

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書
【提出先】 関東財務局長殿
【提出日】 2022年1月11日提出
【計算期間】 第13期(自 2021年4月13日 至 2021年10月11日)
【ファンド名】 D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)
【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】 酒井 隆
【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】 03-6774-5100
【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

<ファンドの特色>

1 国内外の6資産に分散投資することにより、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

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

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

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

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

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

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

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

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

■ 分配方針

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

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

商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

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

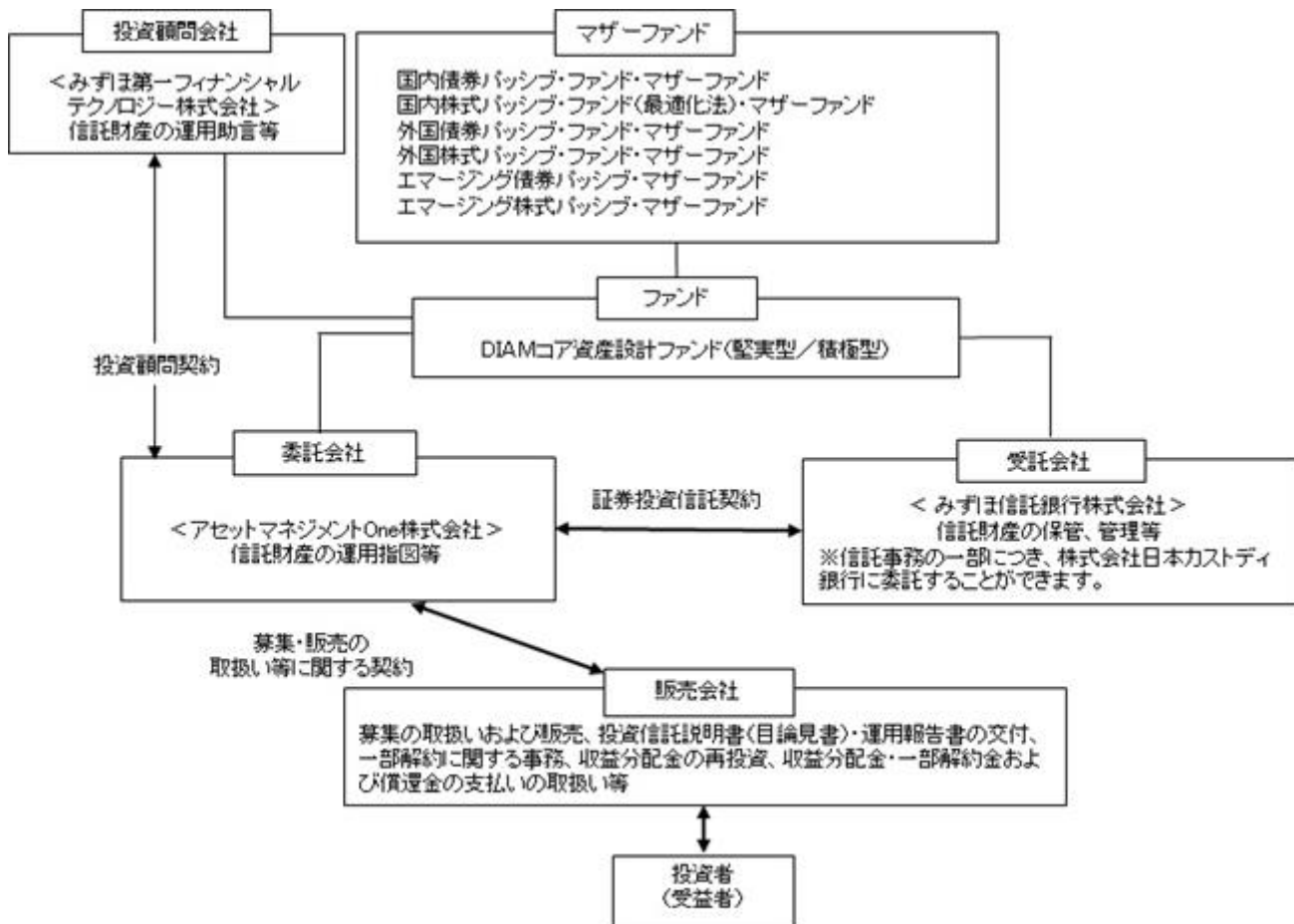
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

（２）【ファンドの沿革】

2015年8月28日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

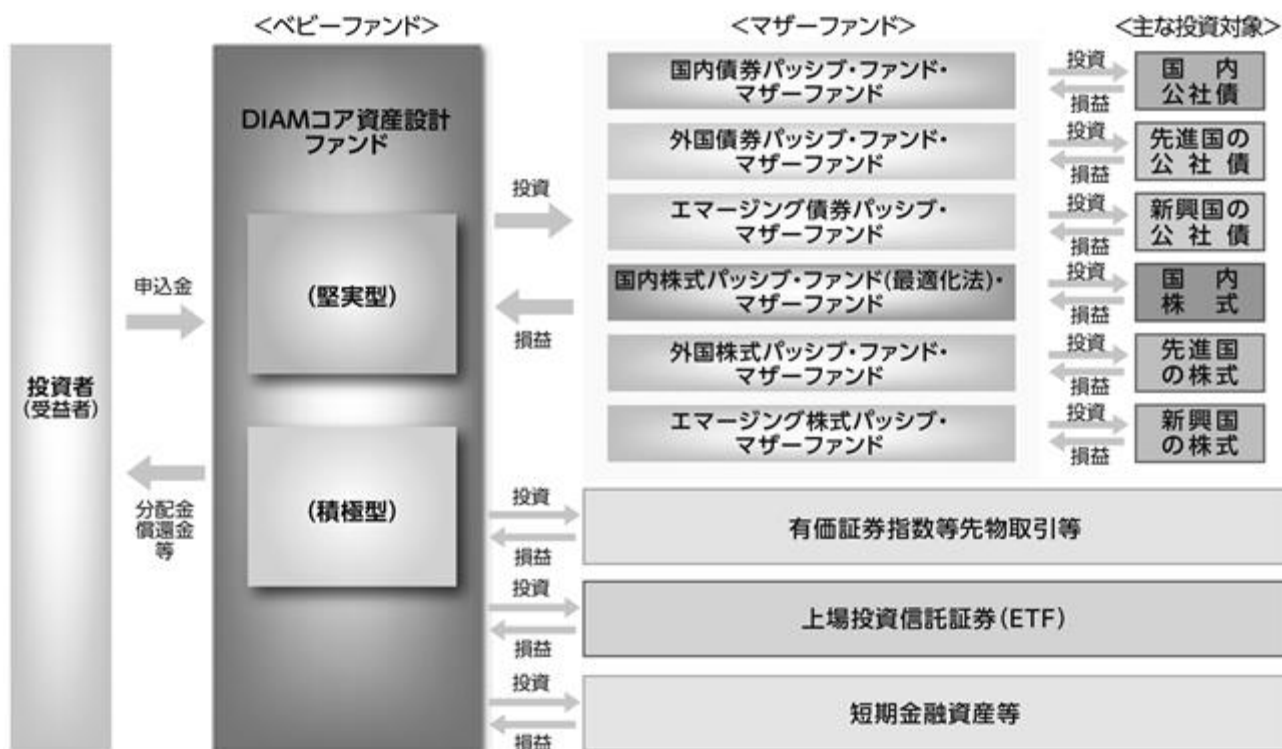
- ・「投資顧問契約」の概要

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

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2021年10月29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10月29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>

信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

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

（*）市場環境によっては、残存期間3年以下の債券に投資することがあります。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

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

基準価額の水準や市場環境等に応じて、投資対象である6資産合計の投資比率(以下、合計資産比率といいます。)を機動的に変更することで、資産価値上昇時には値上がり益の獲得をめざし、資産価値下落時には基準価額の下落を一定水準(下値目安値(*))までに抑えることをめざします。なお、下値目安値は、3ヵ月毎に改定します。

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

運用プロセス

・基本配分比率の決定

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

・下値目安値の決定

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

・リバランスの実施

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

・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

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

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

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

19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

1. 預金

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

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

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

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

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

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

投資態度

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

* 東証市場再編に伴い、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。

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。

㈱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。

㈱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。

㈱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。

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。

㈱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。

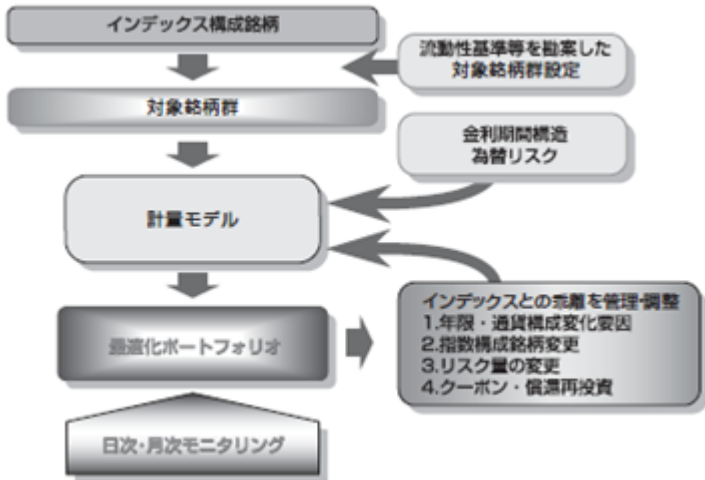
㈱東京証券取引所は、委託会社または当マザーファンドおよび当マザーファンドに投資するファンドの購入者のニーズを、東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、㈱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。

<p>運用プロセス</p>	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
<p>主な投資制限</p>	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産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。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限・通貨構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン・償還再投資 
主な投資制限	<p>1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>3.同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>4.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">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限りなくMSCIが決定、編集、計算するMSCI指数のライセンス所有者です。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数の決定、編集または計算にあたり、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体の要望を考慮する義務を負いません。いかなるMSCI関係者も、本ファンドの発行時期、発行価格もしくは発行数量の決定、または、本ファンドを換金する方程式もしくは本ファンドの換算対価の決定もしくは計算について責任を負うものではなく、また、関与もしていません。また、MSCI関係者は、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関するいかなる義務または責任も負いません。

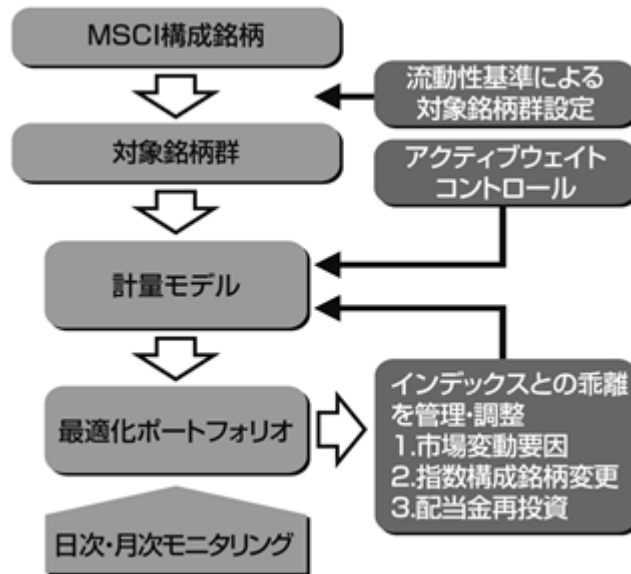
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。ま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

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

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

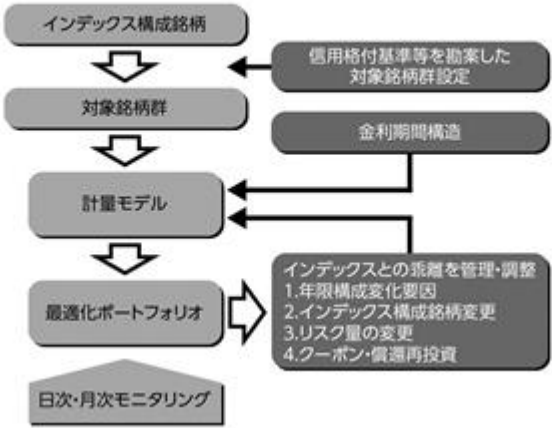
運用プロセス

- 1.流動性基準による対象銘柄群設定
 取引コスト、マーケットインパクトの低減を図る為、MSCIコクサイ・インデックス構成銘柄のうち、流動性が著しく低かつ時価総額比率が小さい銘柄を除外して投資銘柄群を設定します。
- 2.最適化法によるポートフォリオの構築
 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。
- 3.インデックスとの乖離を管理
 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合は速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。
 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。
 - ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施
 - ・ベンチマーク構成銘柄の変更に伴うもの：四半期に一度の銘柄入替、コーポレートアクションおよび指数構築手法の変更に伴い実施
 - ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施



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

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

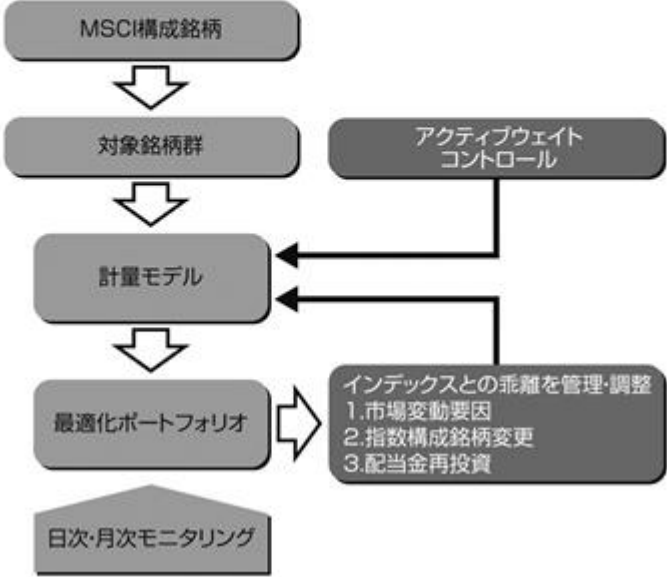
<p>運用プロセス</p>	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> 
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるもの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

ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、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。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

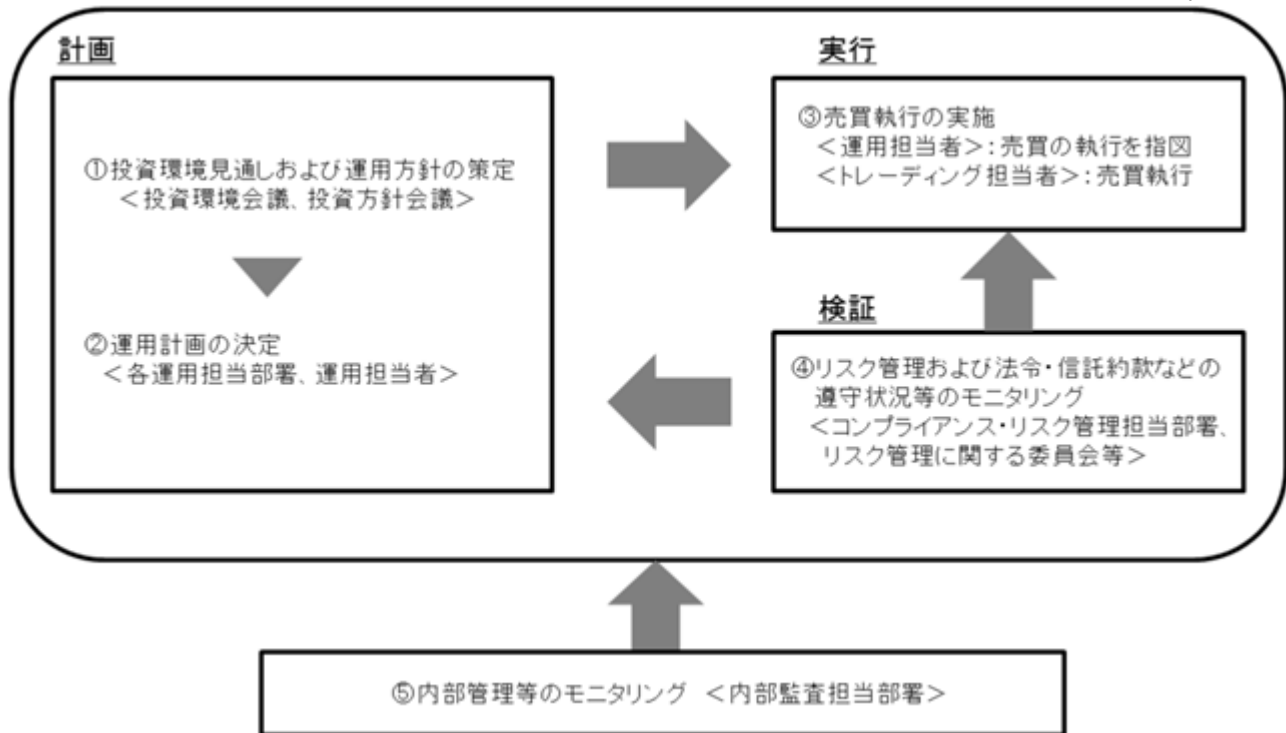
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、MSCI指数およびそれに含まれるデータの各々に関し、いかなるMSCI関係者も明示的または黙示的な保証を行うものではなく、かつMSCI関係者は、それらに関する特定目的に対する市場性および適合性に係る一切の保証を明示的に否認します。前記事項を制限することなく、直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、結果的損害その他あらゆる損害(逸失利益を含む。)については、その可能性について告知されていたとしても、MSCI関係者は、かかる損害について責任を負いません。本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス	<p>現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] D[アクティブウェイトコントロール] --> C E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資] --> C C --> F[最適化ポートフォリオ] G[日次・月次モニタリング] --> F </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（3）【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金の

ある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5)【投資制限】

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

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

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

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

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

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

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

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

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

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

ドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

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

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

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

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第27条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第28条)

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

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

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

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

資金の借入れ(約款第34条)

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

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

ファンドは現金等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、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。

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(債券の価格の下落)は、基準価額の下落要因となります。

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

・ 為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

・信用リスク

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

ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

各ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額にマイナスの影響をおよぼす可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

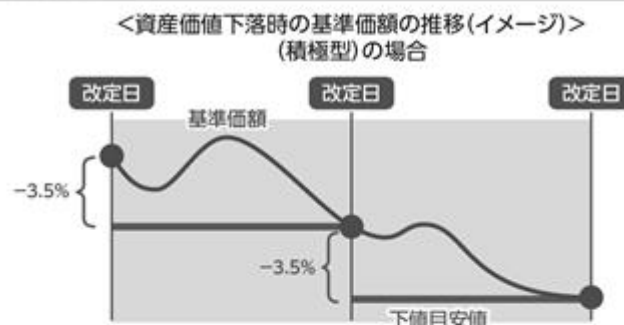
各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、各ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、各ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

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

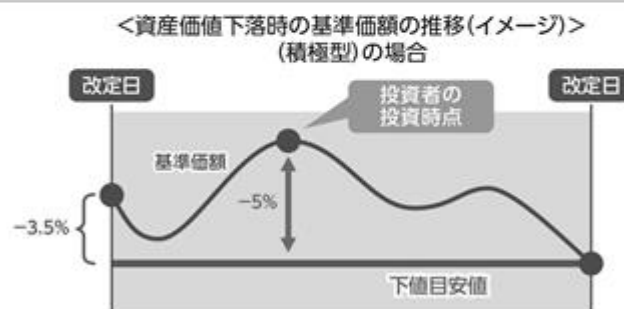
ケース① 下値目安値の切下げについて

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



ケース② 四半期途中の投資について

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



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

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

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

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

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

注意事項

イ．ファンドは、実質的に債券および株式など値動きのある有価証券（外貨建資産には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は変動します。

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

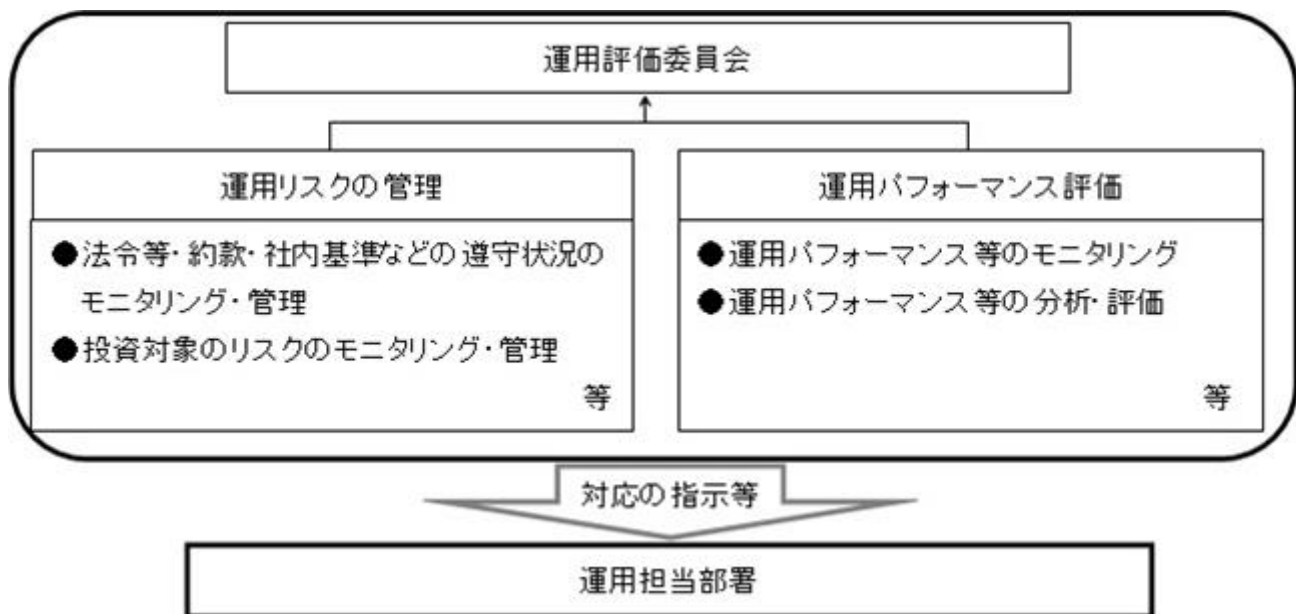
ハ．投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

ニ．投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、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。
- ・運用評価委員会：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、運用評価委員会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10月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

流動性リスク管理体制

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

流動性リスク管理体制は2022年1月1日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

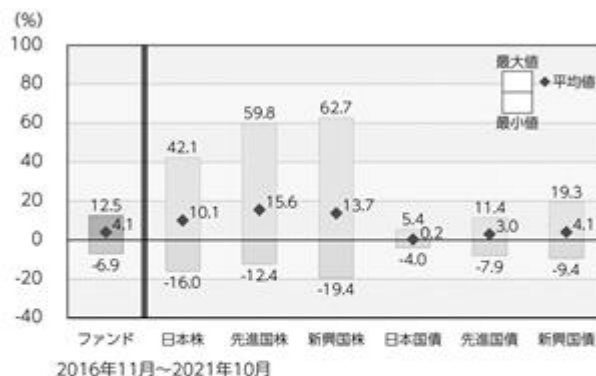
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

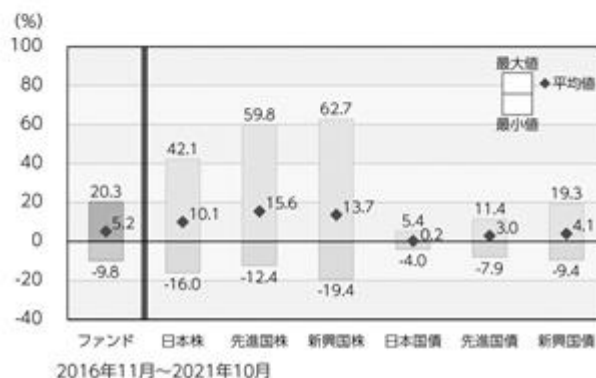
(堅 実 型)



ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



(積 極 型)



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

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

*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】

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.155%（税抜1.05%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.50%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.50%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.05%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2021年10月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)

2021年10月29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	80,125,268	71.23
内 日本	80,125,268	71.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	32,366,671	28.77
純資産総額	112,491,939	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。

DIAMコア資産設計ファンド(積極型)

2021年10月29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	194,269,252	95.24
内 日本	194,269,252	95.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,703,097	4.76
純資産総額	203,972,349	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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	412,721,135,250	84.41
内 日本	412,721,135,250	84.41
地方債証券	27,480,576,963	5.62
内 日本	27,480,576,963	5.62
特殊債券	28,686,135,057	5.87
内 日本	28,686,135,057	5.87
社債券	20,893,624,360	4.27
内 日本	20,088,304,360	4.11
内 フランス	805,320,000	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	814,721,660	0.17
純資産総額	488,966,749,970	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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	460,231,302,040	96.83
内 日本	460,231,302,040	96.83
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	15,070,912,630	3.17
純資産総額	475,302,214,670	100.00

その他資産の投資状況

2021年10月29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)		16,159,175,000	3.40
	内 日本	16,159,175,000	3.40

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

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	151,067,525,929	98.83
内 アメリカ	70,058,595,987	45.83
内 フランス	15,487,219,652	10.13
内 イタリア	13,959,790,744	9.13
内 ドイツ	11,185,779,669	7.32
内 イギリス	9,382,900,211	6.14
内 スペイン	9,081,217,841	5.94
内 ベルギー	3,410,593,999	2.23
内 カナダ	2,973,912,577	1.95
内 オランダ	2,846,122,830	1.86
内 オーストラリア	2,745,539,434	1.80
内 オーストリア	2,266,237,697	1.48
内 アイルランド	1,229,754,877	0.80
内 メキシコ	1,067,114,884	0.70
内 フィンランド	927,986,274	0.61
内 デンマーク	785,314,320	0.51
内 ポーランド	777,511,517	0.51
内 マレーシア	729,034,024	0.48
内 イスラエル	673,684,258	0.44
内 シンガポール	638,019,433	0.42
内 スウェーデン	458,873,120	0.30
内 ノルウェー	382,322,581	0.25
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,793,744,653	1.17
純資産総額	152,861,270,582	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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	650,121,126,088	95.67
内 アメリカ	455,346,008,732	67.01
内 イギリス	27,466,953,318	4.04
内 カナダ	24,049,127,086	3.54
内 スイス	21,868,891,719	3.22
内 フランス	21,122,010,222	3.11
内 ドイツ	17,939,352,410	2.64
内 オランダ	13,743,547,272	2.02
内 オーストラリア	13,053,453,495	1.92
内 アイルランド	12,308,372,088	1.81
内 スウェーデン	7,214,355,152	1.06

内 デンマーク	5,537,175,974	0.81
内 スペイン	4,950,006,712	0.73
内 香港	4,486,017,012	0.66
内 イタリア	3,781,664,990	0.56
内 ジャージー	2,634,227,400	0.39
内 フィンランド	2,546,896,688	0.37
内 シンガポール	1,794,565,434	0.26
内 ベルギー	1,671,885,310	0.25
内 パミュエダ	1,583,540,969	0.23
内 ノルウェー	1,315,094,171	0.19
内 イスラエル	1,210,566,418	0.18
内 ケイマン諸島	1,208,692,659	0.18
内 ルクセンブルグ	663,445,018	0.10
内 ニュージーランド	610,512,468	0.09
内 オランダ領キュラソー	558,882,618	0.08
内 オーストリア	434,989,898	0.06
内 ポルトガル	313,950,552	0.05
内 パナマ	220,516,727	0.03
内 リベリア	219,133,992	0.03
内 マン島	187,660,488	0.03
内 パプアニューギニア	79,629,096	0.01
投資信託受益証券	1,218,538,794	0.18
内 オーストラリア	927,418,910	0.14
内 シンガポール	291,119,884	0.04
投資証券	14,092,048,664	2.07
内 アメリカ	13,102,487,975	1.93
内 イギリス	406,195,817	0.06
内 フランス	278,726,675	0.04
内 香港	231,262,084	0.03
内 カナダ	73,376,113	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,119,371,682	2.08
純資産総額	679,551,085,228	100.00

その他資産の投資状況

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	15,129,890,207	2.23
内 アメリカ	11,289,633,356	1.66
内 ドイツ	2,324,099,019	0.34
内 イギリス	679,116,480	0.10
内 カナダ	536,029,881	0.08
内 オーストラリア	301,011,471	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年10月29日現在

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

国債証券		162,662,369,178	98.35
内	メキシコ	25,922,770,179	15.67
内	インドネシア	22,936,185,733	13.87
内	ロシア	20,730,519,636	12.53
内	ブラジル	17,330,468,240	10.48
内	フィリピン	14,702,268,606	8.89
内	コロンビア	14,082,177,029	8.51
内	パナマ	10,718,800,973	6.48
内	南アフリカ	10,425,516,717	6.30
内	ペルー	9,227,706,727	5.58
内	ハンガリー	6,748,477,377	4.08
内	ルーマニア	6,380,115,431	3.86
内	クロアチア	3,457,362,530	2.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,735,036,144	1.65
純資産総額		165,397,405,322	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10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)	
株式	67,274,341,864	89.96	
内	ケイマン諸島	14,880,848,257	19.90
内	台湾	9,615,457,563	12.86
内	韓国	8,329,114,015	11.14
内	インド	8,162,585,713	10.92
内	中国	7,595,865,313	10.16
内	ブラジル	2,592,727,326	3.47
内	サウジアラビア	2,308,626,389	3.09
内	ロシア	2,287,988,758	3.06
内	南アフリカ	2,049,502,873	2.74
内	タイ	1,109,706,054	1.48
内	インドネシア	978,925,341	1.31
内	メキシコ	954,499,890	1.28
内	マレーシア	905,043,704	1.21
内	香港	754,178,357	1.01
内	アラブ首長国連邦	549,586,194	0.73
内	カタール	508,693,906	0.68
内	ポーランド	485,761,913	0.65
内	フィリピン	444,445,664	0.59
内	バミューダ	408,104,938	0.55
内	クエート	404,455,466	0.54
内	チリ	267,111,965	0.36
内	オランダ	255,549,335	0.34
内	アメリカ	247,174,030	0.33
内	ハンガリー	176,935,444	0.24
内	トルコ	173,714,500	0.23
内	ルクセンブルグ	163,516,409	0.22
内	キプロス	132,172,144	0.18
内	ギリシャ	125,363,670	0.17

	内 コロンビア	118,334,048	0.16
	内 チェコ	83,073,639	0.11
	内 ジャージー	66,215,997	0.09
	内 エジプト	45,763,522	0.06
	内 マン島	25,693,229	0.03
	内 イギリス領バージン諸島	23,733,436	0.03
	内 ペルー	17,491,030	0.02
	内 シンガポール	10,793,946	0.01
	内 アルゼンチン	9,272,128	0.01
	内 パキスタン	6,315,758	0.01
新株予約権証券		0	0.00
	内 タイ	0	0.00
投資信託受益証券		415,393,275	0.56
	内 メキシコ	296,440,572	0.40
	内 ブラジル	118,952,703	0.16
投資証券		50,498,999	0.07
	内 メキシコ	27,118,106	0.04
	内 南アフリカ	23,380,893	0.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		7,039,303,613	9.41
純資産総額		74,779,537,751	100.00

その他資産の投資状況

2021年10月29日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	6,940,777,725	9.28
内 アメリカ	6,940,777,725	9.28

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

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

2021年10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,137,157	3.3138 23,651,313	3.3082 23,611,142	- -	20.99
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	13,589,858	1.4606 19,849,851	1.4874 20,213,554	- -	17.97
3	外国債券パッシブ・ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,761,037	2.0539 11,833,101	2.0879 12,028,469	- -	10.69

4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,412,929	5.6054	5.8844	-	7.39
				7,920,128	8,314,239	-	
5	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	3,633,454	2.1823	2.2177	-	7.16
				7,929,465	8,057,910	-	
6	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	6,051,750	1.3051	1.3054	-	7.02
				7,898,634	7,899,954	-	

(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10月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	71.23
合計	71.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

2021年10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	17,321,468	3.3071	3.3082	-	28.09
				57,284,115	57,302,880	-	
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	32,903,606	1.4547	1.4874	-	23.99
				47,867,836	48,940,823	-	
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,015,437	2.0494	2.0879	-	14.35
				28,724,484	29,262,830	-	
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,429,742	5.5894	5.8844	-	9.89
				19,170,207	20,181,973	-	
5	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	8,806,502	2.1781	2.2177	-	9.57
				19,181,850	19,530,179	-	
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,593,663	1.3049	1.3054	-	9.34
				19,043,790	19,050,567	-	

(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10月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	95.24
合計	95.24

(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10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,310,000,000	101.05 5,365,916,000	100.96 5,360,976,000	0.1 2028/3/20	1.10
2	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,730,000,000	101.90 4,820,236,000	101.67 4,809,369,400	0.4 2025/3/20	0.98
3	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	101.84 4,725,700,800	0.6 2024/6/20	0.97
4	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,610,000,000	102.07 4,705,587,000	101.95 4,699,895,000	0.4 2025/9/20	0.96
5	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,590,000,000	101.09 4,640,235,400	100.90 4,631,355,900	0.1 2026/12/20	0.95
6	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	101.80 4,489,556,400	0.4 2025/6/20	0.92
7	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	101.09 4,437,900,000	100.94 4,431,485,500	0.1 2027/3/20	0.91
8	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,350,000,000	100.98 4,392,955,000	100.86 4,387,410,000	0.1 2026/6/20	0.90
9	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	100.76 4,383,060,000	0.1 2025/9/20	0.90
10	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	100.93 4,380,405,400	0.1 2028/9/20	0.90
11	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	101.08 4,376,933,100	100.98 4,372,650,500	0.1 2027/12/20	0.89
12	333回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,230,000,000	102.07 4,317,681,000	101.67 4,300,641,000	0.6 2024/3/20	0.88
13	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,100,000,000	102.10 4,186,330,000	101.73 4,171,135,000	0.5 2024/9/20	0.85

14	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	100.71 4,129,110,000	0.1 2025/6/20	0.84
15	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,020,000,000	101.81 4,093,158,900	101.63 4,085,887,800	0.3 2025/12/20	0.84
16	356回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,040,000,000	101.11 4,085,098,800	100.82 4,073,451,200	0.1 2029/9/20	0.83
17	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,010,000,000	101.21 4,058,532,500	100.92 4,047,252,900	0.1 2028/12/20	0.83
18	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,950,000,000	100.54 3,971,616,000	100.32 3,962,877,000	0.1 2031/3/20	0.81
19	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,940,000,000	100.49 3,959,628,000	100.57 3,962,655,000	0.1 2030/9/20	0.81
20	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,900,000,000	101.13 3,944,144,200	100.96 3,937,596,000	0.1 2028/6/20	0.81
21	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,900,000,000	100.92 3,935,902,000	100.78 3,930,732,000	0.1 2025/12/20	0.80
22	329回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,850,000,000	101.85 3,921,410,200	101.48 3,906,980,000	0.8 2023/6/20	0.80
23	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,790,000,000	101.09 3,831,379,000	100.97 3,826,914,600	0.1 2027/9/20	0.78
24	357回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,790,000,000	101.08 3,831,274,000	100.77 3,819,258,800	0.1 2029/12/20	0.78
25	139回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,750,000,000	100.69 3,776,045,900	100.48 3,768,337,500	0.1 2024/3/20	0.77
26	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,730,000,000	101.10 3,771,114,200	100.96 3,765,845,300	0.1 2027/6/20	0.77
27	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,680,000,000	101.63 3,740,057,000	101.50 3,735,494,400	0.6 2023/12/20	0.76
28	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.35 3,713,062,000	100.45 3,716,798,000	0.1 2030/12/20	0.76
29	137回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,610,000,000	100.51 3,628,546,100	100.39 3,624,295,600	0.1 2023/9/20	0.74
30	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	100.57 3,620,570,000	100.19 3,606,876,000	0.1 2031/6/20	0.74

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.41
地方債証券	5.62
特殊債券	5.87
社債券	4.27
合計	100.17

(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10月29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	8,502,300	1,773.41 15,078,146,889	2,006.50 17,059,864,950	- -	3.59
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,051,500	11,866.41 12,477,539,151	13,140.00 13,816,710,000	- -	2.91
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	152,100	58,581.74 8,910,282,721	68,510.00 10,420,371,000	- -	2.19
4	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,237,300	5,777.42 7,148,407,348	7,572.00 9,368,835,600	- -	1.97
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,616,900	583.54 6,195,403,511	622.50 6,609,020,250	- -	1.39
6	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,926,600	2,895.68 5,578,829,160	3,188.00 6,142,000,800	- -	1.29
7	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	987,600	8,293.53 8,190,694,590	6,164.00 6,087,566,400	- -	1.28
8	信越化学工業 日本	株式 化学	282,300	18,452.03 5,209,010,223	20,255.00 5,717,986,500	- -	1.20
9	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	106,500	45,389.86 4,834,020,306	52,850.00 5,628,525,000	- -	1.18
10	HOYA 日本	株式 精密機器	327,500	14,539.90 4,761,819,270	16,725.00 5,477,437,500	- -	1.15
11	日本電産 日本	株式 電気機器	435,000	13,151.70 5,720,993,013	12,570.00 5,467,950,000	- -	1.15
12	ダイキン工業 日本	株式 機械	213,800	23,406.17 5,004,239,383	24,890.00 5,321,482,000	- -	1.12
13	日立製作所 日本	株式 電気機器	807,300	5,637.46 4,551,122,792	6,554.00 5,291,044,200	- -	1.11

14	任天堂 日本	株式 その他製 品	94,700	59,802.34 5,663,282,042	50,200.00 4,753,940,000	- -	1.00
15	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,238,800	3,201.27 3,965,743,992	3,612.00 4,474,545,600	- -	0.94
16	本田技研工業 日本	株式 輸送用機 器	1,321,500	3,256.36 4,303,288,789	3,349.00 4,425,703,500	- -	0.93
17	村田製作所 日本	株式 電気機器	493,000	9,051.58 4,462,431,099	8,653.00 4,265,929,000	- -	0.90
18	三井住友フィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	1,145,900	3,777.26 4,328,371,926	3,721.00 4,263,893,900	- -	0.90
19	KDDI 日本	株式 情報・通 信業	1,200,800	3,470.91 4,167,872,966	3,528.00 4,236,422,400	- -	0.89
20	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,319,300	3,640.52 4,802,939,111	3,203.00 4,225,717,900	- -	0.89
21	ソフトバンク 日本	株式 情報・通 信業	2,494,900	1,489.02 3,714,967,322	1,554.50 3,878,322,050	- -	0.82
22	第一三共 日本	株式 医薬品	1,319,100	2,920.54 3,852,496,544	2,867.00 3,781,859,700	- -	0.80
23	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,156,300	3,230.55 3,735,489,620	3,242.00 3,748,724,600	- -	0.79
24	オリエンタルランド 日本	株式 サービ ス業	189,500	17,322.41 3,282,597,902	17,940.00 3,399,630,000	- -	0.72
25	S M C 日本	株式 機械	49,200	65,332.99 3,214,383,405	67,940.00 3,342,648,000	- -	0.70
26	三井物産 日本	株式 卸売業	1,283,700	2,284.96 2,933,210,584	2,592.00 3,327,350,400	- -	0.70
27	ファナック 日本	株式 電気機器	147,300	26,437.90 3,894,303,120	22,310.00 3,286,263,000	- -	0.69
28	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	545,300	5,579.87 3,042,704,171	5,998.00 3,270,709,400	- -	0.69
29	みずほフィナンシャルグ ループ 日本	株式 銀行業	2,117,200	1,568.32 3,320,467,596	1,505.00 3,186,386,000	- -	0.67
30	セブン&アイ・ホールディ ングス 日本	株式 小売業	646,800	4,605.22 2,978,658,667	4,782.00 3,092,997,600	- -	0.65

