	
		US T N/B 2.75 07/31/23	8,860,000.000	9,318,920.260	
		US T N/B 2.75 08/15/42	4,500,000.000	5,148,984.360	
		US T N/B 2.75 08/15/47	7,630,000.000	8,829,042.510	
		US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,404,292.520	
		US T N/B 2.75 08/31/25	6,430,000.000	6,987,099.180	
		US T N/B 2.75 11/15/23	19,530,000.000	20,661,366.650	
		US T N/B 2.75 11/15/42	4,920,000.000	5,629,940.600	
		US T N/B 2.75 11/15/47	9,540,000.000	11,048,885.120	
		US T N/B 2.875 04/30/25	6,920,000.000	7,523,067.130	
		US T N/B 2.875 05/15/28	17,170,000.000	19,199,547.540	
		US T N/B 2.875 05/15/43	9,540,000.000	11,140,931.240	
		US T N/B 2.875 05/15/49	11,490,000.000	13,694,194.820	
		US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,950,968.750	
		US T N/B 2.875 07/31/25	5,270,000.000	5,744,094.100	
		US T N/B 2.875 08/15/28	12,860,000.000	14,400,688.170	
		US T N/B 2.875 08/15/45	7,480,000.000	8,794,843.740	
		US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,262,735.930	
		US T N/B 2.875 10/31/23	9,430,000.000	9,992,484.690	
		US T N/B 2.875 11/15/46	7,030,000.000	8,300,342.920	
		US T N/B 2.875 11/30/23	8,670,000.000	9,202,392.180	
		US T N/B 2.875 11/30/25	6,140,000.000	6,719,942.150	
		US T N/B 3.0 02/15/47	8,500,000.000	10,274,375.000	
		US T N/B 3.0 02/15/48	10,760,000.000	13,047,760.850	
		US T N/B 3.0 02/15/49	10,860,000.000	13,228,837.500	
		US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,888,234.370	
		US T N/B 3.0 05/15/45	4,120,000.000	4,939,010.910	
		US T N/B 3.0 05/15/47	6,010,000.000	7,267,169.870	
		US T N/B 3.0 08/15/48	11,340,000.000	13,784,301.500	
		US T N/B 3.0 09/30/25	6,360,000.000	6,979,603.080	

		US T N/B 3.0 10/31/25	5,620,000.000	6,174,755.420	
		US T N/B 3.0 11/15/44	7,070,000.000	8,463,010.920	
		US T N/B 3.0 11/15/45	3,370,000.000	4,050,713.640	
		US T N/B 3.125 02/15/42	4,040,000.000	4,895,028.090	
		US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	5,774,846.830	
		US T N/B 3.125 05/15/48	9,900,000.000	12,285,281.250	
		US T N/B 3.125 08/15/44	7,650,000.000	9,333,000.000	
		US T N/B 3.125 11/15/28	15,380,000.000	17,516,978.850	
		US T N/B 3.125 11/15/41	3,780,000.000	4,574,095.290	
		US T N/B 3.375 05/15/44	6,000,000.000	7,600,078.070	
		US T N/B 3.375 11/15/48	10,850,000.000	14,091,861.290	
		US T N/B 3.5 02/15/39	2,390,000.000	3,030,818.750	
		US T N/B 3.625 02/15/44	5,280,000.000	6,926,906.230	
		US T N/B 3.625 08/15/43	5,050,000.000	6,600,113.250	
		US T N/B 3.75 08/15/41	3,000,000.000	3,953,671.860	
		US T N/B 3.75 11/15/43	6,300,000.000	8,395,980.430	
		US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	3,438,656.250	
		US T N/B 4.25 05/15/39	3,000,000.000	4,160,625.000	
		US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	4,644,109.350	
		US T N/B 4.375 02/15/38	1,890,000.000	2,634,778.120	
		US T N/B 4.375 05/15/40	2,770,000.000	3,921,497.630	
		US T N/B 4.375 05/15/41	3,500,000.000	4,985,585.920	
		US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	3,806,367.150	
		US T N/B 4.5 02/15/36	1,910,000.000	2,650,721.870	
		US T N/B 4.5 05/15/38	2,140,000.000	3,027,682.010	
		US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,586,162.500	
		US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	4,056,834.370	
		US T N/B 4.75 02/15/41	3,470,000.000	5,156,203.120	
		US T N/B 5.0 05/15/37	1,450,000.000	2,137,957.020	
		US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,196,718.750	
		US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	3,135,868.750	
		US T N/B 5.5 08/15/28	1,600,000.000	2,083,499.990	
		US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	2,242,985.920	
		US T N/B 6.125 11/15/27	2,050,000.000	2,698,953.120	
		US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,840,000.000	
		US T N/B 6.25 08/15/23	2,390,000.000	2,690,523.800	
	アメリカ・ドル　小計		2,221,990,000.000 (244,796,638,300)	2,321,087,328.330 (255,714,190,965)	
	イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	5,610,000.000	5,566,803.000	
		UK TREASURY 0.125 01/31/23	7,480,000.000	7,485,011.600	
		UK TREASURY 0.125 01/31/24	9,620,000.000	9,611,823.000	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	4,870,000.000	4,759,207.500	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	2,750,000.000	2,615,085.000	

		UK TREASURY 0.375 10/22/26	810,000.000	809,765.100	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	4,180,000.000	4,063,796.000	
		UK TREASURY 0.5 07/22/22	5,230,000.000	5,254,183.520	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,960,000.000	2,389,904.000	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	3,610,000.000	3,668,558.530	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	6,520,000.000	6,200,128.800	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	3,970,000.000	3,432,954.280	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,000,000.000	4,055,366.400	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	2,240,000.000	2,090,076.800	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,840,000.000	3,926,576.640	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	2,860,000.000	2,929,183.400	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,760,000.000	3,950,820.000	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	5,480,000.000	5,583,736.400	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,170,000.000	3,358,110.970	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	4,090,000.000	4,385,952.400	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,480,000.000	2,681,641.360	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	3,460,000.000	3,901,927.800	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	1,420,000.000	1,760,090.000	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	3,090,000.000	3,511,492.060	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	5,170,000.000	6,111,663.800	
		UK TREASURY 1.75 09/07/22	5,000,000.000	5,096,844.000	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	5,560,000.000	6,135,626.800	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,750,000.000	2,951,960.000	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	4,920,000.000	5,150,287.480	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,480,000.000	5,202,356.400	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,560,000.000	2,768,369.140	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	4,970,000.000	7,029,568.000	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,750,000.000	7,034,712.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	3,990,000.000	7,570,227.000	

		UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,690,000.000	6,175,916.100	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,990,000.000	5,699,567.900	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,190,000.000	6,066,910.500	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	4,910,000.000	6,691,611.160	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,720,000.000	4,145,280.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,280,000.000	4,073,545.470	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,190,000.000	4,947,928.590	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,860,000.000	6,469,475.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,110,000.000	5,437,236.610	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,520,000.000	6,629,321.600	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,860,000.000	4,137,788.510	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,010,000.000	6,577,500.340	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,100,000.000	5,628,972.000	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,560,000.000	5,665,688.730	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,650,000.000	4,288,056.500	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	2,026,731.700	
	イギリス・ポンド　小計		195,740,000.000 (29,969,751,400)	237,705,340.690 (36,395,064,713)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	6,060,000.000	6,061,175.640	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	4,270,000.000	4,299,574.020	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	5,260,000.000	5,243,699.260	
		ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	3,230,000.000	3,281,793.050	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,710,000.000	3,565,914.730	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	4,730,000.000	4,880,475.490	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	4,500,000.000	4,760,995.500	
		ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	4,340,000.000	4,693,367.140	
		ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,620,000.000	5,092,672.200	
		ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	5,070,000.000	5,561,866.050	

	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	6,420,000.000	8,374,536.900	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	5,570,000.000	5,965,024.400	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	4,900,000.000	7,855,964.200	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	4,450,000.000	5,799,747.300	
イスラエル・シュケル　小計		67,130,000.000 (2,257,078,425)	75,436,805.880 (2,536,374,006)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	6,940,000.000	6,916,079.270	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	4,430,000.000	4,370,000.640	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	5,270,000.000	5,205,975.700	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	7,880,000.000	7,607,478.220	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	6,710,000.000	6,537,681.280	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	5,110,000.000	5,037,000.070	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	6,120,000.000	6,222,975.120	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	3,630,000.000	3,270,630.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	2,910,000.000	3,006,897.180	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,220,000.000	4,565,407.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	4,270,000.000	4,399,323.350	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	8,040,000.000	8,905,961.860	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,190,000.000	3,423,854.740	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	3,040,000.000	3,418,510.700	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,740,000.000	1,988,630.160	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	4,420,000.000	4,917,692.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,750,000.000	4,202,103.370	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,760,000.000	6,474,816.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,970,000.000	3,483,026.210	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	5,320,000.000	5,878,123.850	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	5,900,000.000	6,844,463.140	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	2,150,000.000	2,596,464.700	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,970,000.000	3,790,578.030	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,440,000.000	6,363,782.720	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,890,000.000	3,853,700.530	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	5,090,000.000	6,224,063.190	
	AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	8,510,000.000	9,331,120.530	
	AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	1,240,000.000	1,311,670.510	
オーストラリア・ドル　小計		129,910,000.000 (10,700,686,700)	140,148,010.070 (11,543,991,589)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	5,650,000.000	5,636,010.600	
	CANADA 0.25 03/01/26	5,260,000.000	5,097,618.540	
	CANADA 0.25 04/01/24	8,430,000.000	8,337,683.070	
	CANADA 0.25 05/01/23	9,340,000.000	9,301,313.720	
	CANADA 0.25 11/01/22	2,450,000.000	2,446,268.650	
	CANADA 0.5 09/01/25	6,690,000.000	6,592,660.500	
	CANADA 0.5 12/01/30	8,960,000.000	8,313,966.080	
	CANADA 1.0 06/01/27	2,850,000.000	2,843,675.850	

	CANADA 1.0 09/01/22	1,000,000.000	1,007,748.000	
	CANADA 1.0 09/01/26	3,410,000.000	3,407,964.230	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,200,000.000	2,236,964.400	
	CANADA 1.25 06/01/30	7,990,000.000	7,976,496.900	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,110,000.000	3,169,752.430	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,400,000.000	1,437,585.800	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,200,000.000	2,226,195.400	
	CANADA 1.5 09/01/24	2,150,000.000	2,203,126.500	
	CANADA 1.75 03/01/23	4,490,000.000	4,585,690.880	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,370,000.000	2,509,050.270	
	CANADA 2.0 09/01/23	6,220,000.000	6,413,659.700	
	CANADA 2.0 12/01/51	7,110,000.000	7,426,387.890	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,660,000.000	3,816,454.020	
	CANADA 2.25 06/01/25	2,800,000.000	2,956,892.400	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	2,064,543.830	
	CANADA 2.5 06/01/24	2,620,000.000	2,757,864.400	
	CANADA 2.75 12/01/48	3,080,000.000	3,720,033.240	
	CANADA 2.75 12/01/64	2,190,000.000	2,765,864.880	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,570,000.000	3,452,255.300	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,960,000.000	2,724,588.160	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,480,000.000	2,188,585.520	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,440,000.000	1,933,200.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,240,000.000	3,279,106.880	
カナダ・ドル　小計		119,230,000.000 (10,544,701,200)	124,829,208.040 (11,039,895,159)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	730,000.000	721,824.000	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	1,810,000.000	1,848,344.850	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	1,340,000.000	1,369,232.100	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	930,000.000	965,247.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	2,850,000.000	3,021,498.750	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	700,000.000	746,147.500	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,230,000.000	1,309,704.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	780,000.000	853,944.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,250,000.000	1,370,000.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	2,080,000.000	2,449,200.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,280,000.000	1,483,520.000	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	1,780,000.000	1,861,346.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,530,000.000	1,715,895.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	2,200,000.000	2,480,500.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,790,000.000	1,923,355.000	
	SINGAPORE 3.125 09/01/22	820,000.000	845,912.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,540,000.000	1,838,760.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,090,000.000	2,375,076.000	
シンガポール・ドル　小計		26,730,000.000 (2,179,296,900)	29,179,506.200 (2,379,005,140)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	11,990,000.000	11,876,584.410	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	13,480,000.000	14,162,770.060	

	SWEDEN 0.75 11/12/29	14,910,000.000	15,701,721.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	18,290,000.000	19,395,721.950	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	21,900,000.000	22,827,977.460	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	6,600,000.000	8,005,107.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	16,940,000.000	18,733,776.600	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	11,420,000.000	17,129,624.280	
スウェーデン・クローナ　小計		115,530,000.000 (1,484,560,500)	127,833,282.760 (1,642,657,683)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	6,420,000.000	6,430,114.060	
	DENMARK 0.25 11/15/22	4,700,000.000	4,745,120.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	10,300,000.000	9,796,330.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	17,770,000.000	18,702,036.500	
	DENMARK 0.5 11/15/29	25,320,000.000	26,780,837.400	
	DENMARK 1.5 11/15/23	24,100,000.000	25,275,814.900	
	DENMARK 1.75 11/15/25	16,950,000.000	18,608,638.860	
	DENMARK 4.5 11/15/39	25,360,000.000	45,161,534.310	
デンマーク・クローネ　小計		130,920,000.000 (2,302,882,800)	155,500,426.030 (2,735,252,494)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	9,100,000.000	9,091,355.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	11,960,000.000	12,119,068.000	
	NORWAY 1.5 02/19/26	10,870,000.000	11,105,879.000	
	NORWAY 1.75 02/17/27	9,840,000.000	10,198,658.160	
	NORWAY 1.75 03/13/25	10,570,000.000	10,873,993.200	
	NORWAY 1.75 09/06/29	10,710,000.000	11,176,795.350	
	NORWAY 2.0 04/26/28	9,620,000.000	10,178,441.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	19,260,000.000	19,743,607.040	
	NORWAY 3.0 03/14/24	12,640,000.000	13,367,659.520	
ノルウェー・クローネ　小計		104,570,000.000 (1,326,993,300)	107,855,456.270 (1,368,685,740)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	100,000.000	94,570.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	7,980,000.000	7,940,995.580	
	POLAND 04/25/23	7,310,000.000	7,260,292.000	
	POLAND 07/25/22	4,910,000.000	4,910,018.640	
	POLAND 1.25 10/25/30	16,500,000.000	15,902,275.770	
	POLAND 2.25 10/25/24	6,870,000.000	7,194,787.470	
	POLAND 2.5 01/25/23	7,660,000.000	7,924,247.020	
	POLAND 2.5 04/25/24	10,950,000.000	11,518,305.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	10,300,000.000	10,927,303.960	
	POLAND 2.5 07/25/27	8,290,000.000	8,808,954.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	9,310,000.000	10,094,367.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,753,054.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	9,190,000.000	9,994,906.150	
	POLAND 4.0 10/25/23	7,940,000.000	8,586,871.800	
	POLAND 5.75 04/25/29	120,000.000	156,666.000	
	POLAND 5.75 09/23/22	4,000,000.000	4,272,800.000	
ポーランド・ズロチ　小計		115,790,000.000	120,340,414.890	

		(3,330,861,456)	(3,461,760,511)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,490,000.000	2,375,212.390	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	3,330,000.000	3,445,041.170	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	5,610,000.000	5,754,318.360	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	3,590,000.000	3,762,566.620	
	MALAYSIA 3.757 04/20/23	3,160,000.000	3,261,063.120	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	3,950,000.000	3,805,825.790	
	MALAYSIA 3.795 09/30/22	2,600,000.000	2,663,318.320	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	3,070,000.000	3,188,010.800	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	5,150,000.000	5,159,383.810	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,390,000.000	2,413,364.160	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	5,910,000.000	6,248,303.750	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,449,277.240	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	4,240,000.000	4,486,176.940	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	4,140,000.000	4,383,773.130	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	2,130,000.000	2,255,662.540	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	7,840,000.000	8,289,522.080	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	2,600,000.000	2,747,532.570	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	4,320,000.000	4,233,397.540	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,480,000.000	2,613,239.730	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	3,000,000.000	3,238,411.500	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,200,000.000	2,316,638.720	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,030,000.000	3,267,146.880	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	3,050,000.000	3,347,682.730	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,400,000.000	2,606,287.920	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	2,000,000.000	2,108,832.000	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,730,000.000	4,081,971.750	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,430,000.000	1,552,655.100	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	3,400,000.000	3,677,482.500	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,970,000.000	2,151,743.920	
マレーシア・リンギット　小計		96,580,000.000 (2,542,652,002)	100,883,843.080 (2,655,958,848)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	29,830,000.000	30,310,561.300	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,223,000.000	23,194,673.570	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,893,000.000	65,625,300.270	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	74,714,000.000	72,653,037.420	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	69,445,000.000	72,392,822.160	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	52,700,000.000	56,191,902.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	41,418,000.000	43,016,440.720	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	19,311,000.000	20,626,465.320	

	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	57,570,000.000	60,480,739.200	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	52,126,000.000	55,555,630.170	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	98,133,000.000	102,466,553.280	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	67,501,000.000	74,809,508.740	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	48,613,000.000	54,216,479.510	
メキシコ・ペソ　小計		688,477,000.000 (3,815,401,839)	731,540,113.660 (4,054,049,002)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	2,420,000.000	2,456,776.740	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,960,000.000	1,976,082.780	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	2,800,000.000	2,833,224.800	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	1,700,000.000	1,738,063.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	670,000.000	621,157.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	2,340,000.000	2,476,847.880	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,630,000.000	2,778,844.850	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	3,340,000.000	3,591,765.860	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	1,230,000.000	1,295,155.560	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,830,000.000	4,085,683.140	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	890,000.000	862,206.190	
	AUSTRIA 07/15/23	2,330,000.000	2,361,571.500	
	AUSTRIA 07/15/24	2,700,000.000	2,752,452.900	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	5,040,000.000	5,431,083.840	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	2,420,000.000	3,016,377.540	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	200,000.000	270,100.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	2,520,000.000	2,713,198.320	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	3,720,000.000	3,927,788.040	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,420,000.000	2,447,476.500	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,960,000.000	2,540,751.480	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	1,700,000.000	2,740,921.040	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	980,000.000	2,080,677.200	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,260,000.000	5,263,596.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	2,490,000.000	3,130,201.410	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	360,000.000	507,009.600	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,990,000.000	2,039,689.880	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	2,190,000.000	2,186,003.250	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	3,100,000.000	3,166,650.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	2,610,000.000	2,662,591.500	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	1,060,000.000	1,037,169.720	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	2,820,000.000	2,926,856.270	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	1,420,000.000	1,222,691.710	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	4,720,000.000	4,981,690.960	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	3,060,000.000	3,286,195.200	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	3,870,000.000	4,182,696.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	4,270,000.000	4,655,521.220	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	4,340,000.000	4,668,490.260	

		BELGIUM 1.0 06/22/31	3,110,000.000	3,439,100.200	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,733,408.000	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	60,000.000	70,230.900	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	2,770,000.000	3,334,614.640	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	3,750,000.000	4,621,815.000	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	2,380,000.000	2,964,870.720	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	1,340,000.000	1,936,434.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/23	5,250,000.000	5,552,311.790	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	610,000.000	869,227.430	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	4,100,000.000	4,498,014.060	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	2,140,000.000	2,918,763.120	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	2,230,000.000	3,765,003.090	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,950,000.000	2,791,596.980	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	4,270,000.000	7,268,347.030	
		BELGIUM 4.25 09/28/22	280,000.000	296,863.420	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	2,590,000.000	3,217,292.820	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	4,430,000.000	7,332,677.760	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	4,660,000.000	6,551,191.100	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	4,100,000.000	4,226,608.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	4,910,000.000	5,038,568.350	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	6,960,000.000	7,161,909.600	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,000,000.000	1,030,220.000	
		BUNDESOBL 04/05/24	6,080,000.000	6,198,389.760	
		BUNDESOBL 04/14/23	5,060,000.000	5,123,199.400	
		BUNDESOBL 10/07/22	3,790,000.000	3,823,075.330	
		BUNDESOBL 10/13/23	3,940,000.000	4,004,970.600	
		BUNDESOBL 10/18/24	5,540,000.000	5,668,594.480	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/10/23	5,570,000.000	5,633,013.410	
		BUNDESSCHAT 0.0 09/16/22	2,230,000.000	2,248,375.200	
		BUNDESSCHAT 0.0 12/15/22	3,000,000.000	3,029,664.300	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	7,490,000.000	7,763,010.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	4,670,000.000	4,822,288.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	5,640,000.000	5,717,155.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,480,000.000	2,492,499.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	8,110,000.000	8,393,039.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,320,000.000	2,414,656.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,000,000.000	2,059,440.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	5,510,000.000	5,189,824.920	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	300,000.000	285,666.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	6,660,000.000	6,894,165.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,000,000.000	2,071,769.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,650,000.000	8,021,484.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	6,540,000.000	6,912,747.300	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	6,430,000.000	6,787,122.200	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	7,100,000.000	7,412,542.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	8,490,000.000	8,951,856.000	

		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	5,050,000.000	5,405,520.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	8,390,000.000	8,950,963.790	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	9,270,000.000	9,572,813.820	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	7,680,000.000	7,961,779.200	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	4,400,000.000	4,637,182.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,350,000.000	6,795,389.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	8,930,000.000	11,487,810.970	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,227,989.770	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	7,790,000.000	8,108,799.510	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	5,390,000.000	5,734,226.960	
		DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	4,600,000.000	4,716,803.200	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	6,070,000.000	6,464,000.660	
		DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	5,280,000.000	5,406,661.920	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	6,230,000.000	6,588,305.990	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	7,690,000.000	11,986,710.600	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	6,680,000.000	10,630,270.760	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	4,020,000.000	6,756,012.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	6,380,000.000	10,510,660.820	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	4,590,000.000	8,188,146.900	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,380,000.000	3,285,375.800	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,840,000.000	9,706,021.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,980,000.000	9,551,042.400	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,340,000.000	8,418,777.000	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	890,000.000	1,258,460.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,386,405.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,221,604.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,396,483.400	
		FINLAND 0.0 09/15/24	960,000.000	980,384.640	
		FINLAND 0.0 09/15/30	1,280,000.000	1,298,160.640	
		FINLAND 0.125 04/15/36	770,000.000	763,193.200	
		FINLAND 0.125 04/15/52	940,000.000	846,945.640	
		FINLAND 0.25 09/15/40	1,030,000.000	1,020,542.540	
		FINLAND 0.5 04/15/26	2,170,000.000	2,281,104.000	
		FINLAND 0.5 09/15/27	1,620,000.000	1,715,983.380	
		FINLAND 0.5 09/15/28	990,000.000	1,051,553.250	
		FINLAND 0.5 09/15/29	1,560,000.000	1,658,145.840	
		FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	1,064,731.780	
		FINLAND 0.875 09/15/25	1,360,000.000	1,444,510.400	

		FINLAND 09/15/23	2,050,000.000	2,080,905.800	
		FINLAND 1.125 04/15/34	1,250,000.000	1,418,332.500	
		FINLAND 1.375 04/15/47	980,000.000	1,221,551.380	
		FINLAND 1.5 04/15/23	1,400,000.000	1,453,998.000	
		FINLAND 1.625 09/15/22	150,000.000	154,055.100	
		FINLAND 2.0 04/15/24	1,220,000.000	1,311,887.960	
		FINLAND 2.625 07/04/42	1,080,000.000	1,595,696.760	
		FINLAND 2.75 07/04/28	1,470,000.000	1,799,845.950	
		FINLAND 4.0 07/04/25	1,500,000.000	1,780,506.000	
		FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,723,430.400	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/23	4,660,000.000	4,708,184.400	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	5,490,000.000	5,577,466.680	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	11,150,000.000	11,403,584.450	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,000,000.000	2,042,860.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	9,260,000.000	9,368,462.380	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	11,680,000.000	11,724,524.160	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	4,400,000.000	4,375,052.000	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	10,210,000.000	10,590,710.480	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	11,200,000.000	11,662,112.000	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,150,000.000	9,592,599.220	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	11,050,000.000	11,656,910.200	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	3,370,000.000	3,353,274.690	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	2,000,000.000	1,598,264.000	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,360,000.000	1,323,365.680	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	11,660,000.000	12,506,585.960	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	6,860,000.000	6,694,296.700	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	9,680,000.000	10,398,468.960	
		FRANCE OAT 03/25/23	10,860,000.000	10,979,221.080	
		FRANCE OAT 03/25/24	9,810,000.000	9,975,936.150	
		FRANCE OAT 03/25/25	11,000,000.000	11,229,152.000	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,200,000.000	8,875,680.000	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	9,000,000.000	9,606,642.300	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	10,120,000.000	11,447,096.320	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	10,080,000.000	11,436,768.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,910,000.000	14,842,939.400	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	8,550,000.000	10,125,423.000	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	9,640,000.000	10,073,626.480	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	4,810,000.000	6,213,173.200	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	6,940,000.000	8,531,897.200	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	9,090,000.000	9,818,536.230	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	6,760,000.000	8,851,909.040	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	7,080,000.000	7,669,728.600	
		FRANCE OAT 2.25 10/25/22	9,150,000.000	9,493,509.300	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	11,550,000.000	14,250,262.950	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	10,790,000.000	12,935,138.320	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,450,000.000	10,197,192.000	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	10,550,000.000	12,594,062.500	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	3,510,000.000	6,758,856.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,520,000.000	7,097,866.680	

		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	6,160,000.000	9,886,987.870	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,620,000.000	12,935,682.620	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	9,720,000.000	17,056,461.600	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,130,000.000	9,916,979.140	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	10,070,000.000	14,613,946.520	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,090,000.000	13,301,011.700	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,850,846.300	
		IRISH 0.0 10/18/31	730,000.000	723,049.670	
		IRISH 0.2 05/15/27	1,720,000.000	1,776,013.520	
		IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,691,397.240	
		IRISH 0.4 05/15/35	1,330,000.000	1,345,554.350	
		IRISH 0.55 04/22/41	990,000.000	986,358.780	
		IRISH 0.9 05/15/28	2,160,000.000	2,332,091.520	
		IRISH 1.0 05/15/26	2,740,000.000	2,933,868.700	
		IRISH 1.1 05/15/29	2,280,000.000	2,504,039.170	
		IRISH 1.3 05/15/33	1,740,000.000	1,970,454.300	
		IRISH 1.35 03/18/31	1,420,000.000	1,606,667.520	
		IRISH 1.5 05/15/50	1,480,000.000	1,752,675.200	
		IRISH 1.7 05/15/37	1,600,000.000	1,920,001.600	
		IRISH 10/18/22	160,000.000	161,248.480	
		IRISH 2.0 02/18/45	2,060,000.000	2,680,369.000	
		IRISH 2.4 05/15/30	2,610,000.000	3,184,001.640	
		IRISH 3.4 03/18/24	2,290,000.000	2,535,991.800	
		IRISH 3.9 03/20/23	2,320,000.000	2,497,311.560	
		IRISH 5.4 03/13/25	2,730,000.000	3,329,671.800	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	4,750,000.000	4,781,350.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	2,430,000.000	2,423,196.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	3,350,000.000	3,370,100.000	
		ITALY BTPS 0.05 01/15/23	4,100,000.000	4,129,602.000	
		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	3,760,456.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	5,200,000.000	5,290,157.600	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	4,100,000.000	4,188,765.000	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,000,000.000	1,006,200.000	
		ITALY BTPS 0.6 06/15/23	4,500,000.000	4,585,950.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,880,000.000	2,836,442.440	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,340,000.000	3,414,181.400	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	4,800,000.000	4,975,200.000	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	5,770,000.000	5,869,070.900	
		ITALY BTPS 0.9 08/01/22	2,500,000.000	2,535,750.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/23	4,070,000.000	4,159,990.540	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,450,000.000	3,316,830.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/15/23	4,210,000.000	4,303,251.500	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	4,750,000.000	4,875,875.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	5,100,000.000	5,309,610.000	
		ITALY BTPS 1.0 07/15/22	3,050,000.000	3,095,184.830	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	6,030,000.000	6,387,277.500	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,930,000.000	6,310,889.830	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	5,000,000.000	5,200,500.000	