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.83
合計	96.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年10月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	18.13
情報・通信業		8.16
輸送用機器		7.73
化学		6.73
サービス業		6.38
機械		5.26
卸売業		4.90
医薬品		4.77
銀行業		4.52
小売業		4.22
食料品		3.30
陸運業		3.03
精密機器		2.78
建設業		2.23
その他製品		2.10
不動産業		1.93
保険業		1.90
その他金融業		1.12
電気・ガス業		1.02
鉄鋼		0.78
ガラス・土石製品		0.77
証券、商品先物取引業		0.73
非鉄金属		0.69
ゴム製品		0.67
金属製品		0.60
繊維製品		0.46
海運業		0.44
空運業		0.41
石油・石炭製品		0.41
鉱業		0.21
パルプ・紙		0.21
倉庫・運輸関連業	0.17	
水産・農林業	0.09	
合計	96.83	

(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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証 券	879,805,800	101.43 892,412,475	100.66 885,613,889	1.625 2031/5/15	0.58
2	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	779,776,200	95.88 747,673,133	96.40 751,752,991	1.125 2031/2/15	0.49
3	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	795,690,000	95.66 761,187,302	94.46 751,616,227	0.875 2030/11/15	0.49

4	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証 券	662,696,100	107.22 710,593,404	105.30 697,824,167	2.25 2027/8/15	0.46
5	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証 券	627,458,400	107.02 671,527,545	104.56 656,110,697	2.75 2023/11/15	0.43
6	US T N/B 1.625 11/15/22 アメリカ	国債証 券	638,825,400	102.61 655,519,702	101.55 648,732,182	1.625 2022/11/15	0.42
7	US T N/B 2.0 11/30/22 アメリカ	国債証 券	635,415,300	103.34 656,657,233	101.99 648,061,551	2 2022/11/30	0.42
8	US T N/B 2.125 12/31/22 アメリカ	国債証 券	627,458,400	103.73 650,890,049	102.25 641,576,214	2.125 2022/12/31	0.42
9	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	604,724,400	107.55 650,409,434	104.90 634,393,690	2.75 2024/2/15	0.42
10	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証 券	579,717,000	105.66 612,585,710	109.35 633,974,887	2.375 2051/5/15	0.41
11	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証 券	591,084,000	109.02 644,419,100	105.98 626,456,681	2.375 2027/5/15	0.41
12	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証 券	638,825,400	91.84 586,734,534	97.87 625,275,309	1.875 2051/2/15	0.41
13	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証 券	588,810,600	106.80 628,877,317	103.86 611,558,007	2 2025/8/15	0.40
14	US T N/B 0.125 11/30/22 アメリカ	国債証 券	606,997,800	100.02 607,163,770	99.96 606,772,542	0.125 2022/11/30	0.40
15	US T N/B 1.75 09/30/22 アメリカ	国債証 券	596,767,500	102.64 612,525,891	101.48 605,614,106	1.75 2022/9/30	0.40
16	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証 券	530,838,900	113.57 602,896,086	111.32 590,952,253	3.125 2028/11/15	0.39
17	US T N/B 1.75 01/31/23 アメリカ	国債証 券	566,076,600	103.17 584,076,063	101.88 576,756,868	1.75 2023/1/31	0.38
18	US T N/B 0.125 09/30/22 アメリカ	国債証 券	571,760,100	99.97 571,622,877	99.99 571,748,927	0.125 2022/9/30	0.37
19	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	568,350,000	100.10 568,968,643	99.33 564,575,797	0.375 2024/4/15	0.37
20	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証 券	568,350,000	99.57 565,942,537	99.01 562,777,504	0.125 2024/1/15	0.37
21	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	542,205,900	105.67 572,959,140	103.39 560,611,246	2 2024/5/31	0.37
22	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	533,112,300	108.07 576,177,111	104.91 559,309,768	2.25 2025/11/15	0.37
23	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	533,112,300	107.10 570,971,599	104.42 556,727,505	2.25 2024/11/15	0.36
24	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証 券	593,357,400	92.50 548,912,384	92.92 551,393,585	0.625 2030/5/15	0.36
25	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	503,558,100	113.13 569,689,437	109.29 550,353,591	2.875 2028/5/15	0.36
26	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証 券	546,752,700	99.75 545,391,285	99.13 542,011,325	0.25 2024/3/15	0.35
27	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証 券	306,698,700	179.14 549,421,062	173.23 531,318,387	4.5 2041/4/25	0.35
28	US T N/B 1.625 10/31/23 アメリカ	国債証 券	511,515,000	103.06 527,193,503	102.25 523,044,067	1.625 2023/10/31	0.34

29	US T N/B 2.25 05/15/41 アメリカ	国債証券	499,011,300	106.07 529,338,011	104.57 521,856,660	2.25 2041/5/15	0.34
30	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	430,174,800	124.58 535,940,953	121.26 521,640,286	2.5 2030/5/25	0.34

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.83
合計	98.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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10月29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	1,705,503	15,585.14 26,580,504,069	17,342.63 29,577,910,733	- -	4.35
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	731,048	29,268.10 21,396,386,650	36,868.86 26,952,909,654	- -	3.97
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	46,395	375,127.97 17,404,062,227	391,771.61 18,176,243,934	- -	2.67
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	83,707	88,359.91 7,396,343,510	122,427.13 10,248,008,340	- -	1.51
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	30,705	259,113.84 7,956,090,640	331,573.11 10,180,952,545	- -	1.50
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	29,781	260,346.31 7,753,373,510	332,209.66 9,893,536,140	- -	1.46

7	FACEBOOK INC アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	244,886	33,422.67 8,184,746,158	36,024.29 8,821,845,848	- -	1.30
8	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	254,793	18,819.77 4,795,146,943	28,350.43 7,223,492,308	- -	1.06
9	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	308,951	16,807.74 5,192,768,891	19,364.82 5,982,780,874	- -	0.88
10	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイ ダー/ハ ルスケ ア・サー ビス	96,311	40,513.95 3,901,939,934	51,769.86 4,986,007,448	- -	0.73
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	269,091	18,977.33 5,106,630,750	18,511.15 4,981,186,421	- -	0.73
12	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	108,641	33,447.17 3,633,734,013	42,236.36 4,588,600,593	- -	0.68
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	134,892	29,039.42 3,917,185,903	32,932.47 4,442,327,066	- -	0.65
14	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	293,570	13,044.84 3,829,574,116	14,957.62 4,391,108,973	- -	0.65
15	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	787,107	4,123.55 3,245,678,676	5,431.15 4,274,898,229	- -	0.63
16	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	172,598	24,692.85 4,261,937,132	23,852.51 4,116,896,004	- -	0.61
17	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	249,556	14,982.29 3,738,922,287	16,218.43 4,047,407,914	- -	0.60
18	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	42,901	71,579.47 3,070,831,134	92,726.56 3,978,062,493	- -	0.59
19	THE WALT DISNEY CO アメリカ	株式 娯楽	185,703	20,943.73 3,889,313,664	19,287.52 3,581,751,366	- -	0.53
20	ADOBE INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	48,790	59,968.78 2,925,876,955	72,666.95 3,545,420,861	- -	0.52
21	NETFLIX INC アメリカ	株式 娯楽	45,351	62,920.76 2,853,519,803	76,619.26 3,474,760,218	- -	0.51

22	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	90,347	39,666.30 3,583,731,233	37,855.52 3,420,132,674	- -	0.50
23	SALESFORCE.COM INC アメリカ	株式 ソフト ウェア	99,310	27,715.22 2,752,399,012	33,916.85 3,368,282,830	- -	0.50
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	71,500	40,334.65 2,883,927,626	44,503.66 3,182,011,976	- -	0.47
25	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	432,803	6,101.98 2,640,955,893	7,310.11 3,163,840,870	- -	0.47
26	PAYPAL HOLDINGS INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	113,989	32,703.61 3,727,852,670	26,920.46 3,068,637,010	- -	0.45
27	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサ イエ ン ス・ツ ール/ サー ビス	40,184	58,587.48 2,354,279,512	70,483.35 2,832,303,213	- -	0.42
28	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	572,642	4,261.14 2,440,108,589	4,908.27 2,810,681,892	- -	0.41
29	COMCAST CORP-CL A アメリカ	株式 メディア	468,764	6,197.66 2,905,244,293	5,899.47 2,765,460,561	- -	0.41
30	CISCO SYSTEMS INC アメリカ	株式 通信機器	430,080	5,682.84 2,444,078,810	6,392.80 2,749,415,768	- -	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10月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.67
投資信託受益証券	0.18
投資証券	2.07
合計	97.92

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年10月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.11
銀行		6.15
半導体・半導体製造装置		4.70
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.64
コンピュータ・周辺機器		4.62
医薬品		4.47
情報技術サービス		4.27
資本市場		3.37

インターネット販売・通信販売	3.26
石油・ガス・消耗燃料	3.25
保険	2.98
ヘルスケア機器・用品	2.94
自動車	2.20
化学	2.05
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.93
ホテル・レストラン・レジャー	1.79
専門小売り	1.71
電力	1.66
バイオテクノロジー	1.63
機械	1.62
飲料	1.53
繊維・アパレル・贅沢品	1.50
娯楽	1.49
食品	1.49
食品・生活必需品小売り	1.37
金属・鉱業	1.33
航空宇宙・防衛	1.32
各種電気通信サービス	1.21
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.16
陸運・鉄道	1.08
コングロマリット	1.04
家庭用品	1.02
メディア	0.99
電気設備	0.89
各種金融サービス	0.88
専門サービス	0.80
総合公益事業	0.77
通信機器	0.66
航空貨物・物流サービス	0.62
建設関連製品	0.61
パーソナル用品	0.59
タバコ	0.59
電子装置・機器・部品	0.58
複合小売り	0.50
消費者金融	0.46
商業サービス・用品	0.45
不動産管理・開発	0.36
家庭用耐久財	0.33
商社・流通業	0.33
自動車部品	0.26
容器・包装	0.26
建設資材	0.24
無線通信サービス	0.24
建設・土木	0.21
エネルギー設備・サービス	0.16
ヘルスケア・テクノロジー	0.15
ガス	0.13
運送インフラ	0.13

水道	0.11
紙製品・林産品	0.10
販売	0.09
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.09
海運業	0.08
レジャー用品	0.06
旅客航空輸送業	0.05
合計	95.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年10月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47 ロシア	国債証券	3,410,100,000	125.68 4,286,137,298	127.60 4,351,297,830	5.25 2047/6/23	2.63
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35 ロシア	国債証券	2,500,740,000	119.32 2,983,902,746	119.80 2,995,936,534	5.1 2035/3/28	1.81
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40 メキシコ	国債証券	1,921,023,000	125.09 2,403,131,571	125.18 2,404,909,483	6.05 2040/1/11	1.45
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	2,273,400,000	102.20 2,323,484,707	99.44 2,260,668,960	5 2045/6/15	1.37
5	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29 ロシア	国債証券	1,977,858,000	113.14 2,237,871,304	112.87 2,232,554,686	4.375 2029/3/21	1.35
6	RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26 ロシア	国債証券	1,977,858,000	113.10 2,236,972,175	112.36 2,222,509,145	4.75 2026/5/27	1.34
7	RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42 ロシア	国債証券	1,705,050,000	130.55 2,225,960,962	130.11 2,218,576,959	5.625 2042/4/4	1.34
8	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,977,858,000	112.56 2,226,398,932	111.05 2,196,514,157	6 2024/1/26	1.33
9	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,159,730,000	100.94 2,180,068,404	100.36 2,167,656,209	2.783 2031/1/23	1.31
10	RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23 ロシア	国債証券	1,977,858,000	108.05 2,137,224,022	107.48 2,125,950,117	4.875 2023/9/16	1.29
11	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	2,023,326,000	107.12 2,167,406,362	103.68 2,097,956,379	4.625 2028/1/13	1.27
12	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,861,914,600	111.49 2,076,022,343	110.24 2,052,578,378	5.375 2024/3/25	1.24
13	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,477,710,000	136.83 2,022,021,068	138.63 2,048,549,373	5.625 2050/11/18	1.24
14	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,818,720,000	111.31 2,024,586,372	109.84 1,997,782,077	5.75 2023/11/22	1.21

15	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	2,046,060,000	97.81 2,001,274,020	96.85 1,981,772,794	2.659 2031/5/24	1.20
16	RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27 ロシア	国債証券	1,750,518,000	111.94 1,959,608,281	110.98 1,942,803,649	4.25 2027/6/23	1.17
17	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	2,046,060,000	98.23 2,010,003,876	94.72 1,938,130,335	3.875 2030/6/12	1.17
18	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,705,050,000	113.15 1,929,282,262	112.34 1,915,598,099	4.5 2029/4/22	1.16
19	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,614,114,000	112.30 1,812,744,140	112.01 1,808,001,373	5.875 2025/9/16	1.09
20	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,591,380,000	114.56 1,823,208,259	112.86 1,796,158,778	4.75 2032/4/27	1.09
21	COLOMBIA 6.125 01/18/41 コロンビア	国債証券	1,591,380,000	118.03 1,878,434,829	111.82 1,779,600,469	6.125 2041/1/18	1.08
22	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27 メキシコ	国債証券	1,523,178,000	112.45 1,712,841,737	112.03 1,706,545,783	4.15 2027/3/28	1.03
23	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46 メキシコ	国債証券	1,591,380,000	105.99 1,686,840,066	106.95 1,702,076,392	4.6 2046/1/23	1.03
24	HUNGARY 7.625 03/29/41 ハンガリー	国債証券	1,023,030,000	167.68 1,715,505,366	165.21 1,690,239,935	7.625 2041/3/29	1.02
25	PANAMA 4.5 04/16/50 パナマ	国債証券	1,511,811,000	111.80 1,690,238,457	111.07 1,679,228,950	4.5 2050/4/16	1.02
26	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,239,003,000	135.25 1,675,814,644	133.36 1,652,458,301	6.7 2036/1/26	1.00
27	BRAZIL 5.0 01/27/45 ブラジル	国債証券	1,795,986,000	96.66 1,736,177,392	91.49 1,643,201,470	5 2045/1/27	0.99
28	BRAZIL 6.0 04/07/26 ブラジル	国債証券	1,454,976,000	115.61 1,682,111,394	112.86 1,642,136,837	6 2026/4/7	0.99
29	PANAMA 4.5 04/01/56 パナマ	国債証券	1,477,710,000	111.11 1,642,014,869	110.57 1,633,948,278	4.5 2056/4/1	0.99
30	INDONESIA 7.75 01/17/38 インドネシア	国債証券	1,079,865,000	150.29 1,623,000,720	149.98 1,619,586,170	7.75 2038/1/17	0.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.35
合計	98.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年10月29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	1,828,083	2,463.54 4,503,568,789	2,431.70 4,445,359,485	- -	5.94
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	428,000	8,592.54 3,677,609,528	7,137.48 3,054,843,152	- -	4.09
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,129,968	3,120.83 3,526,448,966	2,415.22 2,729,125,832	- -	3.65
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	355,314	7,853.75 2,790,547,490	6,879.10 2,444,244,090	- -	3.27
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	300,400	4,063.52 1,220,683,456	3,979.56 1,195,461,025	- -	1.60
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	211,545	3,189.05 674,629,481	3,975.85 841,072,880	- -	1.12
7	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	252,086	2,242.47 565,297,719	2,606.96 657,179,883	- -	0.88
8	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	64,804	8,783.09 569,179,473	9,198.17 596,078,623	- -	0.80
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	127,081	3,993.16 507,455,256	4,438.22 564,013,944	- -	0.75
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	7,124,530	90.72 646,390,128	77.92 555,176,150	- -	0.74

11	GAZPROM PAO ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	442,291	814.58 360,284,073	1,132.60 500,942,271	- -	0.67
12	SBERBANK ADR ロシア	株式 銀行	202,678	1,879.42 380,918,976	2,356.37 477,586,203	- -	0.64
13	NIO INC ADR ケイマン諸島	株式 自動車	101,531	4,283.36 434,894,281	4,636.59 470,758,563	- -	0.63
14	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	379,450	956.69 363,016,276	1,222.01 463,692,073	- -	0.62
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	269,500	1,636.47 441,030,998	1,684.22 453,898,368	- -	0.61
16	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	294,321	2,076.00 611,012,998	1,484.57 436,941,878	- -	0.58
17	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	111,507	3,855.68 429,935,479	3,825.33 426,552,008	- -	0.57
18	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	40,765	12,271.77 500,258,806	10,362.44 422,425,274	- -	0.56
19	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	924,225	481.38 444,908,796	443.42 409,827,844	- -	0.55
20	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	471,000	1,174.59 553,232,018	853.07 401,799,267	- -	0.54
21	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	20,725	22,442.72 465,125,551	19,177.26 397,448,831	- -	0.53
22	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	90,579	3,198.59 289,725,239	4,206.50 381,021,469	- -	0.51
23	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	59,839	7,117.00 425,874,601	6,363.41 380,780,689	- -	0.51

24	LUKOIL SPON ADR ロシア	株式 石油・ガス・消耗燃料	31,430	9,646.89 303,201,770	11,730.74 368,697,283	- -	0.49
25	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	9,146	38,304.94 350,337,053	40,184.89 367,531,095	- -	0.49
26	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	68,120	4,990.11 339,926,595	5,235.12 356,616,680	- -	0.48
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	32,864	13,848.98 455,132,988	10,508.79 345,360,923	- -	0.46
28	NETEASE INC-ADR ケイマン諸島	株式 娯楽	30,226	11,952.12 361,264,887	11,364.72 343,510,226	- -	0.46
29	XIAOMI CORP ケイマン諸島	株式 コンピュータ・周辺機器	1,072,200	376.18 403,340,664	319.44 342,511,073	- -	0.46
30	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	161,780	1,725.20 279,104,252	2,000.06 323,570,515	- -	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2021年10月29日現在

種類	投資比率(%)
株式	89.96
新株予約権証券	0.00
投資信託受益証券	0.56
投資証券	0.07
合計	90.59

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2021年10月29日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	12.37
半導体・半導体製造装置		8.61
インターネット販売・通信販売		7.21
インタラクティブ・メディアおよびサービス		6.05
石油・ガス・消耗燃料		5.20
コンピュータ・周辺機器		4.94
金属・鉱業		3.72

自動車	3.17
化学	2.82
電子装置・機器・部品	2.41
保険	2.39
情報技術サービス	2.27
不動産管理・開発	1.74
食品	1.66
無線通信サービス	1.44
医薬品	1.20
食品・生活必需品小売り	1.14
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.10
繊維・アパレル・贅沢品	1.09
飲料	1.01
娯楽	1.01
各種電気通信サービス	0.99
資本市場	0.89
ホテル・レストラン・レジャー	0.88
バイオテクノロジー	0.86
建設資材	0.82
コングロマリット	0.80
貯蓄・抵当・不動産金融	0.75
各種金融サービス	0.74
電力	0.66
電気設備	0.66
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.62
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.62
運送インフラ	0.54
消費者金融	0.54
専門小売り	0.53
ガス	0.51
建設・土木	0.51
自動車部品	0.50
パーソナル用品	0.49
機械	0.43
海運業	0.37
家庭用品	0.36
家庭用耐久財	0.35
タバコ	0.34
ソフトウェア	0.32
複合小売り	0.26
航空貨物・物流サービス	0.26
ヘルスケア機器・用品	0.24
陸運・鉄道	0.20
紙製品・林産品	0.15
通信機器	0.14
旅客航空輸送業	0.13
メディア	0.12
航空宇宙・防衛	0.11
水道	0.10
各種消費者サービス	0.09

商社・流通業	0.08
レジャー用品	0.08
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
エネルギー設備・サービス	0.06
商業サービス・用品	0.06
容器・包装	0.05
建設関連製品	0.04
総合公益事業	0.03
専門サービス	0.02
販売	0.00
合計	89.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

【投資不動産物件】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

該当事項はありません。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年10月29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 0312月	買建	811	16,370,722,630	16,159,175,000	3.40

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29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 Dec21	買建	433	10,979,757,569	11,289,633,356	1.66
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Dec21	買建	415	2,288,290,618	2,324,099,019	0.34
	ICE-EU	FTSE 100 INDEX FUTURE Dec21	買建	60	669,188,688	679,116,480	0.10
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Dec21	買建	23	521,829,123	536,029,881	0.08
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Dec21	買建	19	299,237,618	301,011,471	0.04

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年10月29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 Dec21	買建	954	6,935,837,627	6,940,777,725	9.28

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)

直近日(2021年10月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1計算期間末 (2015年10月13日)	301	301	0.9926	0.9926
第2計算期間末 (2016年4月11日)	240	240	0.9460	0.9460
第3計算期間末 (2016年10月11日)	233	233	0.9477	0.9477
第4計算期間末 (2017年4月11日)	165	165	1.0000	1.0000
第5計算期間末 (2017年10月11日)	141	141	1.0538	1.0538
第6計算期間末 (2018年4月11日)	133	133	1.0645	1.0645
第7計算期間末 (2018年10月11日)	154	154	1.0294	1.0294
第8計算期間末 (2019年4月11日)	157	157	1.0513	1.0513
第9計算期間末 (2019年10月11日)	145	145	1.0129	1.0129
第10計算期間末 (2020年4月13日)	112	112	1.0386	1.0386
第11計算期間末 (2020年10月12日)	109	109	1.0934	1.0934
第12計算期間末 (2021年4月12日)	107	107	1.1720	1.1720
第13計算期間末 (2021年10月11日)	101	101	1.1550	1.1550
2020年10月末日	107	-	1.0795	-
11月末日	108	-	1.1109	-
12月末日	109	-	1.1277	-
2021年1月末日	110	-	1.1472	-
2月末日	107	-	1.1516	-
3月末日	107	-	1.1690	-
4月末日	107	-	1.1684	-
5月末日	105	-	1.1690	-
6月末日	105	-	1.1754	-
7月末日	104	-	1.1593	-
8月末日	103	-	1.1612	-
9月末日	102	-	1.1598	-
10月末日	112	-	1.1652	-

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

直近日(2021年10月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2015年10月13日)	519	519	0.9901	0.9901
第2計算期間末 (2016年4月11日)	418	418	0.9230	0.9230

第3計算期間末 (2016年10月11日)	404	404	0.9286	0.9286
第4計算期間末 (2017年4月11日)	368	368	0.9691	0.9691
第5計算期間末 (2017年10月11日)	312	312	1.0451	1.0451
第6計算期間末 (2018年4月11日)	297	297	1.0571	1.0571
第7計算期間末 (2018年10月11日)	290	290	1.0089	1.0089
第8計算期間末 (2019年4月11日)	310	310	1.0353	1.0353
第9計算期間末 (2019年10月11日)	281	281	0.9819	0.9819
第10計算期間末 (2020年4月13日)	205	205	1.0067	1.0067
第11計算期間末 (2020年10月12日)	201	201	1.0975	1.0975
第12計算期間末 (2021年4月12日)	192	192	1.2155	1.2155
第13計算期間末 (2021年10月11日)	201	201	1.1899	1.1899
2020年10月末日	196	-	1.0786	-
11月末日	197	-	1.1259	-
12月末日	201	-	1.1479	-
2021年1月末日	199	-	1.1709	-
2月末日	191	-	1.1785	-
3月末日	193	-	1.2119	-
4月末日	196	-	1.2094	-
5月末日	199	-	1.2118	-
6月末日	206	-	1.2182	-
7月末日	200	-	1.1961	-
8月末日	201	-	1.1977	-
9月末日	200	-	1.1955	-
10月末日	203	-	1.2069	-

【分配の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

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

第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	1口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000

【収益率の推移】

D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）

	収益率（％）
第1計算期間	0.7
第2計算期間	4.7
第3計算期間	0.2
第4計算期間	5.5
第5計算期間	5.4
第6計算期間	1.0
第7計算期間	3.3
第8計算期間	2.1
第9計算期間	3.7
第10計算期間	2.5
第11計算期間	5.3
第12計算期間	7.2
第13計算期間	1.5

（注）収益率は期間騰落率です。

D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）

	収益率（％）
第1計算期間	1.0
第2計算期間	6.8
第3計算期間	0.6
第4計算期間	4.4
第5計算期間	7.8
第6計算期間	1.1
第7計算期間	4.6
第8計算期間	2.6
第9計算期間	5.2
第10計算期間	2.5

第11計算期間	9.0
第12計算期間	10.8
第13計算期間	2.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	312,448,290	8,299,019
第2計算期間	41,355,881	91,105,022
第3計算期間	7,228,942	14,873,920
第4計算期間	6,056,134	87,803,625
第5計算期間	10,207,312	41,322,402
第6計算期間	12,455,819	20,836,255
第7計算期間	33,165,458	8,351,305
第8計算期間	16,604,344	16,654,728
第9計算期間	1,311,733	7,974,207
第10計算期間	1,606,500	36,538,844
第11計算期間	1,490,630	10,290,763
第12計算期間	1,235,368	9,345,780
第13計算期間	2,058,513	5,746,132

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	538,147,596	13,046,804
第2計算期間	67,620,276	138,974,156
第3計算期間	13,958,010	31,768,621
第4計算期間	14,712,909	70,413,301
第5計算期間	38,653,832	119,655,755
第6計算期間	34,785,616	52,794,441
第7計算期間	43,415,961	36,374,469
第8計算期間	26,771,880	14,887,931
第9計算期間	6,903,112	20,146,926
第10計算期間	3,492,125	85,806,510
第11計算期間	2,999,387	24,224,515
第12計算期間	5,001,682	29,781,945
第13計算期間	20,448,387	9,360,187

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

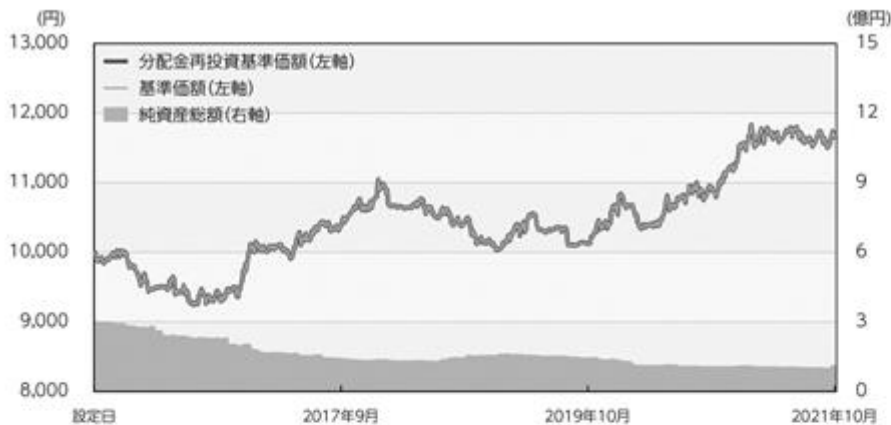
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2021年10月29日

(堅 実 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2021年10月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

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

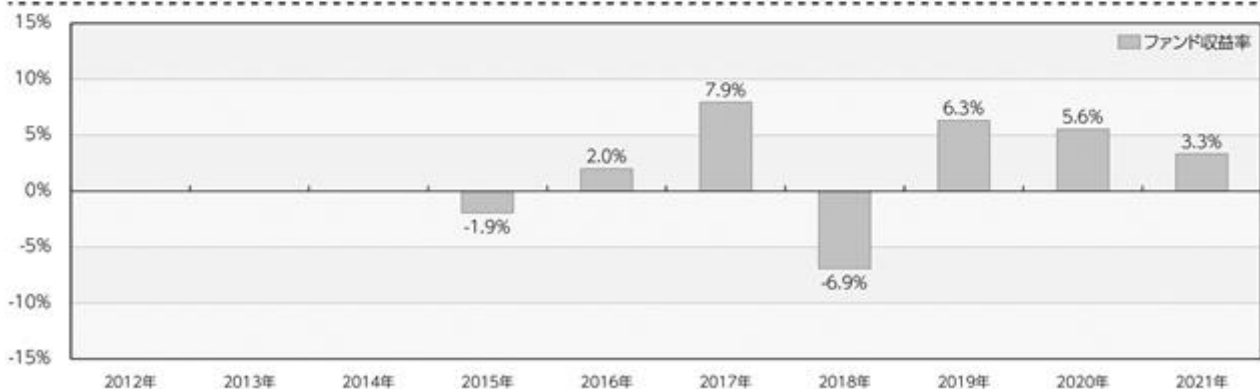
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	20.99
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	17.97
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.69
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.39
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.16
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.02

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

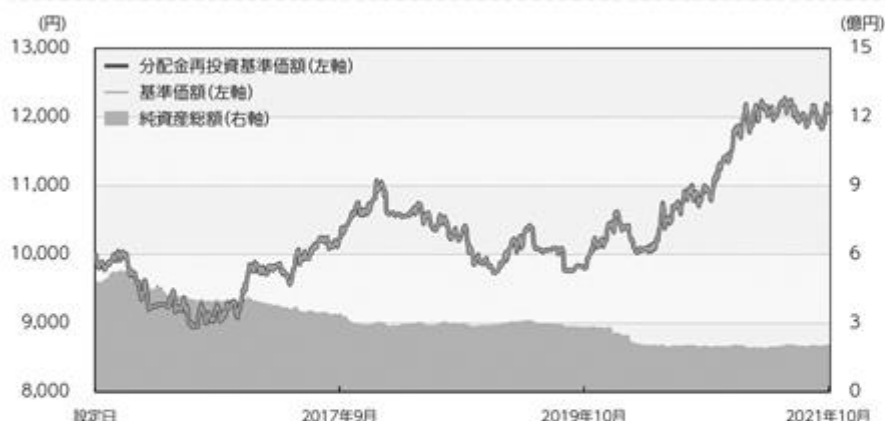
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年10月29日

(積 極 型)

基準価額・純資産の推移 (2015年8月28日～2021年10月29日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

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

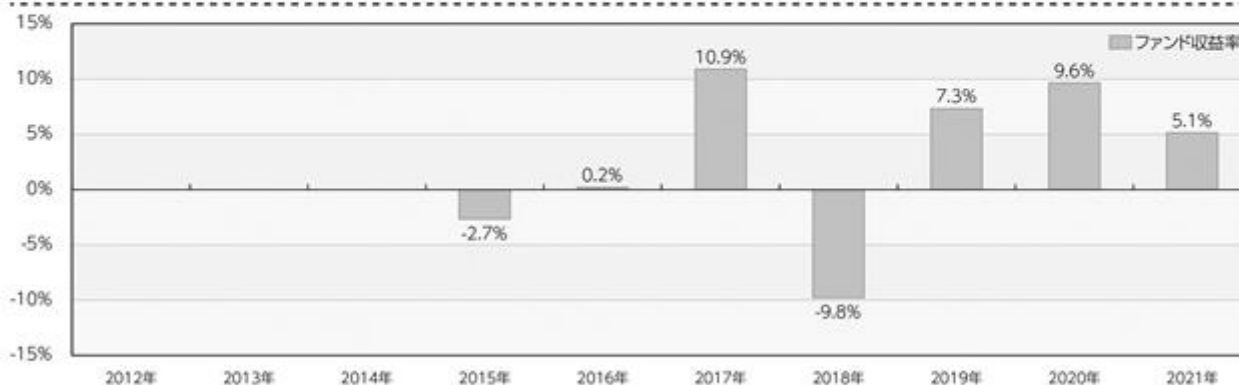
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	28.09
2	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	23.99
3	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.35
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.89
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.57
6	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	9.34

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2021年10月29日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	350回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.10
2	338回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/3/20	0.98
3	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	0.97
4	340回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/9/20	0.96
5	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	0.95

■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	3.59
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.91
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.19
4	リクルートホールディングス	株式	日本	サービス業	1.97
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.39

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.58
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.49
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.49
4	US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	アメリカ	2.25	2027/8/15	0.46
5	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.43

■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	4.35
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.97
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.67
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.51
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	1.50

○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10月29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	2.63
2	RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	国債証券	ロシア	5.1	2035/3/28	1.81
3	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	国債証券	メキシコ	6.05	2040/1/11	1.45
4	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.37
5	RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	国債証券	ロシア	4.375	2029/3/21	1.35

■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	5.94
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.09
3	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	3.65
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.27
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.60

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。)

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ
- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・ お申込手数料

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

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

< 主な投資対象の時価評価方法の原則 >

投資対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	計算日の基準価額
株式	計算日における金融商品取引所等の最終相場
公社債等	計算日における以下のいずれかの価額 <ul style="list-style-type: none"> ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値） ・金融商品取引業者、銀行などの提示する価額（売り気配相場を除きます。） ・価格情報会社の提供する価額
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値

外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買取相場の仲値
------------	-------------------------

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2015年8月28日から原則として無期限です。(注)

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

(注)繰上償還(信託終了)が決定した場合には、信託期間は2022年3月14日までとなります。

(4)【計算期間】

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

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

(5)【その他】

イ.償還規定

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

- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ. 信託約款の変更等

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

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

八. 関係法人との契約の更改

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

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

二．公告

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

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

ホ．運用報告書

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

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

なお、「分配金自動けいぞく投資コース」により収益分配金を再投資する受益者に対しては、委託会社は受託会社から受けた収益分配金を、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に販売会社に交付します。販売会社は、受益者に対し遅滞なく収益分配金の再投資にかかる受益権の売付を行います。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間(2021年4月13日から2021年10月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	18,897,507	80,762,533
親投資信託受益証券	89,288,890	21,582,492
流動資産合計	108,186,397	102,345,025
資産合計	108,186,397	102,345,025
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,894	28,729
未払委託者報酬	598,633	575,480
その他未払費用	2,003	1,986
流動負債合計	630,530	606,195
負債合計	630,530	606,195
純資産の部		
元本等		
元本	91,770,541	88,082,922
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	15,785,326	13,655,908
(分配準備積立金)	14,283,284	13,400,949
元本等合計	107,555,867	101,738,830
純資産合計	107,555,867	101,738,830
負債純資産合計	108,186,397	102,345,025

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第13期 自 2021年4月13日 至 2021年10月11日
営業収益		
受取利息	26	106
有価証券売買等損益	8,267,262	906,398
営業収益合計	8,267,288	906,292
営業費用		
支払利息	3,802	5,886
受託者報酬	29,894	28,729
委託者報酬	598,633	575,480
その他費用	2,003	7,926
営業費用合計	634,332	618,021
営業利益又は営業損失()	7,632,956	1,524,313
経常利益又は経常損失()	7,632,956	1,524,313
当期純利益又は当期純損失()	7,632,956	1,524,313
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()	477,464	37,668
期首剰余金又は期首欠損金()	9,332,641	15,785,326
剰余金増加額又は欠損金減少額	172,228	345,283
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	172,228	345,283
剰余金減少額又は欠損金増加額	875,035	988,056
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	875,035	988,056
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	15,785,326	13,655,908

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2021年4月12日現在	2021年10月11日現在
1. 期首元本額	99,880,953円	91,770,541円
期中追加設定元本額	1,235,368円	2,058,513円
期中一部解約元本額	9,345,780円	5,746,132円
2. 受益権の総数	91,770,541口	88,082,922口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(633,316円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(6,522,176円)、信託約款に規定される収益調整金(2,528,508円)及び分配準備積立金(7,127,792円)より分配対象収益は16,811,792円(1万口当たり1,831.93円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,735,955円)及び分配準備積立金(13,400,949円)より分配対象収益は16,136,904円(1万口当たり1,832.01円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	第13期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,525,289	45,569
合計	3,525,289	45,569

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1720円 (11,720円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2021年10月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	2,015,122	6,651,313	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,608,272	2,098,634	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	399,980	2,220,128	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,583,767	3,233,101	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	3,634,373	5,249,851	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	982,226	2,129,465	
親投資信託受益証券 合計		10,223,740	21,582,492	
合計			21,582,492	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【DIAMコア資産設計ファンド(積極型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	11,902,488	140,990,675
親投資信託受益証券	183,236,114	62,072,282
流動資産合計	195,138,602	203,062,957
資産合計	195,138,602	203,062,957
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,234,971	-
未払受託者報酬	54,383	54,969
未払委託者報酬	1,088,308	1,100,312
その他未払費用	3,789	3,831
流動負債合計	2,381,451	1,159,112
負債合計	2,381,451	1,159,112
純資産の部		
元本等		
元本	158,587,012	169,675,212
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	34,170,139	32,228,633
(分配準備積立金)	32,325,820	30,789,054
元本等合計	192,757,151	201,903,845
純資産合計	192,757,151	201,903,845
負債純資産合計	195,138,602	203,062,957

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第12期 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第13期 自 2021年4月13日 至 2021年10月11日
営業収益		
受取利息	6	153
有価証券売買等損益	21,555,537	3,063,832
営業収益合計	21,555,543	3,063,679
営業費用		
支払利息	2,338	6,662
受託者報酬	54,383	54,969
委託者報酬	1,088,308	1,100,312
その他費用	3,789	9,771
営業費用合計	1,148,818	1,171,714
営業利益又は営業損失()	20,406,725	4,235,393
経常利益又は経常損失()	20,406,725	4,235,393
当期純利益又は当期純損失()	20,406,725	4,235,393
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,945,303	46,397
期首剰余金又は期首欠損金()	17,884,827	34,170,139
剰余金増加額又は欠損金減少額	745,905	4,260,865
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	745,905	4,260,865
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,922,015	2,013,375
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,922,015	2,013,375
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	34,170,139	32,228,633

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第12期	第13期
	2021年4月12日現在	2021年10月11日現在
1. 期首元本額	183,367,275円	158,587,012円
期中追加設定元本額	5,001,682円	20,448,387円
期中一部解約元本額	29,781,945円	9,360,187円
2. 受益権の総数	158,587,012口	169,675,212口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第12期	第13期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月11日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,443,935円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(17,017,487円)、信託約款に規定される収益調整金(4,122,033円)及び分配準備積立金(13,864,398円)より分配対象収益は36,447,853円(1万口当たり2,298.28円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(232,929円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(8,447,596円)及び分配準備積立金(30,556,125円)より分配対象収益は39,236,650円(1万口当たり2,312.45円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第12期	第13期
	自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	自 2021年4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	13,045,883	382,509
合計	13,045,883	382,509