		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	3,120,000.000	3,305,298.040	
		ITALY BTPS 1.45 09/15/22	4,140,000.000	4,231,945.260	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,690,000.000	4,944,609.770	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	2,130,000.000	2,101,032.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,010,000.000	4,259,718.740	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	5,790,000.000	6,218,460.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	6,410,000.000	6,957,857.560	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	5,570,000.000	6,058,277.340	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	2,000,000.000	1,972,434.000	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,630,000.000	4,899,808.620	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	3,700,000.000	3,911,640.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	3,100,000.000	3,283,210.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,670,000.000	5,028,656.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	5,660,000.000	6,275,655.180	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	5,610,000.000	6,105,710.820	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,980,000.000	6,626,461.920	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	4,540,000.000	4,996,043.000	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	1,376,550.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	3,450,000.000	3,848,475.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	4,130,000.000	4,743,305.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	8,170,000.000	9,563,973.570	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	3,480,000.000	4,043,760.000	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	10,900,000.000	11,575,505.700	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,550,000.000	3,939,994.120	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,790,000.000	6,313,588.530	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	4,830,000.000	5,872,797.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	2,400,000.000	2,886,720.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	5,660,000.000	6,633,995.440	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	5,030,000.000	6,298,566.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,790,000.000	5,730,248.260	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	4,440,000.000	5,671,962.360	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,980,000.000	5,293,782.080	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	4,170,000.000	5,361,940.290	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	4,000,000.000	5,521,432.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	6,860,000.000	8,552,156.200	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	5,300,000.000	5,959,914.650	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	2,660,000.000	3,933,871.340	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	5,720,000.000	7,963,956.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	5,190,000.000	5,842,396.480	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,500,000.000	7,849,400.000	
		ITALY BTPS 4.5 05/01/23	5,480,000.000	5,966,004.760	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,830,000.000	6,446,231.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	5,660,000.000	7,386,001.140	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	5,560,000.000	9,004,825.880	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,820,000.000	4,535,387.820	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,950,000.000	5,859,825.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,220,000.000	6,695,452.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,670,000.000	5,883,744.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,940,000.000	9,612,594.000	

		ITALY BTPS 5.5 09/01/22	2,960,000.000	3,160,540.000	
		ITALY BTPS 5.5 11/01/22	5,560,000.000	5,990,027.630	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,690,000.000	5,661,567.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,467,630.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,718,860.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,961,625.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,064,820.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	4,060,000.000	4,177,647.420	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	300,000.000	294,527.100	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	2,130,000.000	1,953,940.590	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,340,000.000	3,418,506.700	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	2,480,000.000	2,523,506.640	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	3,530,000.000	3,658,315.500	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,920,000.000	3,059,333.640	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	2,970,000.000	3,179,284.020	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	6,450,000.000	6,805,717.500	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	4,170,000.000	4,490,602.110	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	3,660,000.000	3,967,692.540	
		NETHERLANDS 01/15/24	9,280,000.000	9,447,290.560	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	5,010,000.000	5,259,808.620	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,650,000.000	2,867,644.500	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,620,000.000	4,729,229.540	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,920,000.000	6,427,314.320	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,900,000.000	6,775,251.600	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,220,000.000	6,833,024.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	2,670,000.000	3,726,519.000	
		NETHERLANDS 7.5 01/15/23	590,000.000	663,986.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	4,920,000.000	4,990,848.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	2,200,000.000	2,228,848.600	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,400,000.000	1,403,080.000	
		SPAIN 0.0 04/30/23	8,700,000.000	8,789,871.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	3,200,000.000	3,239,767.030	
		SPAIN 0.1 04/30/31	4,890,000.000	4,770,732.900	
		SPAIN 0.25 07/30/24	4,190,000.000	4,278,560.250	
		SPAIN 0.35 07/30/23	5,050,000.000	5,138,364.900	
		SPAIN 0.45 10/31/22	4,320,000.000	4,378,790.880	
		SPAIN 0.5 04/30/30	5,040,000.000	5,160,783.600	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,000,000.000	1,007,785.000	
		SPAIN 0.6 10/31/29	7,030,000.000	7,283,923.600	
		SPAIN 0.8 07/30/27	5,720,000.000	6,036,030.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	390,000.000	387,854.220	
		SPAIN 1.0 10/31/50	4,820,000.000	4,437,157.040	

		SPAIN 1.2 10/31/40	4,110,000.000	4,221,841.320	
		SPAIN 1.25 10/31/30	6,970,000.000	7,584,754.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	6,490,000.000	7,024,159.450	
		SPAIN 1.4 04/30/28	5,310,000.000	5,822,441.550	
		SPAIN 1.4 07/30/28	6,200,000.000	6,813,180.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	6,430,000.000	7,105,979.470	
		SPAIN 1.45 10/31/27	5,390,000.000	5,916,225.700	
		SPAIN 1.45 10/31/71	1,460,000.000	1,318,486.580	
		SPAIN 1.5 04/30/27	4,340,000.000	4,764,669.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	5,130,000.000	5,525,227.490	
		SPAIN 1.85 07/30/35	4,900,000.000	5,644,512.840	
		SPAIN 1.95 04/30/26	5,170,000.000	5,728,370.340	
		SPAIN 1.95 07/30/30	5,660,000.000	6,525,838.500	
		SPAIN 2.15 10/31/25	5,460,000.000	6,053,993.400	
		SPAIN 2.35 07/30/33	4,660,000.000	5,622,290.000	
		SPAIN 2.7 10/31/48	3,730,000.000	4,969,542.410	
		SPAIN 2.75 10/31/24	5,470,000.000	6,053,174.180	
		SPAIN 2.9 10/31/46	3,420,000.000	4,685,731.390	
		SPAIN 3.45 07/30/66	3,750,000.000	5,888,171.250	
		SPAIN 3.8 04/30/24	4,470,000.000	5,008,214.820	
		SPAIN 4.2 01/31/37	5,260,000.000	7,912,439.160	
		SPAIN 4.4 10/31/23	4,600,000.000	5,123,977.260	
		SPAIN 4.65 07/30/25	5,310,000.000	6,404,136.120	
		SPAIN 4.7 07/30/41	5,270,000.000	8,798,316.100	
		SPAIN 4.8 01/31/24	3,840,000.000	4,361,882.880	
		SPAIN 4.9 07/30/40	4,720,000.000	7,960,280.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	5,630,000.000	7,736,746.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	3,530,000.000	6,451,223.260	
		SPAIN 5.4 01/31/23	5,480,000.000	5,988,478.770	
		SPAIN 5.75 07/30/32	5,510,000.000	8,679,131.600	
		SPAIN 5.9 07/30/26	5,590,000.000	7,343,762.990	
		SPAIN 6.0 01/31/29	820,000.000	1,189,036.900	
	ユーロ　小計		1,491,060,000.000 (195,060,469,200)	1,732,628,331.280 (226,662,438,298)	
国債証券　合計			510,311,974,021.600 (510,311,974,022)	562,189,324,148 (562,189,324,148)	
合計				562,189,324,148 (562,189,324,148)	

（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	44.60	45.49
イギリス・ポンド	国債証券	50銘柄	6.35	6.47
イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	0.44	0.45

オーストラリア・ドル	国債証券	28銘柄	2.01	2.05
カナダ・ドル	国債証券	31銘柄	1.93	1.96
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	8銘柄	0.29	0.29
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.48	0.49
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.24	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券	16銘柄	0.60	0.62
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	0.46	0.47
メキシコ・ペソ	国債証券	13銘柄	0.71	0.72
ユーロ	国債証券	342銘柄	39.53	40.32

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,663,193,916
コール・ローン	555,414,417
株式	560,116,074,613
投資信託受益証券	1,052,095,927
投資証券	12,170,787,413
派生商品評価勘定	144,262,815
未収入金	77,753,865
未収配当金	408,719,032
差入委託証拠金	3,862,122,633
流動資産合計	582,050,424,631
資産合計	582,050,424,631
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,997,252
未払金	21,888,732
未払解約金	328,194,000
流動負債合計	365,079,984
負債合計	365,079,984
純資産の部	
元本等	
元本	106,771,439,533
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	474,913,905,114
元本等合計	581,685,344,647
純資産合計	581,685,344,647
負債純資産合計	582,050,424,631

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	96,044,539,510円
同期中追加設定元本額	33,205,284,128円
同期中一部解約元本額	22,478,384,105円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,642,621,984円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,917,968円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,358,643円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	9,898,037円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	25,446,418円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,742,203円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,076,354円
たわらノーロード　先進国株式	23,515,364,107円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	266,243,996円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,504,089,471円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	468,314,130円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	52,633,395円
たわらノーロード　バランス（標準型）	423,051,505円
たわらノーロード　バランス（積極型）	512,407,045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）	1,304,396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）	132,430,515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）	365,384,456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）	245,230,203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）	383,400,121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）	572,470円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	6,752,427円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,498,180円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,873,530円
たわらノーロード　全世界株式	119,044,205円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	48,913,966,711円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	1,266,817,556円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	155,901,022円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	849,633,152円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,040,670,055円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	97,521,957円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	303,097,115円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	272,336,437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	131,955,592円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	183,554,879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）	295,063,878円
投資のソムリエ	6,272,856,818円
クルーズコントロール	146,215,612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＞	181,643,617円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	120,557,877円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,089,845円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,828,371円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	163,938,516円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,657,515,116円
ワールドアセットバランス（基本コース）	256,115,887円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	821,968,793円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	21,367,464円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	10,244,039円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,551,710円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	41,406,989円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	39,286,878円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	693,868,629円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	153,922,765円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	16,161,718円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,839,488円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,687,155円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	9,693,367円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	72,023円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	2,575,078円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	3,022,645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）	1,479,914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）	2,392,306円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	3,601,644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）	174,194,922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）	622,216,988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）	59,577,062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）	1,344,175,761円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,192,479,550円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,118,768,512円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	164,992,159円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	9,196,101円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	4,106,147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）	36,627,454円
ＤＩＡＭグローバル・バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	63,456,042円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,483,313円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,769,308円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,222,150円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	780,891円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,280,113円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,620,811円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	240,111,298円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	347,601,401円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,133,044,621円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ（適格機関投資家限定）	170,104,489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）	60,452,544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）	389,075,438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）	16,587,221円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,101,694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）	161,720,334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）	13,657,185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）	51,207,166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）	81,342,175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）	169,451,993円
計	106,771,439,533円
２．　受益権の総数	106,771,439,533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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	46,282,809,266
投資信託受益証券	81,957,035
投資証券	1,816,916,829
合計	48,181,683,130

（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7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	11,974,352	－	12,035,532	△61,180
ユーロ	11,974,352	－	12,035,532	△61,180
買建	401,113,019	－	401,543,035	430,016
アメリカ・ドル	311,982,622	－	312,215,587	232,965
イギリス・ポンド	8,032,415	－	8,114,761	82,346
オーストラリア・ドル	12,128,174	－	12,190,694	62,520
カナダ・ドル	8,791,688	－	8,843,919	52,231
ユーロ	60,178,120	－	60,178,074	△46
合計	413,087,371	－	413,578,567	368,836

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	8,444,821,380	－	8,573,718,107	128,896,727
合計	8,444,821,380	－	8,573,718,107	128,896,727

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.4479円 (54,479円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2021年7月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	40,745	3,719.340	151,544,508.300	
	ABBOTT LABORATORIES	169,013	119.740	20,237,616.620	
	AES CORP	65,452	25.730	1,684,079.960	
	ABIOMED INC	3,987	324.770	1,294,857.990	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	85,020	141.520	12,032,030.400	
	ADVANCED MICRO DEVICES	115,676	90.900	10,514,948.400	
	ADOBE INC	45,638	604.500	27,588,171.000	
	CHUBB LTD	43,030	162.730	7,002,271.900	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	20,624	291.670	6,015,402.080	
	ALLEGHANY CORP	1,278	673.670	860,950.260	
	ALLSTATE CORP	28,336	133.470	3,782,005.920	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	66,301	224.340	14,873,966.340	
	AMGEN INC	55,002	245.200	13,486,490.400	
	HESS CORP	27,192	84.010	2,284,399.920	
	AMERICAN EXPRESS CO	65,687	171.940	11,294,222.780	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	46,414	85.390	3,963,291.460	
	AFLAC INC	61,310	53.350	3,270,888.500	

AMERICAN INTL GROUP	80,846	46.870	3,789,252.020	
AMERCO	929	584.000	542,536.000	
ANALOG DEVICES	34,575	166.270	5,748,785.250	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,674	184.200	3,808,150.800	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	67,283	70.060	4,713,846.980	
VALERO ENERGY CORP	39,592	72.300	2,862,501.600	
ANSYS INC	8,258	353.760	2,921,350.080	
APPLE INC	1,597,566	145.110	231,822,802.260	
APPLIED MATERIALS INC	87,368	134.900	11,785,943.200	
ALBEMARLE CORP	10,736	175.510	1,884,275.360	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,757	60.320	3,182,302.240	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,236	83.650	939,891.400	
AMEREN CORP	25,054	81.920	2,052,423.680	
ARROW ELECTRONICS INC	6,651	113.380	754,090.380	
AUTOLIV INC	7,570	96.040	727,022.800	
AUTODESK INC	21,119	295.380	6,238,130.220	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	40,849	203.720	8,321,758.280	
AUTOZONE INC	2,212	1,564.530	3,460,740.360	
AVERY DENNISON CORP	7,627	210.350	1,604,339.450	
BALL CORP	30,947	84.790	2,623,996.130	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	130,659	280.490	36,648,542.910	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	80,600	49.930	4,024,358.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,518	80.430	3,821,872.740	
BECTON DICKINSON & CO	27,192	249.800	6,792,561.600	
AMETEK INC	21,813	135.470	2,955,007.110	
VERIZON COMM INC	392,604	56.070	22,013,306.280	
WR BERKLEY CORP	12,511	75.620	946,081.820	
BEST BUY CO INC	21,291	110.860	2,360,320.260	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,002	675.170	1,351,690.340	
YUM! BRANDS INC	29,043	118.580	3,443,918.940	
FIRSTENERGY CORP	53,250	37.530	1,998,472.500	
BOEING CO	53,000	239.590	12,698,270.000	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	88.450	994,001.100	
BORGWARNER INC	21,938	47.800	1,048,636.400	
BOSTON BEER COMPANY INC-CL A	860	973.580	837,278.800	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	132,377	43.590	5,770,313.430	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,719	93.170	1,091,859.230	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	10,777	170.370	1,836,077.490	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,263	1,435.410	3,248,332.830	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	213,989	67.160	14,371,501.240	
ONEOK INC	43,019	57.520	2,474,452.880	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	123.430	918,812.920	
UNITED RENTALS INC	7,145	317.480	2,268,394.600	
SEMPRA ENERGY	30,392	132.860	4,037,881.120	
FEDEX CORP	24,119	296.400	7,148,871.600	
VERISIGN INC	10,001	233.030	2,330,533.030	
AMPHENOL CORP	56,395	70.310	3,965,132.450	
BROWN-FORMAN CORP	28,552	74.120	2,116,274.240	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.560	637,212.160	
CSX CORP	219,832	31.830	6,997,252.560	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	45.640	928,043.760	
CONSTELLATION BRANDS INC	15,878	227.690	3,615,261.820	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	57.180	1,658,505.900	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	75,800	24.260	1,838,908.000	
CATERPILLAR INC	52,092	217.420	11,325,842.640	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	9,865	123.800	1,221,287.000	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	116.170	1,346,294.130	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	13.510	1,245,459.880	
CERNER CORP	29,663	79.570	2,360,284.910	
JPMORGAN CHASE & CO	290,618	155.770	45,269,565.860	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,345	86.980	2,117,528.100	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	118.870	1,731,579.290	
CINTAS CORP	9,113	388.320	3,538,760.160	
CISCO SYSTEMS INC	401,554	53.740	21,579,511.960	
CLOROX COMPANY	12,417	180.880	2,245,986.960	
COCA-COLA CO/THE	389,600	54.460	21,217,616.000	
COPART INC	20,203	138.490	2,797,913.470	
COGNEX CORP	16,685	86.580	1,444,587.300	
COLGATE-PALMOLIVE CO	74,700	82.430	6,157,521.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	26,524	142.480	3,779,139.520	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,203	257.250	1,338,471.750	
NRG ENERGY, INC.	21,039	41.970	883,006.830	
COMCAST CORP-CL A	435,455	58.030	25,269,453.650	
CONAGRA BRANDS INC	48,557	36.120	1,753,878.840	
CONSOLIDATED EDISON INC	32,567	73.300	2,387,161.100	
CMS ENERGY CORP	28,837	60.310	1,739,159.470	
COOPER COS INC	4,682	411.230	1,925,378.860	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,513	53.180	878,161.340	
CORNING INC	74,726	41.030	3,066,007.780	
SEALED AIR CORP	13,870	58.400	810,008.000	
HEICO CORP-CL A	7,477	130.220	973,654.940	

CUMMINS INC	13,999	242.700	3,397,557.300	
DR HORTON INC	33,099	89.570	2,964,677.430	
DANAHER CORP	61,194	277.470	16,979,499.180	
MOODY'S CORP	15,692	375.590	5,893,758.280	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,941	69.140	3,522,060.740	
TARGET CORP	47,793	248.580	11,880,383.940	
DEERE & CO	28,474	349.480	9,951,093.520	
MORGAN STANLEY	134,696	90.330	12,167,089.680	
REPUBLIC SERVICES INC	21,249	112.670	2,394,124.830	
COSTAR GROUP INC	37,150	86.280	3,205,302.000	
THE WALT DISNEY CO	173,115	177.040	30,648,279.600	
DOLLAR TREE INC	21,528	99.510	2,142,251.280	
DOVER CORP	13,837	153.460	2,123,426.020	
OMNICOM GROUP	21,323	80.050	1,706,906.150	
DTE ENERGY CO	18,373	115.600	2,123,918.800	
DUKE ENERGY CORP	73,337	100.660	7,382,102.420	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,936	148.580	1,922,030.880	
EBAY INC	65,353	69.460	4,539,419.380	
BANK OF AMERICA CORP	740,316	40.040	29,642,252.640	
CITIGROUP INC	198,704	68.450	13,601,288.800	
EASTMAN CHEMICAL CO	13,081	114.950	1,503,660.950	
EATON CORP PLC	37,269	153.560	5,723,027.640	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,386	138.500	3,654,461.000	
DISH NETWORK CORP	21,420	41.500	888,930.000	
ECOLAB INC	24,683	212.760	5,251,555.080	
PERKINELMER INC	11,099	153.960	1,708,802.040	
ELECTRONIC ARTS INC	26,968	140.990	3,802,218.320	
SALESFORCE.COM INC	87,533	245.060	21,450,836.980	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	188.220	422,177.460	
EMERSON ELECTRIC CO	56,135	97.610	5,479,337.350	
ATMOS ENERGY CORP	11,503	98.530	1,133,390.590	
ENTERGY CORP	19,089	102.920	1,964,639.880	
EOG RESOURCES INC	55,339	82.590	4,570,448.010	
EQUIFAX INC	11,797	248.540	2,932,026.380	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	21,932	317.870	6,971,524.840	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	15,999	128.400	2,054,271.600	
EXXON MOBIL CORP	404,291	61.230	24,754,737.930	
FMC CORP	11,416	107.660	1,229,046.560	
NEXTERA ENERGY INC	186,767	74.990	14,005,657.330	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,844	343.200	1,319,260.800	
FAIR ISAAC CORP	2,810	524.050	1,472,580.500	
ASSURANT INC	5,523	156.990	867,055.770	
FASTENAL CO	54,270	53.840	2,921,896.800	
FIFTH THIRD BANCORP	68,183	38.080	2,596,408.640	
M&T BANK CORP	12,653	142.330	1,800,901.490	
FISERV INC	56,229	108.940	6,125,587.260	
FORD MOTOR CO	366,733	14.480	5,310,293.840	

FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	32.150	858,855.100	
FREEPORT-MCMORAN INC	136,911	36.500	4,997,251.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17,922	140.500	2,518,041.000	
DENTSPLY SIRONA INC	19,366	62.420	1,208,825.720	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,460	190.220	4,462,561.200	
GENERAL MILLS INC	58,257	59.700	3,477,942.900	
GENUINE PARTS CO	14,520	129.520	1,880,630.400	
GILEAD SCIENCES INC	120,161	68.220	8,197,383.420	
GARTNER INC	8,725	256.870	2,241,190.750	
MCKESSON CORP	15,457	189.100	2,922,918.700	
NVIDIA CORP	58,950	802.010	47,278,489.500	
GENERAL ELECTRIC CO	837,394	13.160	11,020,105.040	
WW GRAINGER INC	4,182	456.830	1,910,463.060	
HALLIBURTON CO	84,523	22.380	1,891,624.740	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,030	90.240	3,341,587.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,012	371.760	12,272,541.120	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,744	223.990	4,422,458.560	
HASBRO INC	11,383	97.980	1,115,306.340	
HENRY SCHEIN INC	14,358	76.810	1,102,837.980	
HEICO CORP	3,623	142.200	515,190.600	
HERSHEY FOODS CORP	13,964	176.750	2,468,137.000	
HP INC	119,936	30.040	3,602,877.440	
F5 NETWORKS INC	5,529	190.860	1,055,264.940	
CROWN HOLDINGS INC NPR	13,523	105.570	1,427,623.110	
JUNIPER NETWORKS INC	34,151	27.620	943,250.620	
HOLOGIC INC	24,690	69.310	1,711,263.900	
HOME DEPOT INC	102,578	322.090	33,039,348.020	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,271	83.620	1,527,821.020	
HORMEL FOODS CORP	26,254	47.440	1,245,489.760	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,065	25.470	1,249,685.550	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	342.150	1,170,495.150	
HUMANA INC	12,034	455.650	5,483,292.100	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	7,544	165.780	1,250,644.320	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	135,857	14.270	1,938,679.390	
BIOGEN INC	14,278	358.160	5,113,808.480	
IDEX CORP	7,369	224.270	1,652,645.630	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,326	227.380	6,895,525.880	
INTUIT INC	26,099	503.930	13,152,069.070	
IDEXX LABORATORIES INC	8,039	667.030	5,362,254.170	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	22,329	190.320	4,249,655.280	
INTEL CORP	386,800	55.990	21,656,932.000	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	24,095	147.700	3,558,831.500	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,936	62.240	2,236,656.640	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	35,317	33.080	1,168,286.360	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,946	134.650	1,743,178.900	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,874	167.380	1,150,570.120	
INCYTE CORP	18,028	82.040	1,479,017.120	
JOHNSON & JOHNSON	250,084	169.750	42,451,759.000	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,801	61.580	2,143,045.580	
KLA CORPORATION	14,434	308.760	4,456,641.840	
DEVON ENERGY CORP	62,146	28.650	1,780,482.900	
KELLOGG CO	25,753	64.280	1,655,402.840	
KEYCORP	92,367	20.170	1,863,042.390	
KIMBERLY-CLARK CORP	31,829	135.020	4,297,551.580	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,550	901.310	13,114,060.500	
KROGER CO	67,295	38.270	2,575,379.650	
LAM RESEARCH CORP	13,622	612.850	8,348,242.700	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,354	426.790	1,858,243.660	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,438	138.630	1,169,759.940	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,625	117.900	1,842,187.500	
PLUG POWER INC	48,997	29.390	1,440,021.830	
LENNAR CORP	27,033	98.930	2,674,374.690	
ELI LILLY & CO	77,664	234.990	18,250,263.360	
L BRANDS INC	21,742	73.500	1,598,037.000	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	62.010	1,121,760.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	68,654	213.920	14,686,463.680	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,630	150.030	4,295,358.900	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,054	383.110	9,215,327.940	
LOEWS CORP	22,394	54.710	1,225,175.740	
LOWE'S COS INC	69,807	195.330	13,635,401.310	
DOMINION ENERGY INC	75,079	75.550	5,672,218.450	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36,356	41.600	1,512,409.600	
MCCORMICK & CO INC	24,703	87.100	2,151,631.300	
MCDONALD'S CORPORATION	71,078	235.680	16,751,663.040	
S&P GLOBAL INC	23,018	414.680	9,545,104.240	
EVEREST RE GROUP LTD	4,101	247.860	1,016,473.860	
MARKEL CORPORATION	1,367	1,238.290	1,692,742.430	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	60,035	107.510	6,454,362.850	
MARSH & MCLENNAN COS	48,601	142.600	6,930,502.600	
MASCO CORP	23,151	58.450	1,353,175.950	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,781	357.920	2,069,135.520	
METLIFE INC	70,118	58.860	4,127,145.480	

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	25,532	100.030	2,553,965.960	
MEDTRONIC PLC	128,205	128.170	16,432,034.850	
ACTIVISION BLIZZARD INC	74,057	92.380	6,841,385.660	
CVS HEALTH CORP	125,137	81.320	10,176,140.840	
MERCK & CO.INC.	240,861	77.990	18,784,749.390	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	40,848	37.750	1,542,012.000	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,422	281.030	2,647,864.660	
MICROSOFT CORP	681,800	277.940	189,499,492.000	
MICRON TECH INC	107,206	78.740	8,441,400.440	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,030	144.020	3,748,840.600	
3M CO	55,129	201.000	11,080,929.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	198.950	1,186,338.850	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	4,764	384.890	1,833,615.960	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,003	224.520	3,592,993.560	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,346	273.950	2,286,386.700	
ILLUMINA INC	13,966	476.800	6,658,988.800	
XCEL ENERGY INC	50,530	67.670	3,419,365.100	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	99.030	961,878.390	
NETAPP INC	21,903	82.570	1,808,530.710	
NEWELL BRANDS INC	33,317	27.030	900,558.510	
NEWMONT CORP	77,126	63.980	4,934,521.480	
NOVAVAX INC	6,444	188.590	1,215,273.960	
NVR INC	352	5,060.840	1,781,415.680	
NIKE INC-CL B	121,359	161.000	19,538,799.000	
NORDSON CORP	4,644	221.300	1,027,717.200	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,266	263.640	6,397,488.240	
EVERSOURCE ENERGY	32,548	82.630	2,689,441.240	
NISOURCE INC	40,775	25.140	1,025,083.500	
NORTHERN TRUST CORP	18,957	115.550	2,190,481.350	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,764	371.820	5,489,550.480	
WELLS FARGO & CO	394,303	43.910	17,313,844.730	
NUCOR CORP	28,381	97.170	2,757,781.770	
CHENIERE ENERGY INC	22,775	88.010	2,004,427.750	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44,408	160.550	7,129,704.400	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	86,193	30.240	2,606,476.320	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,119	260.580	2,376,229.020	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,907	591.650	4,086,526.550	
ORACLE CORP	182,094	87.760	15,980,569.440	
PACCAR INC	32,894	87.500	2,878,225.000	
PTC INC	11,092	145.140	1,609,892.880	
EXELON CORP	90,816	44.910	4,078,546.560	