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第12期 2021年4月12日現在	第13期 2021年10月11日現在
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2155円 (12,155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10月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド	5,781,839	19,084,115	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	4,708,246	6,143,790	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,147,661	6,370,207	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	4,518,705	9,224,484	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	10,431,178	15,067,836	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	2,851,407	6,181,850	
親投資信託受益証券 合計		29,439,036	62,072,282	
合計			62,072,282	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,794,870,670
国債証券	450,193,981,300
地方債証券	27,489,509,452
特殊債券	28,687,452,439
社債券	20,885,593,260
未収利息	494,143,091
前払費用	99,958,169
流動資産合計	529,645,508,381
資産合計	
529,645,508,381	
負債の部	
流動負債	
未払金	1,016,142,000
未払解約金	491,792,000
流動負債合計	1,507,934,000
負債合計	
1,507,934,000	
純資産の部	
元本等	
元本	404,749,179,149
剰余金	
剰余金又は欠損金()	123,388,395,232
元本等合計	528,137,574,381
純資産合計	528,137,574,381
負債純資産合計	529,645,508,381

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4月13日 至 2021年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	238,388,248,809円
同期中追加設定元本額	283,706,827,757円
同期中一部解約元本額	117,345,897,417円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,284,375,155円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	73,881,442円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	99,685,085円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	33,798,341円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	675,961,006円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	139,304,717円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	21,939,989円
たわらノーロード 国内債券	15,084,349,547円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,091,119,896円
たわらノーロード バランス(堅実型)	760,158,338円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,245,498,437円
たわらノーロード バランス(積極型)	153,118,153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)	60,098,679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)	1,110,005,152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)	1,097,668,212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)	289,867,797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)	20,343,979円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	15,397,740円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	10,675,931円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	68,448,481円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,375,840円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	676,528円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,380,559,994円
Oneグローバルバランス	1,337,304円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,702,433,757円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,007,312,385円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,915,665,066円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,157,453,585円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,290,376,080円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	370,985,513円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	88,189,996円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,993,318,233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)	4,203,032,491円

D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	1,499,678,544円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	314,214,335円
投資のソムリエ	58,805,211,355円
クルーズコントロール	508,077,988円
投資のソムリエ<DC年金>	3,021,062,558円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,344,677,690円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	638,281,582円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	1,608,272円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	4,708,246円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,344,152,004円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	50,136,335,462円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	23,509,998円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,279,572円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	52,269,868円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	70,943,320円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,002,019,998円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	9,671,586,822円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,073,889,128円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	20,722,876円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,005,345円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,329,583円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	201,529,991円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	68,768円
D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,190,541,450円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,220,065,272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)	1,321,238,250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)	742,465,326円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	1,172,916,218円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	5,018,966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)	568,532,871円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	1,170,389,509円
D I A M国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	8,845,315,606円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	510,704,750円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,608,944,255円
O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(債券動的アロケーション型)(適格機関投資家限定)	228,207,346円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	281,805,273円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,234,218,423円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,245,490,399円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,178,498,774円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,997,362,301円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	16,989,459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)	176,480,874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)	103,471,707円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	34,337,401円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	103,681,152円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	46,248,922円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	6,542,210円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	37,774,150円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	136,033,462円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,825,896,009円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,419,569,022円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,601,826,992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)	130,932,613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)	201,061,497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)	2,283,037,588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)	191,365,616円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	11,493,997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)	2,365,529,784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)	53,507,979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)	362,018,387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)	578,232,525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)	1,132,354,589円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	322,659,522円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	106,198,273円
Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,254,866,754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>	292,626,684円
コア資産形成ファンド	226,331,179円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	46,628,510,091円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	42,045,496,764円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	14,664,242,254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]	3,249,135,338円
計	404,749,179,149円
2. 受益権の総数	404,749,179,149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4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	1,525,202,150
地方債証券	100,826,620
特殊債券	95,427,711
社債券	97,231,360
合計	1,818,687,841

(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10月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3049円 (13,049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10月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	418回 利付国庫債券(2年)	400,000,000	400,928,000	
	419回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,403,584,000	
	420回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,208,800,000	
	421回 利付国庫債券(2年)	1,040,000,000	1,043,057,600	
	422回 利付国庫債券(2年)	1,600,000,000	1,604,976,000	
	423回 利付国庫債券(2年)	3,000,000,000	3,005,730,000	
	424回 利付国庫債券(2年)	500,000,000	501,005,000	
	425回 利付国庫債券(2年)	2,000,000,000	2,004,260,000	
	426回 利付国庫債券(2年)	2,100,000,000	2,104,683,000	
	427回 利付国庫債券(2年)	2,400,000,000	2,405,616,000	
	428回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,706,615,000	
	134回 利付国庫債券(5年)	2,930,000,000	2,937,471,500	
	135回 利付国庫債券(5年)	3,040,000,000	3,049,606,400	
	136回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,262,090,000	
	137回 利付国庫債券(5年)	3,610,000,000	3,625,414,700	
	138回 利付国庫債券(5年)	3,500,000,000	3,516,870,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	3,750,000,000	3,770,137,500	
	140回 利付国庫債券(5年)	3,190,000,000	3,208,470,100	
	141回 利付国庫債券(5年)	3,210,000,000	3,230,351,400	

142回 利付国庫債券(5年)	4,830,000,000	4,862,457,600	
143回 利付国庫債券(5年)	3,200,000,000	3,222,592,000	
144回 利付国庫債券(5年)	4,100,000,000	4,130,340,000	
145回 利付国庫債券(5年)	4,350,000,000	4,383,538,500	
146回 利付国庫債券(5年)	3,900,000,000	3,931,122,000	
147回 利付国庫債券(5年)	4,200,000,000	4,216,800,000	
148回 利付国庫債券(5年)	4,800,000,000	4,819,152,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	157,877,500	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	876,752,100	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	754,455,600	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	1,009,454,400	
5回 利付国庫債券(40年)	1,040,000,000	1,405,664,000	
6回 利付国庫債券(40年)	1,060,000,000	1,411,368,800	
7回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,294,082,700	
8回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,451,274,000	
9回 利付国庫債券(40年)	1,930,000,000	1,735,629,700	
10回 利付国庫債券(40年)	1,720,000,000	1,807,393,200	
11回 利付国庫債券(40年)	1,280,000,000	1,303,910,400	
12回 利付国庫債券(40年)	1,500,000,000	1,378,305,000	
13回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,582,067,700	
14回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	585,522,000	
326回 利付国庫債券(10年)	1,120,000,000	1,130,864,000	
327回 利付国庫債券(10年)	1,970,000,000	1,991,453,300	
328回 利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,566,820,000	
329回 利付国庫債券(10年)	3,850,000,000	3,909,559,500	
330回 利付国庫債券(10年)	3,460,000,000	3,521,518,800	
331回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,470,155,000	
332回 利付国庫債券(10年)	6,480,000,000	6,581,671,200	
333回 利付国庫債券(10年)	4,230,000,000	4,303,855,800	
334回 利付国庫債券(10年)	4,640,000,000	4,729,412,800	

335回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,174,374,000	
336回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,937,088,000	
337回 利付国庫債券(10年)	2,810,000,000	2,846,867,200	
338回 利付国庫債券(10年)	4,730,000,000	4,812,349,300	
339回 利付国庫債券(10年)	4,410,000,000	4,491,585,000	
340回 利付国庫債券(10年)	4,610,000,000	4,701,139,700	
341回 利付国庫債券(10年)	6,020,000,000	6,119,992,200	
342回 利付国庫債券(10年)	5,380,000,000	5,424,277,400	
343回 利付国庫債券(10年)	4,950,000,000	4,993,065,000	
344回 利付国庫債券(10年)	4,490,000,000	4,530,050,800	
345回 利付国庫債券(10年)	4,590,000,000	4,631,814,900	
346回 利付国庫債券(10年)	4,390,000,000	4,430,695,300	
347回 利付国庫債券(10年)	3,730,000,000	3,765,099,300	
348回 利付国庫債券(10年)	3,790,000,000	3,826,118,700	
349回 利付国庫債券(10年)	4,030,000,000	4,068,768,600	
350回 利付国庫債券(10年)	6,110,000,000	6,169,144,800	
351回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,845,024,000	
352回 利付国庫債券(10年)	4,340,000,000	4,380,752,600	
353回 利付国庫債券(10年)	4,510,000,000	4,550,590,000	
354回 利付国庫債券(10年)	4,310,000,000	4,348,488,300	
355回 利付国庫債券(10年)	4,410,000,000	4,447,308,600	
356回 利付国庫債券(10年)	4,040,000,000	4,072,037,200	
357回 利付国庫債券(10年)	3,790,000,000	3,817,894,400	
358回 利付国庫債券(10年)	4,350,000,000	4,381,146,000	
359回 利付国庫債券(10年)	5,010,000,000	5,040,360,600	

360回 利付国庫債券(10年)	4,840,000,000	4,865,845,600	
361回 利付国庫債券(10年)	4,500,000,000	4,518,495,000	
362回 利付国庫債券(10年)	3,950,000,000	3,961,099,500	
363回 利付国庫債券(10年)	4,300,000,000	4,308,256,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	134,347,400	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	119,961,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,786,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,272,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	236,716,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	294,507,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	282,440,000	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	182,887,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	432,333,800	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	334,822,800	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	310,212,000	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	346,550,400	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	509,572,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	357,859,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	432,052,500	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	398,446,100	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	381,706,700	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	462,220,500	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	357,490,800	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	428,366,400	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	815,684,400	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	829,386,400	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,035,334,300	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,147,429,200	

30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,164,856,000	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	944,042,400	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,293,087,600	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,513,727,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,586,664,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,882,684,600	
36回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	2,419,219,000	
37回 利付国庫債券(30年)	2,160,000,000	2,761,992,000	
38回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,830,886,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,439,457,600	
40回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,317,721,600	
41回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,471,637,000	
42回 利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,335,745,200	
43回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,711,952,000	
44回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	1,350,874,800	
45回 利付国庫債券(30年)	1,170,000,000	1,414,588,500	
46回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,899,338,900	
47回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,553,542,200	
48回 利付国庫債券(30年)	1,640,000,000	1,949,320,400	
49回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,736,056,800	
50回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,327,851,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,360,839,500	
52回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,287,153,600	
53回 利付国庫債券(30年)	1,100,000,000	1,104,829,000	
54回 利付国庫債券(30年)	1,150,000,000	1,207,408,000	

55回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,175,081,600	
56回 利付国庫債券(30年)	1,230,000,000	1,289,556,600	
57回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,571,445,000	
58回 利付国庫債券(30年)	1,500,000,000	1,568,445,000	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,141,817,600	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,099,102,700	
61回 利付国庫債券(30年)	1,240,000,000	1,260,137,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	973,589,500	
63回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,367,932,400	
64回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,102,415,000	
65回 利付国庫債券(30年)	1,010,000,000	941,986,600	
66回 利付国庫債券(30年)	990,000,000	921,749,400	
67回 利付国庫債券(30年)	1,550,000,000	1,518,411,000	
68回 利付国庫債券(30年)	1,580,000,000	1,547,562,600	
69回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,374,986,800	
70回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,523,708,800	
71回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,301,599,000	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,216,100	
64回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,175,100	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	62,646,000	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,454,000	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,390,000	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,496,400	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	489,978,200	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	405,593,000	

74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,822,000	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	193,651,200	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	74,825,800	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,895,600	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	268,455,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,876,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	97,309,800	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	433,136,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	152,152,000	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	76,445,600	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	184,939,600	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	647,395,200	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,741,600	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,207,600	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	656,068,200	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,072,800	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	523,142,900	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	122,983,300	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,291,091,600	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	411,676,800	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	749,120,300	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	624,074,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	134,792,400	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	748,684,200	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	180,547,200	

99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	850,102,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	950,258,700	
101回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	150,514,000	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	581,805,000	
103回 利付国債(20年)	160,000,000	185,105,600	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	125,785,000	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	735,052,800	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	577,740,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	691,824,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	785,654,700	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	400,039,500	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	509,458,400	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	538,209,200	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	860,124,200	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,365,074,100	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	960,228,200	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	424,508,400	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	627,562,400	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,257,956,200	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	649,738,500	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	542,083,900	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	761,146,800	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	920,887,200	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	659,358,900	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,246,318,500	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	706,692,000	

125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	720,132,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	602,544,600	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	632,923,200	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,610,462,400	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	886,084,000	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,063,817,300	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	915,752,200	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	964,426,800	
133回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,324,416,500	
134回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,292,456,000	
135回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	745,369,600	
136回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	761,851,200	
137回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	933,872,000	
138回 利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,306,690,800	
139回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,064,237,600	
140回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,446,554,000	
141回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,701,053,000	
142回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,065,753,000	
143回 利付国庫債券(20年)	1,380,000,000	1,606,761,600	
144回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,049,293,700	
145回 利付国庫債券(20年)	2,350,000,000	2,768,370,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,580,000,000	3,045,483,600	
147回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	2,552,256,800	
148回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,891,537,400	
149回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,907,525,000	

150回 利付国庫債券(20年)	2,610,000,000	3,006,928,800	
151回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,751,758,800	
152回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	2,426,533,000	
153回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	2,538,570,000	
154回 利付国庫債券(20年)	2,590,000,000	2,929,315,900	
155回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	2,385,244,800	
156回 利付国庫債券(20年)	2,650,000,000	2,701,595,500	
157回 利付国庫債券(20年)	2,030,000,000	2,009,923,300	
158回 利付国庫債券(20年)	2,290,000,000	2,363,921,200	
159回 利付国庫債券(20年)	2,380,000,000	2,489,146,800	
160回 利付国庫債券(20年)	1,710,000,000	1,812,240,900	
161回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,869,046,400	
162回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,794,390,000	
163回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,792,738,800	
164回 利付国庫債券(20年)	2,380,000,000	2,439,262,000	
165回 利付国庫債券(20年)	1,610,000,000	1,648,076,500	
166回 利付国庫債券(20年)	1,830,000,000	1,930,869,600	
167回 利付国庫債券(20年)	2,040,000,000	2,082,840,000	
168回 利付国庫債券(20年)	1,580,000,000	1,585,166,600	
169回 利付国庫債券(20年)	1,650,000,000	1,624,078,500	
170回 利付国庫債券(20年)	1,990,000,000	1,955,035,700	
171回 利付国庫債券(20年)	1,840,000,000	1,804,212,000	
172回 利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,454,992,200	
173回 利付国庫債券(20年)	1,920,000,000	1,910,035,200	
174回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,234,250,000	

	175回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	2,179,072,800	
	176回 利付国庫債券(20年)	1,780,000,000	1,792,691,400	
	177回 利付国庫債券(20年)	1,800,000,000	1,777,284,000	
国債証券 合計		426,095,000,000	450,193,981,300	
地方債証券	719回 東京都公募公債	200,000,000	202,460,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	304,386,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	406,312,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	100,172,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	111,024,100	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	400,664,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	245,232,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	129,940,000	
	1回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,596,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,214,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,468,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	222,776,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	334,347,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	115,780,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	116,845,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	100,268,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	402,864,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	99,814,000	
	29回1号 宮城県公募公債 10年	100,000,000	101,372,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	250,110,000	
	194回 神奈川県公募公債	300,000,000	302,811,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	304,365,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,800,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	200,910,000	
	3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	133,448,000	
	11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	115,279,000	
	16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	353,817,000	
	19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	116,628,000	
	368回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	101,069,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	304,995,000	

413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,904,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,751,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	198,384,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	200,072,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	232,194,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	111,805,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	102,482,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,201,000	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	110,238,532	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	201,186,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,038,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,281,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	132,987,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	215,826,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	308,850,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	324,414,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	107,082,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	103,644,000	
令和2年度10回 静岡県公募公債	100,000,000	100,087,000	
令和2年度14回 静岡県公募公債	200,000,000	199,718,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	107,713,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	108,383,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	212,236,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	108,547,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	346,419,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	130,850,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	304,170,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	181,602,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,903,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	200,294,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	101,166,000	

27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	101,726,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	99,541,000	
25年度 8回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,528,000	
26年度 5回 埼玉県公募公債	400,000,000	406,720,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	213,970,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	117,382,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	115,541,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	346,980,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,261,000	
25年度 11回 福岡県公募公債	200,000,000	203,252,000	
28年度 8回 福岡県公募公債	100,000,000	101,126,000	
30年度 6回 福岡県公募公債	200,000,000	201,644,000	
令和2年 5回 福岡県公募公債	100,000,000	100,044,000	
24年度 1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	107,723,000	
20回 2号 福岡県公募公債	100,000,000	114,050,000	
21年度 2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	117,566,000	
24年度 2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	345,798,000	
24年度 7回 千葉県公募公債	300,000,000	302,643,000	
25年度 5回 千葉県公募公債	200,000,000	203,126,000	
25年度 6回 千葉県公募公債	100,000,000	101,555,000	
27年度 9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,378,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,229,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	110,946,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	100,909,000	
25年度 2回 新潟県公募公債	100,000,000	101,573,000	
令和3年度 1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	200,842,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	115,580,000	
118回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,077,000	
119回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,460,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,340,000	
127回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,372,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,143,000	

132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,593,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,505,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,348,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	611,766,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,275,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,929,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,380,400	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,564,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,960,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,563,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,002,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,395,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,895,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,864,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	100,714,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	101,615,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	107,491,420	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	199,998,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	101,577,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	101,067,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,184,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	230,388,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	457,785,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	115,447,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	111,814,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	112,338,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	236,550,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	232,808,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	101,649,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	303,498,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	406,204,000	

2回	横浜市公募公債 30年	100,000,000	128,712,000	
17回	横浜市公募公債 20年	100,000,000	114,193,000	
29回	横浜市公募公債 20年	100,000,000	115,499,000	
23年度7回	札幌市公募公債 30年	100,000,000	129,307,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	202,688,000	
26年度4回	札幌市公募公債 10年	100,000,000	101,425,000	
29年度5回	札幌市公募公債 20年	300,000,000	309,081,000	
第91回	川崎市公募公債	200,000,000	201,380,000	
5回	川崎市公募公債 30年	100,000,000	129,850,000	
6回	北九州市公募公債 20年	100,000,000	113,866,000	
17回	北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,451,000	
22年度8回	福岡市公募公債	100,000,000	131,961,000	
30年度7回	福岡市公募公債	200,000,000	208,758,000	
2019年度5回	福岡市公募公債 20年	100,000,000	96,969,000	
26年度3回	広島市公募公債	100,000,000	101,414,000	
29年度2回	広島市公募公債	200,000,000	206,746,000	
29年度6回	広島市公募公債	300,000,000	303,045,000	
30年度2回	仙台市公募公債 20年	100,000,000	104,823,000	
26年度1回	相模原市公募公債	100,000,000	101,527,000	
26年度1回	三重県公募公債	100,000,000	101,429,000	
地方債証券 合計		26,145,330,000	27,489,509,452	
特殊債券				
9回	新関西国際空港社債	200,000,000	215,616,000	
12回	新関西国際空港社債	200,000,000	214,246,000	
78回	日本政策投資銀行債券	300,000,000	302,466,000	
127回	日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,058,000	
131回	日本政策投資銀行債券	100,000,000	98,241,000	
19回	政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,965,000	
19回	高速道路機構債	150,000,000	220,251,000	
26回	高速道路機構債	200,000,000	269,248,000	
75回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,159,000	
101回	日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	201,836,000	
116回	高速道路機構債	100,000,000	101,382,000	
124回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,120,000	
139回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,396,000	

155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,693,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	120,021,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	127,019,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	111,145,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	197,434,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	103,569,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,398,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	123,625,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	575,270,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,415,000	
177回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,932,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,349,000	
189回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	504,255,000	
193回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,655,000	
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	437,133,700	
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,480,500	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,537,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,699,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,410,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	333,846,000	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,450,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,171,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,629,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	233,958,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,558,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,449,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	804,648,000	

319回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	207,762,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,123,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	191,262,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	194,616,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	651,115,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	228,142,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	349,482,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	350,424,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	118,129,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	322,029,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	232,814,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,354,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	231,594,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,282,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	404,308,000	
44回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,999,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,080,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	551,083,920	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,519,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,593,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,311,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	225,524,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	348,939,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,088,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,310,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	104,012,000	

98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,689,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,678,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,100,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	231,352,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,998,970	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	108,642,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	107,526,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	213,272,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	196,904,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	111,284,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,456,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	231,878,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,554,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	412,576,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,712,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,776,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,306,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	317,592,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,268,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,954,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,293,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,367,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,318,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,204,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	499,630,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,852,000	31,119,795	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,606,000	21,949,967	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,709,000	33,232,344	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,833,000	35,660,980	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,132,000	53,876,858	

4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,625,000	11,919,228	
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,420,000	56,445,823	
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,615,000	34,407,305	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,325,000	56,251,693	
4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,423,000	11,669,508	
2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,323,000	20,485,858	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,190,000	125,219,858	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,184,000	191,317,621	
3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,305,000	26,667,674	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,156,000	23,316,531	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,188,000	28,558,275	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,225,000	30,729,795	
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,405,000	39,330,609	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,936,000	86,789,206	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,075,000	37,763,310	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,614,000	44,284,894	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,006,000	44,730,970	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,974,000	48,861,415	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,033,000	50,691,786	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,606,000	55,685,560	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,092,000	62,802,576	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,149,000	65,425,521	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,163,000	234,153,942	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,165,000	80,090,438	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,827,000	79,831,255	

119回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	78,844,000	79,795,647	
126回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	245,925,000	248,482,620	
128回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	246,276,000	248,672,265	
130回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	166,570,000	168,212,380	
131回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	250,221,000	252,297,834	
132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	250,212,000	252,373,831	
137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	432,950,000	438,760,188	
139回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	86,005,000	87,096,403	
142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	88,624,000	88,908,483	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	281,064,000	281,446,247	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	374,720,000	376,578,611	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	287,562,000	289,436,904	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	294,990,000	297,757,006	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	892,404,000	897,651,335	
21回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	102,197,000	
い第828号 利付商工債	100,000,000	100,249,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	100,212,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	300,066,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	299,928,000	
342回 利附信金中金債(5 年)	100,000,000	100,137,000	
369回 利附信金中金債(5 年)	400,000,000	400,308,000	
7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債券	100,000,000	101,400,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	115,863,000	
18回 国際協力機構債券	100,000,000	101,450,000	
72回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,282,000	
77回 東日本高速道路社債	300,000,000	300,090,000	
85回 中日本高速道路債券	300,000,000	300,240,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	505,980,000	
71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,563,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	105,602,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	200,186,000	

特殊債券 合計		27,175,523,000	28,687,452,439	
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	301,614,000	
	26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	100,000,000	100,343,000	
	2回 BPCE SA円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,104,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,332,000	
	11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,768,000	
	25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,955,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	400,164,000	
	344回 東京交通債券	100,000,000	102,177,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	101,581,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	97,490,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	100,280,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,774,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,998,000	
	56回 中日本高速道路社債	100,000,000	101,585,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	199,998,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	203,052,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	102,013,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,781,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,608,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	199,920,000	
	10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,645,000	
	9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	101,924,000	
	12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,389,000	
	14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,360,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	301,785,000	
	42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	199,754,000	
	49回 住友化学社債	100,000,000	102,073,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,433,000	
	23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	207,520,000	
	40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,960,000	
	6回 JXホールディングス社債	100,000,000	101,821,000	
	14回 プリヂストン社債	300,000,000	302,136,000	
	17回 パナソニック社債	100,000,000	101,346,000	

19回	パナソニック社債	100,000,000	100,500,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	200,722,000	
29回	三菱重工業社債	100,000,000	101,520,000	
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	100,622,000	
14回	トヨタ自動車社債	200,000,000	202,696,000	
16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	203,018,000	
26回	トヨタ自動車	200,000,000	199,954,000	
26回	豊田通商社債	100,000,000	103,381,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	101,509,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	101,876,000	
13回	新生銀行社債	200,000,000	199,788,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	111,722,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,733,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,828,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	101,021,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	301,065,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	402,988,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,417,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,977,000	
47回	日立キャピタル社債	200,000,000	202,304,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	300,813,000	
29回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,362,000	
31回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,440,000	
56回	三菱UFJリース社債	300,000,000	303,669,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	106,383,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,876,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	201,418,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	106,972,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,412,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	321,393,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,650,000	
65回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	115,579,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,712,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	233,536,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	113,853,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,337,000	
127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,679,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,403,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,224,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	200,192,000	

171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	198,004,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	311,616,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,013,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,818,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,423,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,952,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	303,966,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	208,466,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,115,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,474,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	132,673,200	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	95,426,000	
30回 光通信社債	200,000,000	203,122,000	
518回 中部電力社債	200,000,000	200,348,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	103,617,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	103,164,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	303,852,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	199,572,000	
377回 中国電力社債	400,000,000	407,856,000	
425回 中国電力社債	100,000,000	100,550,000	
301回 北陸電力社債	100,000,000	101,582,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	104,227,000	
311回 北陸電力社債	100,000,000	103,776,000	
471回 東北電力社債	400,000,000	409,536,000	
488回 東北電力社債	100,000,000	100,623,000	
525回 東北電力社債	200,000,000	199,820,000	
253回 四国電力社債	200,000,000	203,190,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	204,866,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	409,212,000	
428回 九州電力社債	100,000,000	102,337,000	
466回 九州電力社債	100,000,000	101,679,000	
492回 九州電力社債	100,000,000	99,472,000	
493回 九州電力社債	200,000,000	199,448,000	
321回 北海道電力社債	261,000,000	267,384,060	
340回 北海道電力社債	300,000,000	303,762,000	
350回 北海道電力社債	200,000,000	203,080,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	213,950,000	
38回 電源開発社債	300,000,000	305,868,000	
54回 電源開発社債	100,000,000	100,772,000	
23回 東京瓦斯社債	300,000,000	304,674,000	
41回 東京瓦斯社債	200,000,000	203,108,000	
52回 東京瓦斯社債	100,000,000	98,964,000	
55回 東京瓦斯社債	100,000,000	95,272,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	101,679,000	
30回 大阪瓦斯社債	100,000,000	100,815,000	
27回 NTTデータ社債	200,000,000	202,750,000	
5回 ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,069,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,930,000	

	8回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	206,494,000	
社債券 合計		20,481,000,000	20,885,593,260	
合計			527,256,536,451	

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10月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	10,508,458,823
株式	396,733,214,021
派生商品評価勘定	60,687,530
未収配当金	3,032,183,849
前払金	406,195,000
差入委託証拠金	587,400,000
流動資産合計	411,328,139,223
資産合計	411,328,139,223
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	227,492,840
未払金	3,067,965,100
未払解約金	69,201,000
流動負債合計	3,364,658,940
負債合計	3,364,658,940
純資産の部	
元本等	
元本	123,600,479,196
剰余金	
剰余金又は欠損金()	284,363,001,087
元本等合計	407,963,480,283
純資産合計	407,963,480,283
負債純資産合計	411,328,139,223

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4月13日 至 2021年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,157,626,770円
同期中追加設定元本額	68,265,762,461円
同期中一部解約元本額	56,822,910,035円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	561,857,238円
MHAM TOPIXオープン	2,749,361,146円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,948,222,877円
One DC 国内株式インデックスファンド	18,726,451,947円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,039,054,987円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	3,107,252円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,992,312円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	23,301,352円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,245,464円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,558,403円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,937,281円
たわらノーロード TOPIX	1,156,265,022円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	884,832,430円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,840,129円
たわらノーロード バランス(標準型)	214,963,931円
たわらノーロード バランス(積極型)	324,990,223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)	2,355,551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)	153,283,083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)	362,658,281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)	249,784,584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)	348,542,704円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	593,925円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,296,105円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	27,460,859円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,172,491円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,763,835円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,644,577,313円
Oneグローバルバランス	821,917円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,005,576,019円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,356,969,121円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,600,061,218円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	329,101,802円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,119,171,723円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,105,859,591円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	30,491,676円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,039,594,009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)	300,531,320円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	290,196,282円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	509,702,481円
投資のソムリエ	13,735,449,310円
クルーズコントロール	206,666,324円
投資のソムリエ<DC年金>	705,563,618円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,774,130円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	466,727,605円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	2,015,122円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	5,781,839円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	465,273,541円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,329,670,789円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	30,274,942円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	15,919,305円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,513,567円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	82,589,091円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	313,231,871円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,937,528,751円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	275,081,560円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	24,125,782円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,650,379円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	9,475,742円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	66,571,718円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	88,239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)	8,037,090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)	8,249,170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)	49,670,055円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	4,987,983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)	7,724,239円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	76,105,700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)	92,904,195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)	87,374,839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)2021-07(適格機関投資家限定)	153,321,837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)2021-08(適格機関投資家限定)	108,179,975円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	7,816,733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)2021-09(適格機関投資家限定)	107,219,213円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	375,904,829円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,379,034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)	453,183,766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)	13,237,790円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,016,095円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	57,243,911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)	100,764,524円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,722,424円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,891,974円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,197,353円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,909,569円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	9,796,825円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	35,283,314円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	558,397,347円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	627,985,207円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,791,827,916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)	33,967,787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)	31,287,117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)	296,087,798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)	74,490,206円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,490,280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)	345,169,949円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	20,831,595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)	70,439,520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)	168,822,521円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	264,490,165円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	38,217,340円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,685,439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)	291,737,796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)	936,557,239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)	1,240,495,959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)	49,936,951円
動的パッケージファンド<DC年金>	18,453,224円

コア資産形成ファンド	14,049,505円
MHAMトピックスファンド	694,433,580円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	67,262,280円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	2,659,425,997円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	2,185,970,644円
計	123,600,479,196円
2. 受益権の総数	123,600,479,196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4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、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10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	11,998,978,156	
合計	11,998,978,156	

(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10月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	12,276,255,000	-		12,109,650,000
合計	12,276,255,000	-		12,109,650,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
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10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3007円 (33,007円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	6,400	3,045.00	19,488,000
日本水産	182,400	630.00	114,912,000
マルハニチロ	30,800	2,619.00	80,665,200
ハウスイ	700	940.00	658,000
雪国まいたけ	16,200	1,505.00	24,381,000
カネコ種苗	5,100	1,448.00	7,384,800
サカタのタネ	23,600	3,470.00	81,892,000
ホクト	16,700	1,980.00	33,066,000
ホクリヨウ	2,900	772.00	2,238,800
ヒノキヤグループ	4,400	2,215.00	9,746,000
ショーボンドホールディングス	28,100	4,910.00	137,971,000
ミライト・ホールディングス	68,000	2,194.00	149,192,000
タマホーム	11,800	2,564.00	30,255,200
サンヨーホームズ	2,500	727.00	1,817,500
日本アクア	7,600	583.00	4,430,800
ファーストコーポレーション	6,100	820.00	5,002,000
ベステラ	3,700	1,483.00	5,487,100
Robot Home	33,400	291.00	9,719,400
キャンディル	3,500	534.00	1,869,000
スペースバリューホールディングス	23,900	853.00	20,386,700
住石ホールディングス	31,000	161.00	4,991,000
日鉄鉱業	4,400	6,570.00	28,908,000
三井松島ホールディングス	8,000	1,488.00	11,904,000
I N P E X	789,200	965.00	761,578,000
石油資源開発	25,600	2,236.00	57,241,600
K & O エナジーグループ	9,800	1,649.00	16,160,200
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,924.00	6,926,400
第一カッター興業	4,800	1,285.00	6,168,000
明豊ファシリティワークス	7,800	904.00	7,051,200
安藤・間	126,300	803.00	101,418,900
東急建設	57,300	805.00	46,126,500
コムシスホールディングス	69,700	2,919.00	203,454,300
ピーアールホールディングス	26,100	452.00	11,797,200
高松コンストラクショングループ	12,600	2,044.00	25,754,400
東建コーポレーション	6,000	9,550.00	57,300,000
ソネック	1,900	1,084.00	2,059,600
ヤマウラ	8,700	925.00	8,047,500
オリエンタル白石	64,700	282.00	18,245,400
大成建設	141,500	3,650.00	516,475,000
大林組	454,800	948.00	431,150,400
清水建設	426,000	856.00	364,656,000
飛島建設	13,200	1,104.00	14,572,800
長谷工コーポレーション	148,900	1,488.00	221,563,200
松井建設	18,000	749.00	13,482,000
銭高組	1,700	4,095.00	6,961,500
鹿島建設	333,200	1,458.00	485,805,600
不動テトラ	11,100	1,761.00	19,547,100
大末建設	5,800	938.00	5,440,400
鉄建建設	9,400	1,837.00	17,267,800
西松建設	32,400	3,500.00	113,400,000

三井住友建設	110,300	511.00	56,363,300
大豊建設	9,900	3,775.00	37,372,500
佐田建設	7,500	477.00	3,577,500
ナカノフード建設	11,400	351.00	4,001,400
奥村組	25,000	3,020.00	75,500,000
東鉄工業	19,800	2,530.00	50,094,000
イチケン	3,200	1,961.00	6,275,200
富士ピー・エス	6,100	568.00	3,464,800
浅沼組	5,400	4,600.00	24,840,000
戸田建設	189,200	774.00	146,440,800
熊谷組	21,100	2,896.00	61,105,600
北野建設	3,000	2,216.00	6,648,000
植木組	4,100	1,489.00	6,104,900
矢作建設工業	20,400	796.00	16,238,400
ピーエス三菱	14,800	683.00	10,108,400
日本ハウスホールディングス	30,500	427.00	13,023,500
大東建託	49,600	12,950.00	642,320,000
新日本建設	19,800	867.00	17,166,600
N I P P O	37,500	4,110.00	154,125,000
東亜道路工業	2,800	4,910.00	13,748,000
日本道路	4,400	8,300.00	36,520,000
東亜建設工業	12,100	2,472.00	29,911,200
日本国土開発	45,000	602.00	27,090,000
若築建設	8,000	2,036.00	16,288,000
東洋建設	50,600	593.00	30,005,800
五洋建設	193,000	776.00	149,768,000
世紀東急工業	21,900	843.00	18,461,700
福田組	4,800	4,855.00	23,304,000
日本ドライケミカル	3,400	2,175.00	7,395,000
住友林業	116,200	2,106.00	244,717,200
日本基礎技術	13,600	553.00	7,520,800
巴コーポレーション	20,200	459.00	9,271,800
大和ハウス工業	419,800	3,732.00	1,566,693,600
ライト工業	26,000	2,004.00	52,104,000
積水ハウス	493,100	2,369.00	1,168,153,900
日特建設	11,500	715.00	8,222,500
北陸電気工事	8,000	1,272.00	10,176,000
ユアテック	26,100	726.00	18,948,600
日本リーテック	9,600	1,559.00	14,966,400
四電工	4,800	1,673.00	8,030,400
中電工	21,300	2,306.00	49,117,800
関電工	74,200	929.00	68,931,800
きんでん	92,700	1,905.00	176,593,500
東京エネシス	15,200	1,054.00	16,020,800
トーエネック	4,700	3,570.00	16,779,000
住友電設	12,900	2,232.00	28,792,800
日本電設工業	25,100	1,889.00	47,413,900
エクシオグループ	68,700	2,717.00	186,657,900
新日本空調	12,000	2,409.00	28,908,000
日本工営	8,100	3,370.00	27,297,000

九電工	31,900	3,640.00	116,116,000
三機工業	32,100	1,483.00	47,604,300
日揮ホールディングス	151,900	1,067.00	162,077,300
中外炉工業	4,900	1,719.00	8,423,100
ヤマト	14,600	751.00	10,964,600
太平電業	10,200	2,774.00	28,294,800
高砂熱学工業	41,100	2,195.00	90,214,500
三晃金属工業	1,800	2,515.00	4,527,000
NECネットエスアイ	46,700	2,071.00	96,715,700
朝日工業社	2,300	3,250.00	7,475,000
明星工業	29,800	733.00	21,843,400
大気社	22,200	3,350.00	74,370,000
ダイダン	10,200	2,555.00	26,061,000
日比谷総合設備	14,800	1,937.00	28,667,600
ニッポン	42,900	1,660.00	71,214,000
日清製粉グループ本社	164,500	1,857.00	305,476,500
日東富士製粉	1,600	3,220.00	5,152,000
昭和産業	12,800	2,843.00	36,390,400
鳥越製粉	13,200	769.00	10,150,800
中部飼料	17,700	1,142.00	20,213,400
フィード・ワン	19,900	758.00	15,084,200
東洋精糖	1,900	1,195.00	2,270,500
日本甜菜製糖	7,900	1,661.00	13,121,900
DM三井製糖ホールディングス	11,900	2,040.00	24,276,000
塩水港精糖	16,100	225.00	3,622,500
日新製糖	7,400	1,705.00	12,617,000
LIFULL	43,800	365.00	15,987,000
ミクシィ	35,100	2,595.00	91,084,500
ジェイエイシーリクルートメント	11,000	2,222.00	24,442,000
日本M&Aセンターホールディングス	227,000	3,295.00	747,965,000
メンバーズ	4,600	3,105.00	14,283,000
中広	1,300	398.00	517,400
UTグループ	20,000	3,485.00	69,700,000
アイティメディア	4,800	2,347.00	11,265,600
E・Jホールディングス	7,100	1,380.00	9,798,000
夢真ビーネックスグループ	36,800	1,400.00	51,520,000
コシダカホールディングス	36,600	673.00	24,631,800
アルトナー	3,200	856.00	2,739,200
パソナグループ	14,900	3,240.00	48,276,000
CDS	2,600	1,620.00	4,212,000
リンクアンドモチベーション	30,300	1,059.00	32,087,700
エス・エム・エス	47,000	4,105.00	192,935,000
サニーサイドアップグループ	4,600	781.00	3,592,600
パーソルホールディングス	138,400	2,881.00	398,730,400
リニカル	7,700	773.00	5,952,100
クックパッド	42,300	250.00	10,575,000
エスクリ	4,000	586.00	2,344,000
アイ・ケイ・ケイ	7,000	689.00	4,823,000
森永製菓	34,200	4,120.00	140,904,000
中村屋	2,700	3,790.00	10,233,000

江崎グリコ	40,100	4,190.00	168,019,000
名糖産業	6,400	1,720.00	11,008,000
井村屋グループ	8,400	2,278.00	19,135,200
不二家	8,500	2,403.00	20,425,500
山崎製パン	109,000	1,911.00	208,299,000
第一屋製パン	3,400	782.00	2,658,800
モロゾフ	1,900	5,460.00	10,374,000
亀田製菓	8,400	4,620.00	38,808,000
寿スピリッツ	14,000	7,300.00	102,200,000
カルビー	66,300	2,724.00	180,601,200
森永乳業	26,900	6,620.00	178,078,000
六甲バター	10,700	1,682.00	17,997,400
ヤクルト本社	100,100	5,760.00	576,576,000
明治ホールディングス	96,200	7,230.00	695,526,000
雪印メグミルク	35,100	2,234.00	78,413,400
プリマハム	20,500	2,784.00	57,072,000
日本ハム	55,600	4,060.00	225,736,000
林兼産業	4,000	590.00	2,360,000
丸大食品	14,400	1,747.00	25,156,800
S Foods	13,100	2,956.00	38,723,600
柿安本店	5,100	2,669.00	13,611,900
伊藤ハム米久ホールディングス	94,200	719.00	67,729,800
学情	5,400	1,257.00	6,787,800
スタジオアリス	6,900	2,241.00	15,462,900
クロスキャット	3,300	1,304.00	4,303,200
シミックホールディングス	7,700	1,502.00	11,565,400
エプコ	3,000	862.00	2,586,000
システナ	50,500	2,129.00	107,514,500
NJS	3,000	2,050.00	6,150,000
デジタルアーツ	8,300	8,950.00	74,285,000
日鉄ソリューションズ	20,500	3,615.00	74,107,500
総合警備保障	55,100	4,955.00	273,020,500
キューブシステム	7,000	1,021.00	7,147,000
いちご	159,400	368.00	58,659,200
WOW WORLD	4,500	1,813.00	8,158,500
日本駐車場開発	155,000	155.00	24,025,000
コア	5,600	1,522.00	8,523,200
カカクコム	102,200	3,830.00	391,426,000
アイロムグループ	4,900	2,041.00	10,000,900
セントケア・ホールディング	10,200	905.00	9,231,000
サイネックス	2,500	665.00	1,662,500
ルネサンス	8,500	1,216.00	10,336,000
ディップ	21,600	4,275.00	92,340,000
SBSホールディングス	10,700	4,115.00	44,030,500
デジタルホールディングス	9,400	1,824.00	17,145,600
新日本科学	17,500	929.00	16,257,500
キャリアデザインセンター	3,300	1,150.00	3,795,000
ベネフィット・ワン	50,300	5,660.00	284,698,000
エムスリー	244,300	7,275.00	1,777,282,500
ツカダ・グローバルホールディング	10,600	346.00	3,667,600