PARKER HANNIFIN CORP	12,149	311.570	3,785,263.930	
PAYCHEX INC	29,778	111.900	3,332,158.200	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,020	627.190	4,402,873.800	
PPL CORPORATION	75,032	28.440	2,133,910.080	
PEPSICO INC	131,174	149.480	19,607,889.520	
PENTAIR PLC	16,339	69.300	1,132,292.700	
PFIZER INC	530,884	39.610	21,028,315.240	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,458	47.940	1,172,516.520	
CONOCOPHILLIPS	130,401	60.130	7,841,012.130	
PG&E CORP	140,021	10.370	1,452,017.770	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,533	158.000	3,086,214.000	
ALTRIA GROUP INC	177,548	47.400	8,415,775.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	40,734	189.670	7,726,017.780	
BROWN & BROWN INC	24,295	52.950	1,286,420.250	
GARMIN LTD	14,305	148.810	2,128,727.050	
PPG INDUSTRIES INC	22,227	171.410	3,809,930.070	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	207.410	695,445.730	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,184	412.370	17,395,416.080	
T ROWE PRICE GROUP INC	22,009	205.200	4,516,246.800	
QUEST DIAGNOSTICS	11,926	135.040	1,610,487.040	
PROCTER & GAMBLE CO	234,237	137.030	32,097,496.110	
PROGRESSIVE CORP	54,685	99.630	5,448,266.550	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	47,460	60.490	2,870,855.400	
PULTE GROUP INC	25,385	53.230	1,351,243.550	
GLOBAL PAYMENTS INC	27,589	190.370	5,252,117.930	
QUALCOMM INC	108,151	141.430	15,295,795.930	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	12,126	132.020	1,600,874.520	
EXACT SCIENCES CORP	16,027	119.700	1,918,431.900	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	151.040	700,523.520	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,840	580.400	5,711,136.000	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	6,097	112.820	687,863.540	
RESMED INC	14,065	247.680	3,483,619.200	
US BANCORP	136,888	56.970	7,798,509.360	
SEAGEN INC	12,602	148.500	1,871,397.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	38.500	1,494,146.500	
ROSS STORES INC	33,574	124.770	4,189,027.980	
ROLLINS INC	18,567	35.390	657,086.130	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,805	481.180	4,717,969.900	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,708	291.200	3,118,169.600	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,882	82.330	1,883,875.060	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	90.520	1,167,436.440	

ACCENTURE PLC-CL A	60,290	312.620	18,847,859.800	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	134,296	63.020	8,463,333.920	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,442	228.210	2,839,388.820	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	23,554	153.330	3,611,534.820	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	59,564	144.420	8,602,232.880	
BOOKING HOLDINGS INC	3,925	2,194.990	8,615,335.750	
SCHLUMBERGER LTD	132,163	31.190	4,122,163.970	
SCHWAB (CHARLES) CORP	138,073	70.550	9,741,050.150	
POOL CORP	3,925	476.240	1,869,242.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,585	159.310	3,120,086.350	
BUNGE LTD	13,581	77.450	1,051,848.450	
SEI INVESTMENTS CO	10,653	62.120	661,764.360	
ANTHEM INC	23,361	388.610	9,078,318.210	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,836	115.130	1,592,938.680	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25,038	61.990	1,552,105.620	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,473	276.220	6,759,932.060	
CENTENE CORP	56,124	73.510	4,125,675.240	
SVB FINANCIAL GROUP	4,933	575.240	2,837,658.920	
SMITH (A.O.) CORP	14,015	70.750	991,561.250	
SNAP-ON INC	5,408	227.650	1,231,131.200	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,586	100.580	3,780,399.880	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	213.470	1,329,064.220	
EDISON INTERNATIONAL	35,704	58.280	2,080,829.120	
SOUTHERN CO	101,048	61.470	6,211,420.560	
TRUIST FINANCIAL CORP	125,807	55.210	6,945,804.470	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	52.840	698,544.800	
AT&T INC	678,847	28.450	19,313,197.150	
CHEVRON CORP	183,703	104.070	19,117,971.210	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,115	208.530	3,151,930.950	
STATE STREET CORP	32,482	84.110	2,732,061.020	
STARBUCKS CORP	112,621	117.470	13,229,588.870	
STEEL DYNAMICS INC	20,423	61.500	1,256,014.500	
STRYKER CORP	32,381	264.430	8,562,507.830	
NETFLIX INC	42,213	535.980	22,625,323.740	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	27.660	1,532,032.080	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	49.780	790,854.860	
SYNOPSYS INC	14,414	280.750	4,046,730.500	
SYSCO CORP	48,959	76.140	3,727,738.260	
INTUITIVE SURGICAL INC	11,275	950.780	10,720,044.500	
TELEFLEX INC	4,634	422.820	1,959,347.880	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	9.300	983,540.100	
TERADYNE INC	15,807	125.700	1,986,939.900	
TEXAS INSTRUMENTS INC	87,452	190.270	16,639,492.040	
TEXTRON INC	22,278	67.700	1,508,220.600	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,572	517.260	19,434,492.720	
GLOBE LIFE INC	10,611	94.460	1,002,315.060	
DAVITA INC	6,497	122.090	793,218.730	
TRACTOR SUPPLY CO	11,488	186.910	2,147,222.080	
BIO-TECHNE CORP	3,634	465.390	1,691,227.260	
TRIMBLE INC	24,682	83.260	2,055,023.320	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,014	478.840	1,922,063.760	
TYSON FOODS INC	28,566	73.550	2,101,029.300	
UGI CORP	19,377	46.540	901,805.580	
UNION PACIFIC CORP	63,915	221.690	14,169,316.350	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	145,632	86.380	12,579,692.160	
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,263	412.110	37,198,284.930	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	153.950	1,191,111.150	
VF CORP	31,762	83.070	2,638,469.340	
VIACOMCBS INC	55,074	42.770	2,355,514.980	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,192	198.160	4,992,046.720	
VULCAN MATERIALS CO	12,232	174.930	2,139,743.760	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,887	47.410	3,360,752.670	
WALMART INC	148,063	140.300	20,773,238.900	
WASTE MANAGEMENT INC	39,623	143.040	5,667,673.920	
WATERS CORP	5,847	369.400	2,159,881.800	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,128	374.190	2,667,226.320	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	10,306	130.850	1,348,540.100	
VAIL RESORTS INC	3,590	325.630	1,169,011.700	
WESTERN DIGITAL CORP	29,830	70.170	2,093,171.100	
WABTEC CORP	18,377	82.850	1,522,534.450	
WHIRLPOOL CORP	5,587	225.020	1,257,186.740	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,115	189.570	2,865,350.550	
WYNN RESORTS LTD	9,809	113.870	1,116,950.830	
NASDAQ INC	11,126	175.770	1,955,617.020	
CME GROUP INC	34,375	209.620	7,205,687.500	
WILLIAMS COS INC	117,180	26.700	3,128,706.000	
LKQ CORP	28,725	50.970	1,464,113.250	
ALLIANT ENERGY CORP	22,453	56.760	1,274,432.280	
WEC ENERGY GROUP INC	29,256	91.840	2,686,871.040	
CARMAX INC	16,043	134.840	2,163,238.120	
XILINX INC	23,712	135.590	3,215,110.080	
TJX COMPANIES INC	115,318	68.360	7,883,138.480	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,193	547.730	2,844,361.890	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.740	515,238.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	63.930	1,316,958.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,581	176.740	2,046,825.940	
CBRE GROUP INC	31,654	85.830	2,716,862.820	
LIBERTY GLOBAL PLC	12,732	26.490	337,270.680	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,214	19.870	1,931,642.180	
DOMINO'S PIZZA INC	3,716	477.560	1,774,612.960	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,275	382.600	1,635,615.000	
T-MOBILE US INC	59,375	146.010	8,669,343.750	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,060	51.330	1,696,969.800	
MOSAIC CO/THE	32,592	31.790	1,036,099.680	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,402	460.770	1,567,539.540	
CELANESE CORP	11,626	153.530	1,784,939.780	
DEXCOM INC	9,299	440.730	4,098,348.270	
DISCOVERY INC-A	14,886	29.300	436,159.800	
EXPEDIA GROUP INC	12,635	167.740	2,119,394.900	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,094	50.660	1,119,282.040	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,068	248.950	2,755,378.600	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	26.440	899,568.120	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53,911	118.970	6,413,791.670	
LIVE NATION	15,697	83.660	1,313,211.020	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,668	1,592.250	4,248,123.000	
TRANSDIGM GROUP INC	4,893	660.060	3,229,673.580	
MASTERCARD INC	84,411	372.940	31,480,238.340	
WESTERN UNION CO	35,367	23.310	824,404.770	
OWENS CORNING	9,740	96.350	938,449.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	104.840	1,348,871.440	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	16.120	279,682.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,146	168.700	1,880,330.200	
DELTA AIR LINES INC	14,723	42.920	631,911.160	
INSULET CORP	6,122	280.690	1,718,384.180	
DISCOVER FINANCIAL	28,906	122.400	3,538,094.400	
TE CONNECTIVITY LTD	31,111	138.000	4,293,318.000	
MASIMO CORP	5,365	260.330	1,396,670.450	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,647	377.420	4,395,810.740	
VMWARE INC	7,464	159.480	1,190,358.720	
MERCADOLIBRE INC	4,210	1,554.970	6,546,423.700	
ULTA BEAUTY INC	5,259	343.650	1,807,255.350	

INVESCO LTD	39,794	26.330	1,047,776.020	
MSCI INC	7,960	560.230	4,459,430.800	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	148,059	99.400	14,717,064.600	
VISA INC	161,378	238.470	38,483,811.660	
KEURIG DR PEPPER INC	64,776	35.000	2,267,160.000	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,257	162.280	2,800,465.960	
DISCOVERY INC-C	30,388	27.770	843,874.760	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,181	58.680	3,590,101.080	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	98.490	1,328,236.140	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	195,706	18.670	3,653,831.020	
XYLEM INC	17,428	121.050	2,109,659.400	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,636	102.730	2,530,856.280	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,484	206.220	718,470.480	
SPLUNK INC	15,277	138.370	2,113,878.490	
EPAM SYSTEMS INC	5,349	527.820	2,823,309.180	
ZILLOW GROUP INC	4,265	116.590	497,256.350	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,728	61.170	1,084,421.760	
HCA HEALTHCARE INC	25,366	218.790	5,549,827.140	
VERISK ANALYTICS INC	14,768	181.710	2,683,493.280	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	183.990	1,131,906.480	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,343	253.030	1,857,999.290	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,017	194.490	3,115,146.330	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,918	200.350	5,192,671.300	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	88.800	1,215,405.600	
LEAR CORP	5,733	174.030	997,713.990	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	118.790	1,250,502.330	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	23,036	73.550	1,694,297.800	
DOLLAR GENERAL CORP	23,052	220.770	5,089,190.040	
FORTINET INC	13,050	256.810	3,351,370.500	
HORIZON PHARMA PLC	19,642	95.280	1,871,489.760	
TESLA INC	73,128	656.950	48,041,439.600	
GENERAC HOLDINGS INC	6,138	436.370	2,678,439.060	
ENPHASE ENERGY INC	11,597	183.800	2,131,528.600	
GENERAL MOTORS CO	124,496	58.760	7,315,384.960	
XPO LOGISTICS INC	7,614	141.100	1,074,335.400	
ALLY FINANCIAL INC	34,962	51.280	1,792,851.360	
VOYA FINANCIAL INC	10,611	62.330	661,383.630	
APTIV PLC	25,515	155.610	3,970,389.150	

PHILLIPS 66	41,488	82.700	3,431,057.600	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	7,172	111.660	800,825.520	
FACEBOOK INC	229,029	350.420	80,256,342.180	
IQVIA HOLDINGS INC	17,929	251.160	4,503,047.640	
SERVICENOW INC	18,811	566.370	10,653,986.070	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,413	390.240	3,673,329.120	
WORKDAY INC	16,912	239.940	4,057,865.280	
ABBVIE INC	168,303	116.580	19,620,763.740	
ZOETIS INC	45,433	197.500	8,973,017.500	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	25.520	979,253.440	
CDW CORP	13,668	177.980	2,432,630.640	
HOWMET AEROSPACE INC	34,315	33.950	1,164,994.250	
TWILIO INC	15,096	392.270	5,921,707.920	
COUPA SOFTWARE INC	6,721	266.640	1,792,087.440	
SNAP INC	87,965	65.810	5,788,976.650	
TRADE DESK INC A	40,580	77.950	3,163,211.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	18,557	48.880	907,066.160	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	46.890	390,312.360	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,205	46.520	660,816.600	
OKTA INC	11,656	251.840	2,935,447.040	
BLACK KNIGHT INC	16,004	80.940	1,295,363.760	
BAKER HUGHES CO	67,871	22.730	1,542,707.830	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	80.820	1,065,288.420	
ALTICE USA INC-A	21,506	34.800	748,408.800	
BROADCOM INC	38,875	480.180	18,666,997.500	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7,215	294.810	2,127,054.150	
MONGODB INC	5,041	353.700	1,783,001.700	
BURLINGTON STORES INC	6,573	329.890	2,168,366.970	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	34.640	1,401,153.360	
VEEVA SYSTEMS INC	12,865	321.410	4,134,939.650	
TWITTER INC	75,008	68.970	5,173,301.760	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	57.740	922,973.900	
EVERGY INC	22,104	61.790	1,365,806.160	
ALLEGION PLC	8,924	138.270	1,233,921.480	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	99.220	1,325,579.200	
STERIS PLC	9,656	211.240	2,039,733.440	
DOCUSIGN INC	17,990	288.020	5,181,479.800	
WIX.COM LTD	5,567	294.810	1,641,207.270	
DROPBOX INC	28,170	31.050	874,678.500	
KKR & CO INC	50,809	59.100	3,002,811.900	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	139.750	664,930.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	19,591	385.080	7,544,102.280	
MODERNA INC	30,280	232.810	7,049,486.800	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,893	126.050	3,389,862.650	
ARAMARK	20,857	35.920	749,183.440	

CIGNA CORP	33,710	234.900	7,918,479.000	
DELL TECHNOLOGIES INC	24,036	100.250	2,409,609.000	
DOW INC	69,681	63.080	4,395,477.480	
AMCOR PLC	153,824	11.510	1,770,514.240	
PINTEREST INC	51,461	76.990	3,961,982.390	
PELOTON INTERACTIVE INC	24,251	117.840	2,857,737.840	
FOX CORP-A	31,751	36.450	1,157,323.950	
FOX CORP-B	13,009	34.510	448,940.590	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	26.340	832,791.780	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	17,209	264.440	4,550,747.960	
CHEWY INC	6,586	85.570	563,564.020	
AVANTOR INC	49,965	36.080	1,802,737.200	
LYFT INC	23,625	60.060	1,418,917.500	
DYNATRACE INC	15,949	61.810	985,807.690	
CLOUDFLARE INC	20,681	108.970	2,253,608.570	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	87.060	860,675.160	
CARRIER GLOBAL CORP	77,461	48.270	3,739,042.470	
OTIS WORLDWIDE CORP	38,820	83.820	3,253,892.400	
UBER TECHNOLOGIES INC	115,424	49.070	5,663,855.680	
CORTEVA INC	70,517	43.450	3,063,963.650	
MATCH GROUP INC	24,682	162.630	4,014,033.660	
SLACK TECHNOLOGIES INC	43,514	44.470	1,935,067.580	
BLACKSTONE GROUP INC	63,860	99.730	6,368,757.800	
CARLYLE GROUP INC	16,487	47.710	786,594.770	
10X GENOMICS INC	6,780	190.410	1,290,979.800	
DATADOG INC	16,727	108.120	1,808,523.240	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	19,641	87.960	1,727,622.360	
INGERSOLL RAND INC	35,181	49.380	1,737,237.780	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,913	383.590	1,884,577.670	
PPD INC	10,828	45.850	496,463.800	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	106.530	571,746.510	
AON PLC	21,016	236.310	4,966,290.960	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	64.200	1,027,328.400	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	144.150	1,018,275.600	
AIRBNB INC	6,156	149.640	921,183.840	
ZENDESK INC	11,915	143.480	1,709,564.200	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	41.770	704,283.970	
VIATRIS INC	116,960	14.310	1,673,697.600	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	18,899	96.860	1,830,557.140	
DRAFTKINGS INC	14,671	49.090	720,199.390	
SNOWFLAKE INC	2,127	269.490	573,205.230	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	59.570	544,708.080	
ARISTA NETWORKS INC	5,602	378.030	2,117,724.060	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	48,435	23.290	1,128,051.150	
IHS MARKIT LTD	35,312	113.520	4,008,618.240	
FNF GROUP	24,567	44.200	1,085,861.400	

	MARVELL TECHNOLOGY INC	77,153	57.000	4,397,721.000	
	CATALENT INC	16,458	113.250	1,863,868.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	53,993	48.730	2,631,078.890	
	CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,845	45.310	1,941,306.950	
	CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	139.610	482,631.770	
	WAYFAIR INC	6,651	303.900	2,021,238.900	
	KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,862	155.810	2,783,078.220	
	HUBSPOT INC	4,048	602.900	2,440,539.200	
	QORVO INC	11,107	192.940	2,142,984.580	
	LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	172.670	418,724.750	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,950	178.640	2,670,668.000	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,031	267.680	1,346,698.080	
	GODADDY INC	16,574	87.430	1,449,064.820	
	ETSY INC	12,049	195.090	2,350,639.410	
	TRANSUNION	18,741	113.840	2,133,475.440	
	SQUARE INC	37,352	241.890	9,035,075.280	
	DUPONT DE NEMOURS INC	50,291	78.480	3,946,837.680	
	CARVANA CO	6,428	323.420	2,078,943.760	
	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	18,296	61.390	1,123,191.440	
	TELADOC HEALTH INC	12,418	158.600	1,969,494.800	
	WESTROCK CO	26,297	52.870	1,390,322.390	
	KRAFT HEINZ CO	64,743	39.950	2,586,482.850	
	NOVOCURE LTD	8,475	194.550	1,648,811.250	
	FORTIVE CORP	30,123	70.680	2,129,093.640	
	WASTE CONNECTIONS INC	24,861	122.140	3,036,522.540	
	ALPHABET INC-CL A	28,694	2,510.370	72,032,556.780	
	HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	125,591	14.580	1,831,116.780	
	PAYPAL HOLDINGS INC	106,102	300.210	31,852,881.420	
	SEA LTD ADR	1,322	275.700	364,475.400	
	EQUITABLE HOLDINGS INC	35,277	29.650	1,045,963.050	
	SUNRUN INC	16,213	52.580	852,479.540	
	ZILLOW GROUP INC-C	15,665	115.290	1,806,017.850	
	ALPHABET INC-CL C	27,998	2,591.490	72,556,537.020	
	ZSCALER INC	7,764	227.790	1,768,561.560	
	CABLE ONE INC	542	1,933.000	1,047,686.000	
	LINDE PLC	50,083	292.710	14,659,794.930	
	ATHENE HOLDING LTD	13,416	66.920	897,798.720	
	ROKU INC	10,251	431.610	4,424,434.110	
	AVALARA INC	8,515	161.280	1,373,299.200	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,938	736.470	9,528,448.860	
	VISTRA CORP	38,032	19.320	734,778.240	

アメリカ・ドル　小計		30,242,085		3,678,740,639.380 (405,286,856,247)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	14.425	508,639.920	
	ASHTEAD GROUP	42,475	55.320	2,349,717.000	
	SEVERN TRENT PLC	21,933	26.470	580,566.510	
	BHP GROUP PLC	197,559	22.620	4,468,784.580	
	BARCLAYS PLC	1,639,400	1.733	2,841,080.200	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	7.058	691,309.920	
	BT GROUP PLC	864,218	1.875	1,620,408.750	
	BUNZL PLC	34,184	25.560	873,743.040	
	AVIVA PLC	380,790	4.050	1,542,199.500	
	CRODA INTERNATIONAL	12,568	76.380	959,943.840	
	DIAGEO PLC	223,605	34.340	7,678,595.700	
	SCHRODERS PLC	11,354	35.940	408,062.760	
	DCC PLC	7,898	59.600	470,720.800	
	NATIONAL GRID PLC	332,836	9.396	3,127,327.050	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.676	777,326.960	
	BAE SYSTEMS PLC	297,008	5.380	1,597,903.040	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	208,432	27.725	5,778,777.200	
	HALMA PLC	38,776	27.750	1,076,034.000	
	NEXT PLC	13,140	78.400	1,030,176.000	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,182	15.845	1,444,778.790	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	31.620	604,163.340	
	ANGLO AMERICAN PLC	125,262	29.910	3,746,586.420	
	COMPASS GROUP PLC	169,036	15.250	2,577,799.000	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,946,177	4.141	8,059,118.950	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	572,590	2.658	1,521,944.220	
	UNILEVER PLC	250,425	42.950	10,755,753.750	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	2.649	609,831.580	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.315	698,469.910	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	31,166	21.850	680,977.100	
	PEARSON PLC	65,009	8.214	533,983.920	
	PERSIMMON PLC	28,126	30.040	844,905.040	
	PRUDENTIAL PLC	250,932	13.790	3,460,352.280	
	RIO TINTO PLC	107,257	61.060	6,549,112.420	
	VODAFONE GROUP PLC	2,521,502	1.186	2,990,501.370	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	66,793	64.320	4,296,125.760	
	RELX PLC	181,197	20.080	3,638,435.760	
	RENTOKIL INITIAL PLC	169,766	5.072	861,053.150	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	746,540	1.010	754,005.400	
	NATWEST GROUP PLC	490,893	2.024	993,567.430	
	ST JAMES'S PLACE PLC	49,789	15.180	755,797.020	

SSE PLC	99,877	15.290	1,527,119.330	
BP PLC	1,962,097	3.109	6,100,159.570	
SAGE GROUP PLC(THE)	110,105	6.938	763,908.490	
SMITHS GROUP PLC	35,235	16.210	571,159.350	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	6,574	140.100	921,017.400	
STANDARD CHARTERED PLC	267,266	4.541	1,213,654.900	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,677,834	0.467	3,118,548.470	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.646	570,822.920	
TESCO PLC	746,432	2.377	1,774,268.860	
3I GROUP PLC	87,095	12.025	1,047,317.370	
SMITH & NEPHEW PLC	84,627	15.705	1,329,067.030	
GLAXOSMITHKLINE PLC	470,791	14.352	6,756,792.430	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	31,421	78.720	2,473,461.120	
WPP PLC	124,119	9.676	1,200,975.440	
ASTRAZENECA PLC	125,281	86.480	10,834,300.880	
WHITBREAD PLC	18,594	31.360	583,107.840	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	56.020	904,106.780	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	20.630	799,701.320	
INTERCONTINENTAL HOTELS	16,652	48.230	803,125.960	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.842	519,693.800	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	31.210	626,915.270	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,434	47.580	544,029.720	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	394,623	14.684	5,794,644.130	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	354,122	14.330	5,074,568.260	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	26.230	473,031.820	
AVEVA GROUP PLC	10,408	39.240	408,409.920	
ABRDN PLC	206,313	2.837	585,309.980	
EXPERIAN PLC	88,425	29.380	2,597,926.500	
MONDI PLC	47,464	19.790	939,312.560	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	16.535	583,883.920	
OCADO GROUP PLC	42,789	19.090	816,842.010	
INFORMA PLC	151,566	5.078	769,652.140	
GLENCORE PLC	964,668	3.194	3,081,149.590	
ENTAIN PLC	58,126	18.700	1,086,956.200	
EVRAZ PLC	48,765	6.152	300,002.280	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.924	329,517.250	
COCA-COLA HBC AG	20,233	25.730	520,595.090	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	53,472	6.894	368,635.960	
FERGUSON PLC	21,739	103.500	2,249,986.500	
M&G PLC	259,117	2.278	590,268.520	
JD SPORTS FASHION PLC	47,098	9.570	450,727.860	

	AUTO TRADER GROUP PLC	81,805	6.406	524,042.830	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	424,675	1.595	677,356.620	
イギリス・ポンド　小計		27,773,047		167,964,653.570 (25,717,068,108)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	26.800	2,743,221.200	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	130,703	25.240	3,298,943.720	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	417.500	734,800.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	15.550	1,588,183.700	
	ICL GROUP LTD	68,048	21.850	1,486,848.800	
	NICE LTD	5,535	836.000	4,627,260.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	99.500	1,039,178.000	
	AZRIELI GROUP	4,414	240.200	1,060,242.800	
イスラエル・シュケル　小計		425,397		16,578,678.220 (557,416,608)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	63.260	1,066,184.040	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	267,571	27.850	7,451,852.350	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	344,560	25.370	8,741,487.200	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	158,803	23.870	3,790,627.610	
	TELSTRA CORP LTD	364,409	3.750	1,366,533.750	
	ASX LTD	19,940	75.540	1,506,267.600	
	BHP GROUP LTD	281,959	49.480	13,951,331.320	
	AMPOL LTD	20,946	29.090	609,319.140	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	16.000	825,664.000	
	CSL LIMITED	43,660	275.470	12,027,020.200	
	REA GROUP LTD	5,828	165.080	962,086.240	
	TRANSURBAN GROUP	261,689	14.420	3,773,555.380	
	COCHLEAR LTD	6,917	243.260	1,682,629.420	
	ORIGIN ENERGY LTD	196,680	4.550	894,894.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	169,844	98.590	16,744,919.960	
	RIO TINTO LIMITED	35,870	125.400	4,498,098.000	
	APA GROUP	118,205	9.110	1,076,847.550	
	ARISTOCRAT LEISU	51,717	41.700	2,156,598.900	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	225,180	4.870	1,096,626.600	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	39,410	44.010	1,734,434.100	
	ORICA LTD	41,311	13.270	548,196.970	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	11.660	724,272.560	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	21.260	994,479.020	
	SYDNEY AIRPORT	116,056	7.750	899,434.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	32,731	154.190	5,046,792.890	
	SUNCORP GROUP LTD	118,236	11.270	1,332,519.720	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	311,116	26.080	8,113,905.280	
	NEWCREST MINING LTD	73,202	25.710	1,882,023.420	
	OIL SEARCH LTD	211,926	3.890	824,392.140	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	62,282	4.720	293,971.040	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	10.500	1,510,131.000	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	93,404	10.100	943,380.400	
	REECE LTD	30,319	22.990	697,033.810	
	SANTOS LTD	194,614	7.120	1,385,651.680	
	SONIC HEALTHCARE	46,547	38.030	1,770,182.410	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	8,406	33.600	282,441.600	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	4.780	1,025,773.660	
	WESFARMERS LTD	107,472	58.000	6,233,376.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	86,196	23.440	2,020,434.240	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	119,574	38.070	4,552,182.180	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	51.210	796,469.130	
	SEEK LTD	28,713	31.940	917,093.220	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	114.720	698,185.920	
	AUSNET SERVICES	165,066	1.755	289,690.830	
	AGL ENERGY LTD	49,076	8.140	399,478.640	
	BRAMBLES LTD	150,237	11.390	1,711,199.430	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	10.990	361,142.390	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	4.570	644,205.480	
	AURIZON HOLDINGS LTD	150,150	3.750	563,062.500	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	57,667	11.900	686,237.300	
	XERO LTD	12,462	134.280	1,673,397.360	
	AFTERPAY LTD	20,778	117.510	2,441,622.780	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.250	747,337.500	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.240	917,418.960	
	SOUTH32 LTD(AUD)	497,070	2.930	1,456,415.100	
	COLES GROUP LTD	121,032	16.850	2,039,389.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	30.630	416,690.520	
オーストラリア・ドル　小計		6,666,397		143,796,587.640 (11,844,524,924)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,568	76.520	1,879,943.360	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	81,988	46.340	3,799,323.920	
	BARRICK GOLD CORP	169,906	26.320	4,471,925.920	
	ATCO LTD	7,193	44.260	318,362.180	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	21.150	449,902.800	
	BANK OF MONTREAL	62,248	126.120	7,850,717.760	

BANK OF NOVA SCOTIA	116,344	78.900	9,179,541.600	
NATIONAL BANK OF CANADA	31,010	93.500	2,899,435.000	
BCE INC	7,275	61.990	450,977.250	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	123,552	63.850	7,888,795.200	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	36.470	1,028,162.240	
SAPUTO INC	25,395	37.000	939,615.000	
BLACKBERRY LTD	46,671	14.690	685,596.990	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	56,605	18.770	1,062,475.850	
CGI INC	22,007	114.490	2,519,581.430	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	68.640	1,054,173.120	
CAE INC	25,006	38.550	963,981.300	
CAMECO CORP	32,627	22.790	743,569.330	
ROGERS COMM-CL B	35,510	66.690	2,368,161.900	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,847	141.870	5,936,833.890	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	110,821	44.510	4,932,642.710	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	193.870	1,141,700.430	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,291	34.970	569,696.270	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,438	133.740	9,152,898.120	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.250	442,664.250	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	44.160	919,190.400	
OPEN TEXT CORP	24,883	64.150	1,596,244.450	
EMPIRE CO LTD	15,093	39.860	601,606.980	
KINROSS GOLD CORP	118,575	7.860	931,999.500	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	74.320	740,450.160	
FORTIS INC	44,292	55.610	2,463,078.120	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	28.850	1,641,968.900	
TELUS CORP	31,890	27.960	891,644.400	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	36.780	928,695.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	36.450	785,205.900	
ENBRIDGE INC	194,437	50.110	9,743,238.070	
IGM FINANCIAL INC	6,069	43.980	266,914.620	
MANULIFE FINANCIAL CORP	182,556	23.990	4,379,518.440	
LOBLAW CO LTD	15,136	78.570	1,189,235.520	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,109	112.870	3,172,662.830	
SUN LIFE FINANCIAL INC	54,375	63.290	3,441,393.750	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,398	548.490	1,315,279.020	
METRO INC	25,305	60.520	1,531,458.600	
EMERA INC	22,433	57.090	1,280,699.970	
ONEX CORP	6,646	90.060	598,538.760	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	35.440	665,067.040	
POWER CORP OF CANADA	55,860	38.990	2,177,981.400	
QUEBECOR INC-B	16,042	33.050	530,188.100	

	ROYAL BANK OF CANADA	135,699	126.370	17,148,282.630	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	62,219	93.040	5,788,855.760	
	SHAW COMM INC-B	47,913	36.180	1,733,492.340	
	SUNCOR ENERGY INC	143,571	28.970	4,159,251.870	
	LUNDIN MINING CORP	64,310	11.540	742,137.400	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	41,016	29.280	1,200,948.480	
	THOMSON REUTERS CORP	16,826	126.310	2,125,292.060	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	7,417	104.710	776,634.070	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	173,273	84.700	14,676,223.100	
	TC ENERGY CORP	90,472	62.560	5,659,928.320	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	7,200	93.460	672,912.000	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,886	119.300	940,799.800	
	INTACT FINANCIAL CORP	15,672	172.030	2,696,054.160	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	44,630	55.320	2,468,931.600	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,912	1,919.740	3,670,542.880	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	17,971	183.350	3,294,982.850	
	B2GOLD CORP	101,675	5.060	514,475.500	
	KEYERA CORP	23,772	33.080	786,377.760	
	PARKLAND CORP	14,497	39.680	575,240.960	
	ALTAGAS LTD	23,944	26.490	634,276.560	
	PEMBINA PIPELINE CORP	50,410	39.910	2,011,863.100	
	DOLLARAMA INC	26,906	57.180	1,538,485.080	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	119,709	11.370	1,361,091.330	
	NORTHLAND POWER INC	23,490	42.870	1,007,016.300	
	TMX GROUP LTD	5,058	129.310	654,049.980	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	49.030	1,322,388.130	
	IVANHOE MINES LTD	61,930	9.200	569,756.000	
	INTER PIPELINE LTD	41,863	20.120	842,283.560	
	NUTRIEN LTD	55,668	76.220	4,243,014.960	
	LIGHTSPEED POS INC	9,164	106.020	971,567.280	
	WSP GLOBAL INC	10,194	149.910	1,528,182.540	
	IA FINANCIAL CORP INC	11,660	67.150	782,969.000	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	39.500	651,157.500	
	NUVEI CORP	4,960	103.490	513,310.400	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	50.870	551,685.150	
	AIR CANADA	17,940	25.750	461,955.000	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,176	80.100	2,016,597.600	
	SHOPIFY INC	10,761	1,862.970	20,047,420.170	
	FIRSTSERVICE CORP	3,503	222.080	777,946.240	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	27.590	514,112.060	
	HYDRO ONE LTD	27,340	30.470	833,049.800	
カナダ・ドル　小計		3,878,221		227,988,479.030	

				(20,163,301,085)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	125,000	3.940	492,500.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	168,400	29.660	4,994,744.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	6.990	254,436.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	11.160	768,924.000	
	CAPITALAND LTD	232,915	3.760	875,760.400	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.840	608,328.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.240	706,876.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	327,653	11.910	3,902,347.230	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.260	1,827,033.720	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.020	793,411.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	112,500	25.740	2,895,750.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.310	296,055.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	18.920	397,320.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.510	818,114.000	
シンガポール・ドル　小計		3,140,240		19,631,599.350 (1,600,564,295)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	232,092	9.190	2,132,925.480	
	LOGITECH INTL-REG	16,174	114.950	1,859,201.300	
	NESTLE SA-REGISTERED	274,327	115.200	31,602,470.400	
	CIE FINANC RICHEMONT	48,893	110.650	5,410,010.450	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	67,324	353.100	23,772,104.400	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	280.700	1,157,045.400	
	SIKA INHABER	13,317	309.100	4,116,284.700	
	SGS SA-REG	540	2,896.000	1,563,840.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	211,526	84.940	17,967,018.440	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	144.300	614,573.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	401	2,208.000	885,408.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	18.690	373,407.510	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	535.800	1,333,606.200	
	ABB LTD	167,711	32.850	5,509,306.350	
	ADECCO GROUP AG-REG	13,600	62.580	851,088.000	
	GEBERIT AG	3,524	710.400	2,503,449.600	
	LONZA GROUP AG-REG	6,994	666.800	4,663,599.200	
	LINDT & SPRUENGLI PART	95	9,525.000	904,875.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	99,200.000	1,091,200.000	
	GIVAUDAN-REG	869	4,333.000	3,765,377.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,488	365.100	5,289,568.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,699	381.400	1,029,398.600	
	HOLCIM LTD	49,333	53.640	2,646,222.120	
	TEMENOS GROUP	6,753	147.150	993,703.950	
	SONOVA HOLDING AG	5,268	330.200	1,739,493.600	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,816	314.600	1,515,113.600	

	STRAUMANN HOLDING AG	1,032	1,545.000	1,594,440.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	310.200	927,808.200	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	59.550	273,453.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,663	272.000	452,336.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	453.300	1,400,697.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	81.000	202,500.000	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	123.900	651,218.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	937.000	527,531.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	94.600	760,584.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,234	1,420.000	3,172,280.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,176	57.600	1,334,937.600	
	SWISS RE LTD	27,789	84.200	2,339,833.800	
	ALCON INC	47,036	64.420	3,030,059.120	
	UBS GROUP AG	354,847	13.675	4,852,532.720	
スイス・フラン　小計		1,656,413		146,810,503.240 (17,692,133,745)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	65,891	543.000	35,778,813.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	36,051	458.700	16,536,593.700	
	ERICSSON LM-B SHS	274,779	112.140	30,813,717.060	
	LUNDBERGS B	7,382	571.000	4,215,122.000	
	SKF AB-B SHS	34,849	220.600	7,687,689.400	
	SANDVIK AB	111,867	223.500	25,002,274.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,441	111.750	18,152,781.750	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	234.900	7,435,289.700	
	SWEDBANK AB	89,378	163.800	14,640,116.400	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	52,945	149.850	7,933,808.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	98.600	13,728,078.000	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	217.800	5,159,899.800	
	VOLVO AB-B SHS	129,470	211.950	27,441,166.500	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	75.460	11,947,506.340	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	120.050	5,648,952.750	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	330.600	4,010,508.600	
	INDUSTRIVARDEN C	11,403	312.200	3,560,016.600	
	ELECTROLUX AB-SER B	19,191	239.500	4,596,244.500	
	SECURITAS AB-B SHS	35,948	140.200	5,039,909.600	
	INVESTOR AB-B SHS	169,486	205.200	34,778,527.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	198.380	14,064,348.480	
	ASSA ABLOY AB-B	94,311	268.300	25,303,641.300	
	TELIA CO AB	269,954	38.415	10,370,282.910	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	295.900	6,143,475.800	
	BOLIDEN AB	28,603	332.500	9,510,497.500	
	ALFA LAVAL AB	28,392	311.800	8,852,625.600	
	KINNEVIK AB-B	21,722	343.900	7,470,195.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	587.400	5,267,215.800	

	ICA GRUPPEN AB	9,009	401.200	3,614,410.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,692	115.900	3,904,902.800	
	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	90.340	12,444,063.980	
	HEXAGON AB-B SHS	187,573	131.200	24,609,577.600	
	EPIROC AB-A	60,750	203.800	12,380,850.000	
	EPIROC AB-B	38,943	173.100	6,741,033.300	
	ESSITY AB-B	58,695	286.600	16,821,987.000	
	EQT AB	20,934	342.300	7,165,708.200	
	EMBRACER GROUP AB	24,571	222.900	5,476,875.900	
	KINNEVIK AB-B	21,722	174.000	3,779,628.000	
	EVOLUTION AB	16,591	1,422.800	23,605,674.800	
	NORDEA BANK ABP	315,042	95.400	30,055,006.800	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	292.700	4,374,401.500	
	SINCH AB	42,790	141.250	6,044,087.500	
スウェーデン・クローナ　小計		3,139,781		532,107,507.020 (6,837,581,465)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	9,728	1,158.500	11,269,888.000	
	A P MOLLER A/S	568	18,045.000	10,249,560.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	17,450.000	5,950,450.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	113.600	7,807,160.000	
	GENMAB A/S	6,269	2,689.000	16,857,341.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	474.300	9,614,535.300	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	3,200.000	2,601,600.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	164,338	544.600	89,498,474.800	
	GN STORE NORD A/S	11,641	551.400	6,418,847.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	98,601	241.700	23,831,861.700	
	COLOPLAST-B	10,734	1,049.500	11,265,333.000	
	DSV PANALPINA A S	19,457	1,519.500	29,564,911.500	
	DEMANT A/S	10,739	337.100	3,620,116.900	
	TRYG A/S	35,784	157.900	5,650,293.600	
	PANDORA A/S	9,639	857.800	8,268,334.200	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	9,336	561.800	5,244,964.800	
	AMBU A/S B	14,156	224.500	3,178,022.000	
	ORSTED A/S	18,540	926.600	17,179,164.000	
デンマーク・クローネ　小計		509,680		268,070,858.200 (4,715,366,396)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.460	822,285.960	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	13.090	647,287.410	
	A2 MILK CO LTD	62,165	7.600	472,454.000	
	FISHER & PAYKEL	57,388	30.000	1,721,640.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.890	780,556.470	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.550	404,357.700	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	5.220	648,125.640	
ニュージーランド・ドル　小計		624,747		5,496,707.180 (423,191,486)	

ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	223.800	9,668,607.600	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	56.400	7,277,630.400	
	TELENOR ASA	63,038	149.650	9,433,636.700	
	SCHIBSTED ASA	7,537	448.000	3,376,576.000	
	ORKLA ASA	65,283	89.680	5,854,579.440	
	EQUINOR ASA	91,961	177.660	16,337,791.260	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	476.600	7,240,983.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	201.600	3,363,292.800	
	ADEVINTA ASA	22,265	173.050	3,852,958.250	
	DNB BANK ASA	89,294	186.950	16,693,513.300	
	SCHIBSTED ASA	7,445	399.600	2,975,022.000	
ノルウェー・クローネ　小計		550,937		86,074,591.550 (1,092,286,567)	
ユーロ	CRH PLC	74,044	42.400	3,139,465.600	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	16,309	150.800	2,459,397.200	
	KERRY GROUP PLC-A	15,455	120.500	1,862,327.500	
	KINGSPAN GROUP PLC	13,452	84.860	1,141,536.720	
	UMICORE	17,654	51.340	906,356.360	
	AIR LIQUIDE	45,163	147.920	6,680,510.960	
	AIRBUS SE	56,608	112.760	6,383,118.080	
	AXA SA	180,491	21.815	3,937,411.160	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	50,630	25.950	1,313,848.500	
	ADIDAS AG	18,277	318.450	5,820,310.650	
	ASSICURAZIONI GENERALI	97,569	16.885	1,647,452.560	
	DASSAULT AVIATION SA	295	988.000	291,460.000	
	DANONE	62,825	59.460	3,735,574.500	
	SAFRAN SA	33,067	119.920	3,965,394.640	
	INTESA SANPAOLO	1,552,995	2.284	3,547,040.580	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30,673	87.680	2,689,408.640	
	ACCOR SA	17,380	31.410	545,905.800	
	BOUYGUES	21,417	31.760	680,203.920	
	BNP PARIBAS	107,956	50.930	5,498,199.080	
	THALES SA	10,448	89.820	938,439.360	
	CAPGEMINI SA	15,076	167.050	2,518,445.800	
	UNICREDIT SPA	203,331	9.745	1,981,460.590	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,537	158.150	2,615,326.550	
	COMMERZBANK AG	106,215	5.706	606,062.790	
	EIFFAGE	8,477	86.900	736,651.300	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	39,898	44.510	1,775,859.980	
	UNITED INTERNET	9,882	33.940	335,395.080	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	41.060	227,718.760	
	PUBLICIS GROUPE	19,879	53.160	1,056,767.640	
	FAURECIA	10,774	40.360	434,838.640	
	IBERDROLA SA	549,814	10.280	5,652,087.920	
	ENI SPA	238,596	10.080	2,405,047.680	

JERONIMO MARTINS	19,517	16.635	324,665.290	
KESKO OYJ-B	24,085	32.170	774,814.450	
KBC GROUPE	24,033	66.300	1,593,387.900	
HANNOVER RUECK SE	5,923	146.000	864,758.000	
WARTSILA OYJ	48,612	12.785	621,504.420	
L'OREAL	23,954	371.800	8,906,097.200	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,487	662.400	17,544,988.800	
GEA GROUP AG	13,284	35.070	465,869.880	
BOLLORE	71,347	4.494	320,633.410	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.752	560,174.380	
MICHELIN(CGDE)-B	16,350	137.100	2,241,585.000	
CONTINENTAL AG	10,336	118.640	1,226,263.040	
DEUTSCHE POST AG-REG	95,562	58.270	5,568,397.740	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	26.930	571,077.580	
OMV AG	12,817	47.040	602,911.680	
VERBUND AG	6,916	80.450	556,392.200	
PERNOD-RICARD	20,213	180.850	3,655,521.050	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	15,524	92.900	1,442,179.600	
RENAULT SA	19,019	33.500	637,136.500	
REPSOL SA	135,990	9.848	1,339,229.520	
REMY COINTREAU	1,860	178.400	331,824.000	
MERCK KGAA	11,875	169.500	2,012,812.500	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	47,367	57.750	2,735,444.250	
RWE AG	63,738	31.270	1,993,087.260	
SEB SA	2,439	148.700	362,679.300	
SOCIETE GENERALE-A	77,718	24.775	1,925,463.450	
VINCI S.A.	51,385	91.740	4,714,059.900	
SODEXO	9,325	76.120	709,819.000	
SOFINA	1,382	367.600	508,023.200	
SOLVAY SA	7,183	110.000	790,130.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,564	137.020	7,065,299.280	
VIVENDI SA	65,938	28.250	1,862,748.500	
SAP SE	99,580	124.720	12,419,617.600	
TELEFONICA S.A	527,117	3.764	1,984,068.380	
TOTALENERGIES SE	238,398	37.450	8,928,005.100	
VALEO	19,653	24.980	490,931.940	
E.ON SE	209,405	10.128	2,120,853.840	
VOEST-ALPINE AG	9,875	35.580	351,352.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	78.350	812,176.100	
SIEMENS AG-REG	73,136	132.840	9,715,386.240	
UPM-KYMMENE OYJ	54,222	33.190	1,799,628.180	
ING GROEP NV-CVA	367,322	10.876	3,994,994.070	
PUMA AG	10,448	102.900	1,075,099.200	
BAYER AG	92,074	50.830	4,680,121.420	
STORA ENSO OYJ-R SHS	51,891	16.110	835,964.010	

HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	15,809	87.760	1,387,397.840	
DAIMLER AG	82,448	72.890	6,009,634.720	
BASF SE	88,762	68.010	6,036,703.620	
BEIERSDORF AG	10,342	102.150	1,056,435.300	
HEIDELBERGCEMENT AG	15,297	74.620	1,141,462.140	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	69.000	1,363,026.000	
ASM INTERNATIONAL NV	4,578	278.700	1,275,888.600	
ORANGE	184,093	9.485	1,746,122.100	
SAMPO OYJ-A SHS	46,965	39.650	1,862,162.250	
RANDSTAD NV	11,017	65.160	717,867.720	
ALLIANZ SE	39,464	212.100	8,370,314.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.636	1,245,396.490	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,453	25.340	2,469,459.020	
HERMES INTL	2,960	1,235.500	3,657,080.000	
ENDESA S.A.	27,736	21.250	589,390.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	27,990	10.056	281,467.440	
ERSTE GROUP BANK AG	24,204	31.090	752,502.360	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,138	230.850	3,032,907.300	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,239	26.290	1,767,713.310	
DASSAULT SYSTEMES SA	64,065	42.625	2,730,770.620	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21,734	22.120	480,756.080	
HEINEKEN NV	24,566	99.140	2,435,473.240	
AKZO NOBEL	18,548	105.250	1,952,177.000	
ASML HOLDING NV	39,970	583.100	23,306,507.000	
AEGON NV	189,323	3.554	672,853.940	
VOLKSWAGEN AG	2,758	281.200	775,549.600	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,670	212.350	3,752,224.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	643,572	5.227	3,363,950.840	
KERING	7,187	731.200	5,255,134.400	
CNP ASSURANCES	13,987	14.670	205,189.290	
FORTUM OYJ	39,409	23.060	908,771.540	
AGEAS	17,055	46.840	798,856.200	
UCB SA	12,778	90.300	1,153,853.400	
NEMETSCHEK SE	5,095	67.000	341,365.000	
CARREFOUR SA	61,189	16.350	1,000,440.150	
NATURGY ENERGY GROUP SA	23,612	22.070	521,116.840	
ATOS SE	8,972	52.740	473,183.280	
NOKIA OYJ	510,419	4.654	2,375,490.020	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	88,323	39.060	3,449,896.380	
WOLTERS KLUWER-CVA	26,053	86.600	2,256,189.800	
SANOFI	107,938	87.220	9,414,352.360	
STMICROELECTRONICS NV	62,523	32.115	2,007,926.140	
ELISA OYJ	13,642	51.520	702,835.840	

BANCO SANTANDER SA	1,669,723	3.129	5,224,563.260	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	15.750	747,384.750	
QIAGEN N.V.	20,763	42.700	886,580.100	
DEUTSCHE BANK AG-REG	188,943	10.500	1,983,901.500	
BMW VORZUG	6,976	75.000	523,200.000	
ENEL SPA	774,910	7.924	6,140,386.840	
COLRUYT NV	4,673	46.900	219,163.700	
VOPAK (KON.)	5,364	38.130	204,529.320	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	311,165	18.000	5,600,970.000	
SARTORIUS AG	2,441	465.000	1,135,065.000	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	59.780	459,469.080	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	122,634	33.110	4,060,411.740	
RATIONAL AG	479	798.600	382,529.400	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	166.250	626,928.750	
BECHTLE AG	2,511	161.350	405,149.850	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.684	916,443.740	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,226	101.580	1,343,497.080	
TELEPERFORMANCE	5,626	348.000	1,957,848.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,989	144.450	2,598,511.050	
EURAZEO	3,007	73.800	221,916.600	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,904	95.380	944,643.520	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,004	84.300	843,337.200	
INDITEX	102,523	29.730	3,048,008.790	
ESSILORLUXOTTICA	26,761	154.340	4,130,292.740	
SNAM SPA	198,963	4.892	973,326.990	
CREDIT AGRICOLE SA	108,321	11.794	1,277,537.870	
ORPEA	4,932	106.650	525,997.800	
ENAGAS	23,477	18.330	430,333.410	
WENDEL	2,220	109.700	243,534.000	
TENARIS SA	52,985	9.002	476,970.970	
TELECOM ITALIA SPA	1,123,551	0.391	439,308.440	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.428	212,971.080	
ATLANTIA SPA	45,299	15.440	699,416.560	
ILIAD SA	1,046	120.550	126,095.300	
PROXIMUS	13,739	16.545	227,311.750	
TERNA SPA	126,172	6.422	810,276.580	
BIOMERIEUX	3,248	93.820	304,727.360	
GRIFOLS SA	30,687	21.680	665,294.160	
FERROVIAL SA	46,794	25.460	1,191,375.240	
LANXESS AG	6,856	58.420	400,527.520	
NESTE OYJ	39,886	52.280	2,085,240.080	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	18.890	338,338.790	
RECORDATI SPA	10,303	50.200	517,210.600	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	11.180	618,298.720	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,873	213.800	1,041,847.400	

KONE OYJ	32,102	69.760	2,239,435.520	
ELIA GROUP	2,862	90.650	259,440.300	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,771	434.300	1,203,445.300	
ENGIE	166,851	11.606	1,936,472.700	
ALSTOM	26,382	37.830	998,031.060	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	11.375	623,099.750	
IPSEN SA	3,646	88.000	320,848.000	
DEUTSCHE WOHNEN	33,021	51.580	1,703,223.180	
ARKEMA SA	6,393	106.800	682,772.400	
LEGRAND SA	25,357	91.700	2,325,236.900	
AMPLIFON SPA	11,372	38.070	432,932.040	
ADP	2,313	111.050	256,858.650	
ORION OYJ	8,051	37.210	299,577.710	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	8.978	359,910.060	
SYMRISE AG	12,698	120.200	1,526,299.600	
SCOR SE	15,667	25.590	400,918.530	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	46.390	1,123,936.920	
PRYSMIAN SPA	22,328	30.520	681,450.560	
DIASORIN SPA	2,223	160.650	357,124.950	
CAIXABANK	394,299	2.555	1,007,433.940	
BUREAU VERITAS SA	29,810	26.850	800,398.500	
GETLINK	50,458	13.860	699,347.880	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	20.480	572,866.560	
SUEZ SA	34,245	19.545	669,318.520	
AMADEUS IT GROUP SA	43,588	57.580	2,509,797.040	
BRENNTAG SE	14,044	81.860	1,149,641.840	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	28.730	670,558.200	
EDENRED	24,865	48.610	1,208,687.650	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.430	239,075.550	
LEG IMMOBILIEN SE	6,537	130.800	855,039.600	
KION GROUP AG	7,508	92.260	692,688.080	
VONOVIA SE	51,151	57.620	2,947,320.620	
KNORR-BREMSE AG	6,860	96.160	659,657.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	26,679	53.220	1,419,856.380	
FERRARI NV	11,553	176.000	2,033,328.000	
CNH INDUSTRIAL NV	101,681	13.675	1,390,487.670	
AROUNDTOWN SA	106,018	6.664	706,503.950	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	49.030	396,750.760	
MONCLER SPA	17,567	56.360	990,076.120	
NEXI SPA	43,586	18.540	808,084.440	
TEAMVIEWER AG	13,668	28.120	384,344.160	
PROSUS NV	45,840	77.360	3,546,182.400	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	21,717	1.250	27,146.250	
JDE PEET'S BV	7,308	31.130	227,498.040	

	SIEMENS ENERGY AG	35,831	25.880	927,306.280	
	INPOST SA	20,395	17.696	360,909.920	
	WORLDLINE SA	23,570	80.830	1,905,163.100	
	NN GROUP NV	28,556	40.620	1,159,944.720	
	FINECOBANK SPA	53,818	14.950	804,579.100	
	ARGENX SE	4,403	261.900	1,153,145.700	
	IBERDROLA SA-RTS	549,814	0.255	140,202.570	
	ZALANDO SE	15,459	101.500	1,569,088.500	
	STELLANTIS NV	195,811	16.486	3,228,140.140	
	AENA SME SA	7,240	138.650	1,003,826.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	49,741	54.560	2,713,868.960	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,836	74.890	1,260,848.040	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	10.050	344,222.550	
	EXOR NV	9,966	66.700	664,732.200	
	SCOUT24 AG	9,670	70.820	684,829.400	
	COVESTRO AG	19,158	56.140	1,075,530.120	
	HELLOFRESH SE	15,236	82.340	1,254,532.240	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	70,978	58.880	4,179,184.640	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	10.995	612,960.250	
	AMUNDI SA	5,924	75.800	449,039.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	39,494	9.702	383,170.780	
	ADYEN NV	1,855	2,118.500	3,929,817.500	
	UNIPER SE	10,427	31.650	330,014.550	
	DELIVERY HERO SE	14,389	119.150	1,714,449.350	
ユーロ　小計		18,651,499		451,067,277.790 (59,008,621,280)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	18.180	2,981,520.000	
	BANK OF EAST ASIA	103,860	13.720	1,424,959.200	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	77.250	12,514,500.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	49,500	45.250	2,239,875.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	112,740	490.000	55,242,600.000	
	MTR CORP	126,000	44.200	5,569,200.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	152.500	11,559,500.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	115,450	36.400	4,202,380.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	47.300	6,905,800.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,074,456	12.240	13,151,341.440	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	59.600	13,350,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	317,500	25.400	8,064,500.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	37.350	6,090,515.100	
	SINO LAND CO	255,400	12.480	3,187,392.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	120,500	113.500	13,676,750.000	

	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	51.500	2,549,250.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	130,500	131.300	17,134,650.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	30.950	5,137,700.000	
	SJM HOLDINGS LTD	156,000	8.170	1,274,520.000	
	WYNN MACAU LTD	124,400	11.640	1,448,016.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	17.100	3,714,120.000	
	AIA GROUP LTD	1,153,827	94.550	109,094,342.850	
	HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.520	4,681,400.000	
	SANDS CHINA LTD	252,000	30.850	7,774,200.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	22.350	2,328,870.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	43.750	6,551,562.500	
	ESR CAYMAN LTD	203,800	24.700	5,033,860.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.850	1,805,500.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	23.600	3,554,160.000	
	WH GROUP LTD	897,000	6.610	5,929,170.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	260,832	57.650	15,036,964.800	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	52.900	11,893,612.800	
香港・ドル　小計		8,125,713		365,103,131.690 (5,177,162,407)	
合計		105,384,157		560,116,074,613 (560,116,074,613)	