プラス	1,700	740.00	1,258,000	
アウトソーシング	79,100	1,975.00	156,222,500	
ウェルネット	13,700	527.00	7,219,900	
ワールドホールディングス	5,400	2,917.00	15,751,800	
ディー・エヌ・エー	58,400	2,135.00	124,684,000	
博報堂DYホールディングス	192,800	1,839.00	354,559,200	
ぐるなび	23,800	560.00	13,328,000	
タカミヤ	17,100	452.00	7,729,200	
ジャパンベストレスキューシステム	9,900	1,197.00	11,850,300	
ファンコミュニケーションズ	34,900	463.00	16,158,700	
ライク	3,600	2,030.00	7,308,000	
ビジネス・ブレークスルー	5,700	431.00	2,456,700	
エスプール	38,700	1,168.00	45,201,600	
WDBホールディングス	6,200	3,485.00	21,607,000	
手間いらず	1,900	6,240.00	11,856,000	
ティア	8,000	496.00	3,968,000	
CDG	1,400	1,531.00	2,143,400	
アドウェイズ	23,300	774.00	18,034,200	
バリューコマース	10,700	4,595.00	49,166,500	
インフォマート	151,400	1,024.00	155,033,600	
サッポロホールディングス	49,700	2,590.00	128,723,000	
アサヒグループホールディングス	342,200	5,598.00	1,915,635,600	
麒麟ホールディングス	534,800	2,097.00	1,121,475,600	
宝ホールディングス	107,700	1,568.00	168,873,600	
オエノンホールディングス	42,000	380.00	15,960,000	
養命酒製造	4,700	1,838.00	8,638,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	102,100	1,651.00	168,567,100	
サントリー食品インターナショナル	97,300	4,605.00	448,066,500	
ダイドーグループホールディングス	8,200	5,710.00	46,822,000	
伊藤園	44,100	7,210.00	317,961,000	
キーコーヒー	14,400	2,211.00	31,838,400	
ユニカフェ	4,600	1,073.00	4,935,800	
ジャパンフーズ	1,700	1,220.00	2,074,000	
日清オイリオグループ	18,300	3,075.00	56,272,500	
不二製油グループ本社	35,600	2,656.00	94,553,600	
かどや製油	1,100	4,175.00	4,592,500	
J-オイルミルズ	13,800	1,859.00	25,654,200	
ローソン	36,200	5,400.00	195,480,000	
サンエー	10,900	4,055.00	44,199,500	
カワチ薬品	9,900	2,304.00	22,809,600	
エービーシー・マート	22,300	6,290.00	140,267,000	
ハードオフコーポレーション	6,400	781.00	4,998,400	
高千穂交易	5,200	1,186.00	6,167,200	
アスクル	23,000	1,680.00	38,640,000	
ゲオホールディングス	19,000	1,255.00	23,845,000	
アダストリア	19,700	2,017.00	39,734,900	
ジーフット	10,600	401.00	4,250,600	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,200	405.00	891,000	
オルパヘルスケアホールディングス	1,800	1,555.00	2,799,000	

伊藤忠食品	3,200	5,240.00	16,768,000	
くら寿司	14,800	3,655.00	54,094,000	
キャンドウ	6,800	1,925.00	13,090,000	
エレマテック	11,500	1,094.00	12,581,000	
アイケイ	4,000	553.00	2,212,000	
パルグループホールディングス	12,400	1,780.00	22,072,000	
JALUX	4,000	1,728.00	6,912,000	
エディオン	60,500	1,104.00	66,792,000	
あらた	11,400	4,235.00	48,279,000	
サーラコーポレーション	29,400	628.00	18,463,200	
ワッツ	6,800	874.00	5,943,200	
トーメンデバイス	1,800	4,935.00	8,883,000	
ハローズ	5,700	2,849.00	16,239,300	
J Pホールディングス	39,000	268.00	10,452,000	
フジオフードグループ本社	12,100	1,387.00	16,782,700	
あみやき亭	3,200	2,989.00	9,564,800	
東京エレクトロン デバイス	4,600	7,000.00	32,200,000	
ひらまつ	25,700	232.00	5,962,400	
フィールズ	12,300	520.00	6,396,000	
双日	157,460	1,958.00	308,306,680	
アルフレッサ ホールディングス	148,000	1,661.00	245,828,000	
大黒天物産	4,500	6,610.00	29,745,000	
ハニーズホールディングス	11,100	1,047.00	11,621,700	
ファーマライズホールディングス	3,700	778.00	2,878,600	
キッコーマン	104,700	8,830.00	924,501,000	
味の素	346,000	3,344.00	1,157,024,000	
ブルドックソース	6,400	2,328.00	14,899,200	
キュービー	81,000	2,547.00	206,307,000	
ハウス食品グループ本社	54,400	3,425.00	186,320,000	
カゴメ	55,300	2,884.00	159,485,200	
焼津水産化学工業	5,400	1,003.00	5,416,200	
アリアケジャパン	13,300	7,090.00	94,297,000	
ピエトロ	1,300	1,765.00	2,294,500	
エバラ食品工業	2,600	2,513.00	6,533,800	
やまみ	1,200	2,096.00	2,515,200	
ニチレイ	69,300	2,943.00	203,949,900	
横浜冷凍	41,900	892.00	37,374,800	
東洋水産	74,900	4,885.00	365,886,500	
イトアンドホールディングス	4,900	2,432.00	11,916,800	
大冷	1,800	1,939.00	3,490,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	735.00	5,953,500	
日清食品ホールディングス	57,100	8,860.00	505,906,000	
永谷園ホールディングス	7,500	2,114.00	15,855,000	
一正蒲鉾	5,800	923.00	5,353,400	
フジッコ	16,200	1,922.00	31,136,400	
ロック・フィールド	15,500	1,728.00	26,784,000	
日本たばこ産業	780,400	2,204.00	1,720,001,600	
ケンコーマヨネーズ	9,000	1,580.00	14,220,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,377.00	22,343,800	
なとり	8,400	1,950.00	16,380,000	

イフジ産業	2,600	930.00	2,418,000
ピククルスコーポレーション	6,800	1,839.00	12,505,200
ファーマフーズ	13,600	2,669.00	36,298,400
北の達人コーポレーション	50,400	441.00	22,226,400
ユージェナ	73,800	853.00	62,951,400
紀文食品	8,400	1,299.00	10,911,600
スター・マイカ・ホールディングス	7,700	1,373.00	10,572,100
S R Eホールディングス	2,100	7,130.00	14,973,000
A Dワークスグループ	29,500	161.00	4,749,500
片倉工業	17,300	1,730.00	29,929,000
グンゼ	10,400	4,220.00	43,888,000
ヒューリック	303,400	1,173.00	355,888,200
神栄	3,100	1,041.00	3,227,100
ラサ商事	7,800	937.00	7,308,600
アルペン	10,800	2,877.00	31,071,600
ハブ	4,400	775.00	3,410,000
ラクーンホールディングス	10,200	1,596.00	16,279,200
クオールホールディングス	19,100	1,441.00	27,523,100
アルコニックス	15,100	1,708.00	25,790,800
神戸物産	110,700	3,700.00	409,590,000
ソリトンシステムズ	6,900	1,464.00	10,101,600
ジンズホールディングス	9,700	7,320.00	71,004,000
ビックカメラ	84,900	1,057.00	89,739,300
D C Mホールディングス	88,200	1,119.00	98,695,800
ペッパーフードサービス	19,100	395.00	7,544,500
ハイパー	2,200	550.00	1,210,000
M o n o t a R O	180,300	2,540.00	457,962,000
東京一番フーズ	4,100	584.00	2,394,400
D Dホールディングス	7,300	525.00	3,832,500
あい ホールディングス	20,400	2,188.00	44,635,200
ディーブイエックス	4,400	1,097.00	4,826,800
きちりホールディングス	3,700	634.00	2,345,800
アークランドサービスホールディングス	10,800	2,310.00	24,948,000
J . フロント リテイリング	170,300	1,073.00	182,731,900
ドトール・日レスホールディングス	22,600	1,756.00	39,685,600
マツキヨココカラ&カンパニー	80,520	5,500.00	442,860,000
ブロンコビリー	8,100	2,513.00	20,355,300
Z O Z O	84,000	4,085.00	343,140,000
トレジャー・ファクトリー	3,900	958.00	3,736,200
物語コーポレーション	7,600	7,900.00	60,040,000
三越伊勢丹ホールディングス	249,500	824.00	205,588,000
東洋紡	56,100	1,335.00	74,893,500
ユニチカ	41,300	369.00	15,239,700
富士紡ホールディングス	6,900	4,020.00	27,738,000
日清紡ホールディングス	88,400	870.00	76,908,000
倉敷紡績	12,300	1,936.00	23,812,800
ダイワボウホールディングス	64,900	1,931.00	125,321,900
シキボウ	8,100	937.00	7,589,700
日東紡績	21,600	3,455.00	74,628,000

トヨタ紡織	42,100	2,047.00	86,178,700
マクニカ・富士エレホールディングス	34,000	2,504.00	85,136,000
H a m e e	3,500	1,463.00	5,120,500
マーケットエンタープライズ	500	751.00	375,500
ラクト・ジャパン	5,700	2,813.00	16,034,100
ウエルシアホールディングス	75,500	4,155.00	313,702,500
クリエイトSDホールディングス	21,100	3,730.00	78,703,000
グリムス	4,100	3,040.00	12,464,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,800	777.00	19,269,600
八洲電機	11,200	966.00	10,819,200
メディアスホールディングス	8,200	915.00	7,503,000
レスターホールディングス	15,100	1,866.00	28,176,600
ジューテックホールディングス	3,400	1,118.00	3,801,200
丸善CHIホールディングス	20,400	375.00	7,650,000
大光	6,000	703.00	4,218,000
OCHIホールディングス	3,900	1,285.00	5,011,500
TOKAIホールディングス	69,100	898.00	62,051,800
黒谷	3,700	712.00	2,634,400
ミサワ	2,600	669.00	1,739,400
ティーライフ	1,900	1,469.00	2,791,100
Cominix	1,900	724.00	1,375,600
エー・ピーホールディングス	2,100	466.00	978,600
三洋貿易	14,200	1,134.00	16,102,800
チムニー	4,400	1,491.00	6,560,400
シュッピン	9,600	1,226.00	11,769,600
ビューティガレージ	2,600	3,705.00	9,633,000
オイシックス・ラ・大地	18,700	4,525.00	84,617,500
ウイン・パートナーズ	10,700	978.00	10,464,600
ネクステージ	28,600	2,027.00	57,972,200
ジョイフル本田	41,800	1,588.00	66,378,400
鳥貴族ホールディングス	5,100	2,070.00	10,557,000
ホットランド	10,700	1,379.00	14,755,300
すかいらーくホールディングス	184,200	1,610.00	296,562,000
SFPホールディングス	7,000	1,469.00	10,283,000
綿半ホールディングス	10,800	1,250.00	13,500,000
日本毛織	43,000	960.00	41,280,000
ダイトウボウ	21,600	100.00	2,160,000
トーア紡コーポレーション	4,500	432.00	1,944,000
ダイドーリミテッド	18,500	171.00	3,163,500
ヨシックスホールディングス	2,700	2,244.00	6,058,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	41,600	1,060.00	44,096,000
三栄建築設計	5,600	1,990.00	11,144,000
野村不動産ホールディングス	82,000	2,840.00	232,880,000
三重交通グループホールディングス	29,200	544.00	15,884,800
サムティ	20,300	2,340.00	47,502,000
ディア・ライフ	18,300	575.00	10,522,500
コーセーアールイー	4,300	669.00	2,876,700
日本商業開発	9,100	1,746.00	15,888,600

プレサンスコーポレーション	23,500	1,864.00	43,804,000
フィル・カンパニー	2,500	3,185.00	7,962,500
THEグローバル社	9,200	206.00	1,895,200
ハウスコム	1,300	1,283.00	1,667,900
日本管理センター	7,000	1,205.00	8,435,000
サンセイランディック	3,900	832.00	3,244,800
エストラスト	1,400	656.00	918,400
フージャースホールディングス	23,100	675.00	15,592,500
オープンハウス	45,300	6,830.00	309,399,000
東急不動産ホールディングス	388,500	675.00	262,237,500
飯田グループホールディングス	119,200	2,789.00	332,448,800
イーグランド	2,600	1,563.00	4,063,800
ムゲンエステート	9,700	486.00	4,714,200
帝国繊維	16,100	1,997.00	32,151,700
日本コークス工業	120,400	154.00	18,541,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,100	1,322.00	10,708,200
ミタチ産業	3,800	895.00	3,401,000
B E E N O S	7,200	3,040.00	21,888,000
あさひ	10,500	1,337.00	14,038,500
日本調剤	8,700	1,637.00	14,241,900
コスモス薬品	14,400	19,130.00	275,472,000
シップヘルスケアホールディングス	50,300	2,855.00	143,606,500
トーエル	7,100	841.00	5,971,100
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	3,380.00	19,604,000
オンリー	2,900	774.00	2,244,600
セブン&アイ・ホールディングス	558,500	4,766.00	2,661,811,000
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	76,600	938.00	71,850,800
明治電機工業	3,400	1,314.00	4,467,600
ツルハホールディングス	31,100	14,030.00	436,333,000
デリカフーズホールディングス	6,100	639.00	3,897,900
スターティアホールディングス	3,600	1,475.00	5,310,000
サンマルクホールディングス	11,200	1,607.00	17,998,400
フェリシモ	3,000	1,512.00	4,536,000
トリドールホールディングス	35,300	2,700.00	95,310,000
帝人	133,600	1,559.00	208,282,400
東レ	1,028,100	720.40	740,643,240
クラレ	207,900	1,053.00	218,918,700
旭化成	941,100	1,180.50	1,110,968,550
T O K Y O B A S E	15,900	712.00	11,320,800
稲葉製作所	8,000	1,349.00	10,792,000
宮地エンジニアリンググループ	4,500	2,600.00	11,700,000
トーカロ	37,000	1,256.00	46,472,000
アルファ	5,000	1,229.00	6,145,000
S U M C O	182,800	2,115.00	386,622,000
川田テクノロジーズ	2,900	3,865.00	11,208,500
R S T e c h n o l o g i e s	4,600	5,580.00	25,668,000
ジェイテックコーポレーション	1,500	2,136.00	3,204,000
信和	7,500	724.00	5,430,000
ピーロット	9,400	546.00	5,132,400

ファーストブラザーズ	3,300	1,022.00	3,372,600
ハウスドゥ	7,000	1,005.00	7,035,000
シーアールイー	3,600	2,134.00	7,682,400
プロパティエージェント	2,500	2,737.00	6,842,500
ケイアイスター不動産	4,800	5,820.00	27,936,000
アグレ都市デザイン	3,700	1,418.00	5,246,600
グッドコムアセット	6,200	1,403.00	8,698,600
ジェイ・エス・ビー	2,800	2,918.00	8,170,400
テンポイノベーション	3,700	975.00	3,607,500
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	1,094.00	2,406,800
フェイスネットワーク	1,100	1,281.00	1,409,100
住江織物	2,300	1,861.00	4,280,300
日本フェルト	6,200	449.00	2,783,800
イチカワ	1,400	1,329.00	1,860,600
エコナックホールディングス	23,100	93.00	2,148,300
日東製網	1,400	1,472.00	2,060,800
芦森工業	2,600	1,011.00	2,628,600
アツギ	11,000	644.00	7,084,000
ウイルプラスホールディングス	2,100	1,093.00	2,295,300
J Mホールディングス	9,800	1,989.00	19,492,200
コメダホールディングス	31,000	2,137.00	66,247,000
サツドラホールディングス	1,700	2,254.00	3,831,800
アレンザホールディングス	10,900	1,344.00	14,649,600
串カツ田中ホールディングス	3,600	2,270.00	8,172,000
バロックジャパンリミテッド	9,900	871.00	8,622,900
クスリのアオキホールディングス	14,200	7,500.00	106,500,000
ダイニック	4,000	743.00	2,972,000
共和レザー	7,700	689.00	5,305,300
ピーバンドットコム	1,700	680.00	1,156,000
力の源ホールディングス	6,900	628.00	4,333,200
FOOD & LIFE COMPANIES	83,500	5,140.00	429,190,000
アセンテック	3,200	1,265.00	4,048,000
セーレン	34,900	2,174.00	75,872,600
ソトー	6,700	839.00	5,621,300
東海染工	1,400	1,135.00	1,589,000
小松マテーレ	23,300	938.00	21,855,400
ワコールホールディングス	35,500	2,299.00	81,614,500
ホギメディカル	19,100	3,200.00	61,120,000
クラウディアホールディングス	2,600	284.00	738,400
T S Iホールディングス	42,600	358.00	15,250,800
マツオカコーポレーション	4,500	1,425.00	6,412,500
ワールド	18,500	1,385.00	25,622,500
T I S	142,000	2,941.00	417,622,000
J N Sホールディングス	9,500	549.00	5,215,500
グリー	86,200	812.00	69,994,400
G M Oペパボ	1,800	2,829.00	5,092,200
コーエーテクモホールディングス	37,800	5,090.00	192,402,000
三菱総合研究所	5,900	4,430.00	26,137,000
ボルテージ	3,000	454.00	1,362,000

電算	1,100	2,390.00	2,629,000	
A G S	6,800	888.00	6,038,400	
ファインデックス	11,600	975.00	11,310,000	
ブレインパッド	3,600	5,680.00	20,448,000	
K L a b	25,800	652.00	16,821,600	
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,700	1,037.00	19,391,900	
イーブックイニシアティブジャパン	2,500	4,875.00	12,187,500	
ネクソン	320,400	1,887.00	604,594,800	
アイスタイル	42,700	434.00	18,531,800	
エムアップホールディングス	4,400	3,610.00	15,884,000	
エイチーム	9,700	1,574.00	15,267,800	
エニグモ	13,200	1,193.00	15,747,600	
テクノスジャパン	10,700	600.00	6,420,000	
e n i s h	8,600	442.00	3,801,200	
コロプラ	46,800	826.00	38,656,800	
オルトプラス	10,800	407.00	4,395,600	
ブロードリーフ	69,500	564.00	39,198,000	
クロス・マーケティンググループ	7,300	860.00	6,278,000	
デジタルハーツホールディングス	7,900	1,889.00	14,923,100	
システム情報	10,000	947.00	9,470,000	
メディアドゥ	5,400	4,405.00	23,787,000	
じげん	34,700	417.00	14,469,900	
ブイキューブ	14,100	1,579.00	22,263,900	
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	609.00	1,522,500	
サイバーリンクス	6,600	1,377.00	9,088,200	
ディー・エル・イー	10,900	288.00	3,139,200	
フィックスターズ	14,600	778.00	11,358,800	
C A R T A H O L D I N G S	5,500	2,458.00	13,519,000	
オブティム	9,800	1,989.00	19,492,200	
セレス	5,300	2,850.00	15,105,000	
S H I F T	7,200	22,490.00	161,928,000	
特種東海製紙	8,800	4,520.00	39,776,000	
ティーガイア	15,200	2,072.00	31,494,400	
セック	1,900	2,346.00	4,457,400	
テクマトリックス	21,800	1,879.00	40,962,200	
プロシップ	3,800	1,756.00	6,672,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,600	2,074.00	80,056,400	
G M O ペイメントゲートウェイ	27,500	13,970.00	384,175,000	
ザップラス	10,300	540.00	5,562,000	
システムリサーチ	3,800	1,925.00	7,315,000	
インターネットイニシアティブ	37,700	3,815.00	143,825,500	
さくらインターネット	14,500	611.00	8,859,500	
ヴィンクス	3,600	974.00	3,506,400	
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,100	4,585.00	14,213,500	
S R A ホールディングス	7,300	2,837.00	20,710,100	
システムインテグレータ	3,600	635.00	2,286,000	
朝日ネット	11,000	736.00	8,096,000	

e B A S E	16,600	818.00	13,578,800
アバント	16,200	1,566.00	25,369,200
アドソル日進	4,700	2,195.00	10,316,500
ODKソリューションズ	7,200	701.00	5,047,200
フリービット	8,200	1,268.00	10,397,600
コムチュア	12,900	2,997.00	38,661,300
サイバーコム	2,300	1,234.00	2,838,200
アステリア	12,900	707.00	9,120,300
アイル	7,800	1,812.00	14,133,600
王子ホールディングス	639,100	560.00	357,896,000
日本製紙	62,900	1,227.00	77,178,300
三菱製紙	21,500	365.00	7,847,500
北越コーポレーション	101,400	746.00	75,644,400
中越パルプ工業	5,400	1,217.00	6,571,800
巴川製紙所	4,700	861.00	4,046,700
大王製紙	68,500	2,048.00	140,288,000
阿波製紙	4,200	393.00	1,650,600
マークライnz	7,100	3,075.00	21,832,500
メディカル・データ・ビジョン	17,800	1,483.00	26,397,400
g u m i	19,400	840.00	16,296,000
ショーケース	2,600	618.00	1,606,800
モバイルファクトリー	2,800	1,062.00	2,973,600
テラスカイ	4,400	2,040.00	8,976,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,664.00	9,817,600
P C Iホールディングス	6,000	1,066.00	6,396,000
パイブドHD	4,100	2,797.00	11,467,700
アイビーシー	2,100	956.00	2,007,600
ネオジャパン	2,500	1,440.00	3,600,000
P R T I M E S	3,700	3,155.00	11,673,500
ラクス	42,600	3,450.00	146,970,000
ランドコンピュータ	2,550	807.00	2,057,850
ダブルスタンダード	3,500	3,580.00	12,530,000
オーブンドア	8,400	2,699.00	22,671,600
マイネット	4,700	669.00	3,144,300
アカツキ	5,500	3,235.00	17,792,500
ベネフィットジャパン	1,000	2,523.00	2,523,000
U b i c o mホールディングス	4,500	2,731.00	12,289,500
カナミックネットワーク	15,000	613.00	9,195,000
ノムラシステムコーポレーション	6,600	293.00	1,933,800
レンゴー	146,500	881.00	129,066,500
トーモク	8,800	1,980.00	17,424,000
ザ・バック	10,800	2,946.00	31,816,800
チェンジ	26,000	2,171.00	56,446,000
シンクロ・フード	7,800	388.00	3,026,400
オークネット	7,700	2,327.00	17,917,900
キャピタル・アセット・プランニング	2,600	919.00	2,389,400
セグエグループ	3,200	797.00	2,550,400
エイトレッド	2,500	2,451.00	6,127,500
マクロミル	28,900	821.00	23,726,900

ビーグリー	3,100	1,606.00	4,978,600
オロ	4,300	3,580.00	15,394,000
ユーザーローカル	4,000	1,809.00	7,236,000
テモナ	2,700	769.00	2,076,300
ニーズウェル	2,500	700.00	1,750,000
マネーフォワード	21,500	7,980.00	171,570,000
サインポスト	3,300	1,169.00	3,857,700
昭和電工	123,000	2,683.00	330,009,000
住友化学	1,117,300	568.00	634,626,400
住友精化	7,000	3,400.00	23,800,000
日産化学	77,200	6,320.00	487,904,000
ラサ工業	4,500	1,848.00	8,316,000
クレハ	12,100	7,130.00	86,273,000
多木化学	5,500	6,470.00	35,585,000
テイカ	10,600	1,323.00	14,023,800
石原産業	25,200	1,233.00	31,071,600
片倉コープアグリ	2,600	1,181.00	3,070,600
日本曹達	19,400	3,450.00	66,930,000
東ソー	219,400	2,011.00	441,213,400
トクヤマ	42,100	2,120.00	89,252,000
セントラル硝子	27,300	2,082.00	56,838,600
東亜合成	80,900	1,283.00	103,794,700
大阪ソーダ	14,600	2,600.00	37,960,000
関東電化工業	33,600	995.00	33,432,000
デンカ	51,800	3,835.00	198,653,000
イビデン	69,600	5,810.00	404,376,000
信越化学工業	262,500	19,145.00	5,025,562,500
日本カーバイド工業	5,200	1,374.00	7,144,800
電算システムホールディングス	5,600	2,630.00	14,728,000
堺化学工業	9,900	2,302.00	22,789,800
第一稀元素化学工業	14,000	1,452.00	20,328,000
エア・ウォーター	144,700	1,712.00	247,726,400
日本酸素ホールディングス	117,000	2,722.00	318,474,000
日本化学工業	3,900	2,943.00	11,477,700
東邦アセチレン	2,100	1,270.00	2,667,000
日本パーカライジング	72,100	1,113.00	80,247,300
高圧ガス工業	22,700	776.00	17,615,200
チタン工業	1,700	1,830.00	3,111,000
四国化成工業	18,700	1,401.00	26,198,700
戸田工業	2,900	2,990.00	8,671,000
ステラ ケミファ	7,700	2,898.00	22,314,600
保土谷化学工業	4,100	5,100.00	20,910,000
日本触媒	25,800	5,680.00	146,544,000
大日精化工業	11,800	2,627.00	30,998,600
カネカ	36,700	4,510.00	165,517,000
協和キリン	170,100	3,705.00	630,220,500
三菱瓦斯化学	142,200	2,212.00	314,546,400
三井化学	122,400	3,610.00	441,864,000
J S R	142,400	3,835.00	546,104,000
東京応化工業	24,300	6,580.00	159,894,000

大阪有機化学工業	12,000	3,400.00	40,800,000
三菱ケミカルホールディングス	949,000	974.00	924,326,000
KHネオケム	23,400	3,050.00	71,370,000
ダイセル	191,000	870.00	166,170,000
住友ベークライト	22,400	4,950.00	110,880,000
積水化学工業	297,300	1,857.00	552,086,100
日本ゼオン	128,000	1,527.00	195,456,000
アイカ工業	39,600	3,620.00	143,352,000
宇部興産	71,800	2,196.00	157,672,800
積水樹脂	21,600	2,099.00	45,338,400
タキロンシーアイ	30,800	622.00	19,157,600
旭有機材	8,100	1,412.00	11,437,200
ニチバン	7,600	1,840.00	13,984,000
リケンテクノス	34,500	563.00	19,423,500
大倉工業	7,200	2,158.00	15,537,600
積水化成成品工業	19,400	589.00	11,426,600
群栄化学工業	3,200	3,110.00	9,952,000
タイガースポリマー	8,000	424.00	3,392,000
ミライアル	4,400	1,558.00	6,855,200
ダイキアクシス	5,300	981.00	5,199,300
ダイキョーニシカワ	30,100	653.00	19,655,300
竹本容器	5,100	921.00	4,697,100
森六ホールディングス	7,800	2,051.00	15,997,800
恵和	3,600	4,600.00	16,560,000
日本化薬	87,900	1,217.00	106,974,300
カーリットホールディングス	13,700	794.00	10,877,800
ソルクシーズ	11,000	525.00	5,775,000
レグス	3,500	1,765.00	6,177,500
プレステージ・インターナショナル	51,800	766.00	39,678,800
フェイス	4,000	716.00	2,864,000
プロトコーポレーション	16,800	1,530.00	25,704,000
ハイマックス	3,700	1,155.00	4,273,500
アミューズ	7,600	2,329.00	17,700,400
野村総合研究所	246,900	4,070.00	1,004,883,000
ドリームインキュベータ	4,100	842.00	3,452,200
サイバネットシステム	9,200	641.00	5,897,200
クイック	8,400	1,381.00	11,600,400
TAC	7,100	243.00	1,725,300
CEホールディングス	7,000	577.00	4,039,000
日本システム技術	3,200	1,871.00	5,987,200
電通グループ	142,800	4,220.00	602,616,000
インテージホールディングス	17,500	1,606.00	28,105,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	1,263.00	7,830,600
東邦システムサイエンス	3,300	1,074.00	3,544,200
ぴあ	3,900	4,190.00	16,341,000
イオンファンタジー	5,200	1,938.00	10,077,600
ソースネクスト	65,600	235.00	15,416,000
シーティーエス	15,600	789.00	12,308,400
ネクシーズグループ	4,700	926.00	4,352,200
インフォコム	12,800	2,360.00	30,208,000

メディカルシステムネットワーク	12,200	683.00	8,332,600	
日本精化	10,200	2,201.00	22,450,200	
扶桑化学工業	11,200	4,940.00	55,328,000	
トリケミカル研究所	13,100	3,155.00	41,330,500	
HEROZ	3,900	1,985.00	7,741,500	
ラクスル	15,400	5,730.00	88,242,000	
I P S	3,200	2,063.00	6,601,600	
F I G	14,000	286.00	4,004,000	
システムサポート	3,900	1,358.00	5,296,200	
A D E K A	65,200	2,383.00	155,371,600	
日油	53,400	6,070.00	324,138,000	
ミヨシ油脂	5,700	1,341.00	7,643,700	
新日本理化	22,400	351.00	7,862,400	
ハリマ化成グループ	10,900	882.00	9,613,800	
イーソル	8,400	908.00	7,627,200	
アルテリア・ネットワークス	15,300	1,691.00	25,872,300	
E D U L A B	1,200	2,697.00	3,236,400	
東海ソフト	1,900	1,226.00	2,329,400	
ウイングアーク1st	7,900	2,317.00	18,304,300	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,807.00	7,047,300	
サーバーワークス	1,300	4,150.00	5,395,000	
東名	700	1,231.00	861,700	
ヴィッツ	1,200	1,663.00	1,995,600	
トピラシステムズ	2,500	1,230.00	3,075,000	
S a n s a n	12,600	11,870.00	149,562,000	
L i n k - U	2,300	1,245.00	2,863,500	
ギフトィ	12,300	4,245.00	52,213,500	
花王	320,800	6,660.00	2,136,528,000	
第一工業製薬	4,800	3,110.00	14,928,000	
石原ケミカル	7,100	1,342.00	9,528,200	
日華化学	4,700	1,000.00	4,700,000	
ニイタカ	2,900	2,305.00	6,684,500	
三洋化成工業	8,500	5,690.00	48,365,000	
ベース	2,600	4,660.00	12,116,000	
武田薬品工業	1,206,000	3,245.00	3,913,470,000	
アステラス製薬	1,256,800	1,957.50	2,460,186,000	
大日本住友製薬	107,400	1,899.00	203,952,600	
塩野義製薬	182,200	7,544.00	1,374,516,800	
わかもと製薬	16,800	343.00	5,762,400	
日本新薬	41,100	8,820.00	362,502,000	
中外製薬	453,300	3,924.00	1,778,749,200	
科研製薬	24,800	4,500.00	111,600,000	
エーザイ	160,100	8,030.00	1,285,603,000	
理研ビタミン	13,700	1,843.00	25,249,100	
ロート製薬	69,100	3,395.00	234,594,500	
小野薬品工業	332,900	2,446.00	814,273,400	
久光製薬	42,200	4,135.00	174,497,000	
有機合成薬品工業	10,300	328.00	3,378,400	
持田製薬	20,200	3,325.00	67,165,000	

参天製薬	252,200	1,521.00	383,596,200
扶桑薬品工業	4,600	2,523.00	11,605,800
日本ケミファ	1,300	2,180.00	2,834,000
ツムラ	48,300	3,435.00	165,910,500
日医工	40,900	945.00	38,650,500
テルモ	444,400	5,044.00	2,241,553,600
H・U・グループホールディングス	38,700	2,841.00	109,946,700
キッセイ薬品工業	25,600	2,432.00	62,259,200
生化学工業	25,600	1,048.00	26,828,800
栄研化学	25,400	1,939.00	49,250,600
日水製薬	5,600	987.00	5,527,200
鳥居薬品	8,200	2,992.00	24,534,400
JCRファーマ	40,800	2,871.00	117,136,800
東和薬品	20,800	3,340.00	69,472,000
富士製薬工業	9,100	1,132.00	10,301,200
ゼリア新薬工業	26,400	2,038.00	53,803,200
第一三共	1,139,000	2,951.50	3,361,758,500
キョーリン製薬ホールディングス	31,900	1,799.00	57,388,100
大幸薬品	21,700	900.00	19,530,000
ダイト	9,200	3,175.00	29,210,000
大塚ホールディングス	301,300	4,840.00	1,458,292,000
大正製薬ホールディングス	35,800	6,490.00	232,342,000
ペプチドリーム	76,000	2,869.00	218,044,000
大日本塗料	16,300	864.00	14,083,200
日本ペイントホールディングス	533,400	1,229.00	655,548,600
関西ペイント	159,500	2,709.00	432,085,500
神東塗料	10,400	191.00	1,986,400
中国塗料	31,000	881.00	27,311,000
日本特殊塗料	10,700	1,039.00	11,117,300
藤倉化成	19,300	537.00	10,364,100
太陽ホールディングス	20,900	2,714.00	56,722,600
DIC	60,100	3,105.00	186,610,500
サカタインクス	28,500	1,141.00	32,518,500
東洋インキSCホールディングス	30,200	2,051.00	61,940,200
T&K TOKA	10,400	817.00	8,496,800
アルプス技研	12,200	2,057.00	25,095,400
サニックス	21,100	335.00	7,068,500
ダイオーズ	3,200	1,010.00	3,232,000
日本空調サービス	14,400	812.00	11,692,800
オリエンタルランド	147,300	17,990.00	2,649,927,000
フォーカスシステムズ	8,800	997.00	8,773,600
ダスキン	32,100	2,682.00	86,092,200
パーク24	76,600	1,864.00	142,782,400
明光ネットワークジャパン	15,800	653.00	10,317,400
ファルコホールディングス	6,600	1,760.00	11,616,000
クレスコ	10,800	1,996.00	21,556,800
フジ・メディア・ホールディングス	147,500	1,192.00	175,820,000
秀英予備校	6,600	417.00	2,752,200
田谷	1,900	559.00	1,062,100
ラウンドワン	47,100	1,505.00	70,885,500

リゾートトラスト	63,400	2,129.00	134,978,600
オービック	44,700	21,350.00	954,345,000
ジャストシステム	20,200	5,790.00	116,958,000
TDCソフト	14,500	1,355.00	19,647,500
Zホールディングス	1,953,500	712.30	1,391,478,050
ビー・エム・エル	17,700	4,105.00	72,658,500
トレンドマイクロ	75,900	6,120.00	464,508,000
りらいあコミュニケーションズ	21,000	1,207.00	25,347,000
IDホールディングス	7,500	949.00	7,117,500
リソー教育	69,500	449.00	31,205,500
日本オラクル	28,800	10,010.00	288,288,000
早稲田アカデミー	5,700	1,010.00	5,757,000
アルファシステムズ	3,400	4,395.00	14,943,000
フューチャー	15,500	2,773.00	42,981,500
CAC Holdings	8,400	1,641.00	13,784,400
SBテクノロジー	4,900	2,870.00	14,063,000
トーセ	3,700	775.00	2,867,500
ユー・エス・エス	155,100	1,799.00	279,024,900
オービックビジネスコンサルタント	13,500	5,810.00	78,435,000
伊藤忠テクノソリューションズ	64,500	3,565.00	229,942,500
アイティフォー	17,300	848.00	14,670,400
東京個別指導学院	11,900	660.00	7,854,000
東計電算	2,100	4,700.00	9,870,000
サイバーエージェント	341,000	2,115.00	721,215,000
楽天グループ	710,500	1,113.00	790,786,500
エクスネット	6,200	1,018.00	6,311,600
クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,884.00	13,376,400
モーニングスター	19,700	525.00	10,342,500
テー・オー・ダブリュー	23,800	338.00	8,044,400
大塚商会	76,800	5,620.00	431,616,000
サイボウズ	18,700	2,417.00	45,197,900
山田コンサルティンググループ	8,000	1,131.00	9,048,000
セントラルスポーツ	5,100	2,475.00	12,622,500
バラカ	3,700	1,648.00	6,097,600
電通国際情報サービス	20,500	4,025.00	82,512,500
ACCESS	17,400	930.00	16,182,000
デジタルガレージ	23,500	4,965.00	116,677,500
イーエムシステムズ	23,200	779.00	18,072,800
ウェザーニューズ	4,200	6,700.00	28,140,000
C I J	8,800	857.00	7,541,600
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,515.00	6,678,500
日本エンタープライズ	12,900	203.00	2,618,700
WOWOW	6,900	2,454.00	16,932,600
スカラ	15,700	742.00	11,649,400
インテリジェント ウェイブ	7,800	613.00	4,781,400
フルキャストホールディングス	11,700	2,579.00	30,174,300
エン・ジャパン	24,600	4,285.00	105,411,000
あすか製薬ホールディングス	16,300	1,025.00	16,707,500
サワイグループホールディングス	31,700	5,200.00	164,840,000
富士フイルムホールディングス	254,800	9,001.00	2,293,454,800

コニカミノルタ	293,800	617.00	181,274,600
資生堂	270,000	7,725.00	2,085,750,000
ライオン	175,000	1,891.00	330,925,000
高砂香料工業	9,100	2,984.00	27,154,400
マンダム	30,400	1,599.00	48,609,600
ミルボン	17,800	6,600.00	117,480,000
ファンケル	52,700	3,765.00	198,415,500
コーセー	27,200	14,040.00	381,888,000
コタ	9,100	1,585.00	14,423,500
シーボン	1,400	1,861.00	2,605,400
ポーラ・オルビスホールディングス	61,900	2,571.00	159,144,900
ノエビアホールディングス	12,300	5,460.00	67,158,000
アジュバンホールディングス	3,300	1,171.00	3,864,300
新日本製薬	3,900	1,840.00	7,176,000
エステー	9,500	1,723.00	16,368,500
アグロ カネショウ	5,000	1,477.00	7,385,000
コニシ	23,900	1,806.00	43,163,400
長谷川香料	25,000	2,691.00	67,275,000
星光PMC	8,200	808.00	6,625,600
小林製薬	40,600	8,790.00	356,874,000
荒川化学工業	12,300	1,242.00	15,276,600
メック	10,800	2,870.00	30,996,000
日本高純度化学	3,900	2,922.00	11,395,800
タカラバイオ	37,900	2,915.00	110,478,500
JCU	16,300	4,195.00	68,378,500
新田ゼラチン	9,900	626.00	6,197,400
OATアグリオ	2,900	1,978.00	5,736,200
デクセリアルズ	40,300	2,053.00	82,735,900
アース製薬	11,900	6,720.00	79,968,000
北興化学工業	13,300	1,051.00	13,978,300
大成ラミック	4,100	2,746.00	11,258,600
クミアイ化学工業	54,300	851.00	46,209,300
日本農薬	26,200	521.00	13,650,200
富士興産	5,900	969.00	5,717,100
ニチレキ	17,200	1,357.00	23,340,400
ユシロ化学工業	8,300	1,181.00	9,802,300
ビービー・カストロール	5,300	1,424.00	7,547,200
富士石油	34,000	290.00	9,860,000
MORESCO	5,300	1,240.00	6,572,000
出光興産	160,900	3,230.00	519,707,000
ENEOSホールディングス	2,181,300	457.30	997,508,490
コスモエネルギーホールディングス	45,700	2,550.00	116,535,000
テスホールディングス	8,200	2,142.00	17,564,400
インフロニア・ホールディングス	177,764	936.00	166,387,104
横浜ゴム	83,900	2,035.00	170,736,500
TOYO TIRE	76,300	1,946.00	148,479,800
ブリヂストン	417,500	5,272.00	2,201,060,000
住友ゴム工業	130,100	1,454.00	189,165,400
藤倉コンポジット	12,000	783.00	9,396,000
オカモト	8,700	4,095.00	35,626,500

アキレス	10,200	1,314.00	13,402,800
フコク	6,000	1,029.00	6,174,000
ニッタ	15,100	2,662.00	40,196,200
クリエートメディック	4,600	986.00	4,535,600
住友理工	28,200	750.00	21,150,000
三ツ星ベルト	17,700	2,023.00	35,807,100
パンドー化学	25,600	897.00	22,963,200
A G C	133,000	5,870.00	780,710,000
日本板硝子	73,500	562.00	41,307,000
石塚硝子	2,300	2,136.00	4,912,800
有沢製作所	19,800	894.00	17,701,200
日本山村硝子	6,600	904.00	5,966,400
日本電気硝子	58,200	2,738.00	159,351,600
オハラ	5,700	1,416.00	8,071,200
住友大阪セメント	26,100	3,390.00	88,479,000
太平洋セメント	82,300	2,443.00	201,058,900
リソルホールディングス	1,900	4,045.00	7,685,500
日本ヒューム	13,900	759.00	10,550,100
日本コンクリート工業	30,900	301.00	9,300,900
三谷セキサン	6,800	7,330.00	49,844,000
アジアパイルホールディングス	22,700	469.00	10,646,300
東海カーボン	121,200	1,396.00	169,195,200
日本カーボン	7,500	4,175.00	31,312,500
東洋炭素	9,400	2,867.00	26,949,800
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	4,880.00	39,040,000
T O T O	103,500	5,320.00	550,620,000
日本碍子	159,700	1,874.00	299,277,800
日本特殊陶業	110,200	1,727.00	190,315,400
ダントーホールディングス	9,600	264.00	2,534,400
M A R U W A	5,000	10,460.00	52,300,000
品川リフラクトリーズ	3,300	3,890.00	12,837,000
黒崎播磨	2,400	4,620.00	11,088,000
ヨータイ	10,300	1,282.00	13,204,600
イソライト工業	5,900	869.00	5,127,100
東京窯業	19,000	332.00	6,308,000
ニッカトー	6,700	800.00	5,360,000
フジインコーポレーテッド	11,600	6,420.00	74,472,000
クニミネ工業	4,600	1,116.00	5,133,600
エーアンドエーマテリアル	2,600	974.00	2,532,400
ニチアス	36,600	2,598.00	95,086,800
日本製鉄	684,200	1,935.50	1,324,269,100
神戸製鋼所	261,900	664.00	173,901,600
中山製鋼所	19,700	425.00	8,372,500
合同製鐵	7,900	1,537.00	12,142,300
ジェイ エフ イー ホールディングス	414,500	1,643.00	681,023,500
東京製鐵	55,700	1,093.00	60,880,100
共英製鋼	16,300	1,401.00	22,836,300
大和工業	30,500	3,460.00	105,530,000
東京鐵鋼	5,500	1,566.00	8,613,000

大阪製鐵	8,000	1,115.00	8,920,000
淀川製鋼所	19,000	2,398.00	45,562,000
丸一鋼管	46,800	2,559.00	119,761,200
モリ工業	4,300	2,387.00	10,264,100
大同特殊鋼	23,500	4,770.00	112,095,000
日本高周波鋼業	4,400	404.00	1,777,600
日本冶金工業	11,100	2,543.00	28,227,300
山陽特殊製鋼	17,200	1,731.00	29,773,200
愛知製鋼	8,200	2,683.00	22,000,600
日立金属	135,200	2,153.00	291,085,600
日本金属	3,500	1,008.00	3,528,000
大平洋金属	9,700	1,964.00	19,050,800
新日本電工	91,800	323.00	29,651,400
栗本鐵工所	6,700	1,677.00	11,235,900
虹 技	1,400	1,100.00	1,540,000
日本鑄鉄管	1,500	1,340.00	2,010,000
日本製鋼所	43,400	2,988.00	129,679,200
三菱製鋼	10,400	1,135.00	11,804,000
日亜鋼業	22,000	293.00	6,446,000
日本精線	2,000	4,790.00	9,580,000
エンビプロ・ホールディングス	7,700	2,247.00	17,301,900
大紀アルミニウム工業所	21,400	1,826.00	39,076,400
日本軽金属ホールディングス	39,300	1,922.00	75,534,600
三井金属鉱業	38,600	3,130.00	120,818,000
東邦亜鉛	7,900	2,697.00	21,306,300
三菱マテリアル	94,900	2,208.00	209,539,200
住友金属鉱山	183,200	4,141.00	758,631,200
DOWAホールディングス	36,300	4,420.00	160,446,000
古河機械金属	24,200	1,228.00	29,717,600
エス・サイエンス	67,700	33.00	2,234,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,000	800.00	12,000,000
東邦チタニウム	25,600	1,191.00	30,489,600
UACJ	21,800	2,756.00	60,080,800
CKサンエツ	2,300	2,978.00	6,849,400
古河電気工業	44,500	2,436.00	108,402,000
住友電気工業	500,400	1,522.50	761,859,000
フジクラ	172,800	648.00	111,974,400
昭和電線ホールディングス	13,800	2,140.00	29,532,000
東京特殊電線	1,700	2,840.00	4,828,000
タツタ電線	25,200	531.00	13,381,200
カナレ電気	2,500	1,710.00	4,275,000
平河ヒューテック	8,100	1,195.00	9,679,500
リョービ	17,700	1,239.00	21,930,300
アーレスティ	17,100	447.00	7,643,700
アサヒホールディングス	53,700	2,084.00	111,910,800
東洋製罐グループホールディングス	91,100	1,360.00	123,896,000
ホッカンホールディングス	7,500	1,492.00	11,190,000
コロナ	9,000	913.00	8,217,000
横河ブリッジホールディングス	24,600	2,395.00	58,917,000
駒井ハルテック	2,800	1,710.00	4,788,000

高田機工	800	2,780.00	2,224,000
三和ホールディングス	135,100	1,386.00	187,248,600
文化シャッター	42,000	1,136.00	47,712,000
三協立山	18,600	770.00	14,322,000
アルインコ	9,600	1,000.00	9,600,000
東洋シャッター	2,600	662.00	1,721,200
L I X I L	197,400	2,978.00	587,857,200
日本フィルコン	9,600	544.00	5,222,400
ノーリツ	27,400	1,847.00	50,607,800
長府製作所	14,800	2,069.00	30,621,200
リンナイ	27,900	11,700.00	326,430,000
ユニプレス	23,800	916.00	21,800,800
ダイニチ工業	6,800	757.00	5,147,600
日東精工	17,700	652.00	11,540,400
三洋工業	1,400	1,888.00	2,643,200
岡部	30,000	692.00	20,760,000
ジーテクト	17,700	1,442.00	25,523,400
東プレ	26,700	1,274.00	34,015,800
高周波熱錬	27,500	617.00	16,967,500
東京製綱	10,100	915.00	9,241,500
サンコール	12,300	450.00	5,535,000
モリテックスチール	10,900	439.00	4,785,100
パイオラックス	21,600	1,571.00	33,933,600
エイチワン	13,800	738.00	10,184,400
日本発条	143,000	836.00	119,548,000
中央発條	6,800	1,038.00	7,058,400
アドバネクス	1,800	1,247.00	2,244,600
三浦工業	62,100	4,260.00	264,546,000
タクマ	48,600	1,518.00	73,774,800
テクノプロ・ホールディングス	82,800	3,570.00	295,596,000
アトラグループ	2,700	313.00	845,100
インターワークス	3,900	410.00	1,599,000
アイ・アールジャパンホールディングス	5,500	11,880.00	65,340,000
K e e P e r 技研	8,800	3,435.00	30,228,000
ファーストロジック	2,500	799.00	1,997,500
三機サービス	2,600	1,109.00	2,883,400
G u n o s y	8,300	711.00	5,901,300
デザインワン・ジャパン	3,900	265.00	1,033,500
イー・ガーディアン	5,400	3,110.00	16,794,000
リブセンス	7,000	219.00	1,533,000
ジャパンマテリアル	42,700	1,383.00	59,054,100
ベクトル	17,000	1,185.00	20,145,000
ウチヤマホールディングス	6,300	378.00	2,381,400
チャーム・ケア・コーポレーション	11,000	1,730.00	19,030,000
キャリアリンク	5,100	1,692.00	8,629,200
I B J	12,300	1,097.00	13,493,100
アサンテ	4,800	1,766.00	8,476,800
バリューHR	5,400	1,759.00	9,498,600
M & A キャピタルパートナーズ	11,400	6,170.00	70,338,000

ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,529.00	7,950,800	
E R Iホールディングス	4,800	1,480.00	7,104,000	
アビスト	2,100	2,891.00	6,071,100	
シグマクシス・ホールディングス	7,500	2,720.00	20,400,000	
ウィルグループ	10,000	1,307.00	13,070,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	20,100	223.00	4,482,300	
メドピア	10,600	3,690.00	39,114,000	
レアジョブ	2,500	1,345.00	3,362,500	
リクルートホールディングス	992,100	7,158.00	7,101,451,800	
エラン	18,800	1,217.00	22,879,600	
ツガミ	29,500	1,549.00	45,695,500	
オークマ	16,700	5,340.00	89,178,000	
芝浦機械	14,800	2,652.00	39,249,600	
アマダ	210,100	1,139.00	239,303,900	
アイダエンジニアリング	37,600	983.00	36,960,800	
滝澤鉄工所	4,400	1,128.00	4,963,200	
F U J I	57,200	2,645.00	151,294,000	
牧野フライス製作所	16,800	4,025.00	67,620,000	
オーエスジー	66,400	1,817.00	120,648,800	
ダイジェット工業	1,100	1,229.00	1,351,900	
旭ダイヤモンド工業	37,600	669.00	25,154,400	
D M G森精機	85,000	1,913.00	162,605,000	
ソディック	31,800	854.00	27,157,200	
ディスコ	19,600	29,430.00	576,828,000	
日東工器	7,000	1,998.00	13,986,000	
日進工具	11,400	1,391.00	15,857,400	
パンチ工業	11,900	614.00	7,306,600	
富士ダイス	7,100	654.00	4,643,400	
土木管理総合試験所	6,200	360.00	2,232,000	
ネットマーケティング	6,100	521.00	3,178,100	
日本郵政	1,048,700	941.00	986,826,700	
ベルシステム24ホールディングス	23,300	1,675.00	39,027,500	
鎌倉新書	13,700	905.00	12,398,500	
S M N	2,900	726.00	2,105,400	
一蔵	1,900	513.00	974,700	
グローバルキッズCOMPANY	2,300	840.00	1,932,000	
エアトリ	8,900	4,210.00	37,469,000	
アトラエ	9,600	2,405.00	23,088,000	
ストライク	5,100	4,195.00	21,394,500	
ソラスト	33,900	1,426.00	48,341,400	
セラク	5,500	2,341.00	12,875,500	
インソース	13,300	2,188.00	29,100,400	
豊田自動織機	117,300	9,070.00	1,063,911,000	
豊和工業	7,900	816.00	6,446,400	
O K K	5,400	295.00	1,593,000	
石川製作所	3,700	1,550.00	5,735,000	
東洋機械金属	10,700	534.00	5,713,800	
津田駒工業	2,600	844.00	2,194,400	
エンシュウ	2,600	736.00	1,913,600	

島精機製作所	21,100	2,230.00	47,053,000
オプトラン	18,000	2,243.00	40,374,000
NCホールディングス	5,400	1,193.00	6,442,200
イワキ	9,400	938.00	8,817,200
フリー	13,800	1,667.00	23,004,600
ヤマシンフィルタ	28,800	622.00	17,913,600
日阪製作所	18,100	846.00	15,312,600
やまびこ	27,800	1,212.00	33,693,600
野村マイクロ・サイエンス	3,000	4,525.00	13,575,000
平田機工	6,800	6,800.00	46,240,000
ペガサスミシン製造	14,600	477.00	6,964,200
マルマエ	6,000	1,857.00	11,142,000
タツモ	6,700	1,522.00	10,197,400
ナプテスコ	81,700	3,955.00	323,123,500
三井海洋開発	15,300	1,910.00	29,223,000
レオン自動機	14,100	1,483.00	20,910,300
S M C	42,400	63,400.00	2,688,160,000
ホソカワミクロン	10,100	3,190.00	32,219,000
ユニオンツール	5,300	3,670.00	19,451,000
オイレス工業	20,500	1,676.00	34,358,000
日精エー・エス・ビー機械	4,800	3,800.00	18,240,000
サトーホールディングス	18,800	2,553.00	47,996,400
技研製作所	12,600	4,830.00	60,858,000
日本エアータック	6,400	1,237.00	7,916,800
カワタ	3,800	1,209.00	4,594,200
日精樹脂工業	11,000	1,110.00	12,210,000
オカダアイヨン	4,300	1,318.00	5,667,400
ワイエイシーホールディングス	5,500	869.00	4,779,500
小松製作所	656,800	2,677.50	1,758,582,000
住友重機械工業	83,000	2,923.00	242,609,000
日立建機	67,800	3,215.00	217,977,000
日工	21,600	661.00	14,277,600
巴工業	5,700	2,479.00	14,130,300
井関農機	13,300	1,592.00	21,173,600
T O W A	13,400	2,286.00	30,632,400
丸山製作所	2,600	1,549.00	4,027,400
北川鉄工所	6,400	1,580.00	10,112,000
シンニッタン	17,300	239.00	4,134,700
ローツェ	6,300	7,660.00	48,258,000
タカキタ	5,100	663.00	3,381,300
クボタ	707,000	2,337.00	1,652,259,000
荏原実業	6,600	2,782.00	18,361,200
東洋エンジニアリング	18,800	887.00	16,675,600
三菱化工機	4,500	2,431.00	10,939,500
月島機械	27,000	1,138.00	30,726,000
帝国電機製作所	10,200	1,388.00	14,157,600
東京機械製作所	5,600	2,018.00	11,300,800
新東工業	34,900	758.00	26,454,200
澁谷工業	12,800	3,015.00	38,592,000
アイチコーポレーション	25,000	764.00	19,100,000

小森コーポレーション	37,200	810.00	30,132,000
鶴見製作所	11,300	1,731.00	19,560,300
住友精密工業	2,100	2,353.00	4,941,300
日本ギア工業	6,700	307.00	2,056,900
酒井重工業	2,500	2,595.00	6,487,500
荏原製作所	60,200	5,690.00	342,538,000
石井鐵工所	1,300	2,992.00	3,889,600
西島製作所	14,600	891.00	13,008,600
北越工業	15,100	947.00	14,299,700
ダイキン工業	184,600	24,470.00	4,517,162,000
オルガノ	4,600	6,390.00	29,394,000
トーヨーカネツ	5,400	2,686.00	14,504,400
栗田工業	78,400	5,280.00	413,952,000
椿本チエイン	20,800	3,360.00	69,888,000
大同工業	6,900	1,047.00	7,224,300
日機装	43,500	985.00	42,847,500
木村化工機	11,700	717.00	8,388,900
レイズネクスト	25,300	1,218.00	30,815,400
アネスト岩田	24,600	911.00	22,410,600
ダイフク	79,700	9,940.00	792,218,000
サムコ	3,600	2,714.00	9,770,400
加藤製作所	8,100	860.00	6,966,000
油研工業	1,900	1,749.00	3,323,100
タダノ	69,900	1,151.00	80,454,900
フジテック	49,900	2,535.00	126,496,500
C K D	33,600	2,160.00	72,576,000
キトー	12,200	1,586.00	19,349,200
平和	40,600	2,071.00	84,082,600
理想科学工業	10,600	2,344.00	24,846,400
SANKYO	34,500	2,777.00	95,806,500
日本金銭機械	15,900	739.00	11,750,100
マースグループホールディングス	9,600	1,656.00	15,897,600
フクシマガリレイ	10,000	4,655.00	46,550,000
オーイズミ	6,300	387.00	2,438,100
ダイコク電機	6,600	1,227.00	8,098,200
竹内製作所	24,200	2,697.00	65,267,400
アマノ	38,000	2,663.00	101,194,000
JUKI	20,100	830.00	16,683,000
サンデンホールディングス	20,600	294.00	6,056,400
ジャノメ	13,000	744.00	9,672,000
ブラザー工業	177,100	2,386.00	422,560,600
マックス	19,400	1,820.00	35,308,000
モリタホールディングス	23,600	1,486.00	35,069,600
グローリー	37,300	2,403.00	89,631,900
新晃工業	13,400	2,070.00	27,738,000
大和冷機工業	21,200	1,250.00	26,500,000
セガサミーホールディングス	131,800	1,577.00	207,848,600
日本ピストンリング	5,000	1,384.00	6,920,000
リケン	6,700	2,715.00	18,190,500
T P R	19,600	1,469.00	28,792,400

ツバキ・ナカシマ	31,700	1,478.00	46,852,600
ホシザキ	42,400	9,920.00	420,608,000
大豊工業	11,600	830.00	9,628,000
日本精工	297,800	780.00	232,284,000
NTN	335,200	256.00	85,811,200
ジェイテクト	139,100	1,010.00	140,491,000
不二越	12,300	4,200.00	51,660,000
ミネベアミツミ	249,800	2,760.00	689,448,000
日本トムソン	39,300	544.00	21,379,200
THK	84,200	2,440.00	205,448,000
ユーシン精機	10,000	777.00	7,770,000
前澤給装工業	10,300	1,070.00	11,021,000
イーグル工業	17,900	1,215.00	21,748,500
前澤工業	8,100	781.00	6,326,100
日本ピラー工業	14,500	2,458.00	35,641,000
キッツ	48,800	746.00	36,404,800
日立製作所	696,800	6,588.00	4,590,518,400
東芝	286,800	4,900.00	1,405,320,000
三菱電機	1,449,800	1,526.50	2,213,119,700
富士電機	87,300	4,820.00	420,786,000
東洋電機製造	5,800	1,126.00	6,530,800
安川電機	156,000	5,070.00	790,920,000
シンフォニアテクノロジー	18,700	1,163.00	21,748,100
明電舎	24,500	2,445.00	59,902,500
オリジン	4,200	1,278.00	5,367,600
山洋電気	7,000	6,400.00	44,800,000
デンヨー	12,400	2,043.00	25,333,200
ベイカレント・コンサルティング	9,100	48,900.00	444,990,000
Orchestra Holdings	3,300	4,295.00	14,173,500
アイモバイル	5,000	1,470.00	7,350,000
キャリアインデックス	6,900	930.00	6,417,000
MS-Japan	5,400	1,010.00	5,454,000
船場	1,800	801.00	1,441,800
グレイステクノロジー	13,700	1,087.00	14,891,900
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,700	2,448.00	97,185,600
フルテック	2,100	1,435.00	3,013,500
グリーンズ	4,900	556.00	2,724,400
ツナググループ・ホールディングス	2,700	355.00	958,500
GAMewith	3,900	524.00	2,043,600
ソウルドアウト	3,300	1,561.00	5,151,300
MS&Consulting	2,100	712.00	1,495,200
ウェルビー	5,000	1,530.00	7,650,000
エル・ティー・エス	1,700	3,400.00	5,780,000
ミダックホールディングス	5,900	5,240.00	30,916,000
日総工産	10,600	719.00	7,621,400
キュービーネットホールディングス	6,200	1,878.00	11,643,600
RPAホールディングス	16,200	581.00	9,412,200
三櫻工業	19,800	1,032.00	20,433,600

マキタ	189,100	5,720.00	1,081,652,000	
東芝テック	15,600	4,715.00	73,554,000	
芝浦メカトロニクス	2,500	6,440.00	16,100,000	
マブチモーター	34,000	3,770.00	128,180,000	
日本電産	348,900	11,910.00	4,155,399,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,900	661.00	5,221,900	
トレックス・セミコンダクター	7,800	2,384.00	18,595,200	
東光高岳	7,200	1,460.00	10,512,000	
ダブル・スコープ	41,500	855.00	35,482,500	
宮越ホールディングス	5,200	1,205.00	6,266,000	
ダイヘン	15,800	4,560.00	72,048,000	
ヤーマン	23,500	1,244.00	29,234,000	
JVCケンウッド	124,000	205.00	25,420,000	
ミマキエンジニアリング	12,900	942.00	12,151,800	
I - P E X	6,700	1,980.00	13,266,000	
日新電機	34,100	1,323.00	45,114,300	
大崎電気工業	28,700	555.00	15,928,500	
オムロン	120,600	10,280.00	1,239,768,000	
日東工業	21,300	1,715.00	36,529,500	
I D E C	19,300	2,072.00	39,989,600	
正興電機製作所	4,400	1,384.00	6,089,600	
不二電機工業	2,600	1,287.00	3,346,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	52,000	2,501.00	130,052,000	
サクサホールディングス	3,000	1,429.00	4,287,000	
メルコホールディングス	4,900	4,715.00	23,103,500	
テクノメディカ	3,400	1,618.00	5,501,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,300	2,206.00	9,485,800	
日本電気	184,100	6,070.00	1,117,487,000	
富士通	130,400	19,980.00	2,605,392,000	
沖電気工業	58,900	976.00	57,486,400	
岩崎通信機	7,000	887.00	6,209,000	
電気興業	7,000	2,525.00	17,675,000	
サンケン電気	16,900	5,620.00	94,978,000	
ナカヨ	2,100	1,401.00	2,942,100	
アイホン	8,100	2,353.00	19,059,300	
ルネサスエレクトロニクス	784,300	1,306.00	1,024,295,800	
セイコーエプソン	179,800	2,216.00	398,436,800	
ワコム	104,800	711.00	74,512,800	
アルバック	26,600	6,150.00	163,590,000	
アクセル	6,000	712.00	4,272,000	
E I Z O	12,300	4,320.00	53,136,000	
ジャパンディスプレイ	494,200	35.00	17,297,000	
日本信号	34,000	964.00	32,776,000	
京三製作所	31,000	477.00	14,787,000	
能美防災	19,300	2,057.00	39,700,100	
ホーチキ	10,800	1,208.00	13,046,400	
星和電機	6,600	522.00	3,445,200	
エレコム	33,300	1,790.00	59,607,000	
パナソニック	1,545,800	1,360.00	2,102,288,000	

シャープ	192,800	1,371.00	264,328,800
アンリツ	87,100	1,972.00	171,761,200
富士通ゼネラル	44,200	2,843.00	125,660,600
ソニーグループ	908,000	12,385.00	11,245,580,000
T D K	210,000	3,705.00	778,050,000
帝国通信工業	6,200	1,351.00	8,376,200
タムラ製作所	51,800	729.00	37,762,200
アルプスアルパイン	118,500	1,147.00	135,919,500
池上通信機	4,900	786.00	3,851,400
日本電波工業	13,800	894.00	12,337,200
鈴木	6,300	866.00	5,455,800
メイコー	10,800	2,923.00	31,568,400
日本トリム	3,100	3,515.00	10,896,500
ローランド ディー・ジー	8,500	2,898.00	24,633,000
フォスター電機	14,800	901.00	13,334,800
S M K	3,800	2,264.00	8,603,200
ヨコオ	11,800	2,371.00	27,977,800
ティアック	8,100	123.00	996,300
ホシデン	37,800	947.00	35,796,600
ヒロセ電機	22,400	17,680.00	396,032,000
日本航空電子工業	33,300	1,596.00	53,146,800
T O A	17,300	806.00	13,943,800
マクセル	28,800	1,330.00	38,304,000
古野電気	18,600	1,247.00	23,194,200
ユニデンホールディングス	3,300	3,100.00	10,230,000
スミダコーポレーション	13,500	1,232.00	16,632,000
アイコム	6,100	2,381.00	14,524,100
リオン	6,000	2,463.00	14,778,000
本多通信工業	11,500	455.00	5,232,500
横河電機	145,100	2,052.00	297,745,200
新電元工業	5,500	3,810.00	20,955,000
アズビル	98,000	4,520.00	442,960,000
東亜ディーケーケー	7,300	872.00	6,365,600
日本光電工業	59,900	3,630.00	217,437,000
チノー	4,700	1,433.00	6,735,100
共和電業	14,500	392.00	5,684,000
日本電子材料	5,800	1,763.00	10,225,400
堀場製作所	26,800	7,570.00	202,876,000
アドバンテスト	107,700	9,040.00	973,608,000
小野測器	4,700	522.00	2,453,400
エスベック	12,900	2,296.00	29,618,400
キーエンス	142,300	65,950.00	9,384,685,000
日置電機	7,000	9,140.00	63,980,000
シスメックス	113,100	13,605.00	1,538,725,500
日本マイクロニクス	25,200	1,309.00	32,986,800
メガチップス	14,500	3,460.00	50,170,000
O B A R A G R O U P	7,000	3,635.00	25,445,000
I M A G I C A G R O U P	12,100	530.00	6,413,000
澤藤電機	1,500	2,067.00	3,100,500
デンソー	319,200	7,527.00	2,402,618,400

原田工業	5,500	970.00	5,335,000
コーセル	17,500	923.00	16,152,500
イリソ電子工業	12,200	4,440.00	54,168,000
オブテックスグループ	23,800	1,454.00	34,605,200
千代田インテグレ	6,100	2,130.00	12,993,000
アイ・オー・データ機器	5,300	942.00	4,992,600
レーザーテック	63,600	23,460.00	1,492,056,000
スタンレー電気	101,600	2,763.00	280,720,800
岩崎電気	5,200	2,055.00	10,686,000
ウシオ電機	74,300	2,050.00	152,315,000
岡谷電機産業	9,900	344.00	3,405,600
ヘリオス テクノ ホールディング	14,100	327.00	4,610,700
エノモト	3,800	1,782.00	6,771,600
日本セラミック	13,600	2,968.00	40,364,800
遠藤照明	7,500	1,122.00	8,415,000
古河電池	10,300	1,548.00	15,944,400
双信電機	6,700	774.00	5,185,800
山一電機	9,400	1,593.00	14,974,200
図研	9,400	4,145.00	38,963,000
日本電子	27,400	8,090.00	221,666,000
カシオ計算機	116,600	1,659.00	193,439,400
ファナック	127,200	23,185.00	2,949,132,000
日本シイエムケイ	31,300	422.00	13,208,600
エンプラス	6,600	3,040.00	20,064,000
大真空	4,800	4,070.00	19,536,000
ローム	60,300	9,780.00	589,734,000
浜松ホトニクス	104,000	6,500.00	676,000,000
三井ハイテック	14,200	7,190.00	102,098,000
新光電気工業	48,600	3,585.00	174,231,000
京セラ	221,000	6,690.00	1,478,490,000
協栄産業	1,700	1,383.00	2,351,100
太陽誘電	64,400	6,070.00	390,908,000
村田製作所	425,800	8,669.00	3,691,260,200
双葉電子工業	25,400	759.00	19,278,600
日東電工	87,600	7,710.00	675,396,000
北陸電気工業	5,500	1,031.00	5,670,500
東海理化電機製作所	38,300	1,616.00	61,892,800
ニチコン	45,400	1,024.00	46,489,600
日本ケミコン	14,600	2,014.00	29,404,400
K O A	20,000	1,623.00	32,460,000
三井E & Sホールディングス	55,800	535.00	29,853,000
日立造船	114,500	846.00	96,867,000
三菱重工業	227,800	2,991.50	681,463,700
川崎重工業	113,300	2,513.00	284,722,900
I H I	97,400	2,799.00	272,622,600
名村造船所	42,500	244.00	10,370,000
サノヤスホールディングス	17,200	135.00	2,322,000
スプリックス	3,600	1,146.00	4,125,600
マネジメントソリューションズ	7,100	3,715.00	26,376,500
プロレド・パートナーズ	2,800	1,546.00	4,328,800

and factory	2,500	466.00	1,165,000	
テノ・ホールディングス	4,500	966.00	4,347,000	
フロンティア・マネジメント	3,400	1,050.00	3,570,000	
ピアラ	2,000	763.00	1,526,000	
コプロ・ホールディングス	1,600	1,230.00	1,968,000	
ギークス	2,100	1,440.00	3,024,000	
カーブスホールディングス	37,900	977.00	37,028,300	
フォーラムエンジニアリング	9,600	958.00	9,196,800	
日本車輛製造	5,400	2,084.00	11,253,600	
三菱ロジスネクスト	19,200	1,109.00	21,292,800	
近畿車輛	1,800	1,076.00	1,936,800	
一家ホールディングス	2,800	584.00	1,635,200	
フルサト・マルカホールディングス	13,647	2,037.00	27,798,939	
ヤマエグループホールディングス	10,400	1,108.00	11,523,200	
F P G	47,800	710.00	33,938,000	
島根銀行	4,700	585.00	2,749,500	
じもとホールディングス	10,000	678.00	6,780,000	
全国保証	37,200	5,360.00	199,392,000	
めぶきフィナンシャルグループ	741,700	247.00	183,199,900	
ジャパンインベストメントアドバイザ	11,000	1,324.00	14,564,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,700	1,583.00	28,019,100	
九州フィナンシャルグループ	292,300	410.00	119,843,000	
かんぽ生命保険	177,300	2,023.00	358,677,900	
ゆうちょ銀行	405,800	972.00	394,437,600	
あんしん保証	4,200	316.00	1,327,200	
富山第一銀行	34,500	300.00	10,350,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	870,600	473.00	411,793,800	
ジェイリース	5,600	2,258.00	12,644,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,500	717.00	67,039,500	
イントラスト	3,700	822.00	3,041,400	
日本モーゲージサービス	7,200	1,069.00	7,696,800	
C A S A	3,600	970.00	3,492,000	
アルヒ	21,000	1,327.00	27,867,000	
プレミアグループ	7,200	3,395.00	24,444,000	
日産自動車	1,709,600	564.40	964,898,240	
いすゞ自動車	384,700	1,538.00	591,668,600	
トヨタ自動車	7,341,800	1,987.00	14,588,156,600	
日野自動車	180,900	1,124.00	203,331,600	
三菱自動車工業	536,100	322.00	172,624,200	
エフテック	10,000	627.00	6,270,000	
レシップホールディングス	5,800	576.00	3,340,800	
G M B	4,500	892.00	4,014,000	
ファルテック	2,600	724.00	1,882,400	
武蔵精密工業	32,100	1,967.00	63,140,700	
日産車体	21,500	807.00	17,350,500	
新明和工業	41,100	946.00	38,880,600	
極東開発工業	25,000	1,643.00	41,075,000	

トピー工業	12,000	1,225.00	14,700,000
ティラド	4,400	3,145.00	13,838,000
曙ブレーキ工業	79,000	216.00	17,064,000
タチエス	22,200	1,338.00	29,703,600
N O K	70,100	1,312.00	91,971,200
フタバ産業	36,300	477.00	17,315,100
K Y B	16,100	3,075.00	49,507,500
市光工業	19,600	578.00	11,328,800
大同メタル工業	30,100	602.00	18,120,200
プレス工業	71,200	335.00	23,852,000
ミクニ	18,500	322.00	5,957,000
太平洋工業	30,200	1,160.00	35,032,000
河西工業	19,900	366.00	7,283,400
アイシン	106,100	4,120.00	437,132,000
マツダ	454,600	960.00	436,416,000
今仙電機製作所	12,800	678.00	8,678,400
本田技研工業	1,141,300	3,433.00	3,918,082,900
スズキ	287,300	4,978.00	1,430,179,400
S U B A R U	415,500	2,154.50	895,194,750
安永	7,000	1,202.00	8,414,000
ヤマハ発動機	189,100	3,165.00	598,501,500
小糸製作所	86,900	6,650.00	577,885,000
T B K	17,800	406.00	7,226,800
エクセディ	19,700	1,743.00	34,337,100
ミツバ	26,400	643.00	16,975,200
豊田合成	46,900	2,270.00	106,463,000
愛三工業	22,400	815.00	18,256,000
盟和産業	1,800	1,015.00	1,827,000
日本プラスト	11,900	648.00	7,711,200
ヨロズ	12,500	1,200.00	15,000,000
エフ・シー・シー	23,800	1,618.00	38,508,400
新家工業	3,400	1,707.00	5,803,800
シマノ	58,400	30,670.00	1,791,128,000
テイ・エス テック	67,500	1,480.00	99,900,000
三十三フィナンシャルグループ	12,300	1,444.00	17,761,200
第四北越フィナンシャルグループ	23,300	2,626.00	61,185,800
ひろぎんホールディングス	211,000	654.00	137,994,000
マーキュリアホールディングス	4,800	750.00	3,600,000
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	2,518.00	32,734,000
ダイレクトマーケティングミックス	7,400	4,245.00	31,413,000
ポピンズホールディングス	3,200	3,445.00	11,024,000
L I T A L I C O	11,100	3,155.00	35,020,500
十六フィナンシャルグループ	17,800	2,165.00	38,537,000
北國フィナンシャルホールディングス	13,300	2,096.00	27,876,800
ジャムコ	8,400	1,052.00	8,836,800
小野建	12,800	1,595.00	20,416,000
はるやまホールディングス	7,200	585.00	4,212,000
南陽	2,300	1,968.00	4,526,400
ノジマ	25,400	2,923.00	74,244,200
佐鳥電機	9,200	940.00	8,648,000

カッパ・クリエイト	20,100	1,370.00	27,537,000
エコートレーディング	2,900	638.00	1,850,200
伯東	8,500	1,803.00	15,325,500
コンドーテック	11,500	986.00	11,339,000
中山福	8,000	419.00	3,352,000
ライトオン	10,700	717.00	7,671,900
ナガイレベン	19,000	2,410.00	45,790,000
三菱食品	15,700	2,929.00	45,985,300
良品計画	164,200	2,327.00	382,093,400
三城ホールディングス	16,600	263.00	4,365,800
松田産業	10,300	3,085.00	31,775,500
第一興商	27,100	4,090.00	110,839,000
メディバルホールディングス	143,100	2,117.00	302,942,700
アドヴァングループ	14,900	960.00	14,304,000
S P K	6,100	1,402.00	8,552,200
萩原電気ホールディングス	5,300	2,120.00	11,236,000
アルビス	4,700	2,394.00	11,251,800
アズワン	10,200	15,470.00	157,794,000
スズデン	5,100	1,522.00	7,762,200
尾家産業	3,300	1,097.00	3,620,100
シモジマ	8,800	1,190.00	10,472,000
ドウシシャ	13,600	1,710.00	23,256,000
小津産業	2,600	1,945.00	5,057,000
コナカ	16,300	344.00	5,607,200
高速	7,700	1,632.00	12,566,400
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,660.00	2,158,000
G - 7ホールディングス	14,700	2,109.00	31,002,300
たけびし	5,100	1,523.00	7,767,300
イオン北海道	18,800	1,176.00	22,108,800
コジマ	24,300	632.00	15,357,600
ヒマラヤ	4,700	1,041.00	4,892,700
コーナン商事	20,200	3,675.00	74,235,000
ネットワンシステムズ	58,000	3,625.00	210,250,000
エコス	5,200	1,919.00	9,978,800
ワタミ	18,600	1,041.00	19,362,600
マルシェ	3,900	480.00	1,872,000
リックス	2,500	1,498.00	3,745,000
システムソフト	38,600	152.00	5,867,200
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	285,400	2,486.00	709,504,400
丸文	12,700	741.00	9,410,700
西松屋チェーン	31,100	1,440.00	44,784,000
ゼンショーホールディングス	76,700	2,654.00	203,561,800
ハビネット	11,900	1,500.00	17,850,000
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,504.00	13,686,400
ハークスレイ	6,000	486.00	2,916,000
橋本総業ホールディングス	2,800	2,145.00	6,006,000
日本ライフライン	46,300	1,308.00	60,560,400
サイゼリヤ	21,100	2,800.00	59,080,000
タカショー	10,700	835.00	8,934,500

VTホールディングス	53,300	524.00	27,929,200
アルゴグラフィックス	11,100	3,250.00	36,075,000
魚力	4,400	2,040.00	8,976,000
IDOM	47,800	895.00	42,781,000
日本エム・ディ・エム	8,300	2,168.00	17,994,400
ポブラ	3,700	217.00	802,900
フジ・コーポレーション	7,600	1,210.00	9,196,000
ユナイテッドアローズ	16,200	2,177.00	35,267,400
進和	8,600	2,383.00	20,493,800
エスケイジャパン	7,600	571.00	4,339,600
ダイترون	5,900	2,155.00	12,714,500
ハイデイ日高	20,600	1,695.00	34,917,000
シークス	20,500	1,205.00	24,702,500
YU-WA CREATION HOLDINGS	9,100	252.00	2,293,200
コロワイド	53,600	1,719.00	92,138,400
ピーシーデポコーポレーション	16,600	449.00	7,453,400
田中商事	3,400	667.00	2,267,800
オーハシテクニカ	7,500	1,540.00	11,550,000
壱番屋	10,200	4,590.00	46,818,000
白銅	5,000	3,070.00	15,350,000
トップカルチャー	5,400	341.00	1,841,400
PLANT	3,700	733.00	2,712,100
スギホールディングス	28,400	8,050.00	228,620,000
ダイコー通産	1,200	1,222.00	1,466,400
薬王堂ホールディングス	6,200	2,450.00	15,190,000
島津製作所	186,500	4,700.00	876,550,000
JMS	12,200	792.00	9,662,400
クボテック	3,400	300.00	1,020,000
長野計器	10,400	1,316.00	13,686,400
ブイ・テクノロジー	6,800	4,470.00	30,396,000
スター精密	22,400	1,505.00	33,712,000
東京計器	9,300	1,017.00	9,458,100
愛知時計電機	1,300	4,805.00	6,246,500
インターアクション	7,200	2,530.00	18,216,000
オーバル	12,600	263.00	3,313,800
東京精密	24,500	4,265.00	104,492,500
マニー	57,700	2,010.00	115,977,000
ニコン	221,400	1,243.00	275,200,200
トプコン	73,000	1,870.00	136,510,000
オリンパス	760,100	2,371.00	1,802,197,100
理研計器	12,800	2,969.00	38,003,200
SCREENホールディングス	25,100	9,130.00	229,163,000
キャノン電子	13,600	1,625.00	22,100,000
タムロン	11,200	2,519.00	28,212,800
HOYA	282,800	16,710.00	4,725,588,000
シード	5,800	692.00	4,013,600
ノーリツ鋼機	13,000	2,305.00	29,965,000
エー・アンド・デイ	12,000	1,011.00	12,132,000
朝日インテック	158,900	2,917.00	463,511,300