（２）株式以外の有価証券

2021年7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	118,215.000	1,221,160.950	
		GOODMAN GROUP	160,839.000	3,432,304.260	
		GPT GROUP	207,292.000	1,003,293.280	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,213,386.250	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,315,027.500	
		STOCKLAND	243,481.000	1,102,968.930	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	578,010.600	
	オーストラリア・ドル　小計		2,000,913.000	9,866,151.770 (812,674,921)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	292,606.000	880,744.060	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	498,836.000	1,067,509.040	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	421,137.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	567,210.000	

	シンガポール・ドル　小計		1,253,842.000	2,936,600.100 (239,421,006)	
投資信託受益証券　合計			3,254,755	1,052,095,927 (1,052,095,927)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	46,028.000	777,412.920	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,466.000	2,375,396.300	
		AMERICAN TOWER CORP	42,405.000	11,807,672.250	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	127,559.000	1,136,550.690	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,300.000	2,937,039.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,704,706.330	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,873.000	1,252,690.140	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	41,234.000	8,317,722.480	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	26,971.000	4,201,002.960	
		DUKE REALTY TRUST	35,962.000	1,792,705.700	
		EQUINIX INC	8,565.000	7,026,040.800	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,554.000	1,221,611.160	
		EQUITY RESIDENTIAL	32,922.000	2,690,056.620	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,408.000	2,052,097.920	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,714.000	2,201,937.660	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,842,314.760	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	63,952.000	1,094,218.720	
		INVITATION HOMES INC	54,837.000	2,187,996.300	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,243,965.600	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	53,911.000	1,105,175.500	
		MID AMERICA	11,430.000	2,065,401.000	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	743,614.050	
		PROLOGIS INC	70,664.000	8,860,558.960	
		PUBLIC STORAGE	15,117.000	4,711,666.560	
		REALTY INCOME CORP	35,640.000	2,454,526.800	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	942,579.990	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,565.000	3,479,371.450	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	30,857.000	4,001,844.330	
		SUN COMMUNITIES INC	10,801.000	1,953,576.870	
		UDR INC	26,674.000	1,385,981.040	
		VENTAS INC	35,060.000	2,055,918.400	
		VEREIT INC	19,960.000	950,894.400	
		VICI PROPERTIES INC	48,258.000	1,517,231.520	
		VORNADO REALTY TRUST	17,313.000	805,400.760	
		WELLTOWER INC	39,394.000	3,404,823.420	
		WEYERHAEUSER CO	69,174.000	2,477,812.680	
		WP CAREY INC	15,529.000	1,210,796.130	

	アメリカ・ドル　小計		1,190,581.000	101,990,312.170 (11,236,272,693)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	69,819.000	359,707.480	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	509,904.860	
		SEGRO PLC	116,375.000	1,355,186.870	
	イギリス・ポンド　小計		260,222.000	2,224,799.210 (340,639,007)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	503,803.800	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	309,741.000	
	カナダ・ドル　小計		21,687.000	813,544.800 (71,949,902)	
	ユーロ	COVIVIO	4,663.000	361,382.500	
		GECINA SA	4,763.000	632,764.550	
		KLEPIERRE	17,099.000	378,913.840	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	974,555.600	
	ユーロ　小計		39,445.000	2,347,616.490 (307,115,189)	
	香港・ドル	LINK REIT	204,300.000	15,148,845.000	
	香港・ドル　小計		204,300.000	15,148,845.000 (214,810,622)	
投資証券　合計			1,716,235	12,170,787,413 (12,170,787,413)	
合計				13,222,883,340 (13,222,883,340)	

（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　600銘柄	69.67	－	－	72.65
	投資証券　37銘柄	－	－	1.93	
イギリス・ポンド	株式　83銘柄	4.42	－	－	4.54
	投資証券　3銘柄	－	－	0.06	
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	0.10	－	－	0.10
オーストラリア・ドル	株式　57銘柄	2.04	－	－	2.21
	投資信託受益証券　7銘柄	－	0.14	－	
カナダ・ドル	株式　89銘柄	3.47	－	－	3.53
	投資証券　2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式　14銘柄	0.28	－	－	0.32
	投資信託受益証券　4銘柄	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式　40銘柄	3.04	－	－	3.09

スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	1.18	－	－	1.19
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.81	－	－	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	0.19	－	－	0.19
ユーロ	株式	233銘柄	10.14	－	－	10.35
	投資証券	4銘柄	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	32銘柄	0.89	－	－	0.94
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,669,273,393
投資証券	225,543,871,920
派生商品評価勘定	25,235,650
未収入金	227,854,584
未収配当金	550,770,967
差入委託証拠金	106,122,500
流動資産合計	228,123,129,014
資産合計	228,123,129,014
負債の部	
流動負債	
前受金	18,793,500
未払解約金	386,598,000
流動負債合計	405,391,500
負債合計	405,391,500
純資産の部	
元本等	
元本	88,905,630,284
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	138,812,107,230
元本等合計	227,717,737,514
純資産合計	227,717,737,514
負債純資産合計	228,123,129,014

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	31,200,083,619円
同期中追加設定元本額	84,542,252,023円
同期中一部解約元本額	26,836,705,358円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	192,640円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	833,782円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	986,795円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,550,457円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,471,035円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,304,002円
たわらノーロード　国内リート	4,414,056,062円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	956,546,645円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,004,134,101円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	18,992,809円
たわらノーロード　バランス（標準型）	334,703,683円
たわらノーロード　バランス（積極型）	356,979,872円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	116,496,182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）	308,691,788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）	189,356,059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）	246,208,145円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,224,459円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	10,831,634円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,938,645円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,079,917円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,109,534円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	387,435,662円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,214,817円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	130,509,613円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	147,057,515円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	285,082,794円
投資のソムリエ	11,266,486,563円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	588,529,726円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	118,464,447円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	396,175,614円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,008,972,226円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	11,837,774円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	5,695,515円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,754,462円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	30,903,542円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,670,169,314円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	99,385,511円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	8,979,467円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	4,349,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	3,652,744円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	39,913円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	41,444,362円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１２１２（適格機関投資家限定）	82,472,566円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	741,796,987円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	23,665,569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）	318,933,557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）	28,811,478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）	171,767,818円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	14,548,333円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	202,133,368円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	79,655,059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）	249,553,186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）	23,107,305円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	133,666,329円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	317,295,468円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,595,185,937円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	295,826,570円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	606,595,127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）	38,956,719円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,483,597,340円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,655,355,393円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	41,496,552,323円

MHAM　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	3,041,635,281円
MHAM　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	104,653,348円
計	88,905,630,284円
２．　受益権の総数	88,905,630,284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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
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7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	3,534,400,216
合計	3,534,400,216

（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6月8日から2021年7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	1,997,534,000	－	2,022,872,500	25,338,500
合計	1,997,534,000	－	2,022,872,500	25,338,500

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.5613円 (25,613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7月12日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	6,113	1,220,154,800	
	ＧＬＰ投資法人	61,663	11,808,464,500	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	17,258	2,847,570,000	

Ｏｎｅリート投資法人	2,978	1,019,965,000	
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	5,024	851,065,600	
いちごオフィスリート投資法人	15,656	1,560,903,200	
いちごホテルリート投資法人	3,341	324,077,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,574	4,921,036,000	
アドバンス・レジデンス投資法人	18,149	7,023,663,000	
イオンリート投資法人	19,380	3,234,522,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	121,419	2,753,782,920	
インヴィンシブル投資法人	79,892	3,651,064,400	
エスコンジャパンリート投資法人	3,123	466,888,500	
オリックス不動産投資法人	38,070	8,097,489,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	13,268	1,683,709,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	5,911	4,699,245,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,022	3,135,697,600	
ケネディクス商業リート投資法人	7,600	2,278,480,000	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,590	3,247,020,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,678	477,404,400	
サンケイリアルエステート投資法人	4,675	625,047,500	
ザイマックス・リート投資法人	2,927	368,802,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	61,554	4,173,361,200	
ジャパンエクセレント投資法人	17,729	2,765,724,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	19,107	13,413,114,000	
スターアジア不動産投資法人	19,631	1,262,273,300	
スターツプロシード投資法人	2,975	748,510,000	
タカラレーベン不動産投資法人	5,742	753,350,400	
トーセイ・リート投資法人	4,227	607,419,900	
ヒューリックリート投資法人	15,839	2,980,899,800	
フロンティア不動産投資法人	6,698	3,442,772,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,075	636,922,500	
マリモ地方創生リート投資法人	1,790	238,965,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	40,862	6,913,850,400	
ラサールロジポート投資法人	23,112	4,513,773,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	7,411	1,217,627,300	
阪急阪神リート投資法人	8,630	1,485,223,000	

	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,669	3,981,393,000	
	三菱地所物流リート投資法人	4,805	2,311,205,000	
	産業ファンド投資法人	27,008	5,828,326,400	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	4,138	582,630,400	
	森トラスト総合リート投資法人	13,656	2,191,788,000	
	森ヒルズリート投資法人	22,444	3,770,592,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2,907	2,055,249,000	
	積水ハウス・リート投資法人	56,198	5,423,107,000	
	大江戸温泉リート投資法人	3,084	265,532,400	
	大和ハウスリート投資法人	27,261	8,750,781,000	
	大和証券オフィス投資法人	4,039	3,211,005,000	
	大和証券リビング投資法人	24,950	3,093,800,000	
	投資法人みらい	20,635	1,149,369,500	
	東急リアル・エステート投資法人	12,810	2,619,645,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,585	4,569,990,000	
	日本ビルファンド投資法人	21,504	15,138,816,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	11,896	5,150,968,000	
	日本プロロジスリート投資法人	30,207	10,768,795,500	
	日本リート投資法人	6,206	2,739,949,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	12,484	4,213,350,000	
	日本都市ファンド投資法人	95,170	11,277,645,000	
	福岡リート投資法人	9,882	1,843,981,200	
	平和不動産リート投資法人	12,346	2,213,637,800	
	野村不動産マスターファンド投資法人	61,787	10,942,477,700	
投資証券　合計		1,199,364	225,543,871,920	
合計			225,543,871,920	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	808,753,760
コール・ローン	222,128,987
投資信託受益証券	7,988,019,602
投資証券	68,695,168,674
派生商品評価勘定	718,889
未収入金	859,725
未収配当金	256,355,250
流動資産合計	77,972,004,887
資産合計	77,972,004,887
負債の部	
流動負債	
未払金	811,040,177
未払解約金	32,142,000
流動負債合計	843,182,177
負債合計	843,182,177
純資産の部	
元本等	
元本	49,591,590,500
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	27,537,232,210
元本等合計	77,128,822,710
純資産合計	77,128,822,710
負債純資産合計	77,972,004,887

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	45,737,709,443円
同期中追加設定元本額	54,960,779,150円
同期中一部解約元本額	51,106,898,093円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	91,990,088円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	49,238,929円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,083,509円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	13,470,885円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	15,934,138円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	40,885,716円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	23,759,753円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	21,049,235円
たわらノーロード　先進国リート	9,321,016,978円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,473,072,444円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	353,754,549円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,662,547,045円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	15,786,182円

たわらノーロード　バランス（標準型）	278,186,328円
たわらノーロード　バランス（積極型）	548,261,139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）	50,829,713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）	104,623,153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）	220,176,902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）	3,997,304円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,662,141円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	8,139,586円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	686,947,006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	49,505,985円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	214,771,724円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	257,640,235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	14,848,949,235円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	771,021,943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	439,247,237円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,446,583,846円
ワールドアセットバランス（基本コース）	589,151,400円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,946,220,424円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	19,336,040円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,275,009円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,161,748円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	45,837,621円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,892,926,022円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	164,545,219円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	13,208,529円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,092,385円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,106,293円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	65,820円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	450,725,450円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	159,568,116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）	110,155,096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）	155,649,285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）	133,490,763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）	149,211,411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）	68,299,457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）	66,623,991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）	107,329,681円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ２０２１－０４（適格機関投資家限定）	512,635,886円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	388,226,702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）	179,930,919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）	118,752,457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）	287,088,553円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,805,484,457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）	340,995,307円
ＤＩＡＭ海外リートインデックスファンド（適格機関投資家限定）	554,744,495円
計	49,591,590,500円
２．　受益権の総数	49,591,590,500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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年7月12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	59,009,395
投資証券	919,115,258
合計	978,124,653

（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6月23日から2021年7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	22,033,600	－	22,033,480	120
アメリカ・ドル	22,033,600	－	22,033,480	120
買建	106,012,610	－	106,731,379	718,769
オーストラリア・ドル	58,750,560	－	59,306,184	555,624
シンガポール・ドル	30,059,170	－	30,165,619	106,449
ニュージーランド・ドル	3,052,880	－	3,079,576	26,696
香港・ドル	14,150,000	－	14,180,000	30,000
合計	128,046,210	－	128,764,859	718,889

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5553円 (15,553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7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	322,000.000	259,210.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	658,400.000	526,720.000	
		PRIME US REIT	211,400.000	179,690.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,264,500.000	965,620.000 (106,382,355)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	172,535.000	552,112.000	
		APN INDUSTRIA REIT	59,289.000	198,025.260	
		ARENA REIT	159,242.000	589,195.400	
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	161,015.000	505,587.100	
		BWP TRUST	213,381.000	909,003.060	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	264,230.000	790,047.700	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	212,974.000	790,133.540	
		CENTURIA OFFICE REIT	179,274.000	435,635.820	
		CHARTER HALL GROUP	212,582.000	3,233,372.220	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	242,311.000	1,182,477.680	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	236,221.000	871,655.490	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	141,304.000	512,933.520	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	865,185.000	778,666.500	
		DEXUS	498,671.000	5,151,271.430	
		GDI PROPERTY GROUP	212,082.000	233,290.200	
		GOODMAN GROUP	763,063.000	16,283,764.420	
		GPT GROUP	877,934.000	4,249,200.560	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	125,818.000	499,497.460	
		HOME CONSORTIUM LTD	77,683.000	416,380.880	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	213,110.000	317,533.900	

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,965.000	239,646.600	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	134,675.000	808,050.000	
	IRONGATE GROUP	225,633.000	333,936.840	
	MIRVAC GROUP	1,792,441.000	5,251,852.130	
	NATIONAL STORAGE REIT	474,917.000	987,827.360	
	RURAL FUNDS GROUP	160,193.000	398,880.570	
	SCENTRE GROUP	2,355,582.000	6,383,627.220	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	476,191.000	1,138,096.490	
	STOCKLAND	1,086,958.000	4,923,919.740	
	VICINITY CENTRES	1,768,433.000	2,749,913.310	
	WAYPOINT REIT LTD	359,566.000	938,467.260	
オーストラリア・ドル　小計		14,796,458.000	62,654,001.660 (5,160,810,116)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	216,895.000	340,525.150	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	587,880.000	517,334.400	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,498,560.000	4,510,665.600	
	ASCOTT TRUST	815,116.000	864,022.960	
	CAPITALAND CHINA TRUST	450,180.000	616,746.600	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,038,709.000	4,362,837.260	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	322,700.000	406,602.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	103,831.000	
	ESR REIT	1,148,730.000	516,928.500	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	491,500.000	289,985.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	608,800.000	161,332.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	591,700.000	1,467,416.000	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	377,100.000	197,977.500	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,286,964.000	1,917,576.360	
	IREIT GLOBAL	225,300.000	144,192.000	
	KEPPEL DC REIT	561,500.000	1,448,670.000	
	KEPPEL REIT	877,500.000	1,044,225.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	422,200.000	369,425.000	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	2,759,100.000	176,582.400	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,003,900.000	2,198,541.000	

		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	888,120.000	2,540,023.200	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,331,320.000	2,795,772.000	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	944,700.000	973,041.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	1,120,355.000	487,354.420	
		PARKWAY LIFE REIT	179,000.000	843,090.000	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	313,200.000	134,676.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	208,100.000	201,857.000	
		SPH REIT	471,900.000	436,507.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	656,800.000	387,512.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	951,690.000	1,446,568.800	
	シンガポール・ドル　小計		23,476,919.000	31,901,817.650 (2,600,955,193)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	131,740.000	331,984.800	
	ユーロ　小計		131,740.000	331,984.800 (43,430,252)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	641,000.000	5,390,810.000	
	香港・ドル　小計		641,000.000	5,390,810.000 (76,441,686)	
投資信託受益証券　合計			40,310,617	7,988,019,602 (7,988,019,602)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	39,380.000	860,453.000	
		AGREE REALTY CORP	30,274.000	2,192,745.820	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	33,220.000	611,912.400	
		ALEXANDER'S INC.	989.000	267,039.890	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	62,267.000	11,864,976.850	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	23,736.000	896,983.440	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	62,839.000	3,095,449.140	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	50,312.000	418,595.840	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	124,543.000	5,136,153.320	
		AMERICOLD REALTY TRUST	114,906.000	4,497,420.840	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	71,427.000	3,567,778.650	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	68,881.000	495,254.390	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	92,641.000	1,393,320.640	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	27,874.000	376,856.480	

		AVALONBAY COMMUNITIES INC	63,355.000	13,990,684.650	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,643.000	112,496.510	
		BOSTON PROPERTIES INC	64,523.000	7,560,159.910	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	77,648.000	1,083,189.600	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	132,231.000	3,066,436.890	
		BROADSTONE NET LEASE INC	69,043.000	1,688,101.350	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	17,653.000	335,053.940	
		BRT APARTMENTS CORP	3,832.000	67,864.720	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	44,399.000	6,268,250.820	
		CARETRUST REIT INC	42,613.000	1,011,632.620	
		CENTERSPACE	6,060.000	498,010.800	
		CHATHAM LODGING TRUST	22,362.000	278,406.900	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	12,476.000	107,917.400	
		CITY OFFICE REIT INC	20,935.000	256,244.400	
		CLIPPER REALTY INC	5,086.000	40,230.260	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	52,023.000	893,234.910	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	10,481.000	518,599.880	
		COREPOINT LODGING INC	19,106.000	214,751.440	
		CORESITE REALTY CORP	19,121.000	2,645,007.930	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	50,025.000	1,467,233.250	
		COUSINS PROPERTIES INC	66,100.000	2,517,088.000	
		CTO REALTY GROUTH INC	2,965.000	163,223.250	
		CUBESMART	91,696.000	4,448,172.960	
		CYRUSONE INC	55,773.000	4,161,223.530	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	95,324.000	896,045.600	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	127,740.000	19,896,782.400	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	215,691.000	1,658,663.790	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	112,836.000	464,884.320	
		DOUGLAS EMMETT INC	73,354.000	2,507,239.720	
		DUKE REALTY TRUST	170,312.000	8,490,053.200	
		EAST GROUP	18,172.000	3,108,502.320	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	37,693.000	812,284.150	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	62,535.000	766,053.750	
		EPR PROPERTIES	33,157.000	1,745,384.480	
		EQUINIX INC	40,623.000	33,323,859.360	
		EQUITY COMMONWEALTH	54,407.000	1,458,107.600	

		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	77,072.000	6,053,234.880	
		EQUITY RESIDENTIAL	156,171.000	12,760,732.410	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	51,992.000	1,454,736.160	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	29,515.000	9,451,883.600	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	60,712.000	10,514,711.280	
		FARMLAND PARTNERS INC	11,176.000	139,252.960	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	32,220.000	3,803,571.000	
		FIRST INDUSTRIAL RT	58,850.000	3,177,900.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	34,554.000	995,500.740	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	46,648.000	246,767.920	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	99,552.000	4,664,011.200	
		GEO GROUP INC	57,104.000	407,722.560	
		GETTY REALTY CORP	16,951.000	549,042.890	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	16,822.000	379,840.760	
		GLADSTONE LAND CORP	11,352.000	265,409.760	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	25,732.000	391,641.040	
		GLOBAL NET LEASE INC	45,023.000	836,977.570	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	62,877.000	1,928,437.590	
		HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	97,360.000	2,654,033.600	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	244,770.000	8,508,205.200	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618.000	171,830.120	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	46,219.000	2,133,469.040	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	321,066.000	5,493,439.260	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	66,972.000	1,869,858.240	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	46,758.000	886,999.260	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	29,984.000	797,574.400	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,626.000	2,167,491.480	
		INVITATION HOMES INC	257,725.000	10,283,227.500	
		IRON MOUNTAIN INC	131,268.000	5,741,662.320	
		JBG SMITH PROPERTIES	48,926.000	1,557,803.840	
		KILROY REALTY CORP	48,281.000	3,415,880.750	
		KIMCO REALTY	197,291.000	4,184,542.110	
		KITE REALTY GROUP TRUST	37,064.000	796,876.000	
		LEXINGTON REALTY TRUST	122,911.000	1,506,888.860	

LIFE STORAGE INC	34,987.000	3,988,518.000	
LTC PROPERTIES INC	17,932.000	698,810.040	
MACK CALI	39,452.000	691,593.560	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	267,445.000	5,482,622.500	
MID AMERICA	51,988.000	9,394,231.600	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	44,869.000	839,947.680	
NATIONAL HEALTH INVS INC	21,180.000	1,427,532.000	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	79,945.000	3,810,978.150	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	30,538.000	1,609,352.600	
NETSTREIT CORP	10,996.000	269,072.120	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP INC	37,108.000	335,456.320	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	10,397.000	593,460.760	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	22,164.000	642,534.360	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	107,144.000	3,984,685.360	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	7,856.000	229,002.400	
PARAMOUNT GROUP INC	72,807.000	736,806.840	
PARK HOTELS & RESORTS INC	105,061.000	2,064,448.650	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	58,512.000	1,345,776.000	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	65,418.750	
PHYSICIANS REALTY TRUST	98,370.000	1,833,616.800	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	57,283.000	1,074,056.250	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,046.000	270,965.420	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	24,152.000	246,591.920	
PROLOGIS INC	335,439.000	42,060,696.210	
PS BUSINESS PARKS	8,948.000	1,372,354.760	
PUBLIC STORAGE	69,054.000	21,522,750.720	
QTS REALTY TRUST INC	30,578.000	2,373,464.360	
REALTY INCOME CORP	169,571.000	11,678,354.770	
REGENCY CENTERS CORP	71,871.000	4,672,333.710	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	52,231.000	926,055.630	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	97,638.000	1,131,624.420	
RETAIL VALUE INC	8,794.000	190,038.340	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	61,058.000	3,587,768.080	

	RLJ LODGING TRUST	76,242.000	1,097,122.380	
	RPT REALTY	37,794.000	490,188.180	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	24,442.000	1,903,787.380	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	98,359.000	1,823,575.860	
	SAFEHOLD INC	6,652.000	558,834.520	
	SAUL CENTERS INC	6,198.000	282,752.760	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	19,306.000	334,379.920	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	76,025.000	949,552.250	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	149,042.000	19,329,256.980	
	SITE CENTERS CORP	74,473.000	1,127,521.220	
	SL GREEN	30,845.000	2,430,277.550	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	51,124.000	2,490,250.040	
	STAG INDUSTRIAL INC	71,053.000	2,773,909.120	
	STORE CAPITAL CORP	110,821.000	3,977,365.690	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	48,846.000	447,429.360	
	SUN COMMUNITIES INC	50,782.000	9,184,940.340	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,104.000	1,208,255.280	
	TANGER FACTORY OUTLET	47,408.000	898,381.600	
	TERRENO REALTY CORP	30,889.000	2,063,694.090	
	THE MACERICH COMPANY	73,985.000	1,322,851.800	
	UDR INC	134,876.000	7,008,156.960	
	UMH PROPERTIES INC	18,196.000	400,857.880	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,995.000	371,030.550	
	URBAN EDGE PROPERTIES	49,883.000	944,784.020	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	14,440.000	276,237.200	
	VENTAS INC	170,330.000	9,988,151.200	
	VEREIT INC	104,217.000	4,964,897.880	
	VICI PROPERTIES INC	243,970.000	7,670,416.800	
	VORNADO REALTY TRUST	71,538.000	3,327,947.760	
	WASHINGTON REIT	39,905.000	974,480.100	
	WEINGARTEN REALTY INVST	53,192.000	1,731,399.600	
	WELLTOWER INC	189,442.000	16,373,472.060	
	WHITESTONE REIT	17,850.000	144,763.500	
	WP CAREY INC	80,886.000	6,306,681.420	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	52,488.000	968,403.600	
アメリカ・ドル　小計		10,002,531.000	521,684,099.540 (57,473,937,245)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	83,963.000	83,459.220	
	ASSURA PLC	1,181,756.000	904,043.340	

	BIG YELLOW GROUP PLC	75,855.000	1,055,901.600	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	370,408.000	348,183.520	
	BRITISH LAND CO PLC	427,598.000	2,202,984.890	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	382,370.000	658,823.510	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	294,033.000	342,254.410	
	CUSTODIAN REIT PLC	202,920.000	201,905.400	
	DERWENT LONDON PLC	51,200.000	1,783,808.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	281,997.000	255,771.270	
	GCP STUDENT LIVING PLC	210,196.000	407,780.240	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	111,957.000	841,916.640	
	HAMMERSON PLC	1,850,011.000	714,104.240	
	HOME REIT PLC	100,813.000	114,422.750	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	153,417.000	176,736.380	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	338,593.000	2,332,228.580	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	409,522.000	1,005,786.030	
	LXI REIT PLC	271,372.000	388,061.960	
	NEWRIVER REIT PLC	139,604.000	121,455.480	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	257,572.000	241,602.530	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	586,897.000	929,057.950	
	REGIONAL REIT LTD	206,337.000	186,734.980	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	93,123.000	951,717.060	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	255,156.000	125,791.900	
	SEGRO PLC	544,441.000	6,340,015.440	
	SHAFTESBURY PLC	137,986.000	839,644.810	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	131,101.430	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	371,767.000	440,543.890	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	177,390.000	185,904.720	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	785,580.000	1,624,579.440	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	347,914.000	280,070.770	
	UNITE GROUP PLC	181,588.000	2,080,090.540	
	WORKSPACE GROUP PLC	57,883.000	494,899.650	
イギリス・ポンド　小計		11,351,850.000	28,791,382.570 (4,408,248,585)	

イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	79,692.000	1,381,859.280	
イスラエル・シュケル　小計		79,692.000	1,381,859.280 (46,461,564)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	27,463.000	1,267,417.450	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	31,111.000	363,998.700	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,088.000	90,159.360	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,704.000	432,701.360	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	38,609.000	2,366,345.610	
	CHOICE PROPERTIES REIT	70,289.000	1,045,900.320	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	38,144.000	434,460.160	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	21,592.000	397,724.640	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,180.000	412,269.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	42,899.000	690,673.900	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10,554.000	246,224.820	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	48,389.000	881,647.580	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,841.000	1,283,004.450	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	63,562.000	1,080,554.000	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	31,544.000	564,637.600	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,752.000	521,524.640	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,825.000	217,183.250	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	152,691.570	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	43,997.000	573,720.880	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	94,810.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	71,411.000	1,642,453.000	
	SLATE GROCERY REIT	10,657.000	141,205.250	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	62,823.600	
	SMARTCENTRES REIT	31,024.000	944,370.560	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	37,879.000	698,867.550	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	22,019.000	164,481.930	

	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,145.000	439,760.650	
カナダ・ドル　小計		790,506.000	17,211,612.430 (1,522,195,003)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	388,009.000	655,735.210	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	496,347.000	1,211,086.680	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	682,186.000	808,390.410	
	PRECINCT PROPERTIES	562,911.000	956,948.700	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	180,112.000	595,270.160	
ニュージーランド・ドル　小計		2,309,565.000	4,227,431.160 (325,469,925)	
ユーロ	AEDIFICA	16,283.000	1,919,765.700	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	80,603.000	1,346,070.100	
	ALTAREA	1,643.000	311,184.200	
	BEFIMMO	11,181.000	403,075.050	
	CARE PROPERTY INVEST NV	12,034.000	333,943.500	
	CARMILA SA	21,853.000	259,176.580	
	COFINIMMO SA	13,093.000	1,741,369.000	
	COVIVIO	21,403.000	1,658,732.500	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,061.000	374,659.560	
	GECINA SA	24,738.000	3,286,443.300	
	HAMBORNER REIT AG	32,106.000	296,370.480	
	HIBERNIA REIT PLC	290,450.000	374,099.600	
	ICADE	14,236.000	1,079,800.600	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	25,287.000	105,826.090	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	114,141.000	1,031,834.640	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,415.000	257,250.500	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	198,525.000	317,640.000	
	KLEPIERRE	91,535.000	2,028,415.600	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,656.000	146,300.240	
	MERCIALYS	19,022.000	202,394.080	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	152,243.000	1,409,770.180	
	MONTEA SCA	4,725.000	501,795.000	
	NSI NV	8,112.000	291,626.400	
	RETAIL ESTATES	5,045.000	372,321.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	62,570.000	4,719,655.100	
	VASTNED RETAIL	8,822.000	230,695.300	
	WAREHOUSES DE PAUW	62,257.000	2,135,415.100	
	WERELDHAVE NV	17,064.000	256,130.640	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,239.000	441,610.400	

	ユーロ　小計		1,372,342.000	27,833,370.440 (3,641,161,521)	
	韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	46,423.000	355,135,950.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,958.000	56,362,280.000	
		JR REIT XXVII	47,016.000	248,714,640.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	17,860.000	110,553,400.000	
		LOTTE REIT CO LTD	54,509.000	325,963,820.000	
		MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	32,290.000	150,309,950.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,635.000	154,134,750.000	
	韓国・ウォン　小計		227,691.000	1,401,174,790.000 (134,793,015)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	874,070.000	3,819,685.900	
		LINK REIT	944,920.000	70,065,818.000	
		PROSPERITY REIT	597,000.000	1,791,000.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	451,000.000	2,124,210.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	705,000.000	2,798,850.000	
	香港・ドル　小計		3,571,990.000	80,599,563.900 (1,142,901,816)	
投資証券　合計			29,706,167	68,695,168,674 (68,695,168,674)	
合計				76,683,188,276 (76,683,188,276)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　4銘柄 投資証券　152銘柄	0.14 －	－ 74.52	75.09
イギリス・ポンド	投資証券　34銘柄	－	5.72	5.75
イスラエル・シュケル	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	6.69	－	6.73
カナダ・ドル	投資証券　27銘柄	－	1.97	1.99
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　30銘柄	3.37	－	3.39
ニュージーランド・ドル	投資証券　5銘柄	－	0.42	0.42
ユーロ	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　29銘柄	0.06 －	－ 4.72	4.80
韓国・ウォン	投資証券　7銘柄	－	0.17	0.18

香港・ドル	投資信託受益証券　1銘柄	0.10	－	1.59
	投資証券　5銘柄	－	1.48	

（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7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,148,195,870
コール・ローン	362,494,273
国債証券	153,533,513,819
未収利息	1,662,345,265
前払費用	401,843,905
流動資産合計	157,108,393,132
資産合計	157,108,393,132
負債の部	
流動負債	
未払金	426,798,580
未払解約金	245,471,000
流動負債合計	672,269,580
負債合計	672,269,580
純資産の部	
元本等	
元本	71,691,455,689
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	84,744,667,863
元本等合計	156,436,123,552
純資産合計	156,436,123,552
負債純資産合計	157,108,393,132

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　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7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	68,481,201,187円
同期中追加設定元本額	59,370,368,934円
同期中一部解約元本額	56,160,114,432円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ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）	200,891,579円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,166,676,004円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	88,739,552円
たわらノーロード　バランス（標準型）	234,201,830円
たわらノーロード　バランス（積極型）	96,248,268円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	945,000円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,620,691円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	9,746,430円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,545,096円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	1,889,848円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	50,537,183円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	202,138,086円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	275,347,290円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	548,520,300円
投資のソムリエ	17,988,990,853円
クルーズコントロール	355,525,667円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	949,009,625円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	194,129,245円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	2,656,636円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	6,900,790円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	717,670,605円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	7,264,588,649円
ワールドアセットバランス（基本コース）	632,061,212円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,035,467,015円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	19,039,872円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,125,892円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	6,796,597円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	53,217,219円

リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,045,767,967円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	190,995,096円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	15,343,769円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	6,984,718円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,008,648円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	63,866円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	23,568,549,802円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	477,704,679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）	3,646,174,808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）	836,481,092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）	11,102,676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）	200,117,677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）	100,654,107円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	6,045,495,831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）	425,783,919円
計	71,691,455,689円
２．　受益権の総数	71,691,455,689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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,709,804,897
合計	1,709,804,897

（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7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1821円 (21,821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7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	10,000,000.000	10,285,000.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	16,000,000.000	16,129,600.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	10,000,000.000	10,657,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	14,800,000.000	16,009,530.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	14,000,000.000	13,513,360.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	15,800,000.000	15,950,495.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	11,100,000.000	12,003,429.000	

		BRAZIL 5.625 02/21/47	10,600,000.000	11,499,887.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	10,800,000.000	12,632,166.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	10,487,838.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	10,200,000.000	14,108,640.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,934,480.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	8,797,095.000	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	13,000,000.000	12,693,070.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	8,100,000.000	8,566,519.500	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	7,000,000.000	6,615,770.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	9,000,000.000	9,823,545.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	10,000,000.000	10,891,100.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	21,000,000.000	22,267,350.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	7,641,900.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	13,000,000.000	14,673,100.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	12,000,000.000	14,142,360.000	
		COLOMBIA 7.375 09/18/37	10,400,000.000	13,665,184.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	12,400,000.000	13,456,095.600	
		CROATIA 6.0 01/26/24	14,400,000.000	16,328,736.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	10,358,000.000	11,200,612.940	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	13,380,000.000	15,090,499.200	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	13,000,000.000	14,600,560.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	9,000,000.000	14,852,637.000	
		INDONESIA 2.85 02/14/30	7,000,000.000	7,291,620.840	
		INDONESIA 3.375 04/15/23	6,700,000.000	7,054,798.700	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	5,000,000.000	5,418,525.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	7,200,000.000	7,882,488.000	
		INDONESIA 3.7 10/30/49	4,000,000.000	4,259,259.680	
		INDONESIA 3.85 07/18/27	5,600,000.000	6,237,280.000	
		INDONESIA 3.85 10/15/30	8,000,000.000	8,927,959.280	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	6,000,000.000	6,800,160.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	9,800,000.000	10,852,747.160	
		INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	8,076,354.510	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	7,000,000.000	7,944,304.200	
		INDONESIA 4.35 01/11/48	7,000,000.000	8,056,595.330	
		INDONESIA 4.45 04/15/70	5,000,000.000	6,009,836.150	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	10,800,000.000	12,360,898.620	
		INDONESIA 4.75 02/11/29	7,000,000.000	8,219,500.520	
		INDONESIA 5.125 01/15/45	8,400,000.000	10,549,083.800	
		INDONESIA 5.25 01/17/42	9,300,000.000	11,801,996.670	
		INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,270,559.640	
		INDONESIA 5.875 01/15/24	9,200,000.000	10,390,524.430	
		INDONESIA 5.95 01/08/46	6,200,000.000	8,650,643.000	
		INDONESIA 6.75 01/15/44	9,500,000.000	14,185,004.510	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	11,500,000.000	17,592,182.500	
		PANAMA 2.252 09/29/32	13,000,000.000	12,626,380.000	
		PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	8,441,600.000	
		PANAMA 3.75 03/16/25	7,200,000.000	7,846,416.000	
		PANAMA 3.875 03/17/28	8,100,000.000	8,959,450.500	
		PANAMA 4.5 04/01/56	12,000,000.000	13,847,640.000	

		PANAMA 4.5 04/16/50	11,300,000.000	13,031,160.000	
		PANAMA 6.7 01/26/36	12,900,000.000	17,691,060.000	
		PANAMA 7.125 01/29/26	5,800,000.000	7,203,716.000	
		PERU 2.392 01/23/26	6,000,000.000	6,200,820.000	
		PERU 2.78 12/01/60	10,000,000.000	9,143,400.000	
		PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	17,446,420.000	
		PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,168,450.000	
		PERU 4.125 08/25/27	7,300,000.000	8,202,134.000	
		PERU 5.625 11/18/50	12,000,000.000	16,823,400.000	
		PERU 6.55 03/14/37	9,000,000.000	12,481,200.000	
		PHILIPPINES 1.648 06/10/31	4,000,000.000	3,878,536.360	
		PHILIPPINES 2.457 05/05/30	6,000,000.000	6,266,070.600	
		PHILIPPINES 2.95 05/05/45	6,000,000.000	5,891,999.160	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	11,000,000.000	11,909,977.640	
		PHILIPPINES 3.7 02/02/42	8,000,000.000	8,774,200.000	
		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	8,000,000.000	9,099,640.000	
		PHILIPPINES 3.95 01/20/40	9,800,000.000	11,029,682.140	
		PHILIPPINES 4.2 01/21/24	7,800,000.000	8,546,688.300	
		PHILIPPINES 5.0 01/13/37	6,800,000.000	8,613,561.970	
		PHILIPPINES 5.5 03/30/26	9,600,000.000	11,635,950.520	
		PHILIPPINES 6.375 10/23/34	10,000,000.000	14,147,130.800	
		PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	12,003,592.500	
		PHILIPPINES 9.5 02/02/30	7,800,000.000	12,344,893.470	
		ROMANIA 3.0 02/14/31	11,000,000.000	11,442,200.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	12,000,000.000	12,746,880.000	
		ROMANIA 4.875 01/22/24	7,600,000.000	8,377,092.400	
		ROMANIA 5.125 06/15/48	7,600,000.000	9,408,047.600	
		ROMANIA 6.125 01/22/44	9,400,000.000	12,918,185.000	
		RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	10,440,000.000	12,026,034.330	
		RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	15,400,000.000	17,257,625.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	15,400,000.000	17,392,760.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.5 04/04/22	3,800,000.000	3,913,730.200	
		RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	18,400,000.000	20,950,700.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	16,400,000.000	17,837,050.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	22,000,000.000	26,314,772.000	

		RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	27,000,000.000	34,207,326.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	16,000,000.000	20,720,320.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	8,200,000.000	11,029,123.000	
		SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	13,200,000.000	13,711,896.000	
		SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	14,000,000.000	14,931,700.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	10,400,000.000	11,346,400.000	
		SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	8,200,000.000	8,405,000.000	
		SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	13,000,000.000	13,301,600.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,141,894.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	9,400,000.000	10,774,449.200	
		SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	14,200,000.000	16,090,701.600	
		SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	4,000,000.000	4,392,228.000	
		UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	12,000,000.000	11,793,600.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	11,000,000.000	11,429,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	9,200,000.000	10,137,664.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	11,200,000.000	12,261,816.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	7,000,000.000	7,786,100.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.0 10/02/23	2,418,000.000	2,623,203.570	
		UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	11,000,000.000	12,457,940.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	12,400,000.000	14,060,298.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	10,000,000.000	10,707,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	16,000,000.000	18,150,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	13,000,000.000	14,069,250.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	11,400,000.000	12,291,081.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	14,000,000.000	16,100,000.000	

		UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	10,000,000.000	11,418,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.55 01/21/45	12,400,000.000	15,097,124.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	11,800,000.000	14,198,350.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	14,900,000.000	18,782,269.500	
	アメリカ・ドル　小計		1,216,896,000.000 (134,065,432,320)	1,393,605,462.640 (153,533,513,819)	
国債証券　合計			134,065,432,320 (134,065,432,320)	153,533,513,819 (153,533,513,819)	
合計				153,533,513,819 (153,533,513,819)	

（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	98.14	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。

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7月12日現在
資産の部	
流動資産	
預金	3,068,649,251
コール・ローン	506,722,555
株式	52,826,219,697
投資信託受益証券	384,013,694
投資証券	49,383,108
派生商品評価勘定	1,130,058
未収入金	6,721,893
未収配当金	191,297,296
差入委託証拠金	3,181,470,095
流動資産合計	60,215,607,647
資産合計	60,215,607,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	200,073,005
未払金	38,362,648
未払解約金	371,950,000
流動負債合計	610,385,653
負債合計	610,385,653
純資産の部	
元本等	
元本	40,256,641,322
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	19,348,580,672
元本等合計	59,605,221,994
純資産合計	59,605,221,994
負債純資産合計	60,215,607,647

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2021年7月12日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	64,399,345,495円
同期中追加設定元本額	15,870,931,455円
同期中一部解約元本額	40,013,635,628円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	7,609,314,688円
ＤＩＡＭ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）	349,014,059円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,058,239円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	8,723,922円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	10,411,187円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,428,792円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	16,426,555円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	13,664,759円
たわらノーロード　新興国株式	7,761,831,732円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,106,249,753円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,680,990,299円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	16,130,445円
たわらノーロード　バランス（標準型）	54,959,337円
たわらノーロード　バランス（積極型）	91,972,937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）	899,929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）	95,172,877円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	200,165,906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）	128,667,276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）	216,614,615円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	271,565円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	3,932,838円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,309,081円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	3,558,519円
たわらノーロード　全世界株式	66,338,609円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	240,571,761円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	334,605,434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）	384,832,627円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	787,054,334円
投資のソムリエ	7,329,994,593円
クルーズコントロール	505,768,379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）	9,398,223円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	24,550,860円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	288,647,335円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,921,374,126円
ワールドアセットバランス（基本コース）	866,000,074円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,825,159,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	23,122,059円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	11,127,007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）	30,182,034円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,241,569,657円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	274,292,308円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	13,148,219円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	8,497,686円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	7,352,586円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	77,320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）	15,484,954円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	191,263,536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）	282,073,008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）	141,866,599円
計	40,256,641,322円
２．　受益権の総数	40,256,641,322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　2021年1月13日 至　2021年7月12日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年7月12日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2021年7月12日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△1,072,477,444
投資信託受益証券	22,083,306
投資証券	418,443
合計	△1,049,975,695

（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7月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	111,413,390	－	111,489,794	76,404
アメリカ・ドル	111,413,390	－	111,489,794	76,404
合計	111,413,390	－	111,489,794	76,404

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年7月12日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	6,600,034,063	－	6,401,014,712	△199,019,351
合計	6,600,034,063	－	6,401,014,712	△199,019,351

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2021年7月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4806円 (14,806円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2021年7月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	30,150	32.180	970,227.000	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	8,898	8.590	76,433.820	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	6.360	153,975.600	
	CREDICORP LTD	4,299	119.400	513,300.600	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	35,762	8.540	305,407.480	
	NETEASE INC-ADR	23,636	108.330	2,560,487.880	
	SOUTHERN COPPER CORP	4,518	65.180	294,483.240	
	YPF SA ADR	4,248	4.320	18,351.360	
	LUKOIL SPON ADR	25,186	89.520	2,254,650.720	
	GAZPROM PAO ADR	351,271	7.900	2,775,040.900	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	72,118	3.510	253,134.180	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.945	91,086.660	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	56,784	4.714	267,679.770	
	51JOB INC ADR	2,101	77.550	162,932.550	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	7,085	33.350	236,284.750	
	NOVATEK PJSC GDR	5,500	216.100	1,188,550.000	
	BAIDU INC -SPON ADR	15,867	181.360	2,877,639.120	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	10,730	31.420	337,136.600	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	38,025	33.390	1,269,654.750	
	ROSNEFT OIL CO GDR	58,131	7.696	447,376.170	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	92,139	6.600	608,117.400	
	SEVERSTAL GDR	15,471	21.760	336,648.960	
	TATNEFT ADR	15,024	41.840	628,604.160	
	VTB BANK OJSC GDR	112,000	1.296	145,152.000	

MAGNIT PJSC GDR	16,621	14.275	237,264.770	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	27,011	18.780	507,266.580	
21VIANET GROUP INC ADR	4,106	19.740	81,052.440	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	21.220	522,606.160	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	6,853	21.680	148,573.040	
YANDEX NV	18,499	70.440	1,303,069.560	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,716	44.190	75,830.040	
SBERBANK ADR	160,668	16.395	2,634,151.860	
PHOSAGRO PJSC GDR	8,308	19.670	163,418.360	
ADECOAGRO SA	5,000	9.540	47,700.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	10,775	49.490	533,254.750	
JOYY INC-ADR	3,647	59.940	218,601.180	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	3,303	67.800	223,943.400	
GDS HOLDINGS LTD ADR	5,777	70.450	406,989.650	
ZAI LAB LTD ADR	4,538	169.000	766,922.000	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	7,502	89.100	668,428.200	
HUYA INC ADR	4,204	15.130	63,606.520	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	26.310	152,940.030	
BILIBILI INC ADR	9,699	106.740	1,035,271.260	
NIO INC ADR	76,062	45.530	3,463,102.860	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	40,897	12.880	526,753.360	
AUTOHOME INC ADR	4,265	61.830	263,704.950	
UP FINTECH HOLDING LTD ADR	5,517	20.510	113,153.670	
DOUYU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD ADR	7,360	5.450	40,112.000	
GAOTU TECHEDU INC ADR	4,275	13.210	56,472.750	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNOLOGY CO LTD ADR	7,893	10.590	83,586.870	
I-MAB ADR	2,148	80.700	173,343.600	
WEIBO CORP ADR	3,003	60.030	180,270.090	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	29.690	86,427.590	
BURNING ROCK BIOTECH LTD ADR	2,868	27.410	78,611.880	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	3,000	7.960	23,880.000	
KE HOLDINGS INC ADR	21,054	40.750	857,950.500	
CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	13.950	88,387.200	
DADA NEXUS LTD ADR	4,179	26.210	109,531.590	
JD.COM INC ADR	50,835	73.560	3,739,422.600	
AGORA INC ADR	3,131	37.900	118,664.900	
LI AUTO INC ADR	28,419	31.820	904,292.580	
XPENG INC ADR	22,389	39.920	893,768.880	
OZON HOLDINGS PLC ADR	2,945	55.595	163,727.270	

	LUFAX HOLDING LTD ADR	11,272	9.550	107,647.600	
	GLOBANT SA	2,498	220.010	549,584.980	
	MOMO INC SPON ADR	7,793	13.660	106,452.380	
	BAOZUN INC-SPN ADR	4,490	32.990	148,125.100	
	PINDUODUO INC ADR	25,812	111.070	2,866,938.840	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	24,702	65.360	1,614,522.720	
	IQIYI INC ADR	15,440	13.190	203,653.600	
	POLYUS PJSC GDR	4,381	95.150	416,852.150	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	3,761	37.520	141,112.720	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	26,312	29.080	765,152.960	
	BEIGENE LTD ADR	2,729	329.250	898,523.250	
アメリカ・ドル　小計		1,866,886		48,346,976.910 (5,326,386,446)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	5.500	628,479.500	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	94,296	4.800	452,620.800	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	107,147	22.040	2,361,519.880	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	176,404	6.730	1,187,198.920	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	251,763	16.280	4,098,701.640	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	187,397	4.000	749,588.000	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	224,384	3.810	854,903.040	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	138,597	13.100	1,815,620.700	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	159,897	4.340	693,952.980	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,454,154		12,842,585.460 (384,635,435)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	22,906	15.855	363,174.630	
イギリス・ポンド　小計		22,906		363,174.630 (55,605,668)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	166,403	2,071.200	344,653,893.600	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	51,564	456.900	23,559,591.600	
	ASIAN PAINTS LTD	23,101	3,010.600	69,547,870.600	
	EICHER MOTORS LTD	8,743	2,712.150	23,712,327.450	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	13,338	1,500.150	20,009,000.700	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	52,399	771.550	40,428,448.450	
	SHREE CEMENT LTD	581	27,502.750	15,979,097.750	
	ICICI BANK LTD	299,985	638.550	191,555,421.750	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	37,298	278.950	10,404,277.100	
	STATE BANK OF INDIA LTD	106,595	423.750	45,169,631.250	

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	10,949	673.950	7,379,078.550	
TATA STEEL LTD	37,523	1,239.350	46,504,130.050	
TATA MOTORS LTD	101,027	306.300	30,944,570.100	
JSW STEEL LTD	50,822	681.550	34,637,734.100	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	37,935	765.950	29,056,313.250	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	6,300	3,475.950	21,898,485.000	
NESTLE INDIA LTD	2,001	17,636.000	35,289,636.000	
GAIL INDIA LTD	83,449	147.150	12,279,520.350	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	32,663	1,720.050	56,181,993.150	
VEDANTA LTD	48,843	271.550	13,263,316.650	
AXIS BANK LTD	134,205	747.350	100,298,106.750	
TITAN COMPANY LTD	21,618	1,720.600	37,195,930.800	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	155,474	117.900	18,330,384.600	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	6,531	1,724.000	11,259,444.000	
BHARAT ELECTRONICS LTD	82,654	180.850	14,947,975.900	
LUPIN LTD	12,780	1,147.850	14,669,523.000	
ACC LTD	3,592	2,037.250	7,317,802.000	
BAJAJ FINANCE LTD	16,003	6,136.150	98,196,808.450	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	100,287	2,496.450	250,361,481.150	
INFOSYS LTD	199,050	1,562.900	311,095,245.000	
WIPRO LTD	81,673	525.800	42,943,663.400	
MRF LTD	96	79,994.700	7,679,491.200	
INDIAN OIL CORP LTD	125,755	107.300	13,493,511.500	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	47,777	2,451.450	117,122,926.650	
TRENT LTD	9,385	905.300	8,496,240.500	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	4,770	3,725.900	17,772,543.000	
HCL TECHNOLOGIES LTD	64,008	976.850	62,526,214.800	
DABUR INDIA LTD	39,316	595.600	23,416,609.600	
HERO MOTOCORP LTD	7,629	2,896.800	22,099,687.200	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,280.200	14,495,231.400	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,250	5,460.300	39,587,175.000	
IPCA LABORATORIES LTD	2,666	2,089.550	5,570,740.300	
BHARTI AIRTEL LTD	144,412	536.250	77,440,935.000	
UNITED SPIRITS LTD	15,017	655.250	9,839,889.250	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	51,875	667.900	34,647,312.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,146	4,599.700	37,469,156.200	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,114	7,425.700	60,252,129.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,868	948.700	17,900,071.600	
HAVELLS INDIA LTD	11,619	1,023.350	11,890,303.650	

INDRAPRASTHA GAS LTD	11,498	570.050	6,554,434.900	
BIOCON LTD	21,917	388.550	8,515,850.350	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	67,610	236.350	15,979,623.500	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	9,353	1,455.700	13,615,162.100	
PETRONET LNG LTD	52,703	224.000	11,805,472.000	
CIPLA LTD/INDIA	30,575	959.800	29,345,885.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	41,053	1,499.600	61,563,078.800	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,327	6,899.550	36,753,902.850	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	53,622	3,208.150	172,027,419.300	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,203	1,431.350	24,623,514.050	
NTPC LTD	295,091	117.800	34,761,719.800	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,327	2,312.150	12,316,823.050	
YES BANK LTD	714,850	13.250	9,471,762.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	34,517	363.600	12,550,381.200	
BHARAT FORGE LTD	18,024	808.000	14,563,392.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	97,347	390.050	37,970,197.350	
ITC LTD	175,871	201.350	35,411,625.850	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,676	2,277.800	19,762,192.800	
UNITED PHOSPHORUS LTD	31,183	814.550	25,400,112.650	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	2,521	3,005.050	7,575,731.050	
SIEMENS INDIA LTD	3,637	2,002.150	7,281,819.550	
INFO EDGE INDIA LTD	4,882	5,381.900	26,274,435.800	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	18,093	965.650	17,471,505.450	
TECH MAHINDRA LTD	38,981	1,051.750	40,998,266.750	
MARICO LTD	26,696	531.950	14,200,937.200	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	31,357.850	11,853,267.300	
DLF LTD	33,709	300.350	10,124,498.150	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	143,220	230.250	32,976,405.000	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,292	728.500	22,796,222.000	
REC LTD	45,037	145.350	6,546,127.950	
BAJAJ FINSERV LTD	2,329	12,854.750	29,938,712.750	
BAJAJ AUTO LTD	3,052	3,995.900	12,195,486.800	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,592	3,108.750	17,384,130.000	
MUTHOOT FINANCE LTD	4,965	1,534.600	7,619,289.000	
COAL INDIA LTD	100,287	146.700	14,712,102.900	
INDUS TOWERS LTD	37,374	241.500	9,025,821.000	
PI INDUSTRIES LTD	4,133	2,992.150	12,366,555.950	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	2,748	4,054.100	11,140,666.800	
ADANI GREEN ENERGY LTD	23,447	1,019.400	23,901,871.800	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	48,563	683.250	33,180,669.750	

	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	2,425	2,920.950	7,083,303.750	
	BANDHAN BANK LTD	38,990	316.750	12,350,082.500	
	ADANI TOTAL GAS LTD	16,897	917.150	15,497,083.550	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,249	519.300	14,150,405.700	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	12,184	974.500	11,873,308.000	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	12,556	844.100	10,598,519.600	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	16,803	1,000.500	16,811,401.500	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	8,810	3,377.600	29,756,656.000	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	11,517	1,568.600	18,065,566.200	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	19,044	613.350	11,680,637.400	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	4,893	1,809.300	8,852,904.900	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	24,046	1,019.600	24,517,301.600	
インド・ルピー 小計		5,026,543		3,694,565,115.350 (5,504,902,022)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,590.000	1,480,703,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,470,900	890.000	1,309,101,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	84,801	19,500.000	1,653,619,500.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,475.000	2,285,027,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	480,500	4,890.000	2,349,645,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,306,700	4,910.000	6,415,897,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,139,900	3,160.000	9,922,084,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	386,800	6,325.000	2,446,510,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	41,150.000	1,333,260,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	67,800	10,650.000	722,070,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	7,200.000	1,373,760,000.000	
	BANK MANDIRI	1,183,100	5,775.000	6,832,402,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,422,100	3,800.000	13,003,980,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	344,300	4,640.000	1,597,552,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,005,700	1,320.000	1,327,524,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	149,800	8,900.000	1,333,220,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	616,700	30,100.000	18,562,670,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,250.000	1,167,625,000.000	