キヤノン	720,200	2,760.00	1,987,752,000	
リコー	368,500	1,164.00	428,934,000	
シチズン時計	183,500	498.00	91,383,000	
リズム	4,300	1,474.00	6,338,200	
大研医器	11,700	609.00	7,125,300	
メニコン	44,500	3,975.00	176,887,500	
シンシア	1,300	594.00	772,200	
中本パックス	3,400	1,798.00	6,113,200	
スノーピーク	9,400	4,820.00	45,308,000	
パラマウントベッドホールディングス	27,900	2,169.00	60,515,100	
トランザクション	7,800	1,126.00	8,782,800	
粧美堂	5,300	418.00	2,215,400	
ニホンフラッシュ	12,400	1,100.00	13,640,000	
前田工織	15,900	3,175.00	50,482,500	
永大産業	20,000	299.00	5,980,000	
アートネイチャー	14,000	719.00	10,066,000	
バンダイナムコホールディングス	119,800	8,112.00	971,817,600	
アイフィスジャパン	3,600	699.00	2,516,400	
共立印刷	24,400	172.00	4,196,800	
SHOEI	13,500	4,720.00	63,720,000	
フランスベッドホールディングス	19,000	918.00	17,442,000	
マーベラス	22,500	716.00	16,110,000	
パイロットコーポレーション	24,500	4,210.00	103,145,000	
萩原工業	9,400	1,550.00	14,570,000	
エイベックス	24,300	1,528.00	37,130,400	
トッパン・フォームズ	26,000	1,041.00	27,066,000	
フジシールインターナショナル	29,800	2,460.00	73,308,000	
タカラトミー	64,900	1,094.00	71,000,600	
広済堂ホールディングス	9,900	1,110.00	10,989,000	
エステールホールディングス	4,200	654.00	2,746,800	
レック	17,300	1,089.00	18,839,700	
タカノ	5,000	746.00	3,730,000	
三光合成	14,800	460.00	6,808,000	
プロネクサス	11,500	1,067.00	12,270,500	
ホクシン	9,600	172.00	1,651,200	
ウッドワン	4,700	1,105.00	5,193,500	
大建工業	9,700	2,235.00	21,679,500	
きもと	21,100	243.00	5,127,300	
凸版印刷	220,400	1,870.00	412,148,000	
大日本印刷	171,300	2,786.00	477,241,800	
共同印刷	4,400	2,669.00	11,743,600	
N I S S H A	29,600	1,700.00	50,320,000	
光村印刷	800	1,555.00	1,244,000	
藤森工業	13,000	4,760.00	61,880,000	
ヴィア・ホールディングス	18,600	193.00	3,589,800	
TAKARA & COMPANY	7,100	1,783.00	12,659,300	
前澤化成工業	9,100	1,262.00	11,484,200	
未来工業	5,400	1,617.00	8,731,800	
アシックス	128,100	2,520.00	322,812,000	
ツツミ	3,600	2,220.00	7,992,000	

ウェーブロックホールディングス	4,900	681.00	3,336,900	
J S P	8,800	1,595.00	14,036,000	
ニチハ	20,200	3,130.00	63,226,000	
ローランド	10,100	5,350.00	54,035,000	
エフピコ	26,700	3,930.00	104,931,000	
小松ウオール工業	4,500	1,912.00	8,604,000	
ヤマハ	86,300	6,950.00	599,785,000	
河合楽器製作所	4,000	3,460.00	13,840,000	
クリナップ	13,500	552.00	7,452,000	
ビジョン	87,600	2,664.00	233,366,400	
天馬	10,900	2,775.00	30,247,500	
兼松サステック	700	1,799.00	1,259,300	
キングジム	11,900	884.00	10,519,600	
象印マホービン	39,200	1,567.00	61,426,400	
リンテック	31,300	2,470.00	77,311,000	
信越ポリマー	22,700	997.00	22,631,900	
東リ	38,600	240.00	9,264,000	
イトーキ	26,700	380.00	10,146,000	
任天堂	82,900	51,150.00	4,240,335,000	
三菱鉛筆	24,000	1,407.00	33,768,000	
松風	6,700	2,049.00	13,728,300	
タカラスタンダード	30,000	1,549.00	46,470,000	
コクヨ	69,500	1,820.00	126,490,000	
ナカバヤシ	14,800	570.00	8,436,000	
ニフコ	53,200	3,535.00	188,062,000	
立川ブラインド工業	6,400	1,282.00	8,204,800	
グローブライト	14,000	4,020.00	56,280,000	
オカムラ	49,700	1,568.00	77,929,600	
バルカー	11,800	2,130.00	25,134,000	
M U T O Hホールディングス	1,300	1,605.00	2,086,500	
伊藤忠商事	998,600	3,296.00	3,291,385,600	
丸紅	1,407,600	953.20	1,341,724,320	
スクロール	21,200	889.00	18,846,800	
高島	1,800	1,891.00	3,403,800	
ヨンドシーホールディングス	13,100	1,749.00	22,911,900	
三陽商会	7,300	917.00	6,694,100	
長瀬産業	78,600	1,887.00	148,318,200	
ナイガイ	4,300	331.00	1,423,300	
蝶理	9,200	1,833.00	16,863,600	
豊田通商	143,400	4,820.00	691,188,000	
オンワードホールディングス	84,800	327.00	27,729,600	
三共生興	21,900	550.00	12,045,000	
兼松	57,000	1,381.00	78,717,000	
美津濃	14,300	2,610.00	37,323,000	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,394.00	2,648,600	
ルックホールディングス	4,400	1,389.00	6,111,600	
三井物産	1,108,200	2,581.00	2,860,264,200	
日本紙パルプ商事	7,600	3,775.00	28,690,000	
東京エレクトロン	84,900	46,810.00	3,974,169,000	
カメイ	18,600	1,204.00	22,394,400	

東都水産	1,500	5,170.00	7,755,000	
OUGホールディングス	2,300	2,753.00	6,331,900	
スターゼン	10,600	2,131.00	22,588,600	
セイコーホールディングス	20,500	2,285.00	46,842,500	
山善	55,800	1,077.00	60,096,600	
椿本興業	2,200	3,905.00	8,591,000	
住友商事	901,300	1,608.50	1,449,741,050	
日本ユニシス	49,200	2,996.00	147,403,200	
内田洋行	6,000	5,060.00	30,360,000	
三菱商事	869,200	3,619.00	3,145,634,800	
第一実業	6,400	5,040.00	32,256,000	
キャノンマーケティングジャパン	35,500	2,524.00	89,602,000	
西華産業	7,600	1,659.00	12,608,400	
佐藤商事	11,900	1,229.00	14,625,100	
菱洋エレクトロ	10,900	2,322.00	25,309,800	
東京産業	12,200	700.00	8,540,000	
ユアサ商事	14,600	3,050.00	44,530,000	
神鋼商事	3,100	3,425.00	10,617,500	
トルク	6,300	229.00	1,442,700	
阪和興業	28,500	3,265.00	93,052,500	
正栄食品工業	9,300	4,185.00	38,920,500	
カナデン	12,000	1,016.00	12,192,000	
菱電商事	10,400	1,734.00	18,033,600	
ニプロ	108,100	1,151.00	124,423,100	
岩谷産業	34,200	6,930.00	237,006,000	
ナイス	5,600	1,660.00	9,296,000	
ニチモウ	2,100	2,001.00	4,202,100	
極東貿易	4,500	2,458.00	11,061,000	
アステナホールディングス	19,700	625.00	12,312,500	
兼松エレクトロニクス	7,900	3,760.00	29,704,000	
三愛石油	35,100	1,433.00	50,298,300	
稲畑産業	34,300	1,706.00	58,515,800	
G S Iクレオス	6,800	1,010.00	6,868,000	
明和産業	12,900	784.00	10,113,600	
クワザワホールディングス	4,800	673.00	3,230,400	
キムラタン	76,100	23.00	1,750,300	
ゴールドウイン	23,500	6,860.00	161,210,000	
ユニ・チャーム	279,500	4,725.00	1,320,637,500	
デサント	24,200	3,825.00	92,565,000	
キング	7,700	534.00	4,111,800	
ワキタ	28,100	1,040.00	29,224,000	
ヤマトインターナショナル	12,800	325.00	4,160,000	
東邦ホールディングス	45,900	1,817.00	83,400,300	
サンゲツ	38,100	1,561.00	59,474,100	
ミツウロコグループホールディングス	21,000	1,385.00	29,085,000	
シナネンホールディングス	5,200	3,570.00	18,564,000	
伊藤忠エネクス	31,600	1,040.00	32,864,000	
サンリオ	40,100	2,524.00	101,212,400	
サンワテクノス	9,300	1,434.00	13,336,200	
リョーサン	15,800	2,205.00	34,839,000	

新光商事	19,600	855.00	16,758,000
トーホー	6,600	1,631.00	10,764,600
三信電気	7,700	1,642.00	12,643,400
東陽テクニカ	13,800	1,130.00	15,594,000
モスフードサービス	20,200	3,210.00	64,842,000
加賀電子	12,900	2,895.00	37,345,500
三益半導体工業	11,300	2,286.00	25,831,800
都築電気	6,300	1,729.00	10,892,700
ソーダニッカ	13,500	628.00	8,478,000
立花エレテック	11,100	1,498.00	16,627,800
木曽路	18,600	2,240.00	41,664,000
S R S ホールディングス	19,300	776.00	14,976,800
千趣会	25,700	395.00	10,151,500
タカキュー	11,100	132.00	1,465,200
リテールパートナーズ	17,300	1,182.00	20,448,600
ケーヨー	26,300	805.00	21,171,500
上新電機	16,400	2,440.00	40,016,000
日本瓦斯	69,200	1,493.00	103,315,600
ロイヤルホールディングス	24,500	2,142.00	52,479,000
東天紅	700	1,124.00	786,800
いなげや	16,000	1,379.00	22,064,000
チヨダ	14,200	800.00	11,360,000
ライフコーポレーション	13,300	4,020.00	53,466,000
リンガーハット	17,600	2,358.00	41,500,800
MrMaxHD	19,600	652.00	12,779,200
テンアライド	14,100	315.00	4,441,500
AOKIホールディングス	27,400	723.00	19,810,200
オークワ	22,400	1,162.00	26,028,800
コメリ	22,100	2,693.00	59,515,300
青山商事	31,500	835.00	26,302,500
しまむら	16,600	9,560.00	158,696,000
はせがわ	5,800	263.00	1,525,400
高島屋	103,700	1,236.00	128,173,200
松屋	31,000	1,052.00	32,612,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,400	925.00	62,345,000
近鉄百貨店	5,500	2,617.00	14,393,500
丸井グループ	120,600	2,196.00	264,837,600
クレディセゾン	83,300	1,519.00	126,532,700
アクシアル リテイリング	11,900	3,695.00	43,970,500
井筒屋	7,100	315.00	2,236,500
イオン	549,400	2,684.50	1,474,864,300
イズミ	29,000	3,620.00	104,980,000
フォーバル	5,100	1,182.00	6,028,200
平和堂	26,400	2,024.00	53,433,600
フジ	17,200	2,066.00	35,535,200
ヤオコー	16,200	6,610.00	107,082,000
ゼビオホールディングス	17,000	1,076.00	18,292,000
ケーズホールディングス	121,300	1,220.00	147,986,000
PALTAC	22,900	5,160.00	118,164,000
三谷産業	18,700	375.00	7,012,500

Olympicグループ	7,500	761.00	5,707,500
日産東京販売ホールディングス	21,600	244.00	5,270,400
新生銀行	116,400	1,910.00	222,324,000
あおぞら銀行	85,100	2,774.00	236,067,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,779,300	663.80	6,491,499,340
りそなホールディングス	1,591,300	459.50	731,202,350
三井住友トラスト・ホールディングス	270,300	3,909.00	1,056,602,700
三井住友フィナンシャルグループ	989,400	3,949.00	3,907,140,600
千葉銀行	477,100	756.00	360,687,600
群馬銀行	294,000	376.00	110,544,000
武蔵野銀行	21,300	1,858.00	39,575,400
千葉興業銀行	35,800	285.00	10,203,000
筑波銀行	58,600	182.00	10,665,200
七十七銀行	44,900	1,296.00	58,190,400
青森銀行	11,200	2,180.00	24,416,000
秋田銀行	8,700	1,487.00	12,936,900
山形銀行	16,100	850.00	13,685,000
岩手銀行	9,600	1,698.00	16,300,800
東邦銀行	128,800	214.00	27,563,200
東北銀行	6,800	1,015.00	6,902,000
みちのく銀行	9,300	894.00	8,314,200
ふくおかフィナンシャルグループ	129,000	2,147.00	276,963,000
静岡銀行	348,200	952.00	331,486,400
スルガ銀行	124,800	438.00	54,662,400
八十二銀行	322,200	407.00	131,135,400
山梨中央銀行	16,800	864.00	14,515,200
大垣共立銀行	28,400	2,008.00	57,027,200
福井銀行	12,400	1,500.00	18,600,000
清水銀行	6,000	1,632.00	9,792,000
富山銀行	2,100	2,140.00	4,494,000
滋賀銀行	28,800	1,969.00	56,707,200
南都銀行	20,900	2,062.00	43,095,800
百五銀行	129,700	336.00	43,579,200
京都銀行	51,200	5,230.00	267,776,000
紀陽銀行	50,700	1,583.00	80,258,100
ほくほくフィナンシャルグループ	95,300	868.00	82,720,400
山陰合同銀行	90,200	580.00	52,316,000
中国銀行	123,400	870.00	107,358,000
鳥取銀行	4,400	1,113.00	4,897,200
伊予銀行	190,000	585.00	111,150,000
百十四銀行	15,300	1,563.00	23,913,900
四国銀行	20,500	754.00	15,457,000
阿波銀行	22,100	2,213.00	48,907,300
大分銀行	8,300	1,913.00	15,877,900
宮崎銀行	9,000	2,140.00	19,260,000
佐賀銀行	8,100	1,506.00	12,198,600
琉球銀行	31,000	788.00	24,428,000
セブン銀行	477,200	252.00	120,254,400
みずほフィナンシャルグループ	1,942,900	1,590.00	3,089,211,000
高知銀行	4,600	802.00	3,689,200

山口フィナンシャルグループ	178,900	671.00	120,041,900	
芙蓉総合リース	15,000	7,840.00	117,600,000	
みずほリース	22,100	3,630.00	80,223,000	
東京センチュリー	33,300	6,340.00	211,122,000	
SBIホールディングス	176,200	2,800.00	493,360,000	
日本証券金融	60,100	864.00	51,926,400	
アイフル	238,900	389.00	92,932,100	
日本アジア投資	11,300	241.00	2,723,300	
長野銀行	4,600	1,135.00	5,221,000	
名古屋銀行	11,500	2,642.00	30,383,000	
北洋銀行	215,500	254.00	54,737,000	
愛知銀行	4,700	3,695.00	17,366,500	
中京銀行	5,400	1,448.00	7,819,200	
大光銀行	3,900	1,400.00	5,460,000	
愛媛銀行	20,400	807.00	16,462,800	
トマト銀行	5,700	1,057.00	6,024,900	
京葉銀行	61,500	454.00	27,921,000	
栃木銀行	68,300	185.00	12,635,500	
北日本銀行	4,400	1,591.00	7,000,400	
東和銀行	25,200	543.00	13,683,600	
福島銀行	15,600	259.00	4,040,400	
大東銀行	6,600	700.00	4,620,000	
リコーリース	11,300	3,775.00	42,657,500	
イオンフィナンシャルサービス	87,400	1,564.00	136,693,600	
アコム	282,300	413.00	116,589,900	
ジャックス	15,600	3,050.00	47,580,000	
オリエン트コーポレーション	385,500	171.00	65,920,500	
オリックス	867,900	2,162.00	1,876,399,800	
三菱HCキャピタル	494,900	595.00	294,465,500	
ジャフコグループ	18,100	7,140.00	129,234,000	
九州リースサービス	7,300	614.00	4,482,200	
トモニホールディングス	110,600	331.00	36,608,600	
大和証券グループ本社	1,071,000	669.20	716,713,200	
野村ホールディングス	2,182,700	557.00	1,215,763,900	
岡三証券グループ	122,300	400.00	48,920,000	
丸三証券	42,200	632.00	26,670,400	
東洋証券	45,400	172.00	7,808,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	152,200	409.00	62,249,800	
光世証券	3,300	600.00	1,980,000	
水戸証券	37,700	305.00	11,498,500	
いちよし証券	28,200	677.00	19,091,400	
松井証券	70,400	818.00	57,587,200	
SOMPOホールディングス	252,000	5,017.00	1,264,284,000	
日本取引所グループ	386,200	2,806.00	1,083,677,200	
マネックスグループ	127,600	646.00	82,429,600	
極東証券	19,100	813.00	15,528,300	
岩井コスモホールディングス	14,400	1,411.00	20,318,400	
アイザワ証券グループ	25,500	1,019.00	25,984,500	
フィデアホールディングス	13,510	1,244.00	16,806,440	

池田泉州ホールディングス	162,700	170.00	27,659,000	
アニコムホールディングス	40,000	919.00	36,760,000	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	347,300	3,804.00	1,321,129,200	
マネーパートナーズグループ	14,300	217.00	3,103,100	
スパークス・グループ	65,500	282.00	18,471,000	
小林洋行	3,300	267.00	881,100	
第一生命ホールディングス	703,500	2,556.50	1,798,497,750	
東京海上ホールディングス	470,800	6,130.00	2,886,004,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,800	1,074.00	7,303,200	
イー・ギャランティ	16,700	2,431.00	40,597,700	
アサックス	7,900	705.00	5,569,500	
NECキャピタルソリューション	5,800	2,100.00	12,180,000	
T&Dホールディングス	427,000	1,584.00	676,368,000	
アドバンスクリエイト	6,700	1,086.00	7,276,200	
三井不動産	651,500	2,582.50	1,682,498,750	
三菱地所	939,500	1,726.00	1,621,577,000	
平和不動産	24,500	3,635.00	89,057,500	
東京建物	141,000	1,679.00	236,739,000	
ダイビル	36,200	1,550.00	56,110,000	
京阪神ビルディング	24,600	1,400.00	34,440,000	
住友不動産	321,500	4,044.00	1,300,146,000	
太平洋興発	5,700	700.00	3,990,000	
テーオーシー	26,300	657.00	17,279,100	
東京楽天地	2,200	4,015.00	8,833,000	
レオパレス21	118,100	246.00	29,052,600	
スターツコーポレーション	17,000	2,708.00	46,036,000	
フジ住宅	16,700	691.00	11,539,700	
空港施設	14,500	573.00	8,308,500	
明和地所	6,700	615.00	4,120,500	
ゴールドクレスト	12,900	1,671.00	21,555,900	
リログループ	75,700	2,339.00	177,062,300	
エスリード	5,500	1,663.00	9,146,500	
日神グループホールディングス	21,200	515.00	10,918,000	
日本エスコン	26,600	798.00	21,226,800	
タカラレーベン	59,700	319.00	19,044,300	
A V A N T I A	7,400	903.00	6,682,200	
イオンモール	71,800	1,700.00	122,060,000	
毎日コムネット	3,900	791.00	3,084,900	
ファースト住建	5,500	1,312.00	7,216,000	
ランド	764,100	12.00	9,169,200	
カチタス	35,400	3,960.00	140,184,000	
東祥	8,600	1,950.00	16,770,000	
トーセイ	19,700	1,174.00	23,127,800	
穴吹興産	3,100	2,037.00	6,314,700	
サンフロンティア不動産	17,200	1,095.00	18,834,000	
FJネクストホールディングス	14,000	1,028.00	14,392,000	
インテリックス	2,900	754.00	2,186,600	
ランドビジネス	6,100	269.00	1,640,900	
サンネクスタグループ	4,700	1,005.00	4,723,500	

グランディハウス	9,100	491.00	4,468,100	
東武鉄道	151,100	2,884.00	435,772,400	
相鉄ホールディングス	49,800	2,187.00	108,912,600	
東急	365,600	1,617.00	591,175,200	
京浜急行電鉄	186,100	1,307.00	243,232,700	
小田急電鉄	232,200	2,446.00	567,961,200	
京王電鉄	81,000	5,650.00	457,650,000	
京成電鉄	108,600	3,595.00	390,417,000	
富士急行	19,800	4,640.00	91,872,000	
新京成電鉄	3,800	2,065.00	7,847,000	
東日本旅客鉄道	255,100	7,409.00	1,890,035,900	
西日本旅客鉄道	161,700	5,553.00	897,920,100	
東海旅客鉄道	120,500	17,295.00	2,084,047,500	
西武ホールディングス	174,400	1,371.00	239,102,400	
鴻池運輸	23,300	1,246.00	29,031,800	
西日本鉄道	40,300	2,755.00	111,026,500	
ハマキョウレックス	11,300	3,270.00	36,951,000	
サカイ引越センター	6,800	4,730.00	32,164,000	
近鉄グループホールディングス	137,400	3,690.00	507,006,000	
阪急阪神ホールディングス	183,200	3,445.00	631,124,000	
南海電気鉄道	65,100	2,319.00	150,966,900	
京阪ホールディングス	61,200	3,030.00	185,436,000	
神戸電鉄	3,500	3,390.00	11,865,000	
名古屋鉄道	112,900	1,983.00	223,880,700	
山陽電気鉄道	10,000	1,989.00	19,890,000	
アルプス物流	9,700	1,064.00	10,320,800	
トランコム	4,200	8,380.00	35,196,000	
日本通運	47,600	7,600.00	361,760,000	
ヤマトホールディングス	192,400	2,770.00	532,948,000	
山九	35,300	5,150.00	181,795,000	
日新	11,100	1,619.00	17,970,900	
丸運	8,500	271.00	2,303,500	
丸全昭和運輸	11,200	3,425.00	38,360,000	
センコーグループホールディングス	75,900	1,014.00	76,962,600	
トナミホールディングス	2,900	4,715.00	13,673,500	
ニッコンホールディングス	46,400	2,230.00	103,472,000	
日本石油輸送	1,000	2,691.00	2,691,000	
福山通運	17,600	4,775.00	84,040,000	
セイノーホールディングス	103,000	1,361.00	140,183,000	
エスライン	3,300	926.00	3,055,800	
神奈川中央交通	3,700	3,520.00	13,024,000	
日立物流	28,300	4,735.00	134,000,500	
丸和運輸機関	29,000	1,563.00	45,327,000	
C & F ロジホールディングス	13,900	1,641.00	22,809,900	
日本郵船	114,700	7,700.00	883,190,000	
商船三井	81,300	6,920.00	562,596,000	
川崎汽船	42,200	5,270.00	222,394,000	
NSユナイテッド海運	6,300	3,880.00	24,444,000	
明治海運	14,300	788.00	11,268,400	
飯野海運	63,100	552.00	34,831,200	

共栄タンカー	2,500	1,062.00	2,655,000
九州旅客鉄道	105,900	2,669.00	282,647,100
S Gホールディングス	259,400	2,951.00	765,489,400
日本航空	334,200	2,604.00	870,256,800
A N Aホールディングス	370,300	2,820.00	1,044,246,000
パスコ	2,500	1,518.00	3,795,000
T R Eホールディングス	19,792	1,509.00	29,866,128
人・夢・技術グループ	6,200	2,054.00	12,734,800
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,200	3,700.00	11,840,000
シルバーライフ	2,800	1,564.00	4,379,200
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,083.00	2,499,600
Genky Drug Stores	6,200	5,230.00	32,426,000
コア商事ホールディングス	10,600	740.00	7,844,000
国際紙パルプ商事	29,700	372.00	11,048,400
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,080.00	2,808,000
ブックオフグループホールディングス	8,400	982.00	8,248,800
ギフト	3,500	3,000.00	10,500,000
三菱倉庫	47,600	3,215.00	153,034,000
三井倉庫ホールディングス	14,500	2,352.00	34,104,000
住友倉庫	48,600	1,837.00	89,278,200
澁澤倉庫	7,700	2,221.00	17,101,700
ヤマタネ	6,300	1,586.00	9,991,800
東陽倉庫	23,600	333.00	7,858,800
乾汽船	9,300	2,320.00	21,576,000
日本トランスシティ	30,300	596.00	18,058,800
ケイヒン	1,900	1,427.00	2,711,300
中央倉庫	8,900	985.00	8,766,500
川西倉庫	2,600	1,152.00	2,995,200
安田倉庫	12,000	984.00	11,808,000
ファイズホールディングス	2,200	716.00	1,575,200
東洋埠頭	3,300	1,472.00	4,857,600
宇徳	10,100	529.00	5,342,900
上組	75,600	2,325.00	175,770,000
サンリツ	2,600	823.00	2,139,800
キムラユニティー	3,900	1,437.00	5,604,300
キューソー流通システム	3,600	1,835.00	6,606,000
近鉄エクスプレス	25,900	2,738.00	70,914,200
東海運	8,800	342.00	3,009,600
エーアイティー	8,600	1,182.00	10,165,200
内外トランスライン	5,100	2,104.00	10,730,400
ショーエイコーポレーション	2,900	821.00	2,380,900
日本コンセプト	4,300	1,842.00	7,920,600
T B Sホールディングス	94,300	1,747.00	164,742,100
日本テレビホールディングス	118,700	1,280.00	151,936,000
朝日放送グループホールディングス	14,600	728.00	10,628,800
テレビ朝日ホールディングス	43,800	1,801.00	78,883,800
スカパーJ S A Tホールディングス	93,200	444.00	41,380,800
テレビ東京ホールディングス	10,300	2,211.00	22,773,300
日本B S放送	4,800	1,124.00	5,395,200

ビジョン	24,000	1,461.00	35,064,000
スマートバリュー	3,400	660.00	2,244,000
USEN-NEXT HOLDINGS	13,400	3,375.00	45,225,000
ワイヤレスゲート	5,400	399.00	2,154,600
コネクシオ	8,200	1,587.00	13,013,400
日本通信	124,600	208.00	25,916,800
クロップス	2,600	984.00	2,558,400
日本電信電話	1,663,700	3,120.00	5,190,744,000
KDDI	1,140,700	3,682.00	4,200,057,400
ソフトバンク	1,292,500	1,522.00	1,967,185,000
光通信	16,700	18,250.00	304,775,000
エムティーアイ	13,300	756.00	10,054,800
GMOインターネット	50,200	2,890.00	145,078,000
ファイバーゲート	4,400	1,484.00	6,529,600
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	377.00	1,206,400
KADOKAWA	36,800	6,210.00	228,528,000
学研ホールディングス	19,900	1,154.00	22,964,600
ゼンリン	25,800	1,044.00	26,935,200
昭文社ホールディングス	4,800	504.00	2,419,200
インプレスホールディングス	16,700	273.00	4,559,100
東京電力ホールディングス	1,228,500	362.00	444,717,000
中部電力	443,700	1,322.00	586,571,400
関西電力	549,200	1,105.50	607,140,600
中国電力	209,200	1,013.00	211,919,600
北陸電力	132,500	604.00	80,030,000
東北電力	339,500	812.00	275,674,000
四国電力	120,600	779.00	93,947,400
九州電力	320,100	852.00	272,725,200
北海道電力	135,200	538.00	72,737,600
沖縄電力	28,400	1,444.00	41,009,600
電源開発	115,200	1,640.00	188,928,000
エフオン	10,800	875.00	9,450,000
イーレックス	21,200	2,514.00	53,296,800
レノバ	24,700	4,420.00	109,174,000
東京瓦斯	277,900	2,013.00	559,412,700
大阪瓦斯	262,600	2,008.00	527,300,800
東邦瓦斯	71,200	4,325.00	307,940,000
北海道瓦斯	8,000	1,524.00	12,192,000
広島ガス	30,900	368.00	11,371,200
西部ガスホールディングス	16,400	2,384.00	39,097,600
静岡ガス	37,400	1,327.00	49,629,800
メタウォーター	16,400	1,831.00	30,028,400
アイネット	7,000	1,279.00	8,953,000
松竹	9,400	12,620.00	118,628,000
東宝	83,900	5,250.00	440,475,000
エイチ・アイ・エス	30,600	2,736.00	83,721,600
東映	4,600	22,110.00	101,706,000
ラックランド	3,900	2,867.00	11,181,300

エヌ・ティ・ティ・データ	378,300	2,138.00	808,805,400
共立メンテナンス	22,900	4,340.00	99,386,000
イチネンホールディングス	14,500	1,306.00	18,937,000
建設技術研究所	8,200	2,595.00	21,279,000
スペース	10,200	933.00	9,516,600
アインホールディングス	20,800	6,530.00	135,824,000
燦ホールディングス	5,900	1,466.00	8,649,400
ピー・シー・エー	7,600	1,908.00	14,500,800
スバル興業	800	8,140.00	6,512,000
東京テアトル	5,600	1,255.00	7,028,000
タナベ経営	5,000	748.00	3,740,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	1,797.00	11,860,200
ナガワ	4,400	12,600.00	55,440,000
東京都競馬	10,300	4,460.00	45,938,000
常磐興産	5,700	1,444.00	8,230,800
カナモト	24,500	2,591.00	63,479,500
D T S	29,200	2,527.00	73,788,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,700	6,000.00	364,200,000
シーイーシー	14,800	1,294.00	19,151,200
カブコン	121,800	3,020.00	367,836,000
西尾レントオール	12,800	2,855.00	36,544,000
アイ・エス・ビー	9,800	1,227.00	12,024,600
アゴーラ ホスピタリティグループ	79,300	25.00	1,982,500
日本空港ビルデング	49,700	5,630.00	279,811,000
トランス・コスモス	13,100	3,600.00	47,160,000
乃村工藝社	59,300	1,064.00	63,095,200
ジャステック	8,100	1,265.00	10,246,500
S C S K	98,300	2,289.00	225,008,700
藤田観光	5,900	2,566.00	15,139,400
K N T - C Tホールディングス	7,300	1,755.00	12,811,500
日本管財	14,700	2,691.00	39,557,700
トーカイ	13,400	2,198.00	29,453,200
白洋舎	1,100	2,038.00	2,241,800
セコム	136,600	8,113.00	1,108,235,800
日本システムウエア	4,400	2,401.00	10,564,400
セントラル警備保障	6,700	2,865.00	19,195,500
アイネス	13,500	1,572.00	21,222,000
丹青社	25,900	945.00	24,475,500
メイテック	16,700	6,260.00	104,542,000
T K C	23,900	3,345.00	79,945,500
富士ソフト	15,100	5,660.00	85,466,000
応用地質	15,500	1,524.00	23,622,000
船井総研ホールディングス	28,300	2,938.00	83,145,400
N S D	45,300	1,958.00	88,697,400
進学会ホールディングス	7,400	412.00	3,048,800
丸紅建材リース	1,000	1,838.00	1,838,000
オオバ	9,700	829.00	8,041,300
コナミホールディングス	51,600	6,350.00	327,660,000

いであ	3,600	2,004.00	7,214,400
学究社	3,900	1,392.00	5,428,800
ベネッセホールディングス	50,800	2,578.00	130,962,400
イオンディライト	17,000	3,540.00	60,180,000
ナック	7,200	971.00	6,991,200
福井コンピュータホールディングス	7,100	4,145.00	29,429,500
ダイセキ	27,700	5,030.00	139,331,000
ステップ	5,000	1,917.00	9,585,000
日鉄物産	10,300	4,935.00	50,830,500
泉州電業	3,900	4,525.00	17,647,500
元気寿司	3,900	2,837.00	11,064,300
トラスコ中山	29,700	2,770.00	82,269,000
ヤマダホールディングス	478,400	474.00	226,761,600
オートバックスセブン	51,500	1,533.00	78,949,500
モリト	10,400	679.00	7,061,600
アークランドサカモト	22,300	1,768.00	39,426,400
ニトリホールディングス	56,600	21,000.00	1,188,600,000
グルメ杵屋	10,700	1,004.00	10,742,800
愛眼	8,500	220.00	1,870,000
ケーユーホールディングス	7,500	1,100.00	8,250,000
吉野家ホールディングス	46,900	2,162.00	101,397,800
加藤産業	20,800	3,285.00	68,328,000
北恵	3,600	1,039.00	3,740,400
イノテック	8,000	1,332.00	10,656,000
イエローハット	26,800	1,938.00	51,938,400
松屋フーズホールディングス	7,000	3,715.00	26,005,000
JBCホールディングス	9,300	1,584.00	14,731,200
JKホールディングス	13,100	811.00	10,624,100
サガミホールディングス	21,900	1,017.00	22,272,300
日伝	11,900	2,293.00	27,286,700
関西スーパーマーケット	10,600	1,926.00	20,415,600
ミロク情報サービス	13,900	1,690.00	23,491,000
北沢産業	8,100	252.00	2,041,200
杉本商事	7,200	2,552.00	18,374,400
因幡電機産業	38,200	2,682.00	102,452,400
王将フードサービス	9,500	6,080.00	57,760,000
プレナス	16,000	2,132.00	34,112,000
ミニストップ	10,800	1,417.00	15,303,600
アークス	27,300	2,245.00	61,288,500
バローホールディングス	29,200	2,435.00	71,102,000
東テク	4,400	2,566.00	11,290,400
ミスミグループ本社	179,100	4,530.00	811,323,000
藤久	3,300	774.00	2,554,200
アルテック	9,800	320.00	3,136,000
ベルク	7,100	5,670.00	40,257,000
大庄	7,800	1,051.00	8,197,800
タキヒヨー	4,700	1,822.00	8,563,400
ファーストリテイリング	19,000	73,520.00	1,396,880,000
ソフトバンクグループ	1,128,500	6,416.00	7,240,456,000
蔵王産業	2,100	1,740.00	3,654,000

スズケン	60,500	3,270.00	197,835,000	
サンドラッグ	53,700	3,475.00	186,607,500	
サックスパー ホールディングス	12,300	567.00	6,974,100	
ジェコス	10,500	880.00	9,240,000	
ヤマザワ	2,900	1,712.00	4,964,800	
やまや	3,000	2,436.00	7,308,000	
グローセル	16,000	410.00	6,560,000	
ベルーナ	30,500	846.00	25,803,000	
合計	159,151,043		396,733,214,021	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	465,089,128
コール・ローン	491,750,296
国債証券	147,899,584,143
派生商品評価勘定	125,474
未収利息	869,961,217
前払費用	63,912,583
流動資産合計	149,790,422,841
資産合計	149,790,422,841
負債の部	
流動負債	
未払金	1,652,416,779
未払解約金	40,585,000
流動負債合計	1,693,001,779
負債合計	1,693,001,779
純資産の部	
元本等	
元本	72,547,974,858
剰余金	
剰余金又は欠損金()	75,549,446,204
元本等合計	148,097,421,062
純資産合計	148,097,421,062
負債純資産合計	149,790,422,841

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4月13日 至 2021年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,839,896,050円
同期中追加設定元本額	14,568,870,830円
同期中一部解約元本額	9,860,792,022円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,799,440,690円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	6,408,342円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	25,901,908円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	32,976,082円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	58,921,285円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	36,115,379円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	21,168,495円
たわらノーロード 先進国債券	12,176,638,557円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	217,514,235円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,398,637,102円
たわらノーロード バランス（堅実型）	41,276,641円
たわらノーロード バランス（標準型）	193,824,484円
たわらノーロード バランス（積極型）	39,384,841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）	6,193,270円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（安定型）	347,929,224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）	382,559,305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）	87,158,191円
たわらノーロード スマートグローバルバランス（積極型）	2,643,196円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	161,343円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,604,726円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	21,205,028円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,424,732円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,595,508円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,156,702,905円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	559,714,947円

Oneグローバルバランス	898,381円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	672,686,872円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,101,638,499円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,276,002,333円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	396,925,668円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	808,341,212円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	703,241,601円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	13,972,311円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	461,057,609円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	33,315,532円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,346,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	119,050,155円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	200,805,610円
クルーズコントロール	486,828,826円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	146,939,002円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	296,981,281円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,583,767円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,518,705円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	371,517,241円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	174,216,253円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	52,486,558円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,229,933,700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)	720,457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)	122,880円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	102,319,415円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	108,928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)	742,824円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	1,565,229,929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)	727,528,342円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	492,539円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,871,204,906円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	4,200,998,245円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,564,314,563円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,409,232,539円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	54,843,869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)	979,316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)	451,114,831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)	264,560,574円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	21,949,106円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	44,180,159円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,823,899円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,044,597円

D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	24,147,423円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	57,966,165円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,141,449,583円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,676,842,515円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,943,832,244円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	139,592,322円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	179,946,154円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,947,373,489円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	451,151,079円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,674,010円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	377,963,913円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	369,904,200円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	579,448,730円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	62,782,803円
計	72,547,974,858円
2. 受益権の総数	72,547,974,858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4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券	2,955,126,671	
合計	2,955,126,671	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年2月23日から2021年10月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	1,450,000,000	-	1,450,125,474	125,474
イギリス・ポンド	780,294,000	-	780,350,286	56,286
ユーロ	86,247,000	-	86,249,309	2,309
	583,459,000	-	583,525,879	66,879
合計	1,450,000,000	-	1,450,125,474	125,474

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

2. 計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切捨てております。
 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2021年10月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0414円 (20,414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10月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	5,000,000.000	4,969,140.600	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,000,000.000	3,973,593.720	
		US T N/B 0.125 05/15/23	3,000,000.000	2,994,843.750	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,595,937.480	
		US T N/B 0.125 07/31/23	1,540,000.000	1,535,789.050	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,000,000.000	1,994,218.740	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	528,260.930	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,992,890.620	
		US T N/B 0.125 09/30/22	5,030,000.000	5,031,375.350	
		US T N/B 0.125 11/30/22	5,340,000.000	5,340,000.000	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,000,000.000	1,989,453.120	
		US T N/B 0.25 03/15/24	4,810,000.000	4,788,016.760	
		US T N/B 0.25 04/15/23	2,000,000.000	2,000,937.400	
		US T N/B 0.25 05/15/24	5,000,000.000	4,968,750.000	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,470,000.000	4,387,758.970	
		US T N/B 0.25 06/15/23	2,800,000.000	2,799,671.860	
		US T N/B 0.25 06/15/24	300,000.000	297,890.620	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,000,000.000	2,942,109.360	
		US T N/B 0.25 07/31/25	1,000,000.000	979,570.310	
		US T N/B 0.25 08/31/25	1,000,000.000	978,046.870	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,000,000.000	2,930,976.540	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,951,093.740	
		US T N/B 0.375 01/31/26	4,000,000.000	3,906,406.240	
		US T N/B 0.375 04/15/24	5,000,000.000	4,987,890.600	
US T N/B 0.375 04/30/25	2,000,000.000	1,974,687.500			
US T N/B 0.375 07/31/27	3,500,000.000	3,337,851.540			
US T N/B 0.375 08/15/24	3,500,000.000	3,482,363.250			
US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,988,359.360			
US T N/B 0.375 09/30/27	1,050,000.000	998,402.330			