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,550.000	1,410,750,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	3,240.000	1,727,892,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,325.000	2,276,747,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	425,600	2,980.000	1,268,288,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		18,583,201		81,800,328,000.000 (621,682,493)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	117.580	1,038,466.560	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,400	15.720	84,888.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	38.000	114,000.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	15.560	186,720.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	1,800	151.710	273,078.000	
	UNISPLENDOUR CORP LTD	7,540	23.010	173,495.400	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	8.540	139,202.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.410	237,031.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	31.680	126,720.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	157.900	189,480.000	
	JOYOUNG CO LTD	5,100	30.830	157,233.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,400	35.080	575,312.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	23.800	178,500.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	900	381.520	343,368.000	
	ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	23.750	245,337.500	
	YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	15.940	105,204.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	57.280	303,584.000	
	SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	17.870	105,433.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	19.930	380,663.000	
	HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	3.570	84,966.000	

SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	22.060	145,596.000	
GEM CO LTD	29,100	11.430	332,613.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	64.630	445,947.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	6.080	113,088.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	2,400	118.000	283,200.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	26.630	228,165.840	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	47.430	280,026.720	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	27.990	194,810.400	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	18.510	49,236.600	
AVIC JONHON OPTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	81.220	219,294.000	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	22.220	146,652.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	51.550	175,270.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	40.180	204,918.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	15.550	23,325.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	14.330	37,258.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	74.000	340,400.000	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD	12,400	48.650	603,260.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	9.520	104,720.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	20.860	175,224.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,800	56.700	952,560.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	4,800	175.030	840,144.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	17.580	179,316.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	14.650	164,080.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	8.080	253,712.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	14.380	80,528.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	5.080	72,644.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	16.200	44,226.000	

SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	19.740	51,324.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	35.910	280,098.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	17.080	858,270.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	25.800	154,800.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	170.330	545,056.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	27.180	97,032.600	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	15.040	224,096.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	11.630	147,701.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	8.640	74,304.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	16,181	63.830	1,032,833.230	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	77.610	43,461.600	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	28.600	197,340.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.400	244,480.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	34.190	167,531.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	9.200	140,760.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	10.710	224,910.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	41.040	307,800.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	45.470	227,350.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	21.380	141,108.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	4,800	216.510	1,039,248.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	79.200	879,120.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	7.490	111,975.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.150	144,255.000	

TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	2,400	39.480	94,752.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	15.900	94,446.000	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,320	22.130	117,731.600	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	5.630	90,080.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	104.140	218,694.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	9.160	334,156.800	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.740	139,282.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	46.270	1,418,360.580	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.540	179,850.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	8.250	367,125.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	13.650	271,635.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	20.520	490,428.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.540	28,652.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	61.400	828,900.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.420	253,374.000	
GOERTEK INC	8,700	40.020	348,174.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.620	162,306.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	19,100	35.100	670,410.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	28.200	411,720.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	8.060	382,044.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.090	200,647.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	7.560	284,256.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	17,360	20.990	364,386.400	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.030	182,281.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	8,200	30.310	248,542.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	104.110	395,618.000	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUTRY GROUP	10,700	24.860	266,002.000	

EAST MONEY INFORMATION CO LTD	33,408	31.490	1,052,017.920	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	4,800	185.100	888,480.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	14,000	267.280	3,741,920.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	7.250	150,800.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	6.220	147,414.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,600	6.310	792,536.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	65,300	11.290	737,237.000	
MIDEA GROUP CO LTD	14,100	69.200	975,720.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	10.540	179,180.000	
PING AN BANK CO LTD	61,400	21.270	1,305,978.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	53,580	13.970	748,512.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	180,400	4.500	811,800.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,300	24.060	993,678.000	
ZTE CORP	24,300	31.270	759,861.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	8.570	244,245.000	
WEICHAI POWER CO LTD	17,000	16.990	288,830.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	44.340	186,228.000	
GF SECURITIES CO LTD	52,200	14.270	744,894.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	12.320	259,952.000	
BYD CO LTD	7,700	248.820	1,915,914.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	9.140	311,674.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	30	113.850	3,415.500	
LB GROUP CO LTD	11,000	31.320	344,520.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	11.260	145,254.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	40.750	118,175.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	27.600	220,800.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,500	329.000	493,500.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	11.400	41,040.000	

PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	20.540	113,997.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	222.990	267,588.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	12.750	198,900.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	50.380	332,508.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	60.500	36,300.000	
NINESTAR CORP	5,700	31.660	180,462.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	16.150	113,373.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	4.160	140,608.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	13.190	158,280.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	65.610	440,899.200	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	93.290	149,264.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	357.590	178,795.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	8.710	131,521.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	18.440	97,732.000	
SF HOLDING CO LTD	15,000	65.500	982,500.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	6.520	153,872.000	
SHANDONG SINOCERA FUNCTIONAL MATERIAL CO LTD	6,500	45.040	292,760.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	7.560	482,252.400	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	29.240	397,664.000	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO LTD	7,000	64.920	454,440.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	159.250	468,195.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	16,400	24.910	408,524.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	134.260	416,206.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.080	271,800.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	46.900	73,164.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	34.880	181,376.000	

YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	83.530	263,119.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	249.070	821,931.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	116.200	313,740.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	76.500	237,150.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	132.500	278,250.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	6.450	152,220.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	135.990	587,476.800	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.780	140,410.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	36.340	109,020.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	23.100	180,180.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	108.900	91,476.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	60.200	162,540.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	2,080	57.900	120,432.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	81.800	108,794.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	112.000	145,600.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	76.060	228,180.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	139.500	279,000.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	10.160	129,032.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	12.870	347,490.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	135.410	257,279.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	9.880	96,824.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	11.950	172,080.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,600	444.410	2,044,286.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	18.400	97,520.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.200	142,600.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	252.720	303,264.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	97.740	396,824.400	

SG MICRO CORP	900	247.880	223,092.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	8,500	545.880	4,639,980.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	189.000	645,624.000	
WUXI APPTEC CO LTD	10,872	150.780	1,639,280.160	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,500	99.790	349,265.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	600	485.800	291,480.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	13.570	492,591.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	200.650	662,145.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.600	554,842.400	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	329.150	1,250,770.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.950	509,945.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	2.420	197,714.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	174.110	156,699.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	5.250	911,925.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	4.760	512,652.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	79.860	487,146.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	800	119.490	95,592.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	198.000	118,800.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	4.990	553,391.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	4.850	1,027,230.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	3.030	831,432.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.070	257,880.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.200	176,820.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	32.160	321,600.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	19.980	309,690.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	73,900	49.900	3,687,610.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	42,100	60.090	2,529,789.000	

INDUSTRIAL BANK CO LTD	68,800	20.310	1,397,328.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	97,800	9.910	969,198.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	4.340	599,788.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	23,900	21.930	524,127.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,400	1,972.110	8,677,284.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.850	613,525.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	23.510	1,328,315.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	27.900	856,530.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.270	201,841.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	75,500	20.310	1,533,405.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	109,700	3.620	397,114.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	75,800	11.430	866,394.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	5.820	482,478.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	16,300	34.310	559,253.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.850	426,315.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	70,500	7.700	542,850.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	39.220	549,080.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	18.360	615,060.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	3.990	31,122.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	2,300	49.130	112,999.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	12.180	549,318.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	25,152	62.100	1,561,939.200	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	26,700	29.700	792,990.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	55,000	15.440	849,200.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	156,800	5.210	816,928.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	44.660	665,434.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	25.660	713,348.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	27,000	25.700	693,900.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	6.480	66,744.000	

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	63.600	502,440.000	
GEMDALE CORP	10,600	10.070	106,742.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	32.360	715,156.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	10,300	124.650	1,283,895.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	10.140	939,978.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	8.940	612,390.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	9.740	307,784.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	30,120	25.300	762,036.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.400	131,120.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,300	265.160	1,935,668.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	600	96.650	57,990.000	
AVIC CAPITAL CO LTD	25,000	3.850	96,250.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	95,100	5.860	557,286.000	
AIR CHINA LTD	28,400	7.550	214,420.000	
TBEA CO LTD	26,700	13.300	355,110.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	163,800	3.080	504,504.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	3.860	325,398.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	36,100	15.900	573,990.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	46.140	152,262.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	32.300	222,870.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.690	160,867.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	23.700	196,710.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	11.810	174,788.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	12.860	61,728.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	12.420	294,354.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	27,900	19.920	555,768.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	10.260	298,566.000	

JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	14.890	113,164.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	54,900	28.800	1,581,120.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	60,200	6.650	400,330.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	8.750	286,125.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	8.990	253,518.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	19.330	184,021.600	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	30.920	234,992.000	
BBMG CORP	54,200	2.580	139,836.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	4.690	137,886.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	14.650	272,490.000	
YUTONG BUS CO LTD	12,500	12.810	160,125.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	4.920	189,912.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	19.150	30,640.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	10.660	160,102.540	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	10.980	84,546.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	5,640	84.080	474,211.200	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	30.810	500,662.500	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	5.890	192,603.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.760	162,840.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,800	53.950	97,110.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	7.430	140,427.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.670	170,752.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	50.950	234,370.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.080	135,744.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.120	201,728.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	8.150	159,740.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	432.050	777,690.000	

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	11.650	104,850.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	3,780	316.700	1,197,126.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	17.540	21,048.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	31,560	4.340	136,970.400	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.790	269,750.000	
CHINA AEROSPACE TIMES ELECTRONICS CO LTD	25,900	7.200	186,480.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	57.290	177,599.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	10.460	236,396.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.920	102,704.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	39.590	213,786.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	9.970	125,622.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.260	187,800.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	40.000	168,000.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	20.380	118,815.400	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.730	150,214.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	24.500	110,250.000	
TONGWEI CO LTD	10,300	41.470	427,141.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,430	55.300	79,079.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	184.200	460,500.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	52.000	275,600.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	17.090	95,704.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	36.610	442,614.900	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	15.320	409,748.720	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	2,224	86.960	193,399.040	

TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	24.420	383,394.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	111.920	190,264.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	50.720	248,528.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	17,920	91.930	1,647,385.600	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	217.500	391,500.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	10.380	335,803.380	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	13,224	113.900	1,506,213.600	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	54.670	273,350.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	28.340	34,008.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	64.500	374,100.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	10.530	138,996.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	54,300	16.650	904,095.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	4.950	295,515.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	65.800	223,720.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	5.340	88,110.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	6.840	623,124.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	13.960	329,456.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	900	40.520	36,468.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	71.970	102,917.100	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	21.800	43,600.000	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	116.360	139,632.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	74.070	111,105.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.010	392,392.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	77,216	7.980	616,183.680	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	361.700	289,360.000	
TOLY BREAD CO LTD	5,040	29.040	146,361.600	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	50.180	143,514.800	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	58.140	170,931.600	

	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	9.570	185,658.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	4,200	54.800	230,160.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.880	254,080.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	79.520	477,120.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	29,200	5.360	156,512.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	40.680	435,276.000	
オフショア・人民元　小計		8,150,276		150,660,458.070 (2,561,242,853)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	250,492	17.800	4,458,757.600	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	90,299	5.440	491,226.560	
	OOREDOO QSC	40,049	7.260	290,755.740	
	QATAR FUEL QSC	28,478	17.750	505,484.500	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24,605	16.750	412,133.750	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.301	474,611.420	
	INDUSTRIES QATAR QSC	90,288	13.430	1,212,567.840	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,819	17.060	1,293,472.140	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	138,961	3.193	443,702.470	
	MASRAF AL RAYAN	242,381	4.450	1,078,595.450	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.134	433,899.160	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	251,921	1.885	474,871.080	
カタール・リアル　小計		1,422,770		11,570,077.710 (347,449,434)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	254,684	0.754	192,031.730	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	126,248	0.584	73,728.830	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	418,385	0.857	358,555.940	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	58,560	0.941	55,104.960	
	MABANEE CO KPSC	53,293	0.716	38,157.780	
	BOUBYAN BANK KSCP	83,909	0.750	62,931.750	
クウェート・ディナール　小計		995,079		780,510.990 (286,627,051)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	23,125	23,350.000	539,968,750.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,761.000	776,476,030.000	
	BANCOLOMBIA SA	12,950	28,100.000	363,895,000.000	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	28,810.000	1,012,066,490.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	4,847	19,510.000	94,564,970.000	
コロンビア・ペソ　小計		357,281		2,786,971,240.000 (80,094,766)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	15,478	67.800	1,049,408.400	
	JARIR MARKETING CO	4,004	203.000	812,812.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	79.000	328,245.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	18,500	31.100	575,350.000	
	SAUDI BRITISH BANK	44,520	29.900	1,331,148.000	
	AL RAJHI BANK	70,298	106.600	7,493,766.800	
	ARAB NATIONAL BANK	34,464	21.920	755,450.880	
	BANK ALBILAD	26,491	35.850	949,702.350	
	BANK AL-JAZIRA	35,440	18.400	652,096.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,102	37.500	1,391,325.000	
	RIYAD BANK	73,924	25.600	1,892,454.400	
	SAUDI TELECOM CO	36,286	126.800	4,601,064.800	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	12,050	119.800	1,443,590.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	50,439	116.800	5,891,275.200	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	63.700	412,584.900	
	SAUDI ELECTRICITY CO	45,963	24.720	1,136,205.360	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	18,628	35.350	658,499.800	
	SAVOLA GROUP	14,538	40.900	594,604.200	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	20.080	452,362.240	
	ALMARAI CO JSC	16,575	58.300	966,322.500	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	12.120	343,129.320	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	16,278	30.000	488,340.000	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	73.000	612,835.000	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	39,276	18.600	730,533.600	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	10.100	313,211.100	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	26.150	280,249.550	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	21,818	14.040	306,324.720	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,968	130.000	385,840.000	
	ALINMA BANK	61,501	20.880	1,284,140.880	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	118.000	414,888.000	

	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,062	64.100	1,734,674.200	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	43.800	373,000.800	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	172.800	583,545.600	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	121,247	34.600	4,195,146.200	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,712	158.800	430,665.600	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	124,979	55.400	6,923,836.600	
サウジアラビア・リアル　小計		1,099,544		52,788,629.000 (1,553,041,465)	
タイ・バーツ	BANGKOK BANK PCL	27,700	105.000	2,908,500.000	
	BERLI JUCKER PCL NVDR	36,300	33.750	1,225,125.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	103,600	10.200	1,056,720.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	34,200	44.000	1,504,800.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	43,200	92.000	3,974,400.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	509,355	3.040	1,548,439.200	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	12,400	169.000	2,095,600.000	
	SHIN CORP PCL	99,500	64.500	6,417,750.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	163,400	26.250	4,289,250.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	69,700	169.500	11,814,150.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	493,920	13.900	6,865,488.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	14,300	588.000	8,408,400.000	
	PTT PCL	578,800	37.250	21,560,300.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	147,100	22.100	3,250,910.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	32,500	66.250	2,153,125.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	722,300	7.900	5,706,170.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	47,350	420.000	19,887,000.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	259,800	60.250	15,652,950.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	93,800	50.750	4,760,350.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	510,600	24.000	12,254,400.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	126.500	5,034,700.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	169,510	29.250	4,958,167.500	

	THAI OIL PCL NVDR	83,100	51.500	4,279,650.000	
	CP ALL PCL NVDR	356,700	60.250	21,491,175.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	356,100	8.800	3,133,680.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	70,645	113.000	7,982,885.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	69,922	39.500	2,761,919.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	147,408	58.500	8,623,368.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	76,000	59.250	4,503,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	645,000	7.950	5,127,750.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	40.500	2,292,300.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	33.250	6,546,925.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	120,500	37.500	4,518,750.000	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	17.700	1,863,810.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	4.000	1,414,400.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	91,933	33.500	3,079,755.500	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	61.750	5,582,200.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	30,300	68.750	2,083,125.000	
	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	36,600	39.750	1,454,850.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	29.000	5,701,400.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	148.500	3,890,700.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	58.000	3,543,800.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	73.250	3,596,575.000	
タイ・バーツ　小計		7,429,143		250,798,712.200 (845,191,660)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,704	772.000	4,403,488.000	
	CEZ	7,596	600.000	4,557,600.000	
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	85.000	2,294,065.000	
チェコ・コルナ　小計		40,289		11,255,153.000 (57,176,177)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	3,631,383	35.330	128,296,761.390	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,773	30,850.000	85,547,050.000	
	BANCO DE CHILE	2,874,683	70.000	201,227,810.000	
	EMPRESAS CMPC SA	60,153	1,646.700	99,053,945.100	
	EMPRESAS COPEC SA	23,509	6,700.000	157,510,300.000	

	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	7,854.100	83,104,232.100	
	ENEL AMERICAS SA	835,617	107.900	90,163,074.300	
	COLBUN SA	580,423	102.100	59,261,188.300	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	8,180	35,950.000	294,071,000.000	
	FALABELLA SA	48,873	3,150.000	153,949,950.000	
	CENCOSUD SA	81,121	1,386.800	112,498,602.800	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	1,210.000	35,369,510.000	
	ENEL CHILE SA	1,469,615	39.550	58,123,273.250	
チリ・ペソ　小計		9,656,142		1,558,176,697.240 (229,324,655)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	5.320	1,270,612.840	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	14.800	664,490.400	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	18.050	1,736,157.300	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	174.400	814,099.200	
	KOC HOLDING AS	53,770	19.900	1,070,023.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	7.720	694,800.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	62,654	16.020	1,003,717.080	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	114,153	8.530	973,725.090	
	TURKIYE IS BANKASI	66,205	5.270	348,900.350	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,201	96.600	599,016.600	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,755	63.250	1,755,503.750	
トルコ・リラ　小計		805,327		10,931,045.610 (139,178,445)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	8,393	8,270.000	69,410,110.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	26,296	2,378.000	62,531,888.000	
	OTP BANK NYRT	13,167	16,185.000	213,107,895.000	
ハンガリー・フォリント　小計		47,856		345,049,893.000 (126,910,731)	
パキスタン・ルピー	LUCKY CEMENT LTD	7,000	888.190	6,217,330.000	
	MCB BANK LTD	12,400	157.970	1,958,828.000	
	HABIB BANK LTD	19,300	128.680	2,483,524.000	
パキスタン・ルピー　小計		38,700		10,659,682.000 (7,461,777)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	425,500	36.000	15,318,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	94,330	41.500	3,914,695.000	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	107,520	88.400	9,504,768.000	
	AYALA CORP	17,253	784.000	13,526,352.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,420	1,965.000	2,790,300.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	46,120	160.000	7,379,200.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	60.400	12,058,860.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	14,940	203.000	3,032,820.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	61,575	47.450	2,921,733.750	
	BDO UNIBANK INC	125,723	111.500	14,018,114.500	
	PLDT INC	5,260	1,300.000	6,838,000.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	590,375	36.000	21,253,500.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	54,840	144.000	7,896,960.000	
	SM INVESTMENTS CORP	13,953	1,000.000	13,953,000.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.750	3,382,125.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	275.200	4,873,792.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	587.500	3,878,087.500	
フィリピン・ペソ　小計		2,684,670		146,540,307.750 (322,432,639)	
ブラジル・レアル	BRF SA	29,692	26.300	780,899.600	
	VALE SA	230,721	113.660	26,223,748.860	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	79,000	5.950	470,050.000	
	RAIA DROGASIL SA	70,100	25.630	1,796,663.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	11,250	42.290	475,762.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	42.700	841,190.000	
	BANCO DO BRASIL SA	52,000	31.790	1,653,080.000	
	ITAUSA SA	272,560	11.170	3,044,495.200	
	LOJAS AMERICANAS SA	53,174	20.570	1,093,789.180	
	GERDAU SA	69,130	29.100	2,011,683.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	214,810	28.160	6,049,049.600	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	66,200	28.730	1,901,926.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	279,912	27.490	7,694,780.880	
	CCR SA	65,320	13.270	866,796.400	
	WEG SA	100,244	34.730	3,481,474.120	
	BANCO BRADESCO SA PREF	292,193	24.590	7,185,025.870	
	BANCO BRADESCO SA	78,457	20.760	1,628,767.320	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,106	44.090	1,856,453.540	
	BRADESPAR SA	10,200	75.950	774,690.000	
	SUZANO SA	45,075	60.980	2,748,673.500	
	CPFL ENERGIA SA	20,700	26.500	548,550.000	

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	284,247	29.290	8,325,594.630	
	B2W CIA DIGITAL	9,400	65.920	619,648.000	
	BRASKEM SA	12,300	58.390	718,197.000	
	ENGIE BRASIL SA	16,587	39.180	649,878.660	
	ALPARGATAS SA	8,500	53.040	450,840.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	36,389	65.510	2,383,843.390	
	LOJAS RENNER SA	57,237	44.570	2,551,053.090	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	37,904	19.060	722,450.240	
	COSAN SA	57,600	24.650	1,419,840.000	
	TOTVS SA	23,600	37.370	881,932.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	62,400	24.300	1,516,320.000	
	JBS SA	63,900	29.010	1,853,739.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	56,717	11.730	665,290.410	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	17,998	35.450	638,029.100	
	HYPERA SA	18,200	33.950	617,890.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	367,348	16.150	5,932,670.200	
	MAGAZINE LUIZA SA	177,700	21.920	3,895,184.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	32,628	41.650	1,358,956.200	
	VIA VAREJO S/A	68,300	14.850	1,014,255.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	42,300	22.600	955,980.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	31,600	83.780	2,647,448.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	59,100	15.000	886,500.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	20.770	621,023.000	
	AMBEV SA	277,195	17.360	4,812,105.200	
	NATURA &CO HOLDING SA	54,400	60.100	3,269,440.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA-RTS	46,756	0.010	467.560	
	TIM SA	25,700	11.240	288,868.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	14,800	70.600	1,044,880.000	
	RUMO SA	80,500	20.000	1,610,000.000	
ブラジル・レアル　小計		4,173,750		125,479,871.250 (2,628,075,519)	
ポーランド・ズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	8,662	187.800	1,626,723.600	
	BANK PEKAO SA	9,730	92.260	897,689.800	
	ORANGE POLSKA SA	30,783	7.200	221,637.600	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	18,695	74.540	1,393,525.300	
	LPP SA	67	13,630.000	913,210.000	

	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,600	253.200	405,120.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	188.000	871,004.000	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	53,609	37.460	2,008,193.140	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	88,535	6.540	579,018.900	
	CYFROWY POLSAT SA	12,239	31.540	386,018.060	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	9.040	471,815.680	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	37,670	37.070	1,396,426.900	
	DINO POLSKA SA	2,109	292.000	615,828.000	
	ALLEGRO.EU SA	21,992	71.550	1,573,527.600	
ポーランド・ズロチ　小計		342,516		13,359,738.580 (384,311,584)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	81,400	2.880	234,432.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	358,900	4.490	1,611,461.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.240	997,672.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	5.720	513,198.400	
	RHB BANK BHD	83,480	5.250	438,270.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.770	246,309.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	262,700	3.820	1,003,514.000	
	GENTING BHD	107,200	4.830	517,776.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	25,256	17.820	450,061.920	
	HONG LEONG BANK BHD	34,908	18.660	651,383.280	
	IOI CORP BHD	190,813	3.720	709,824.360	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	22,600	19.820	447,932.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	26.100	302,760.000	
	MALAYAN BANKING BHD	254,375	8.130	2,068,068.750	
	MISC BHD	100,880	6.780	683,966.400	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	133.600	547,760.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	18.340	848,408.400	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	18.800	419,240.000	
	PETRONAS GAS BHD	39,600	15.600	617,760.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	219,800	2.800	615,440.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.980	355,810.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	139,650	9.690	1,353,208.500	
	QL RESOURCES BHD	50,950	5.580	284,301.000	
	DIALOG GROUP BHD	233,944	2.870	671,419.280	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	849,850	4.060	3,450,391.000	

	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	3.090	255,852.000	
	SUPERMAX CORP BHD	74,571	3.290	245,338.590	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.200	306,900.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	107,200	7.110	762,192.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	3.780	642,978.000	
	MAXIS BHD	130,800	4.420	578,136.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	136,200	8.060	1,097,772.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	113,100	5.610	634,491.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	35,700	4.240	151,368.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	157,600	4.900	772,240.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	93,400	3.840	358,656.000	
マレーシア・リンギット　小計		4,797,757		25,846,290.880 (680,452,715)	
メキシコ・ペソ	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,000	45.130	3,836,050.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,615	220.290	2,338,378.350	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	156.670	2,798,126.200	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	62.860	2,193,814.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	154,000	127.520	19,638,080.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	53,025	53.330	2,827,823.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,635	276.960	2,114,589.600	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	86,300	34.300	2,960,090.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,040	372.920	4,489,956.800	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	184,252	91.730	16,901,435.960	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,954,178	14.780	28,882,750.840	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	96,600	19.990	1,931,034.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	23,100	117.800	2,721,180.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	307,300	63.190	19,418,287.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,410	219.760	5,364,341.600	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	18.110	1,399,903.000	
	BECLE SAB DE CV	38,400	52.110	2,001,024.000	
メキシコ・ペソ　小計		3,166,915		121,816,864.600 (675,084,700)	
ユーロ	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,162	14.635	192,625.870	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	

	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.824	149,918.560	
	OPAP SA	11,246	12.460	140,125.160	
	JUMBO SA	3,560	14.200	50,552.000	
ユーロ　小計		213,038		533,221.590 (69,756,048)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,472	160,000.000	235,520,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	1,774	24,450.000	43,374,300.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,068	109,500.000	226,446,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,915	209,500.000	401,192,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	1,858	53,500.000	99,403,000.000	
	COWAY CO LTD	3,621	76,100.000	275,558,100.000	
	KT&G CORP	7,210	82,200.000	592,662,000.000	
	S-1 CORPORATION	794	81,400.000	64,631,600.000	
	CJ CORP	1,001	98,400.000	98,498,400.000	
	KAKAO CORP	18,304	160,500.000	2,937,792,000.000	
	CJ ENM CO LTD	299	179,800.000	53,760,200.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	32,700.000	81,651,900.000	
	KMW CO LTD	1,334	50,600.000	67,500,400.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,372	322,000.000	763,784,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	11,262	9,030.000	101,695,860.000	
	NCSOFT CORPORATION	993	800,000.000	794,400,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,606	14,600.000	213,247,600.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	8,781	26,100.000	229,184,100.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	566	1,720,000.000	973,520,000.000	
	LG CHEM LTD	2,677	833,000.000	2,229,941,000.000	
	LG CHEM LTD	499	373,000.000	186,127,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	794,000.000	80,988,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	26,101	38,200.000	997,058,200.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	15,510	44,650.000	692,521,500.000	
	S-OIL CORP	2,460	102,000.000	250,920,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	6,526	42,900.000	279,965,400.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	4,650.000	94,171,800.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	2,368	42,850.000	101,468,800.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,996	158,500.000	316,366,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,117	253,000.000	282,601,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	1,675	92,700.000	155,272,500.000	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,505	124,500.000	311,872,500.000	
HYUNDAI MOBIS	3,978	276,500.000	1,099,917,000.000	
SK HYNIX INC	32,124	119,500.000	3,838,818,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,534	57,100.000	258,891,400.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	110,500.000	167,407,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	8,132	226,000.000	1,837,832,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	4,533	51,600.000	233,902,800.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,371	10,050.000	184,628,550.000	
KIA CORPORATION	15,661	86,000.000	1,346,846,000.000	
KOREA ZINC CO LTD	465	426,500.000	198,322,500.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	15,823	24,300.000	384,498,900.000	
KOREAN AIR CO LTD	10,084	30,300.000	305,545,200.000	
CJ LOGISTICS	451	181,500.000	81,856,500.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	216,000.000	258,984,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,020	93,000.000	94,860,000.000	
HLB INC	4,888	33,850.000	165,458,800.000	
LG ELECTRONICS INC	6,395	159,000.000	1,016,805,000.000	
LG CORP	4,786	97,100.000	464,720,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	12,300.000	112,704,900.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,631	42,050.000	194,733,550.000	
NAVER CORP	7,239	415,500.000	3,007,804,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,241	95,200.000	213,343,200.000	
AMOREPACIFIC GROUP	1,094	60,800.000	66,515,200.000	
KANGWON LAND INC	3,615	25,450.000	92,001,750.000	
POSCO	4,393	338,000.000	1,484,834,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,811	23,000.000	202,653,000.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,244	736,000.000	2,387,584,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,503	182,000.000	637,546,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	321,500.000	131,815,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	279,951	79,400.000	22,228,109,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	26,770	6,550.000	175,343,500.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	47,221	72,200.000	3,409,356,200.000	
SHINSEGAE CO LTD	272	272,000.000	73,984,000.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	67,100.000	104,877,300.000	
YUHAN CORP	4,055	61,800.000	250,599,000.000	

	HANON SYSTEMS	10,146	15,950.000	161,828,700.000	
	GS HOLDINGS CORP	2,879	44,050.000	126,819,950.000	
	LG DISPLAY CO LTD	14,712	23,050.000	339,111,600.000	
	CELLTRION INC	5,715	262,000.000	1,497,330,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	18,154	42,500.000	771,545,000.000	
	HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,132	199,000.000	225,268,000.000	
	CELLTRION PHARM INC	988	160,600.000	158,672,800.000	
	LOTTE SHOPPING CO	538	108,000.000	58,104,000.000	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,275	75,600.000	323,190,000.000	
	AMOREPACIFIC CORP	1,954	239,500.000	467,983,000.000	
	SK INNOVATION CO LTD	3,022	272,000.000	821,984,000.000	
	CJ CHEILJEDANG CORP	466	442,500.000	206,205,000.000	
	STX PAN OCEAN CO LTD	9,792	7,940.000	77,748,480.000	
	LG INNOTEK CO LTD	764	227,500.000	173,810,000.000	
	SK INC	1,893	270,000.000	511,110,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	23,443	50,400.000	1,181,527,200.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	3,664	33,750.000	123,660,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	287	339,000.000	97,293,000.000	
	FILA HOLDINGS CORP	2,517	53,000.000	133,401,000.000	
	SEEGENE INC	1,958	88,000.000	172,304,000.000	
	E-MART CO LTD	1,007	152,000.000	153,064,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	3,856	49,800.000	192,028,800.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	2,305	66,600.000	153,513,000.000	
	BGF RETAIL CO LTD	344	163,000.000	56,072,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,760	117,000.000	205,920,000.000	
	SK CHEMICALS CO LTD	409	247,000.000	101,023,000.000	
	NETMARBLE CORP	901	133,500.000	120,283,500.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	32,854	11,150.000	366,322,100.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	1,169	128,000.000	149,632,000.000	
	HYBE CO LTD	620	308,000.000	190,960,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,198	182,000.000	400,036,000.000	
	ALTEOGEN INC	1,059	93,300.000	98,804,700.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,017	128,000.000	642,176,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	991	857,000.000	849,287,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	80,300.000	167,024,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,922	48,600.000	142,009,200.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,096	111,000.000	565,656,000.000	
韓国・ウォン　小計		881,537		73,128,901,940.000 (7,035,000,367)	

香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	16.180	1,084,060.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	8.550	769,500.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	48,000	4.670	224,160.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	107.820	690,048.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	74,000	38.350	2,837,900.000	
	BEIJING ENTERPRISES	21,500	25.450	547,175.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	180,000	2.650	477,000.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	244,000	15.160	3,699,040.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	10.400	728,000.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	27,400	34.600	948,040.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	43,500	52.050	2,264,175.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	7.300	1,036,600.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	543,600	10.160	5,522,976.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	229,120	17.720	4,060,006.400	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	188,888	30.800	5,817,750.400	
	CITIC LTD	351,000	8.230	2,888,730.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	96,000	4.950	475,200.000	
	LENOVO GROUP LTD	442,000	8.930	3,947,060.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,166,000	3.490	4,069,340.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	11.940	1,320,444.600	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,453,200	3.710	5,391,372.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	49,000	15.000	735,000.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	161,000	24.900	4,008,900.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	47,100	147.100	6,928,410.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	208,000	6.780	1,410,240.000	
	COSCO SHIPPING PORTS LTD	62,000	6.190	383,780.000	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	63,200	8.020	506,864.000	
	CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	110,000	11.480	1,262,800.000	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	146,000	4.670	681,820.000	

(THE) WHARF HOLDINGS LTD	87,000	29.200	2,540,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	10.540	1,017,110.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	44,000	8.860	389,840.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	184,800	23.350	4,315,080.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	39.950	1,777,775.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	356,000	23.650	8,419,400.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	2.310	498,960.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	56,000	45.650	2,556,400.000	
BYD CO LTD	45,000	216.200	9,729,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	6.300	743,400.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	540,000	1.000	540,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	4.150	1,168,606.800	
MMG LTD	184,000	3.590	660,560.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	6.500	455,000.000	
CHINA YOUZAN LTD	580,000	1.340	777,200.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	417,788	6.940	2,899,448.720	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	4.970	670,950.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	91,200	10.480	955,776.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	196,000	27.500	5,390,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	424,000	13.920	5,902,080.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	329,000	10.620	3,493,980.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	156,000	16.800	2,620,800.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	16.440	2,095,113.600	
TINGYI HOLDING CORP	106,000	15.400	1,632,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	28,000	73.850	2,067,800.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	188,000	10.640	2,000,320.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	238,000	4.920	1,170,960.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	87,333	63.150	5,515,078.950	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	68,000	6.890	468,520.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	633,250	6.950	4,401,087.500	

CHINA MENGNIU DAIRY CO	165,000	44.550	7,350,750.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	337,000	538.500	181,474,500.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	363,500	71.250	25,899,375.000	
LI NING CO LTD	134,000	91.700	12,287,800.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	260,000	2.950	767,000.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	0.950	654,778.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	439,000	1.700	746,300.000	
AIR CHINA / HONG KONG	76,000	5.470	415,720.000	
ZTE CORP	44,288	21.900	969,907.200	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	206,000	14.920	3,073,520.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	165,750	14.500	2,403,375.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	414,205	4.620	1,913,627.100	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	4.990	550,147.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,500	53.200	2,207,800.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	5,603,530	5.550	31,099,591.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	49,100	181.600	8,916,560.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	140,000	6.970	975,800.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	44,000	9.590	421,960.000	
MINTH GROUP LTD	32,000	33.850	1,083,200.000	
SSY GROUP LTD	28,000	7.130	199,640.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	84,000	10.880	913,920.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	242,000	8.840	2,139,280.000	
BANK OF CHINA LTD	4,475,200	2.740	12,262,048.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	67,500	17.920	1,209,600.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	11.440	686,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	8.390	832,288.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	226,970	61.550	13,970,003.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,276,235	4.500	14,743,057.500	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	49,500	7.370	364,815.000	

KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	16.180	865,630.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.500	586,600.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	33,000	25.350	836,550.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	47.900	1,499,270.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	453,142	8.210	3,720,295.820	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	5.770	1,367,490.000	
CHINA CITIC BANK-H	417,800	3.630	1,516,614.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65,000	10.200	663,000.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,400	230.200	9,990,680.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	64,000	185.400	11,865,600.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	22.700	454,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	10.980	1,855,927.440	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	2.480	744,000.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	6.280	533,800.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	5.320	861,840.000	
KINGSOFT CORP LTD	60,000	41.600	2,496,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	13.960	488,600.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	168,000	3.920	658,560.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	8.380	930,180.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	29,000	45.350	1,315,150.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	320,000	5.390	1,724,800.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	150,800	23.050	3,475,940.000	
CHINA EVERGRANDE GROUP	110,000	9.470	1,041,700.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	18.340	1,687,280.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	83,500	5.430	453,405.000	
SINOPHARM GROUP CO	86,000	21.850	1,879,100.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	112,000	7.040	788,480.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	178,527	7.690	1,372,872.630	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	10.620	1,598,310.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	6.650	718,200.000	

CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	3.010	595,980.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	210,000	13.240	2,780,400.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	30,100	15.520	467,152.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	155,000	24.150	3,743,250.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	61,200	7.730	473,076.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	7.830	704,700.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	106,500	40.950	4,361,175.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	43,100	23.450	1,010,695.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	364,656	3.710	1,352,873.760	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	125,000	2.590	323,750.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	31,000	12.100	375,100.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	44,000	17.500	770,000.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.830	707,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,447,000	2.650	3,834,550.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	30,000	75.450	2,263,500.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	8.070	831,210.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	33,000	63.900	2,108,700.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	109,000	17.460	1,903,140.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	118,000	7.110	838,980.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	93,600	6.700	627,120.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	461,000	2.540	1,170,940.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	25,500	54.750	1,396,125.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	226,000	5.750	1,299,500.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	106,500	4.220	449,430.000	

HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	72,000	9.260	666,720.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	438,000	5.080	2,225,040.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	26,000	51.750	1,345,500.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	68,000	34.750	2,363,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	88,000	76.000	6,688,000.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.330	398,360.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	22,600	83.850	1,895,010.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	16.800	873,600.000	
PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LTD	55,000	1.750	96,250.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.720	514,500.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	23,750	33.100	786,125.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,594,000	1.060	2,749,640.000	
XIAOMI CORP	845,400	26.700	22,572,180.000	
WUXI APPTEC CO LTD	18,912	170.800	3,230,169.600	
WEIMOB INC	105,000	14.760	1,549,800.000	
MEITUAN	212,000	279.200	59,190,400.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	44,400	18.520	822,288.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	67,000	44.150	2,958,050.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	298,000	15.580	4,642,840.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	70,000	82.300	5,761,000.000	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERVICES GROUP LTD	42,000	17.640	740,880.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.460	970,900.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	24,000	42.150	1,011,600.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	10.040	1,034,120.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	31.150	3,192,875.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	48.400	280,720.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	78,000	16.580	1,293,240.000	

CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	27,000	10.660	287,820.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	4,000	327.200	1,308,800.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	62,000	11.400	706,800.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	66,000	31.050	2,049,300.000	
CHINA FEIHE LTD	215,000	15.600	3,354,000.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	887,568	195.500	173,519,544.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,700	181.600	1,398,320.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	72,000	41.500	2,988,000.000	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	61.100	947,050.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	31.150	1,557,500.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	16,200	152.800	2,475,360.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	113,200	27.050	3,062,060.000	
AKESO INC	20,000	57.000	1,140,000.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	42,000	26.700	1,121,400.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	37.300	932,500.000	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	25.200	1,033,200.000	
NONGFU SPRING CO LTD	19,000	39.050	741,950.000	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	72,000	2.820	203,040.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	12,750	98.450	1,255,237.500	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	23,000	46.600	1,071,800.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	4,600	156.300	718,980.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	92,661	24.350	2,256,295.350	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	28,000	40.350	1,129,800.000	
CGN POWER CO LTD	450,000	1.700	765,000.000	
GF SECURITIES CO LTD	68,200	9.800	668,360.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	51.100	2,432,360.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	48,400	10.720	518,848.000	
3SBIO INC	90,500	8.270	748,435.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	4.520	424,880.000	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	1.020	470,220.000	

	CHINA LITERATURE LTD	28,400	80.650	2,290,460.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	31.650	1,076,100.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.620	676,830.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	6.510	416,640.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	7.750	503,750.000	
	BOC AVIATION LTD	10,700	62.900	673,030.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	41.350	1,405,900.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	54,000	17.120	924,480.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	68,800	20.050	1,379,440.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	199,000	134.400	26,745,600.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	176,000	5.490	966,240.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	13,400	132.500	1,775,500.000	
香港・ドル　小計		50,677,663		944,474,560.370 (13,392,649,263)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	31,000	331.000	10,261,000.000	
	ACER INC	202,532	28.550	5,782,288.600	
	ASUSTEK COMPUTER INC	42,554	373.000	15,872,642.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,616	515.000	14,737,240.000	
	ASIA CEMENT CORP	145,928	52.800	7,704,998.400	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	19,000	211.000	4,009,000.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	469,267	9.480	4,448,651.160	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	62,000	113.500	7,037,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	38,000	154.500	5,871,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	74,000	142.500	10,545,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	160,858	90.500	14,557,649.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	43,760	181.500	7,942,440.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	244,761	16.200	3,965,128.200	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	84,169	44.700	3,762,354.300	
	CHINA STEEL CORP	707,058	38.050	26,903,556.900	
	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	88,973	26.900	2,393,373.700	
	ADVANTECH CO LTD	20,675	348.000	7,194,900.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	213,304	22.100	4,714,018.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	113,663	295.000	33,530,585.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	52,000	78.600	4,087,200.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	204,427	114.500	23,406,891.500	

AU OPTRONICS CORP	537,194	22.250	11,952,566.500	
TAIWAN MOBILE CO LTD	90,800	103.000	9,352,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	155,820	187.000	29,138,340.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	168,824	32.950	5,562,750.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	21,768	238.000	5,180,784.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	11,322	630.000	7,132,860.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	35,285	492.500	17,377,862.500	
FORMOSA PLASTICS CORP	227,633	103.500	23,560,015.500	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	209,594	85.100	17,836,449.400	
GIANT MANUFACTURING	16,151	296.000	4,780,696.000	
MEDIATEK INC	88,507	919.000	81,337,933.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	392,936	74.200	29,155,851.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	466,944	18.650	8,708,505.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	14,000	591.000	8,274,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	89,000	65.400	5,820,600.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	585,146	25.550	14,950,480.300	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	460,941	53.800	24,798,625.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	882,403	13.700	12,088,921.100	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	652,448	26.200	17,094,137.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	729,225	114.000	83,131,650.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	621,495	32.900	20,447,185.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	2,990.000	18,597,800.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	528,058	16.100	8,501,733.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	733,061	9.630	7,059,377.430	
INVENTEC CO LTD	120,005	27.500	3,300,137.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	140,845	57.500	8,098,587.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	553,443	13.950	7,720,529.850	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,072,048	22.700	24,335,489.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	596,977	22.650	13,521,529.050	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,560	110.500	4,150,380.000	

NAN YA PLASTICS CORP	301,828	86.300	26,047,756.400	
WISTRON CORP	157,916	32.700	5,163,853.200	
POU CHEN CORP	157,990	38.750	6,122,112.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	279,297	73.800	20,612,118.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	35,392	260.500	9,219,616.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	64,480	110.000	7,092,800.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	6,658	482.000	3,209,156.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	46,589	62.900	2,930,448.100	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	43,588	65.000	2,833,220.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	62,899	52.600	3,308,487.400	
TAIWAN CEMENT CORP	307,171	52.000	15,972,892.000	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,441,083	584.000	841,592,472.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	705,525	52.200	36,828,405.000	
WAN HAI LINES LTD	35,000	275.000	9,625,000.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	180,000	35.300	6,354,000.000	
YAGEO CORP	22,160	584.000	12,941,440.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	94,000	195.500	18,377,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	79,000	29.850	2,358,150.000	
INNOLUX CORPORATION	536,345	20.700	11,102,341.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	118,203	55.400	6,548,446.200	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	14,000	418.000	5,852,000.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,475	380.500	6,268,737.500	
PEGATRON CORP	103,554	67.600	7,000,250.400	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	1,080.000	8,640,000.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	15,000	370.000	5,550,000.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,470	208.500	15,318,495.000	
ONENESS BIOTECH CO LTD	9,000	207.500	1,867,500.000	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,445.000	2,890,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	29,385	105.000	3,085,425.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	540,954	21.500	11,630,511.000	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	217,993	44.950	9,798,785.350	
WIWYNN CORP	4,000	1,045.000	4,180,000.000	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	196,903	111.000	21,856,233.000	

	SILERGY CORP	5,000	3,750.000	18,750,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	12,000	886.000	10,632,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	414.500	2,901,500.000	
台湾・ドル　小計		19,222,056		1,936,156,248.840 (7,606,189,824)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	265.300	1,900,343.900	
	BIDVEST GROUP LTD	16,200	191.690	3,105,378.000	
	CLICKS GROUP LTD	16,368	257.350	4,212,304.800	
	DISCOVERY LTD	21,137	124.720	2,636,206.640	
	GOLD FIELDS LTD	52,869	129.320	6,837,019.080	
	REMGRO LTD	26,000	115.350	2,999,100.000	
	NORTHAM PLATINUM LTD	22,064	217.150	4,791,197.600	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	28,537	53.950	1,539,571.150	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,115	177.570	2,506,400.550	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,906	1,630.080	7,997,172.480	
	MTN GROUP LTD	100,234	105.470	10,571,679.980	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	24,940	277.640	6,924,341.600	
	FIRSTRAND LTD	300,251	56.030	16,823,063.530	
	NASPERS LTD	25,534	2,735.450	69,846,980.300	
	NEDBANK GROUP LTD	15,999	174.490	2,791,665.510	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,205	1,675.630	5,370,394.150	
	SASOL LTD	33,596	222.500	7,475,110.000	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	31,242	157.870	4,932,174.540	
	MR PRICE GROUP LTD	17,459	212.880	3,716,671.920	
	STANDARD BANK GROUP LTD	78,636	133.210	10,475,101.560	
	SPAR GROUP LTD/THE	9,414	182.520	1,718,243.280	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	54,219	55.110	2,988,009.090	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	25,010	168.050	4,202,930.500	
	ABSA GROUP LTD	39,186	139.180	5,453,907.480	
	TIGER BRANDS LTD	6,370	204.000	1,299,480.000	
	SANLAM LTD	117,098	60.250	7,055,154.500	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	47,214	235.470	11,117,480.580	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,173	691.700	2,194,764.100	
	RMI HOLDINGS	35,836	31.120	1,115,216.320	
	VODACOM GROUP PTY LTD	38,342	127.310	4,881,320.020	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	22,185	105.000	2,329,425.000	
	OLD MUTUAL LTD	304,247	13.170	4,006,932.990	
	REINET INVESTMENTS SCA	7,743	277.930	2,152,011.990	
	MULTICHOICE GROUP LTD	19,199	112.750	2,164,687.250	
	SIBANYE STILLWATER LTD	167,996	59.640	10,019,281.440	
	BID CORP LTD	20,642	322.500	6,657,045.000	
南アフリカ・ランド　小計		1,758,329		246,807,766.830	

			(1,905,355,960)	
合計	144,914,328		52,826,219,697 (52,826,219,697)	

（２）株式以外の有価証券

2021年7月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	66,800.000	2,032,724.000	
		BANCO INTER SA	19,500.000	1,481,415.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,700.000	863,660.000	
		ENERGISA SA	15,800.000	712,580.000	
		KLABIN SA	31,400.000	847,800.000	
	ブラジル・レアル　小計		155,200.000	5,938,179.000 (124,370,409)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	906,975.000	15,155,552.250	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,668,192.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	114,700.000	19,025,289.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	157,800.000	8,506,998.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	6,900.000	495,765.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,221,575.000	46,851,796.250 (259,643,285)	
投資信託受益証券　合計			1,376,775	384,013,694 (384,013,694)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	173,900.000	3,752,762.000	
	メキシコ・ペソ　小計		173,900.000	3,752,762.000 (20,797,056)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	235,102.000	3,702,856.500	
	南アフリカ・ランド　小計		235,102.000	3,702,856.500 (28,586,052)	
投資証券　合計			409,002	49,383,108 (49,383,108)	
合計				433,396,802 (433,396,802)	

（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	74銘柄	8.94	－	－	10.00
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式	9銘柄	0.65	－	－	0.72
イギリス・ポンド	株式	1銘柄	0.09	－	－	0.10
インド・ルピー	株式	101銘柄	9.24	－	－	10.34
インドネシア・ルピア	株式	22銘柄	1.04	－	－	1.17
オフショア・人民元	株式	346銘柄	4.30	－	－	4.81
カタール・リアル	株式	12銘柄	0.58	－	－	0.65
クウェート・ディナール	株式	6銘柄	0.48	－	－	0.54
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	2.61	－	－	2.92
タイ・バーツ	株式	43銘柄	1.42	－	－	1.59
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.10	－	－	0.11
チリ・ペソ	株式	13銘柄	0.38	－	－	0.43
トルコ・リラ	株式	11銘柄	0.23	－	－	0.26
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.21	－	－	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	0.54	－	－	0.61
ブラジル・レアル	株式	50銘柄	4.41	－	－	5.17
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.21	－	
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.64	－	－	0.72
マレーシア・リンギット	株式	36銘柄	1.14	－	－	1.28
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	1.13	－	－	1.79
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.44	－	
	投資証券	1銘柄	－	－	0.03	
ユーロ	株式	5銘柄	0.12	－	－	0.13
韓国・ウォン	株式	103銘柄	11.80	－	－	13.21
香港・ドル	株式	213銘柄	22.47	－	－	25.15
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.76	－	－	14.28
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.20	－	－	3.63
	投資証券	1銘柄	－	－	0.05	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	581,913,776,902円
Ⅱ　負債総額	1,499,768,127円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	580,414,008,775円
Ⅳ　発行済数量	468,071,926,684口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2400円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	506,198,291,616円
Ⅱ　負債総額	1,399,333,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	504,798,958,616円
Ⅳ　発行済数量	384,611,486,906口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3125円

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	392,193,140,759円
Ⅱ　負債総額	1,361,600,340円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	390,831,540,419円
Ⅳ　発行済数量	125,380,953,255口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.1172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7月30日現在

Ⅰ　資産総額	578,784,456,252円
Ⅱ　負債総額	58,485,967円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	578,725,970,285円
Ⅳ　発行済数量	396,972,428,160口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4578円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	589,661,162,872円
Ⅱ　負債総額	84,312,984円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	589,576,849,888円
Ⅳ　発行済数量	107,610,515,657口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	5.4788円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	228,876,787,254円
Ⅱ　負債総額	2,589,775,090円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	226,287,012,164円
Ⅳ　発行済数量	88,961,214,417口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5437円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	**78,078,551,203円**
Ⅱ　負債総額	**110,052,393円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**77,968,498,810円**
Ⅳ　発行済数量	**49,995,777,027口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.5595円**

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	**156,332,448,476円**
Ⅱ　負債総額	**1,598,323,000円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**154,734,125,476円**
Ⅳ　発行済数量	**71,409,978,928口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.1668円**

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年7月30日現在

Ⅰ　資産総額	**60,446,712,188円**
Ⅱ　負債総額	**371,896,713円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**60,074,815,475円**
Ⅳ　発行済数量	**41,549,211,829口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4459円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（1）資本金の額（2021年7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7月30日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年7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	1,421,929,893,732
追加型株式投資信託	834	15,898,581,758,577
単位型公社債投資信託	29	61,675,044,716
単位型株式投資信託	215	1,335,566,478,953
合計	1,104	18,717,753,175,978

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		1,278,455		1,119,327
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		3,524,781		3,991,834
ソフトウエア		3,299,065		2,878,179
ソフトウエア仮勘定		221,784		1,109,723
電話加入権		3,931		3,931
投資その他の資産		9,482,127		11,153,554
投資有価証券		261,361		261,360
関係会社株式		5,299,196		5,299,196
長期差入保証金		1,302,402		1,324,203
繰延税金資産		2,508,004		3,676,823
その他		111,162		591,970
固定資産計		14,285,364		16,264,717
資産合計		95,566,859		104,757,915

（単位：千円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

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

（単位：千円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第35期（自　2019年4月1日　至　2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

第36期（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：千円）

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

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

重要な会計方針

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

（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

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

第35期（2020 年3月31日現在）

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

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

①非上場株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券」には含めておりません。
②関係会社株式は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期（2020年3月31日現在）

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

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 その他有価証券(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、記載しておりません。

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			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計			
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	2,988	3,000	△ 11
小計	2,988	3,000	△ 11
合計	2,988	3,000	△ 11

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

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			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計			
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	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 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
繰延税金資産	（千円）	（千円）
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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

	第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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

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

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

a.名称

みずほ信託銀行株式会社

b.資本金の額

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おります。

(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。
ＰａｙＰａｙ銀行株式会社	37,250	日本において銀行業務を営んでおります。
ソニー銀行株式会社	（※2）38,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社イオン銀行	51,250	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社青森銀行	19,562	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北都銀行	12,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社荘内銀行	8,500	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社山形銀行	12,008	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社岩手銀行	12,089	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東北銀行	13,233	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社七十七銀行	24,600	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社群馬銀行	48,652	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社足利銀行	135,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社常陽銀行	85,113	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑波銀行	48,868	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社武蔵野銀行	45,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉銀行	145,069	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社千葉興業銀行	62,120	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社第四北越銀行	32,776	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社八十二銀行	52,243	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福井銀行	17,965	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社静岡銀行	90,845	日本において銀行業務を営んでおります。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。

株式会社清水銀行	10,816	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十六銀行	36,839	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社三十三銀行	37,400	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社百五銀行	20,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京都銀行	42,103	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社関西みらい銀行	38,971	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社南都銀行	37,924	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社紀陽銀行	80,096	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鳥取銀行	9,061	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,948	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社四国銀行	25,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社筑邦銀行	8,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社佐賀銀行	16,062	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大分銀行	19,598	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社宮崎銀行	14,697	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社沖縄銀行	22,725	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社西日本シティ銀行	85,745	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おります。
株式会社北洋銀行	121,101	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北日本銀行	7,761	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社仙台銀行	22,735	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福島銀行	18,682	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大東銀行	14,743	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東和銀行	38,653	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社栃木銀行	27,408	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社京葉銀行	49,759	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東日本銀行	38,300	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東京スター銀行	26,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	6,191	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長野銀行	13,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山第一銀行	10,182	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社福邦銀行	7,300	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社静岡中央銀行	2,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社愛知銀行	18,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社名古屋銀行	25,090	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社みなと銀行	39,984	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社トマト銀行	17,810	日本において銀行業務を営んでおります。

株式会社徳島大正銀行	11,036	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社香川銀行	12,000	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社佐賀共栄銀行	2,679	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長崎銀行	7,621	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社宮崎太陽銀行	12,252	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社南日本銀行	16,601	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	（※1）690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一勧業信用組合	（※1）15,487	協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
アイザワ証券株式会社	（※3）3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
八十二証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
エース証券株式会社	8,831	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＯＫＢ証券株式会社	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三オンライン証券株式会社	2,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
九州ＦＧ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
きらぼしライフデザイン証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
あかつき証券株式会社	3,067	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

七十七証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
北洋証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
頭川証券株式会社	175	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（※4）7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
とうほう証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
南都まほろば証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
西村証券株式会社	500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村證券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
浜銀ＴＴ証券株式会社	3,307	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
フィデリティ証券株式会社	10,858	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
三豊証券株式会社	300	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
山形證券株式会社	100	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2021年3月末日現在

（※1）出資の総額

（※2）2021年6月11日現在

（※3）2021年10月1日現在

（※4）2020年12月31日現在

(3)投資顧問会社

ａ．名称

アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク

ｂ．資本金の額

2020年12月末日現在　　400万米ドル

ｃ．事業の内容

米国において投資顧問業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

３【資本関係】

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

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

②請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨

・目論見書の使用開始日

・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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）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8月１３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

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」に掲げられている投資のソムリエの２０２１年1月１３日から２０２１年7月１２日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエの２０２１年7月１２日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業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、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。