US T N/B 0.375 11/30/25	2,590,000.000	2,535,873.040	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,933,906.250	
US T N/B 0.5 02/28/26	1,200,000.000	1,177,265.610	
US T N/B 0.5 03/15/23	2,000,000.000	2,008,593.600	
US T N/B 0.5 03/31/25	1,300,000.000	1,290,656.250	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,929,062.500	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,444,335.930	
US T N/B 0.5 06/30/27	1,700,000.000	1,635,187.500	
US T N/B 0.5 08/31/27	2,000,000.000	1,918,437.500	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,869,335.930	
US T N/B 0.625 03/31/27	1,800,000.000	1,751,203.110	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,220,000.000	4,841,550.000	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,200,000.000	3,140,249.980	
US T N/B 0.625 08/15/30	7,120,000.000	6,579,603.090	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,000,000.000	1,924,609.360	
US T N/B 0.625 12/31/27	2,430,000.000	2,335,837.500	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,390,000.000	3,279,427.720	
US T N/B 0.75 03/31/26	2,570,000.000	2,546,307.810	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,000,000.000	2,970,000.000	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,967,187.500	
US T N/B 0.75 08/31/26	4,000,000.000	3,946,093.720	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,289,571.070	
US T N/B 0.875 11/15/30	7,000,000.000	6,596,953.070	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,000,000.000	2,929,218.750	
US T N/B 1.125 02/15/31	6,860,000.000	6,595,782.760	
US T N/B 1.125 02/28/25	1,000,000.000	1,015,273.430	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,100,343.750	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,020,000.000	2,989,210.130	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,100,000.000	1,789,101.540	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,500,000.000	2,969,531.250	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,000,000.000	2,951,132.790	
US T N/B 1.25 03/31/28	2,910,000.000	2,897,950.760	
US T N/B 1.25 04/30/28	3,170,000.000	3,155,264.440	
US T N/B 1.25 05/15/50	3,780,000.000	3,035,664.850	
US T N/B 1.25 05/31/28	1,500,000.000	1,491,445.300	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,000,000.000	2,981,015.610	
US T N/B 1.25 08/15/31	4,660,000.000	4,509,824.180	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,440,000.000	2,488,132.800	
US T N/B 1.375 01/31/25	3,280,000.000	3,355,978.110	
US T N/B 1.375 02/15/23	4,000,000.000	4,064,531.240	
US T N/B 1.375 06/30/23	3,460,000.000	3,527,172.640	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,040,000.000	3,345,940.580	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,118,132.800	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,500,000.000	1,531,523.430	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,810,000.000	3,376,314.820	
US T N/B 1.5 01/31/27	2,490,000.000	2,541,064.440	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,970,000.000	3,972,326.130	
US T N/B 1.5 02/28/23	1,000,000.000	1,018,203.120	
US T N/B 1.5 03/31/23	2,000,000.000	2,037,890.620	

US T N/B 1.5 08/15/26	3,090,000.000	3,159,404.270	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,200,000.000	2,259,984.360	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,000,000.000	2,054,609.360	
US T N/B 1.625 02/15/26	4,180,000.000	4,302,787.500	
US T N/B 1.625 04/30/23	3,000,000.000	3,064,570.290	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,090,000.000	3,178,475.380	
US T N/B 1.625 05/15/31	5,780,000.000	5,802,126.520	
US T N/B 1.625 05/31/23	2,900,000.000	2,966,042.940	
US T N/B 1.625 08/15/29	1,380,000.000	1,397,681.250	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,900,000.000	1,954,105.460	
US T N/B 1.625 10/31/23	4,500,000.000	4,618,828.120	
US T N/B 1.625 10/31/26	2,350,000.000	2,416,277.330	
US T N/B 1.625 11/15/22	5,620,000.000	5,710,666.390	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,400,000.000	3,880,421.850	
US T N/B 1.625 11/30/26	3,260,000.000	3,350,541.380	
US T N/B 1.75 01/31/23	4,980,000.000	5,082,128.890	
US T N/B 1.75 05/15/23	2,620,000.000	2,683,248.420	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,384,806.250	
US T N/B 1.75 07/31/24	3,690,000.000	3,815,834.750	
US T N/B 1.75 08/15/41	1,740,000.000	1,640,153.890	
US T N/B 1.75 09/30/22	5,250,000.000	5,333,979.470	
US T N/B 1.75 11/15/29	1,940,000.000	1,981,831.250	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,600,000.000	1,656,750.000	
US T N/B 1.75 12/31/26	1,740,000.000	1,799,132.800	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,110,000.000	3,965,828.870	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,420,000.000	4,140,987.500	
US T N/B 1.875 06/30/26	450,000.000	468,123.040	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,370,000.000	2,466,373.820	
US T N/B 1.875 08/31/24	3,120,000.000	3,237,975.000	
US T N/B 2.0 02/15/23	4,370,000.000	4,477,030.820	
US T N/B 2.0 02/15/25	4,300,000.000	4,489,468.750	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,270,000.000	3,156,955.040	
US T N/B 2.0 05/31/24	4,770,000.000	4,958,377.690	
US T N/B 2.0 08/15/25	5,180,000.000	5,413,504.660	
US T N/B 2.0 08/15/51	2,800,000.000	2,701,453.100	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	4,332,930.450	
US T N/B 2.0 11/30/22	6,590,000.000	6,731,324.590	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,300,000.000	1,352,710.930	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,080,000.000	4,247,343.720	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,320,000.000	3,480,942.170	
US T N/B 2.125 05/31/26	2,050,000.000	2,156,183.580	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,930,000.000	3,063,452.320	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	2,075,468.740	
US T N/B 2.125 12/31/22	5,520,000.000	5,652,393.720	
US T N/B 2.25 01/31/24	350,000.000	364,820.310	
US T N/B 2.25 02/15/27	3,550,000.000	3,758,146.470	
US T N/B 2.25 03/31/26	3,090,000.000	3,265,260.930	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,449,015.620	
US T N/B 2.25 05/15/41	4,390,000.000	4,502,836.690	

US T N/B 2.25 08/15/27	2,690,000.000	2,849,823.820	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,710,000.000	1,737,587.100	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,400,000.000	3,465,210.900	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,000,000.000	2,100,234.360	
US T N/B 2.25 11/15/24	4,690,000.000	4,927,064.810	
US T N/B 2.25 11/15/25	4,690,000.000	4,949,415.620	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,463,900.760	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	3,153,984.360	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,870,137.490	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,200,000.000	5,543,281.220	
US T N/B 2.375 05/15/29	2,810,000.000	3,001,870.310	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,100,000.000	5,348,824.190	
US T N/B 2.375 08/15/24	3,920,000.000	4,123,503.110	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,770,000.000	2,897,896.070	
US T N/B 2.5 01/31/24	3,890,000.000	4,076,750.380	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,080,000.000	2,213,574.990	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,970,000.000	2,098,896.460	
US T N/B 2.5 02/28/26	2,550,000.000	2,721,726.560	
US T N/B 2.5 03/31/23	3,020,000.000	3,121,217.170	
US T N/B 2.5 05/15/24	4,240,000.000	4,460,612.500	
US T N/B 2.5 05/15/46	1,810,000.000	1,928,074.080	
US T N/B 2.5 08/15/23	4,330,000.000	4,505,906.250	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,180,000.000	2,337,368.750	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,110,000.000	4,459,671.060	
US T N/B 2.625 02/28/23	1,800,000.000	1,860,679.670	
US T N/B 2.625 03/31/25	2,150,000.000	2,292,269.520	
US T N/B 2.625 06/30/23	1,820,000.000	1,893,653.120	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,060,000.000	3,212,282.790	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,454,057.010	
US T N/B 2.75 02/15/24	5,320,000.000	5,610,729.640	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,370,000.000	4,763,641.360	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,660,000.000	1,775,486.710	
US T N/B 2.75 04/30/23	2,490,000.000	2,587,071.080	
US T N/B 2.75 05/31/23	3,270,000.000	3,403,610.130	
US T N/B 2.75 06/30/25	790,000.000	847,120.690	
US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,414,595.310	
US T N/B 2.75 08/15/42	430,000.000	477,199.210	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,880,000.000	2,100,679.670	
US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,269,430.070	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,640,000.000	1,761,270.300	
US T N/B 2.75 11/15/23	5,520,000.000	5,797,940.610	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,220,000.000	1,353,151.540	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,140,000.000	2,392,369.500	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,430,000.000	4,868,327.710	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,400,000.000	2,716,781.230	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,090,000.000	3,557,845.300	
US T N/B 2.875 05/31/25	2,530,000.000	2,722,220.690	
US T N/B 2.875 07/31/25	1,860,000.000	2,004,367.950	
US T N/B 2.875 08/15/28	2,730,000.000	3,002,466.770	

US T N/B 2.875 08/15/45	1,890,000.000	2,147,438.650	
US T N/B 2.875 09/30/23	840,000.000	882,000.000	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,690,000.000	3,881,707.010	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,440,000.000	1,641,937.480	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,640,000.000	1,913,034.360	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,540,000.000	2,972,296.070	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,070,000.000	3,612,526.550	
US T N/B 3.0 05/15/42	980,000.000	1,131,210.930	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,300,000.000	1,507,746.080	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,290,000.000	1,506,730.070	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,710,000.000	3,178,745.290	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,410,000.000	1,529,299.200	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,920,000.000	2,084,474.990	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,790,000.000	2,072,554.280	
US T N/B 3.0 11/15/45	650,000.000	754,812.500	
US T N/B 3.125 02/15/42	680,000.000	800,593.750	
US T N/B 3.125 02/15/43	1,440,000.000	1,692,675.000	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,760,000.000	3,306,285.900	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,750,000.000	2,064,658.190	
US T N/B 3.125 11/15/28	6,170,000.000	6,900,518.310	
US T N/B 3.125 11/15/41	760,000.000	893,237.500	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,530,000.000	1,874,967.180	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,660,000.000	3,336,014.030	
US T N/B 3.5 02/15/39	900,000.000	1,108,476.550	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	2,069,399.600	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,170,000.000	1,481,512.500	
US T N/B 3.75 08/15/41	710,000.000	908,633.580	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,755,515.620	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,110,000.000	1,437,103.120	
US T N/B 4.25 05/15/39	810,000.000	1,090,399.200	
US T N/B 4.25 11/15/40	510,000.000	692,125.770	
US T N/B 4.375 02/15/38	550,000.000	743,660.150	
US T N/B 4.375 05/15/40	1,200,000.000	1,649,343.740	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,040,000.000	1,438,612.500	
US T N/B 4.375 11/15/39	910,000.000	1,245,775.760	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,030,000.000	1,392,914.050	
US T N/B 4.5 05/15/38	540,000.000	741,213.270	
US T N/B 4.5 08/15/39	790,000.000	1,096,310.150	
US T N/B 4.625 02/15/40	750,000.000	1,059,199.200	
US T N/B 4.75 02/15/41	1,200,000.000	1,731,937.500	
US T N/B 5.0 05/15/37	500,000.000	716,015.620	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	1,074,718.750	
US T N/B 5.375 02/15/31	700,000.000	935,757.800	
US T N/B 5.5 08/15/28	650,000.000	827,429.680	
US T N/B 6.0 02/15/26	840,000.000	1,021,978.120	
US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,159,804.680	
US T N/B 6.25 05/15/30	710,000.000	984,071.090	
US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,110,039.060	
アメリカ・ドル 小計	595,600,000.000	615,401,991.850	

		(66,885,880,000)	(69,109,643,683)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	900,000.000	878,490.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,495,104.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,783,350.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	954,930.000	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	800,000.000	734,376.240	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,200,000.000	1,176,960.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,020,000.000	957,673.920	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	770,000.000	559,060.960	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	750,000.000	750,757.500	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,100,000.000	996,737.280	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	860,000.000	683,734.050	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,569,282.000	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	450,000.000	390,519.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	901,673.500	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,470,000.000	1,487,995.740	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	290,000.000	275,059.920	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	718,344.200	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	390,000.000	365,157.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,340,000.000	1,287,291.620	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	934,516.440	
	UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,030,000.000	1,027,188.100	
	UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	977,234.700	
	UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,070,000.000	1,108,830.300	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	557,170.000		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	537,856.200		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,210,000.000	1,312,729.000		

	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,507,580.340	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	832,178.100	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,220,763.100	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,337,406.000	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	510,568.320	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,742,695.620	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,781,413.880	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,664,962.560	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	740,000.000	1,152,276.200	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	770,000.000	1,357,779.500	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,140,000.000	1,573,359.600	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,010,000.000	1,319,686.200	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,020,000.000	1,474,248.840	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	940,633.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,407,772.800	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,666,341.200	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,387,795.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,783,123.200	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	860,000.000	1,187,832.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,180,000.000	1,827,348.000	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,149,296.100	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,330,199.200	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,619,139.370	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,028,336.840	
	イギリス・ボンド 小計	48,690,000.000 (7,457,847,300)	57,224,756.840 (8,765,116,005)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,350,000.000	1,325,629.800	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,013,368.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	936,823.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,127,147.680	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,781,255.150	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,257,324.000	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,824,837.600	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,390,000.000	1,740,469.040	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,320,000.000	2,460,624.480	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,328,804.000	
イスラエル・シュケル 小計		16,960,000.000 (588,936,000)	18,796,282.750 (652,700,918)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,430,300.590	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,421,142.360	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	210,000.000	205,728.180	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,505,467.070	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,560,000.000	1,485,458.940	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	990,000.000	949,565.370	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,626,298.180	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	930,000.000	775,992.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	900,000.000	904,422.870	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	980,000.000	1,044,337.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,219,914.850	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,112,441.210	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	790,616.660	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	584,898.030	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,785,991.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,276,873.240	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,714,908.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	960,342.880	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	190,000.000	207,568.590	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,640,000.000	1,866,211.100	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	714,461.400		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	932,580.110		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,315,913.750		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	880,000.000	1,139,065.840		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,120,000.000	2,295,110.720		
オーストラリア・ドル 小計		30,440,000.000 (2,501,863,600)	32,265,609.940 (2,651,910,481)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	500,000.000	498,587.500	
	CANADA 0.25 03/01/26	1,300,000.000	1,250,939.300	
	CANADA 0.25 04/01/24	2,000,000.000	1,975,236.000	
	CANADA 0.25 05/01/23	1,000,000.000	995,817.000	
	CANADA 0.25 08/01/23	700,000.000	695,595.600	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,550,000.000	1,518,070.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	617,691.120	

	CANADA 0.5 12/01/30	1,100,000.000	999,639.300	
	CANADA 1.0 06/01/27	700,000.000	690,408.600	
	CANADA 1.0 09/01/26	600,000.000	594,194.400	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	707,345.800	
	CANADA 1.25 06/01/30	1,810,000.000	1,770,764.630	
	CANADA 1.5 06/01/23	1,210,000.000	1,229,270.460	
	CANADA 1.5 06/01/26	800,000.000	813,092.000	
	CANADA 1.5 06/01/31	1,300,000.000	1,285,694.800	
	CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	448,239.880	
	CANADA 1.75 03/01/23	2,460,000.000	2,502,863.040	
	CANADA 1.75 12/01/53	410,000.000	374,452.590	
	CANADA 2.0 06/01/28	720,000.000	749,708.640	
	CANADA 2.0 09/01/23	420,000.000	430,699.920	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,430,000.000	2,385,307.440	
	CANADA 2.25 03/01/24	530,000.000	549,230.520	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,000,000.000	1,045,536.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	610,000.000	646,647.580	
	CANADA 2.5 06/01/24	1,550,000.000	1,619,841.450	
	CANADA 2.75 12/01/48	850,000.000	971,500.700	
	CANADA 2.75 12/01/64	350,000.000	404,642.350	
	CANADA 3.5 12/01/45	780,000.000	997,216.740	
	CANADA 4.0 06/01/41	540,000.000	719,398.260	
	CANADA 5.0 06/01/37	390,000.000	556,226.190	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,000,000.000	1,311,333.000	
	CANADA 5.75 06/01/33	520,000.000	738,446.280	
	カナダ・ドル 小計	30,890,000.000 (2,782,571,200)	32,093,637.090 (2,890,994,829)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	200,000.000	196,580.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	200,000.000	199,105.040	
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	203,460.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	440,000.000	419,540.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	200,000.000	206,568.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	420,000.000	441,170.100	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	495,780.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	358,972.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	188,820.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	380,000.000	408,500.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	469,812.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	423,958.400	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	727,580.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	514,885.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	407,000.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	586,080.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	555,360.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	815,775.000		
	シンガポール・ドル 小計	7,140,000.000 (592,762,800)	7,618,945.540 (632,524,859)	

スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,500,000.000	2,436,670.770	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,599,306.470	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,290,555.100	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,463,137.500	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	4,700,000.000	4,878,232.930	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,700,000.000	3,207,843.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,980,000.000	8,744,193.520	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,779,123.960	
スウェーデン・クローナ 小計		30,110,000.000 (386,913,500)	33,399,063.250 (429,177,963)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	1,700,000.000	1,680,170.900	
	DENMARK 0.25 11/15/22	3,510,000.000	3,540,888.000	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,320,000.000	2,154,584.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	7,130,000.000	7,453,951.550	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,370,000.000	4,573,991.600	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,500,000.000	3,657,146.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,803,597.570	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,680,000.000	13,344,614.400	
デンマーク・クローネ 小計		35,530,000.000 (620,709,100)	42,208,944.520 (737,390,261)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,800,000.000	1,730,160.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,648,816.550	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,779,041.960	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,200,000.000	1,214,964.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,852,706.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,850,000.000	1,865,947.000	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,127,028.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,833,045.840	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,470,630.000	
ノルウェー・クローネ 小計		26,220,000.000 (344,793,000)	26,522,339.850 (348,768,769)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,400,000.000	1,288,560.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	180,000.000	174,645.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,050,000.000	3,702,745.480	
	POLAND 2.25 10/25/24	1,000,000.000	1,020,899.100	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,906,438.550	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,350,685.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,180,000.000	2,246,710.390	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,250,000.000	2,308,912.420	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,510,000.000	3,653,383.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	217,875.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,509,709.760	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,240,000.000	4,468,832.800	
POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,803,024.000		
ポーランド・ズロチ 小計		27,980,000.000	28,652,421.000	

		(789,788,662)	(808,769,022)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,246,795.100	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,028,050.800	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,700,000.000	1,641,302.920	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,193,820.840	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	822,132.000	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,821,258.350	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,539,461.530	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,254,257.100	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,915,958.160	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,273,464.600	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,871,091.860	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,196,557.000	
マレーシア・リングgit 小計		22,730,000.000 (612,780,343)	23,804,150.260 (641,738,467)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	8,000,000.000	8,082,160.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	8,085,000.000	9,735,678.870	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	24,685,876.920	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	19,143,000.000	18,189,546.120	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,299,614.410	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	12,000,000.000	12,208,080.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	13,458,799.990	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,082,390.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,000,000.000	20,685,800.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,654,000.000	11,741,399.170	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,438,929.400	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	18,214,414.200	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	11,818,437.930	
	メキシコ・ペソ 小計		182,426,000.000 (989,095,529)	188,641,127.010 (1,022,793,327)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	690,000.000	691,792.620	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	830,000.000	825,252.670	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,222.600	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	220,000.000	198,748.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	140,000.000	136,171.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	820,000.000	859,618.780	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	650,000.000	682,319.950	

AUSTRIA 0.75 02/20/28	675,000.000	719,971.200	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	390,000.000	395,980.650	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	721,264.300	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	250,000.000	216,490.500	
AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	658,300.500	
AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	814,900.000	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	686,435.200	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	530,000.000	640,302.540	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	187,125.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	700,000.000	749,575.400	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	780,000.000	819,762.840	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	549,451.350	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	680,000.000	864,435.040	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	738,177.810	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	774,056.280	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	428,146.910	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,404,776.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	740,000.000	920,010.180	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	929,638.400	
BELGIUM 0.0 10/22/27	610,000.000	621,757.750	
BELGIUM 0.0 10/22/31	570,000.000	560,923.770	
BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	807,440.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	672,243.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	430,000.000	409,907.470	
BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	548,542.470	
BELGIUM 0.65 06/22/71	330,000.000	270,252.970	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,198,820.580	
BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	896,330.400	
BELGIUM 0.8 06/22/28	930,000.000	995,611.500	
BELGIUM 0.9 06/22/29	680,000.000	733,801.310	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,460,000.000	1,561,545.330	
BELGIUM 1.0 06/22/31	930,000.000	1,012,667.700	
BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	794,002.940	
BELGIUM 1.45 06/22/37	340,000.000	388,364.660	
BELGIUM 1.6 06/22/47	570,000.000	665,916.180	
BELGIUM 1.7 06/22/50	670,000.000	800,773.950	
BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	668,500.800	
BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	577,668.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	872,021.240	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	481,121.200	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,220,000.000	1,328,633.680	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	787,231.100	
BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	1,215,989.230	
BELGIUM 4.0 03/28/32	730,000.000	1,024,587.120	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,110,000.000	1,841,023.800	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	528,070.530	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,760,450.050	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,340,000.000	1,852,090.380	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,430,000.000	1,467,980.800	

BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,278,962.500	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	600,000.000	616,194.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,400,000.000	1,435,294.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	670,000.000	688,391.500	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,567,741.090	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,041,412.500	
BUNDESOBL 10/07/22	1,000,000.000	1,007,122.000	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,299,379.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,153,847.280	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,730,492.400	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,660,000.000	1,690,610.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,700,000.000	1,689,868.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	700,000.000	689,934.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,043,420.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	513,510.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	507,540.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,720,000.000	1,566,180.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	400,000.000	368,436.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	600,000.000	538,308.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,233,060.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	500,000.000	513,061.650	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,041,712.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,890,000.000	1,976,587.510	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,504,958.400	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,060,000.000	2,142,441.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,897,730.700	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,140,000.000	3,329,907.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,645,332.500	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,726,367.310	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,650,588.900	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,405,911.250	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,883,138.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,020,000.000	2,524,648.290	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,462,972.320	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,709,172.300	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,410,000.000	1,492,139.550	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,750,000.000	2,912,758.750	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,080,581.490	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,674,478.400	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,890,000.000	2,932,334.790	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,801,470.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,730,000.000	2,782,964.500	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	1,982,083.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,100,000.000	1,491,061.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,306,690.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,140,000.000	2,130,181.200	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,913,989.600	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,610,393.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	972,216.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,102,977.900	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	999,978.200	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	183,402.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	170,418.370	
FINLAND 0.125 04/15/36	240,000.000	232,873.440	
FINLAND 0.125 04/15/52	210,000.000	181,598.130	
FINLAND 0.125 09/15/31	140,000.000	140,841.400	
FINLAND 0.25 09/15/40	300,000.000	289,019.400	
FINLAND 0.5 04/15/26	580,000.000	606,813.400	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	525,648.890	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	252,331.920	
FINLAND 0.5 09/15/29	370,000.000	388,443.390	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	267,857.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	390,000.000	412,245.210	
FINLAND 09/15/23	260,000.000	263,586.960	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	322,834.670	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	338,070.880	
FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	485,909.500	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	299,198.760	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	502,146.050	
FINLAND 2.75 07/04/28	420,000.000	507,239.040	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	505,090.040	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,176,410.270	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,110,340.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	500,000.000	507,482.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,300,000.000	2,346,190.900	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	900,000.000	915,678.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,550,000.000	2,555,015.850	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,700,000.000	2,678,716.770	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,930,000.000	1,893,889.700	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,550,000.000	2,633,879.700	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,090,000.000	3,208,748.700	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,570,000.000	2,683,154.530	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,620,000.000	2,737,208.320	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,100,000.000	1,070,557.400	

FRANCE OAT 0.5 05/25/72	600,000.000	456,963.360	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	740,000.000	702,340.660	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,170,000.000	3,373,653.480	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,930,000.000	1,823,782.450	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	250,000.000	233,939.870	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,240,000.000	3,449,997.360	
FRANCE OAT 03/25/23	2,200,000.000	2,222,563.200	
FRANCE OAT 03/25/24	2,520,000.000	2,559,528.200	
FRANCE OAT 03/25/25	2,970,000.000	3,027,528.900	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,350,000.000	2,527,072.500	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,358,929.820	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,540,000.000	2,819,389.840	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,434,842.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,500,617.740	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,000,000.000	2,301,964.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,254,198.400	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	1,019,066.480	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,990,000.000	2,395,203.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,980,000.000	3,200,758.400	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,156,247.340	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,130,804.720	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,092,331.960	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,240,000.000	3,941,055.000	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,450,000.000	4,093,435.350	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,471,533.440	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,331,830.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,360,000.000	2,544,696.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,129,602.970	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,386,265.480	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,130,000.000	3,447,407.040	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,310,000.000	3,960,536.580	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,050,000.000	3,247,700.200	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,624,290.440	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,380,021.400	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,280,708.000	
IRISH 0.0 10/18/31	360,000.000	352,721.880	
IRISH 0.2 05/15/27	530,000.000	545,800.360	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	454,072.050	
IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	388,240.550	
IRISH 0.55 04/22/41	280,000.000	273,034.720	
IRISH 0.9 05/15/28	680,000.000	730,458.720	
IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	683,247.360	
IRISH 1.1 05/15/29	520,000.000	566,393.880	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	379,233.620	
IRISH 1.35 03/18/31	270,000.000	301,794.930	
IRISH 1.5 05/15/50	420,000.000	481,299.000	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	459,498.970	
IRISH 10/18/22	20,000.000	20,132.000	
IRISH 2.0 02/18/45	570,000.000	724,125.720	

IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	760,685.310	
IRISH 3.4 03/18/24	640,000.000	703,862.010	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	607,747.110	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	964,900.800	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,007,900.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	986,733.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,000,000.000	1,007,100.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	400,000.000	397,960.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	580,000.000	574,200.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,013,590.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,098,254.160	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,428,172.200	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	501,500.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	509,100.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,210,000.000	1,180,106.750	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,001,130.760	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,300,000.000	1,343,810.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,200,000.000	2,214,647.600	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	938,115.620	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	900,000.000	852,930.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,091,614.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,190,124.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,200,000.000	1,244,760.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	600,000.000	601,882.800	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,425,127.500	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,591,808.780	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,045,500.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,415,655.060	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,092,972.400	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	530,000.000	515,001.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	790,000.000	836,294.790	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,177,440.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,840,000.000	1,971,652.000	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,592,867.760	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	700,000.000	679,155.400	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,265,608.920	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	623,640.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	855,036.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	964,350.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,620,000.000	1,784,912.760	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,051,324.800	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,040,000.000	1,145,612.000	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,580,000.000	1,730,367.020	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	500,000.000	488,450.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,120,000.000	1,242,976.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,153,008.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,140,000.000	1,312,998.420	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	1,106,673.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	983,014.270	

ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,379,715.120	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,269,052.430	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,220,000.000	1,459,120.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	691,775.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.000	1,161,849.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,155,354.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,575,157.570	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	790,000.000	992,820.650	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,296,068.400	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,010,000.000	1,277,384.370	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,382,913.960	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,897,434.000	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,410,000.000	1,572,708.210	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,074,605.800	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,270,216.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,665,906.380	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,950,295.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,509,130.000	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,079,455.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,890,000.000	2,438,517.690	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,541,945.950	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,103,561.460	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,347,058.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,068,948.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,490,000.000	2,347,942.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,650,000.000	3,626,260.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,084,107.780	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,928,704.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,470,000.000	2,179,128.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,450,868.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,468,584.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,420,027.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	940,962.200	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	400,000.000	382,780.400	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	510,000.000	449,141.190	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	959,343.250	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	540,000.000	541,563.840	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,420,000.000	1,465,954.180	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	817,771.660	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	630,000.000	658,400.010	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,250,000.000	1,311,125.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	820,000.000	875,268.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	980,000.000	1,051,135.260	
NETHERLANDS 01/15/24	1,930,000.000	1,960,993.870	

NETHERLANDS 1.75 07/15/23	450,000.000	469,895.850	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	880,000.000	945,929.600	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	980,000.000	1,252,249.880	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,110,000.000	1,764,452.670	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	350,000.000	369,965.400	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,280,000.000	2,159,098.880	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,160,000.000	1,827,812.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,165,666.200	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,421,000.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	800,000.000	810,544.800	
SPAIN 0.0 01/31/28	580,000.000	580,319.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	999,385.200	
SPAIN 0.0 05/31/24	860,000.000	870,765.480	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,190,000.000	1,154,883.100	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,240,000.000	1,265,842.840	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,620,000.000	1,647,105.840	
SPAIN 0.45 10/31/22	840,000.000	849,409.250	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,850,000.000	1,887,111.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	800,000.000	801,166.240	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,218,562.400	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,263,120.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	591,681.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,170,000.000	1,068,728.310	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,280,000.000	1,307,252.480	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,370,000.000	1,484,121.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,850,000.000	1,995,361.900	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,440,000.000	1,571,747.040	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,653,223.500	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,286,511.280	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,500,000.000	1,639,305.000	
SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	264,819.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,240,000.000	1,355,258.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,556,045.020	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,490,000.000	1,700,081.060	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,400,583.940	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,671,580.280	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,522,649.220	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,481,800.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,138,567.760	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,693,755.140	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,608,321.120	
SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,405,116.920	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,670,000.000	1,854,732.060	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,350,000.000	2,011,217.850	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,223,869.350	

	SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,636,333.060	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,390,000.000	2,304,814.600	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,269,742.580	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,962,090.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,540,000.000	2,096,710.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,653,301.650	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,573,992.420	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,897,699.980	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,670,000.000	2,168,798.940	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,265,731.060	
	ユーロ 小計	393,515,000.000 (51,156,950,000)	455,446,581.220 (59,208,055,559)	
国債証券 合計		135,710,891,034.400 (135,710,891,034)	147,899,584,143 (147,899,584,143)	
合計			147,899,584,143 (147,899,584,143)	

(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 224銘柄	46.66	46.73
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	5.92	5.93
イスラエル・シケル	国債証券 10銘柄	0.44	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券 25銘柄	1.79	1.79
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	1.95	1.95
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.43	0.43
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	0.50	0.50
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 13銘柄	0.55	0.55
マレーシア・リンギット	国債証券 12銘柄	0.43	0.43
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.69	0.69
ユーロ	国債証券 337銘柄	39.98	40.03

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,602,024,836
コール・ローン	326,759,171
株式	579,243,944,914
投資信託受益証券	1,045,766,868
投資証券	12,141,400,302
派生商品評価勘定	19,839,447
未収入金	30,177,410
未収配当金	476,765,749
差入委託証拠金	4,201,579,053
流動資産合計	605,088,257,750
資産合計	
605,088,257,750	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	122,657,718
未払解約金	3,951,081,000
流動負債合計	4,073,738,718
負債合計	
4,073,738,718	
純資産の部	
元本等	
元本	108,278,476,055
剰余金	
剰余金又は欠損金()	492,736,042,977
元本等合計	601,014,519,032
純資産合計	601,014,519,032
負債純資産合計	605,088,257,750

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4月13日 至 2021年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	98,331,117,304円
同期中追加設定元本額	42,427,333,060円
同期中一部解約元本額	32,479,974,309円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,911,955,936円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,409,456円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,653,128円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	18,043,340円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,082,279円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,632,984円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,620,599円
たわらノーロード 先進国株式	25,787,643,164円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	352,386,022円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,652,850,864円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	525,147,861円
たわらノーロード バランス(堅実型)	61,502,697円
たわらノーロード バランス(標準型)	487,926,356円
たわらノーロード バランス(積極型)	591,319,711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)	854,350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)	133,118,427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)	395,466,082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)	286,443,962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)	444,166,455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)	754,604円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	11,864,578円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,015,072円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,714,037円
たわらノーロード 全世界株式	142,580,511円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	49,000,178,109円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,453,063,264円
Oneグローバルバランス	468,956円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	155,395,559円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	787,980,968円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,015,365,528円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	98,109,225円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	290,728,148円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	261,815,592円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	20,636,202円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	677,580,152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)	180,149,751円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	171,757,741円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	301,431,412円
投資のソムリエ	4,785,343,163円
クルーズコントロール	60,892,273円
投資のソムリエ<DC年金>	245,381,669円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	184,486,321円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	132,787,421円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	399,980円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	1,147,661円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	174,871,567円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,651,631,119円
ワールドアセットバランス(基本コース)	238,457,825円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	747,929,009円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	24,431,050円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,845,284円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,720,830円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	61,504,897円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	92,834,778円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,524,530,008円

9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	162,319,793円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	19,465,444円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,401,075円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,647,277円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	19,562,185円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	72,105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)	165,689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)	103,336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)	10,539,464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)	99,264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)	151,000円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-04(適格機関投資家限定)	57,511,261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)	174,612,383円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	115,277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)	994,839,493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)	58,914,489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)	1,194,151,502円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,191,328,387円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,072,517,347円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	131,750,825円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	8,753,329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)	313,860円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,383,570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)	35,029,763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)	61,660,781円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,503,827円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,705,815円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,201,915円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	779,203円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,998,271円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	32,414,809円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	227,880,462円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	336,442,557円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,097,195,543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)	104,639,860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)	57,546,213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)	362,822,030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)	15,182,575円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	4,132,817円

D I A M世界アセットバランスファンド2 V A (適格機関投資家限定)	140,903,911円
D I A M世界アセットバランスファンド4 0 V A (適格機関投資家限定)	12,755,643円
D I A M世界アセットバランスファンド2 5 V A (適格機関投資家限定)	43,146,487円
D I A M世界アセットバランスファンド3 V A (適格機関投資家限定)	68,899,808円
D I A M世界アセットバランスファンド4 V A (適格機関投資家限定)	161,950,434円
計	108,278,476,055円
2. 受益権の総数	108,278,476,055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4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	36,998,680,253	
投資信託受益証券	78,186,576	
投資証券	1,090,699,225	
合計	38,167,566,054	

(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10月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
売建					
アメリカ・ドル	3,832,452,735	-	3,854,375,257	21,922,522	
イギリス・ポンド	2,855,563,200	-	2,870,364,996	14,801,796	
オーストラリア・ドル	171,918,200	-	173,081,083	1,162,883	
カナダ・ドル	81,919,512	-	82,354,380	434,868	
ユーロ	135,865,884	-	137,460,706	1,594,822	
買建	587,185,939	-	591,114,092	3,928,153	
アメリカ・ドル	563,897,624	-	563,938,134	40,510	
イギリス・ポンド	426,365,130	-	426,395,885	30,755	
オーストラリア・ドル	26,191,044	-	26,191,745	701	
カナダ・ドル	16,768,188	-	16,766,760	1,428	
ユーロ	14,501,270	-	14,502,574	1,304	
ユーロ	80,071,992	-	80,081,170	9,178	
合計	4,396,350,359	-	4,418,313,391	21,882,012	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2021年10月11日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	9,093,018,162	-		9,012,081,903	80,936,259
合計	9,093,018,162	-		9,012,081,903	80,936,259

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.5506円 (55,506円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	43,740	3,288.620	143,844,238.800	
	ABBOTT LABORATORIES	171,442	118.390	20,297,018.380	
	AES CORP	65,452	24.070	1,575,429.640	
	ABIOMED INC	4,985	337.130	1,680,593.050	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	86,594	143.220	12,401,992.680	
	ADVANCED MICRO DEVICES	116,586	105.060	12,248,525.160	
	ADOBE INC	46,067	576.860	26,574,209.620	
	CHUBB LTD	43,301	182.780	7,914,556.780	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21,196	265.430	5,626,054.280	
	ALLEGHANY CORP	1,454	647.130	940,927.020	
	ALLSTATE CORP	28,568	126.880	3,624,707.840	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,117	217.700	14,611,370.900	
AMGEN INC	55,430	208.950	11,582,098.500	
HESS CORP	27,192	89.150	2,424,166.800	
AMERICAN EXPRESS CO	65,715	175.150	11,509,982.250	
AMERICAN ELECTRIC POWER	47,413	83.580	3,962,778.540	
AFLAC INC	66,003	54.520	3,598,483.560	
AMERICAN INTL GROUP	81,476	57.610	4,693,832.360	
AMERCO	929	698.520	648,925.080	
ANALOG DEVICES	51,668	168.620	8,712,258.160	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	67,905	69.010	4,686,124.050	
VALERO ENERGY CORP	38,208	78.600	3,003,148.800	
ANSYS INC	8,119	345.670	2,806,494.730	
APPLE INC	1,608,716	142.900	229,885,516.400	
APPLIED MATERIALS INC	88,147	126.220	11,125,914.340	
ALBEMARLE CORP	11,129	215.060	2,393,402.740	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	51,945	63.290	3,287,599.050	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,236	66.580	748,092.880	
AMEREN CORP	25,054	82.140	2,057,935.560	
ARROW ELECTRONICS INC	8,279	117.340	971,457.860	
AUTOLIV INC	7,570	91.690	694,093.300	
AUTODESK INC	20,970	278.940	5,849,371.800	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,013	206.160	8,455,240.080	
AUTOZONE INC	2,017	1,681.370	3,391,323.290	
AVERY DENNISON CORP	7,898	206.770	1,633,069.460	
BALL CORP	30,793	91.400	2,814,480.200	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	128,224	284.140	36,433,567.360	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	78,981	55.840	4,410,299.040	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,667	80.200	3,822,893.400	
BECTON DICKINSON & CO	27,892	238.580	6,654,473.360	
AMETEK INC	21,194	126.190	2,674,470.860	
VERIZON COMM INC	403,112	53.240	21,461,682.880	
WR BERKLEY CORP	16,304	77.150	1,257,853.600	
BEST BUY CO INC	21,362	107.250	2,291,074.500	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,975	722.430	1,426,799.250	
YUM! BRANDS INC	30,538	123.390	3,768,083.820	
FIRSTENERGY CORP	53,250	36.220	1,928,715.000	
BOEING CO	53,362	226.390	12,080,623.180	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	109.100	1,226,065.800	
BORGWARNER INC	21,938	46.650	1,023,407.700	
BOSTON BEER COMPANY INC-CL A	860	537.810	462,516.600	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	135,649	43.160	5,854,610.840	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	15,040	90.660	1,363,526.400	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,805	173.690	1,876,720.450	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,180	1,385.300	3,019,954.000	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	215,715	57.260	12,351,840.900	
ONEOK INC	43,019	61.630	2,651,260.970	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	135.770	1,010,671.880	
UNITED RENTALS INC	7,145	342.560	2,447,591.200	
SEMPRA ENERGY	30,010	124.620	3,739,846.200	
FEDEX CORP	24,133	223.440	5,392,277.520	
VERISIGN INC	10,001	205.940	2,059,605.940	
AMPHENOL CORP	61,252	75.740	4,639,226.480	
BROWN-FORMAN CORP	33,368	67.960	2,267,689.280	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.060	588,644.160	
CSX CORP	218,399	32.710	7,143,831.290	
COTERRA ENERGY INC	71,747	22.270	1,597,805.690	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	42.210	858,298.140	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,101	219.660	3,536,745.660	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	48.710	1,412,833.550	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	73,922	23.830	1,761,561.260	
CATERPILLAR INC	52,543	195.160	10,254,291.880	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,347	116.810	1,442,253.070	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	98.320	1,139,430.480	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	12.480	1,150,506.240	
CERNER CORP	29,663	71.070	2,108,149.410	
JPMORGAN CHASE & CO	292,453	170.220	49,781,349.660	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,345	83.150	2,024,286.750	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	120.090	1,749,351.030	
CINTAS CORP	8,902	402.800	3,585,725.600	
CISCO SYSTEMS INC	408,114	55.080	22,478,919.120	
CLOROX COMPANY	13,010	163.480	2,126,874.800	
COCA-COLA CO/THE	396,146	54.120	21,439,421.520	
COPART INC	19,653	140.400	2,759,281.200	
COGNEX CORP	16,685	80.290	1,339,638.650	
COLGATE-PALMOLIVE CO	77,391	75.590	5,849,985.690	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	25,389	157.090	3,988,358.010	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,363	280.620	1,785,585.060	
NRG ENERGY, INC.	27,425	41.390	1,135,120.750	
COMCAST CORP-CL A	440,010	54.700	24,068,547.000	
CONAGRA BRANDS INC	48,557	33.720	1,637,342.040	
CONSOLIDATED EDISON INC	31,468	73.470	2,311,953.960	

CMS ENERGY CORP	28,837	60.150	1,734,545.550	
COOPER COS INC	5,116	410.590	2,100,578.440	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	22,156	46.770	1,036,236.120	
CORNING INC	83,765	37.160	3,112,707.400	
SEALED AIR CORP	13,870	57.200	793,364.000	
HEICO CORP-CL A	7,477	118.500	886,024.500	
CUMMINS INC	13,461	236.000	3,176,796.000	
DR HORTON INC	31,517	83.410	2,628,832.970	
DANAHER CORP	61,893	299.770	18,553,664.610	
MOODY'S CORP	16,101	362.270	5,832,909.270	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,383	75.490	3,803,412.670	
TARGET CORP	47,531	228.900	10,879,845.900	
DEERE & CO	28,548	343.170	9,796,817.160	
MORGAN STANLEY	134,588	100.040	13,464,183.520	
REPUBLIC SERVICES INC	23,343	125.640	2,932,814.520	
COSTAR GROUP INC	37,089	86.880	3,222,292.320	
THE WALT DISNEY CO	174,439	176.740	30,830,348.860	
DOLLAR TREE INC	21,953	98.850	2,170,054.050	
DOVER CORP	12,789	157.840	2,018,615.760	
OMNICOM GROUP	21,323	75.220	1,603,916.060	
DTE ENERGY CO	18,647	114.130	2,128,182.110	
DUKE ENERGY CORP	74,513	100.530	7,490,791.890	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,936	154.580	1,999,646.880	
EBAY INC	64,670	75.050	4,853,483.500	
BANK OF AMERICA CORP	744,285	44.340	33,001,596.900	
CITIGROUP INC	199,423	72.350	14,428,254.050	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,862	105.220	1,248,119.640	
EATON CORP PLC	38,152	153.560	5,858,621.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,235	150.120	3,938,398.200	
DISH NETWORK CORP	21,420	44.510	953,404.200	
ECOLAB INC	24,739	215.060	5,320,369.340	
PERKINELMER INC	11,099	169.970	1,886,497.030	
ELECTRONIC ARTS INC	27,348	139.990	3,828,446.520	
SALESFORCE.COM INC	93,566	272.480	25,494,863.680	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	190.380	427,022.340	
EMERSON ELECTRIC CO	57,052	96.640	5,513,505.280	
ATMOS ENERGY CORP	10,719	89.960	964,281.240	
ENTERGY CORP	19,079	103.190	1,968,762.010	
EOG RESOURCES INC	54,857	90.530	4,966,204.210	
EQUIFAX INC	11,380	258.680	2,943,778.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	22,262	311.710	6,939,288.020	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,810	114.290	1,692,634.900	
EXXON MOBIL CORP	408,773	62.180	25,417,505.140	
FMC CORP	14,467	89.070	1,288,575.690	
NEXTERA ENERGY INC	189,952	80.210	15,236,049.920	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,844	401.130	1,541,943.720	
FAIR ISAAC CORP	2,810	400.960	1,126,697.600	

ASSURANT INC	5,523	162.210	895,885.830	
FASTENAL CO	58,642	52.720	3,091,606.240	
FIFTH THIRD BANCORP	65,494	43.950	2,878,461.300	
M&T BANK CORP	11,387	153.740	1,750,637.380	
FISERV INC	57,108	107.890	6,161,382.120	
FORD MOTOR CO	373,690	15.120	5,650,192.800	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	30.050	802,755.700	
FREEPORT-MCMORAN INC	137,810	34.130	4,703,455.300	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,793	155.660	3,236,638.380	
DENTSPLY SIRONA INC	24,507	58.030	1,422,141.210	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,967	202.120	4,642,090.040	
GENERAL MILLS INC	56,563	61.460	3,476,361.980	
GENUINE PARTS CO	14,520	126.040	1,830,100.800	
GILEAD SCIENCES INC	120,589	68.050	8,206,081.450	
GARTNER INC	7,941	304.100	2,414,858.100	
MCKESSON CORP	16,362	200.200	3,275,672.400	
NVIDIA CORP	239,952	208.310	49,984,401.120	
GENERAL ELECTRIC CO	105,142	104.720	11,010,470.240	
VW GRAINGER INC	3,895	417.240	1,625,149.800	
HALLIBURTON CO	84,523	23.940	2,023,480.620	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,156	89.270	3,316,916.120	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,683	392.810	12,838,209.230	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,177	233.170	4,471,501.090	
HASBRO INC	14,615	90.000	1,315,350.000	
HENRY SCHEIN INC	14,358	79.830	1,146,199.140	
HEICO CORP	3,623	134.780	488,307.940	
HERSHEY FOODS CORP	14,916	177.750	2,651,319.000	
HP INC	118,505	27.890	3,305,104.450	
F5 NETWORKS INC	5,548	200.770	1,113,871.960	
CROWN HOLDINGS INC NPR	13,523	103.640	1,401,523.720	
JUNIPER NETWORKS INC	34,151	28.690	979,792.190	
HOLOGIC INC	24,690	71.370	1,762,125.300	
HOME DEPOT INC	102,444	334.340	34,251,126.960	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,271	77.830	1,422,031.930	
HORMEL FOODS CORP	24,812	41.690	1,034,412.280	
CENTERPOINT ENERGY INC	60,210	25.540	1,537,763.400	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	295.050	1,009,366.050	
HUMANA INC	12,223	412.760	5,045,165.480	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,576	169.780	1,456,033.280	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	153,872	16.000	2,461,952.000	
BIOGEN INC	14,303	285.830	4,088,226.490	
IDEX CORP	7,369	211.820	1,560,901.580	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,381	216.400	6,574,448.400	
INTUIT INC	26,342	531.120	13,990,763.040	
IDEXX LABORATORIES INC	8,072	617.020	4,980,585.440	

TRANE TECHNOLOGIES PLC	22,595	172.020	3,886,791.900	
INTEL CORP	389,611	53.810	20,964,967.910	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	23,358	138.040	3,224,338.320	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,544	54.390	1,933,238.160	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	32,532	37.230	1,211,166.360	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,946	135.350	1,752,241.100	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,620	166.060	1,099,317.200	
INCYTE CORP	18,028	65.890	1,187,864.920	
JOHNSON & JOHNSON	254,706	160.930	40,989,836.580	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,801	73.010	2,540,821.010	
KLA CORPORATION	14,521	326.050	4,734,572.050	
DEVON ENERGY CORP	62,146	39.860	2,477,139.560	
KELLOGG CO	25,753	62.690	1,614,455.570	
KEYCORP	101,297	22.970	2,326,792.090	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,079	132.870	4,262,336.730	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,724	844.400	12,432,945.600	
KROGER CO	74,030	39.470	2,921,964.100	
LAM RESEARCH CORP	13,662	550.160	7,516,285.920	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,190	422.630	1,770,819.700	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,881	139.130	1,235,613.530	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,625	102.190	1,596,718.750	
PLUG POWER INC	54,206	27.190	1,473,861.140	
LENNAR CORP	25,435	93.850	2,387,074.750	
ELI LILLY & CO	78,478	233.940	18,359,143.320	
BATH & BODY WORKS INC	24,546	63.660	1,562,598.360	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	72.630	1,313,876.700	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	69,686	183.490	12,786,684.140	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,832	152.470	4,396,015.040	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,161	353.750	8,546,953.750	
LOEWS CORP	22,394	57.420	1,285,863.480	
LOWE'S COS INC	67,847	206.160	13,987,337.520	
DOMINION ENERGY INC	77,064	72.700	5,602,552.800	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,345	44.430	1,836,958.350	
MCCORMICK & CO INC	24,703	79.310	1,959,194.930	
MCDONALD'S CORPORATION	71,870	247.700	17,802,199.000	
S&P GLOBAL INC	23,202	429.720	9,970,363.440	
EVEREST RE GROUP LTD	4,101	268.600	1,101,528.600	
MARKEL CORPORATION	1,367	1,265.760	1,730,293.920	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	59,184	108.730	6,435,076.320	

MARSH & MCLENNAN COS	49,081	156.660	7,689,029.460	
MASCO CORP	21,780	56.870	1,238,628.600	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,739	357.800	2,053,414.200	
METLIFE INC	71,197	64.990	4,627,093.030	
MEDTRONIC PLC	130,784	125.270	16,383,311.680	
ACTIVISION BLIZZARD INC	74,432	77.610	5,776,667.520	
CVS HEALTH CORP	126,594	84.370	10,680,735.780	
MERCK & CO. INC.	245,355	80.630	19,782,973.650	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	40,848	44.480	1,816,919.040	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,426	278.340	2,623,632.840	
MICROSOFT CORP	689,859	294.850	203,404,926.150	
MICRON TECH INC	107,101	70.120	7,509,922.120	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,997	146.140	3,799,201.580	
3M CO	55,881	176.950	9,888,142.950	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	178.630	1,065,170.690	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,187	409.160	2,122,312.920	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,137	236.760	3,820,596.120	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,697	285.470	2,482,732.590	
ILLUMINA INC	13,951	410.000	5,719,910.000	
XCEL ENERGY INC	50,377	63.200	3,183,826.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	104.080	1,010,929.040	
NETAPP INC	21,903	91.510	2,004,343.530	
NEWELL BRANDS INC	33,317	21.990	732,640.830	
NEWMONT CORP	76,661	54.310	4,163,458.910	
NOVAVAX INC	7,606	164.050	1,247,764.300	
NVR INC	352	4,838.240	1,703,060.480	
NIKE INC-CL B	122,767	152.480	18,719,512.160	
NORDSON CORP	5,870	237.980	1,396,942.600	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,009	264.880	6,359,503.920	
EVERSOURCE ENERGY	31,781	85.410	2,714,415.210	
NISOURCE INC	40,775	24.430	996,133.250	
NORTHERN TRUST CORP	17,989	115.450	2,076,830.050	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,627	389.720	5,700,434.440	
WELLS FARGO & CO	398,015	48.000	19,104,720.000	
NUCOR CORP	27,949	97.970	2,738,163.530	
CHENIERE ENERGY INC	24,614	99.670	2,453,277.380	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,964	168.800	7,252,323.200	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	97,764	33.630	3,287,803.320	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,195	287.670	2,932,795.650	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,508	610.250	3,971,507.000	
ORACLE CORP	180,771	94.390	17,062,974.690	

PACCAR INC	32,111	84.760	2,721,728.360	
PTC INC	11,092	120.040	1,331,483.680	
EXELON CORP	100,657	48.350	4,866,765.950	
PARKER HANNIFIN CORP	12,039	290.950	3,502,747.050	
PAYCHEX INC	33,684	118.670	3,997,280.280	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,148	643.560	4,600,166.880	
PPL CORPORATION	75,032	28.360	2,127,907.520	
PEPSICO INC	133,710	156.030	20,862,771.300	
PENTAIR PLC	16,339	70.800	1,156,801.200	
PFIZER INC	539,863	42.450	22,917,184.350	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,458	46.360	1,133,872.880	
CONOCOPHILLIPS	129,475	74.920	9,700,267.000	
PG&E CORP	140,021	10.710	1,499,624.910	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	21,771	193.080	4,203,544.680	
ALTRIA GROUP INC	178,220	46.730	8,328,220.600	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,219	202.760	8,357,564.440	
BROWN & BROWN INC	24,295	59.990	1,457,457.050	
GARMIN LTD	14,761	155.460	2,294,745.060	
PPG INDUSTRIES INC	22,360	150.740	3,370,546.400	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	159.530	534,904.090	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,679	451.850	19,284,506.150	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,330	195.360	4,167,028.800	
QUEST DIAGNOSTICS	12,499	141.930	1,773,983.070	
PROCTER & GAMBLE CO	236,726	141.730	33,551,175.980	
PROGRESSIVE CORP	56,047	90.930	5,096,353.710	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,270	59.890	2,950,780.300	
PULTE GROUP INC	25,385	47.330	1,201,472.050	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,012	159.390	4,464,832.680	
QUALCOMM INC	108,867	126.550	13,777,118.850	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	18,189	96.360	1,752,692.040	
EXACT SCIENCES CORP	17,983	93.690	1,684,827.270	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	147.310	683,223.780	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,932	550.020	5,462,798.640	
RESMED INC	13,775	253.900	3,497,472.500	
US BANCORP	136,776	62.330	8,525,248.080	
SEAGEN INC	12,330	161.860	1,995,733.800	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	40.950	1,589,228.550	
ROSS STORES INC	33,423	107.870	3,605,339.010	
ROLLINS INC	25,899	36.690	950,234.310	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,987	451.590	4,510,029.330	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,912	301.330	3,288,112.960	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,882	87.730	2,007,437.860	

RPM INTERNATIONAL INC	12,897	79.020	1,019,120.940	
ACCENTURE PLC-CL A	61,565	325.190	20,020,322.350	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	135,239	59.540	8,052,130.060	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,411	242.890	3,014,507.790	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	26,020	157.330	4,093,726.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	59,365	120.030	7,125,580.950	
BOOKING HOLDINGS INC	3,914	2,474.370	9,684,684.180	
SCHLUMBERGER LTD	131,610	31.660	4,166,772.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	138,727	77.340	10,729,146.180	
POOL CORP	3,925	446.530	1,752,630.250	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,561	146.650	2,868,620.650	
BUNGE LTD	13,581	84.360	1,145,693.160	
SEI INVESTMENTS CO	14,469	59.950	867,416.550	
ANTHEM INC	23,467	386.170	9,062,251.390	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,734	119.370	1,639,427.580	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,249	68.920	1,671,241.080	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,294	289.990	7,045,017.060	
CENTENE CORP	54,694	64.330	3,518,465.020	
SVB FINANCIAL GROUP	5,236	670.490	3,510,685.640	
SMITH (A.O.) CORP	14,015	64.230	900,183.450	
SNAP-ON INC	5,408	215.530	1,165,586.240	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,136	109.720	4,074,561.920	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	214.150	1,333,297.900	
EDISON INTERNATIONAL	34,912	57.140	1,994,871.680	
SOUTHERN CO	102,494	62.560	6,412,024.640	
TRUIST FINANCIAL CORP	129,210	60.830	7,859,844.300	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	53.920	712,822.400	
AT&T INC	690,815	26.770	18,493,117.550	
CHEVRON CORP	187,025	108.050	20,208,051.250	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,076	177.280	2,672,673.280	
STATE STREET CORP	36,094	91.200	3,291,772.800	
STARBUCKS CORP	112,686	111.220	12,532,936.920	
STEEL DYNAMICS INC	20,423	59.090	1,206,795.070	
STRYKER CORP	32,758	263.680	8,637,629.440	
NETFLIX INC	42,608	632.660	26,956,377.280	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	25.670	1,421,809.960	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	48.100	764,164.700	
SYNOPSYS INC	14,414	291.660	4,203,987.240	
SYSCO CORP	48,685	83.350	4,057,894.750	
INTUITIVE SURGICAL INC	34,527	328.540	11,343,500.580	
TELEFLEX INC	4,634	362.910	1,681,724.940	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	10.160	1,074,491.120	
TERADYNE INC	17,775	109.560	1,947,429.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	89,450	195.240	17,464,218.000	
TEXTRON INC	22,278	72.010	1,604,238.780	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,836	583.920	22,093,197.120	
GLOBE LIFE INC	10,611	94.420	1,001,890.620	
DAVITA INC	6,497	113.220	735,590.340	
TRACTOR SUPPLY CO	11,488	194.720	2,236,943.360	
BIO-TECHNE CORP	3,504	479.620	1,680,588.480	
TRIMBLE INC	24,682	81.930	2,022,196.260	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,014	475.910	1,910,302.740	
TYSON FOODS INC	28,083	78.570	2,206,481.310	
UGI CORP	19,377	44.210	856,657.170	
UNION PACIFIC CORP	64,419	216.480	13,945,425.120	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	145,549	90.620	13,189,650.380	
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,985	408.460	37,163,733.100	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	130.430	1,009,136.910	
VF CORP	35,294	68.000	2,399,992.000	
VIACOMCBS INC	62,590	39.810	2,491,707.900	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,197	178.940	4,329,811.180	
VULCAN MATERIALS CO	12,739	175.440	2,234,930.160	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	69,370	47.380	3,286,750.600	
WALMART INC	149,575	139.660	20,889,644.500	
WASTE MANAGEMENT INC	40,322	154.720	6,238,619.840	
WATERS CORP	5,920	343.400	2,032,928.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,810	407.140	2,772,623.400	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,125	121.630	1,109,873.750	
VAIL RESORTS INC	3,547	343.640	1,218,891.080	
WESTERN DIGITAL CORP	29,830	56.590	1,688,079.700	
WABTEC CORP	18,377	89.670	1,647,865.590	
WHIRLPOOL CORP	7,030	198.770	1,397,353.100	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,892	160.860	2,556,387.120	
WYNN RESORTS LTD	9,809	86.060	844,162.540	
NASDAQ INC	11,126	197.400	2,196,272.400	
CME GROUP INC	34,435	201.530	6,939,685.550	
WILLIAMS COS INC	126,594	28.320	3,585,142.080	
LKQ CORP	28,725	52.520	1,508,637.000	
ALLIANT ENERGY CORP	20,873	55.960	1,168,053.080	
WEC ENERGY GROUP INC	28,977	88.810	2,573,447.370	
CARMAX INC	16,043	130.540	2,094,253.220	
XILINX INC	23,225	156.270	3,629,370.750	
TJX COMPANIES INC	115,092	64.740	7,451,056.080	

ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,003	498.730	2,495,146.190	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.920	534,804.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	53.690	1,106,014.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,581	203.700	2,359,049.700	
CBRE GROUP INC	34,563	97.100	3,356,067.300	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	29.240	426,816.280	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,214	22.020	2,140,652.280	
DOMINO'S PIZZA INC	3,715	480.320	1,784,388.800	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,275	468.720	2,003,778.000	
T-MOBILE US INC	59,927	121.220	7,264,350.940	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,060	38.220	1,263,553.200	
MOSAIC CO/THE	32,592	40.400	1,316,716.800	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,162	410.150	1,707,044.300	
CELANESE CORP	11,626	159.070	1,849,347.820	
DEXCOM INC	9,155	529.100	4,843,910.500	
DISCOVERY INC-A	20,231	25.890	523,780.590	
EXPEDIA GROUP INC	12,886	169.980	2,190,362.280	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,094	61.060	1,349,059.640	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,840	279.100	3,304,544.000	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	29.310	997,214.130	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	54,133	128.100	6,934,437.300	
LIVE NATION	15,697	98.340	1,543,642.980	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,646	1,817.610	4,809,396.060	
TRANSDIGM GROUP INC	5,382	644.060	3,466,330.920	
MASTERCARD INC	85,300	354.960	30,278,088.000	
WESTERN UNION CO	48,040	20.770	997,790.800	
OWENS CORNING	9,740	87.810	855,269.400	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	98.880	1,272,190.080	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	10.810	187,553.500	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,532	168.940	1,779,276.080	
DELTA AIR LINES INC	14,723	43.380	638,683.740	
INSULET CORP	6,387	290.920	1,858,106.040	
DISCOVER FINANCIAL	28,700	128.350	3,683,645.000	
TE CONNECTIVITY LTD	31,400	145.670	4,574,038.000	
MASIMO CORP	5,365	271.530	1,456,758.450	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,749	397.220	4,666,937.780	
VMWARE INC	7,464	147.830	1,103,403.120	
MERCADOLIBRE INC	4,278	1,511.190	6,464,870.820	
ULTA BEAUTY INC	5,259	378.370	1,989,847.830	

INVESCO LTD	39,794	25.030	996,043.820	
MSCI INC	7,829	600.120	4,698,339.480	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	150,641	95.350	14,363,619.350	
VISA INC	163,269	230.270	37,595,952.630	
KEURIG DR PEPPER INC	64,023	35.040	2,243,365.920	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,228	170.830	3,113,889.240	
DISCOVERY INC-C	30,388	24.960	758,484.480	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,620	65.160	4,015,159.200	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	94.680	1,276,854.480	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	192,243	17.470	3,358,485.210	
XYLEM INC	16,073	121.470	1,952,387.310	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,698	97.950	2,419,169.100	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,818	206.390	994,387.020	
SPLUNK INC	15,213	150.900	2,295,641.700	
EPAM SYSTEMS INC	5,248	586.720	3,079,106.560	
ZILLOW GROUP INC	7,658	90.670	694,350.860	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,728	65.360	1,158,702.080	
HCA HEALTHCARE INC	25,845	240.420	6,213,654.900	
VERISK ANALYTICS INC	15,704	207.470	3,258,108.880	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	135.970	836,487.440	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,466	262.550	2,222,748.300	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,569	204.030	3,380,573.070	
NXP SEMICONDUCTOR NV	26,371	190.310	5,018,665.010	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	80.820	1,106,183.340	
LEAR CORP	5,733	168.250	964,577.250	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	126.370	1,330,296.990	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	23,036	71.300	1,642,466.800	
DOLLAR GENERAL CORP	22,273	210.400	4,686,239.200	
FORTINET INC	13,143	307.170	4,037,135.310	
HORIZON PHARMA PLC	20,678	113.760	2,352,329.280	
TESLA INC	78,889	785.490	61,966,520.610	
GENERAC HOLDINGS INC	6,138	406.780	2,496,815.640	
ENPHASE ENERGY INC	13,117	154.360	2,024,740.120	
GENERAL MOTORS CO	125,535	58.570	7,352,584.950	
ALLY FINANCIAL INC	39,108	53.000	2,072,724.000	
VOYA FINANCIAL INC	8,842	64.960	574,376.320	
APTIV PLC	25,603	165.120	4,227,567.360	
PHILLIPS 66	40,510	82.130	3,327,086.300	

GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,826	118.770	810,724.020	
FACEBOOK INC	230,966	330.050	76,230,328.300	
IQVIA HOLDINGS INC	18,203	242.230	4,409,312.690	
SERVICENOW INC	18,949	617.580	11,702,523.420	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,207	492.790	4,537,117.530	
WORKDAY INC	18,032	255.900	4,614,388.800	
ABBVIE INC	170,332	111.180	18,937,511.760	
ZOETIS INC	45,709	197.880	9,044,896.920	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	24.080	923,997.760	
CDW CORP	12,970	176.880	2,294,133.600	
HOWMET AEROSPACE INC	43,243	31.640	1,368,208.520	
TWILIO INC	15,432	320.600	4,947,499.200	
COUPA SOFTWARE INC	6,855	223.940	1,535,108.700	
SNAP INC	91,202	75.000	6,840,150.000	
TRADE DESK INC A	40,522	71.000	2,877,062.000	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	53.100	985,376.700	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	48.390	402,798.360	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	15,995	48.570	776,877.150	
OKTA INC	11,653	228.550	2,663,293.150	
BLACK KNIGHT INC	16,004	71.020	1,136,604.080	
BAKER HUGHES CO	69,453	25.240	1,752,993.720	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	56.390	743,276.590	
ALTICE USA INC-A	21,506	18.490	397,645.940	
BROADCOM INC	39,475	492.850	19,455,253.750	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,277	225.940	1,870,105.380	
MONGODB INC	5,198	449.000	2,333,902.000	
BURLINGTON STORES INC	6,573	277.450	1,823,678.850	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	33.150	1,340,884.350	
VEEVA SYSTEMS INC	12,976	286.500	3,717,624.000	
TWITTER INC	76,364	63.680	4,862,859.520	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	57.050	911,944.250	
EVERGY INC	22,104	62.010	1,370,669.040	
ALLEGION PLC	8,924	131.450	1,173,059.800	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	118.900	1,588,504.000	
STERIS PLC	9,081	219.490	1,993,188.690	
DOCUSIGN INC	18,424	263.030	4,846,064.720	
WIX.COM LTD	5,567	184.840	1,029,004.280	
DROPBOX INC	28,170	28.510	803,126.700	
KKR & CO INC	48,489	65.510	3,176,514.390	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	87.640	416,991.120	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	20,278	255.050	5,171,903.900	
MODERNA INC	32,778	304.910	9,994,339.980	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	25,200	141.510	3,566,052.000	
ARAMARK	20,857	36.570	762,740.490	

AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	53,186	37.190	1,977,987.340	
CIGNA CORP	32,511	205.180	6,670,606.980	
DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	105.060	2,918,881.980	
DOW INC	70,936	58.710	4,164,652.560	
AMCOR PLC	153,824	11.710	1,801,279.040	
PINTEREST INC	52,639	51.640	2,718,277.960	
PELTON INTERACTIVE INC	24,387	86.110	2,099,964.570	
FOX CORP-A	26,689	42.250	1,127,610.250	
FOX CORP-B	15,080	39.080	589,326.400	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	21.280	672,809.760	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	17,953	245.000	4,398,485.000	
CHEWY INC	9,068	62.600	567,656.800	
AVANTOR INC	49,938	40.580	2,026,484.040	
LYFT INC	23,625	54.890	1,296,776.250	
DYNATRACE INC	20,409	71.240	1,453,937.160	
CLOUDFLARE INC	22,227	139.660	3,104,222.820	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	83.670	827,161.620	
CARRIER GLOBAL CORP	78,248	51.500	4,029,772.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,822	83.450	3,490,045.900	
UBER TECHNOLOGIES INC	116,273	47.770	5,554,361.210	
CORTEVA INC	69,358	42.780	2,967,135.240	
MATCH GROUP INC	24,556	157.540	3,868,552.240	
BLACKSTONE INC	65,505	116.430	7,626,747.150	
CARLYLE GROUP INC	16,487	49.420	814,787.540	
10X GENOMICS INC	7,667	155.330	1,190,915.110	
DATADOG INC	19,036	140.320	2,671,131.520	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	19,472	79.930	1,556,396.960	
INGERSOLL RAND INC	41,830	50.990	2,132,911.700	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,898	505.060	2,473,783.880	
PPD INC	10,828	47.040	509,349.120	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	136.220	731,092.740	
AON PLC	21,662	294.500	6,379,459.000	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	57.400	918,514.800	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	140.820	994,752.480	
AIRBNB INC	12,671	169.970	2,153,689.870	
ZENDESK INC	11,915	112.170	1,336,505.550	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	35.490	598,396.890	
VIATRIS INC	114,640	13.630	1,562,543.200	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,765	113.960	2,480,339.400	
DRAFTKINGS INC	33,459	47.910	1,603,020.690	
SNOWFLAKE INC	18,451	313.520	5,784,757.520	
DOORDASH INC	7,641	204.420	1,561,973.220	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	37.860	346,191.840	
ARISTA NETWORKS INC	5,602	371.920	2,083,495.840	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	146,368	23.500	3,439,648.000	

IHS MARKIT LTD	36,000	119.140	4,289,040.000	
FNF GROUP	30,955	46.790	1,448,384.450	
MARVELL TECHNOLOGY INC	77,931	64.620	5,035,901.220	
CATALENT INC	15,634	130.340	2,037,735.560	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,826	49.950	2,688,608.700	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,845	49.050	2,101,547.250	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	164.020	567,017.140	
WAYFAIR INC	7,829	242.170	1,895,948.930	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,187	161.760	2,780,169.120	
HUBSPOT INC	4,156	679.870	2,825,539.720	
QORVO INC	11,107	165.830	1,841,873.810	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	165.480	401,289.000	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	13,265	168.500	2,235,152.500	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	5,031	261.870	1,317,467.970	
GODADDY INC	16,574	70.010	1,160,345.740	
ETSY INC	13,199	212.020	2,798,451.980	
TRANSUNION	18,741	113.340	2,124,104.940	
SQUARE INC	37,530	238.490	8,950,529.700	
DUPONT DE NEMOURS INC	50,529	70.420	3,558,252.180	
CARVANA CO	7,521	282.430	2,124,156.030	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,941	54.050	1,239,961.050	
TELADOC HEALTH INC	14,744	131.550	1,939,573.200	
WESTROCK CO	26,297	50.280	1,322,213.160	
KRAFT HEINZ CO	64,743	36.780	2,381,247.540	
NOVOCURE LTD	9,772	111.500	1,089,578.000	
FORTIVE CORP	29,332	70.760	2,075,532.320	
WASTE CONNECTIONS INC	24,251	128.370	3,113,100.870	
ALPHABET INC-CL A	28,951	2,795.710	80,938,600.210	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	119,706	14.830	1,775,239.980	
PAYPAL HOLDINGS INC	107,503	260.060	27,957,230.180	
SEA LTD ADR	7,078	323.280	2,288,175.840	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,417	31.670	1,280,006.390	
SUNRUN INC	16,213	43.220	700,725.860	
ZILLOW GROUP INC-C	15,665	91.040	1,426,141.600	
ALPHABET INC-CL C	28,126	2,801.120	78,784,301.120	
ZSCALER INC	8,506	266.660	2,268,209.960	
CABLE ONE INC	542	1,784.190	967,030.980	
LINDE PLC	50,154	296.190	14,855,113.260	
ATHENE HOLDING LTD	13,416	73.600	987,417.600	
ROKU INC	11,730	323.360	3,793,012.800	
AVALARA INC	8,515	165.270	1,407,274.050	

	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,584	706.130	8,885,939.920	
	VISTRA CORP	38,032	17.900	680,772.800	
アメリカ・ドル	小計	30,359,762		3,758,128,261.510 (422,037,803,766)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	13.635	480,783.730	
	ASHTREAD GROUP	41,819	56.240	2,351,900.560	
	SEVERN TRENT PLC	18,929	26.050	493,100.450	
	BHP GROUP PLC	201,852	19.130	3,861,428.760	
	BARCLAYS PLC	1,587,377	1.951	3,096,972.520	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	6.356	622,551.130	
	BT GROUP PLC	864,218	1.463	1,264,350.930	
	BUNZL PLC	34,184	23.990	820,074.160	
	AVIVA PLC	353,095	4.041	1,426,856.890	
	CRODA INTERNATIONAL	15,033	82.640	1,242,327.120	
	DIAGEO PLC	225,216	35.435	7,980,528.960	
	SCHRODERS PLC	11,354	34.970	397,049.380	
	DCC PLC	7,898	60.020	474,037.960	
	NATIONAL GRID PLC	336,378	8.900	2,993,764.200	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.249	687,033.540	
	BAE SYSTEMS PLC	307,253	5.750	1,766,704.750	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	209,139	25.370	5,305,856.430	
	HALMA PLC	38,776	27.480	1,065,564.480	
	NEXT PLC	13,140	75.680	994,435.200	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,865	15.195	1,395,888.670	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	26.260	501,749.820	
	ANGLO AMERICAN PLC	121,934	26.910	3,281,243.940	
	COMPASS GROUP PLC	164,861	15.045	2,480,333.740	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,964,872	4.195	8,242,638.040	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	544,587	2.831	1,541,725.790	
	UNILEVER PLC	252,667	38.665	9,769,369.550	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	2.854	657,025.040	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	9.820	664,951.480	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29,411	18.050	530,868.550	
	PEARSON PLC	87,535	7.404	648,109.140	
	PERSIMMON PLC	29,453	25.440	749,284.320	
	PRUDENTIAL PLC	249,443	15.015	3,745,386.640	
	RIO TINTO PLC	107,463	49.290	5,296,851.270	
	VODAFONE GROUP PLC	2,645,129	1.121	2,965,189.600	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	67,622	54.880	3,711,095.360	
	RELX PLC	184,767	21.460	3,965,099.820	
	RENTOKIL INITIAL PLC	199,293	5.866	1,169,052.730	

ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	781,282	1.437	1,122,702.230	
NATWEST GROUP PLC	572,346	2.262	1,294,646.650	
ST JAMES'S PLACE PLC	57,843	14.465	836,698.990	
SSE PLC	99,950	15.455	1,544,727.250	
BP PLC	1,941,000	3.535	6,861,435.000	
SAGE GROUP PLC(THE)	110,105	7.100	781,745.500	
SMITHS GROUP PLC	35,235	14.480	510,202.800	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,856	145.000	1,139,120.000	
STANDARD CHARTERED PLC	267,266	4.808	1,285,014.920	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,725,520	0.468	3,147,543.360	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.491	517,069.850	
TESCO PLC	794,842	2.756	2,190,584.550	
3I GROUP PLC	83,387	12.565	1,047,757.650	
SMITH & NEPHEW PLC	84,627	12.555	1,062,491.980	
GLAXOSMITHKLINE PLC	485,549	13.990	6,792,830.510	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	33,898	76.500	2,593,197.000	
WPP PLC	124,119	9.822	1,219,096.810	
ASTRAZENECA PLC	149,128	88.890	13,255,987.920	
WHITBREAD PLC	18,594	32.610	606,350.340	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	49.490	798,719.110	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	18.345	711,125.580	
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,802	49.540	980,991.080	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.956	540,540.070	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	30.570	614,059.590	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	42.300	446,645.700	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	396,961	17.086	6,782,475.640	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	354,015	17.146	6,069,941.190	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	23.400	421,995.600	
AVEVA GROUP PLC	10,408	34.780	361,990.240	
ABRDN PLC	206,313	2.540	524,035.020	
EXPERIAN PLC	87,216	31.130	2,715,034.080	
MONDI PLC	47,464	17.705	840,350.120	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	14.010	494,721.120	
OCADO GROUP PLC	54,445	16.245	884,459.020	
INFORMA PLC	151,566	5.688	862,107.400	
GLENCORE PLC	938,148	3.553	3,333,239.840	
ENTAIN PLC	58,126	21.320	1,239,246.320	
EVRAZ PLC	48,765	5.786	282,154.290	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.814	317,120.910	
COCA-COLA HBC AG	20,233	23.930	484,175.690	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	39,279	6.448	253,270.990	

	FERGUSON PLC	22,957	104.300	2,394,415.100	
	M&G PLC	259,117	2.001	518,493.110	
	JD SPORTS FASHION PLC	47,098	10.415	490,525.670	
	AUTO TRADER GROUP PLC	77,282	5.814	449,317.540	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	498,786	1.648	821,999.320	
イギリス・ポンド 小計		28,160,037		171,083,537.300 (26,204,865,408)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOLIM BM	102,359	28.580	2,925,420.220	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	27.490	3,948,801.050	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	467.000	821,920.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	17.490	1,786,323.660	
	ICL GROUP LTD	68,048	25.600	1,742,028.800	
	NICE LTD	6,862	852.900	5,852,599.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	106.600	1,113,330.400	
	AZRIELI GROUP	4,414	294.400	1,299,481.600	
イスラエル・シュケル 小計		439,666		19,489,905.530 (676,786,970)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	67.610	1,139,498.940	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	270,980	27.960	7,576,600.800	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	349,412	25.960	9,070,735.520	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	179,715	14.250	2,560,938.750	
	TELSTRA CORP LTD	479,279	3.890	1,864,395.310	
	ASX LTD	19,940	80.360	1,602,378.400	
	BHP GROUP LTD	282,043	37.740	10,644,302.820	
	AMPOL LTD	20,946	29.170	610,994.820	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	18.250	941,773.000	
	CSL LIMITED	43,540	290.460	12,646,628.400	
	REA GROUP LTD	5,828	157.030	915,170.840	
	TRANSURBAN GROUP	251,267	13.780	3,462,459.260	
	COCHLEAR LTD	6,917	220.470	1,524,990.990	
	ORIGIN ENERGY LTD	196,680	5.070	997,167.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	170,975	104.450	17,858,338.750	
	RIO TINTO LIMITED	38,299	100.400	3,845,219.600	
	APA GROUP	118,205	8.790	1,039,021.950	
	ARISTOCRAT LEISU	50,270	45.160	2,270,193.200	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	216,220	5.190	1,122,181.800	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	41,434	49.150	2,036,481.100	
	ORICA LTD	41,311	14.330	591,986.630	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	11.110	690,108.760	
BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	20.280	948,637.560		
SYDNEY AIRPORT	116,130	8.240	956,911.200		

	MACQUARIE GROUP LTD	32,165	182.280	5,863,036.200	
	SUNCORP GROUP LTD	105,244	12.690	1,335,546.360	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	312,992	28.380	8,882,712.960	
	NEWCREST MINING LTD	70,671	23.450	1,657,234.950	
	OIL SEARCH LTD	211,926	4.510	955,786.260	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.590	600,829.970	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	12.230	1,758,943.060	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	130,073	9.220	1,199,273.060	
	REECE LTD	30,319	17.860	541,497.340	
	SANTOS LTD	194,614	7.380	1,436,251.320	
	SONIC HEALTHCARE	46,547	39.960	1,860,018.120	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	35.990	889,348.890	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.100	1,094,444.700	
	WESFARMERS LTD	106,369	55.060	5,856,677.140	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,871	25.350	2,126,129.850	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	117,924	39.950	4,711,063.800	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	33.900	527,246.700	
	SEEK LTD	36,770	32.000	1,176,640.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	142.180	865,307.480	
	AUSNET SERVICES	165,066	2.500	412,665.000	
	AGL ENERGY LTD	49,076	6.250	306,725.000	
	BRAMBLES LTD	150,237	10.500	1,577,488.500	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	9.220	302,978.420	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	3.710	522,976.440	
	AURIZON HOLDINGS LTD	153,654	3.940	605,396.760	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	12.050	914,631.150	
	XERO LTD	12,462	139.280	1,735,707.360	
	AFTERPAY LTD	22,748	122.990	2,797,776.520	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.990	835,822.260	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.570	1,010,859.780	
	SOUTH32 LTD(AUD)	497,070	3.580	1,779,510.600	
	COLES GROUP LTD	127,363	17.030	2,168,991.890	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	52.590	715,434.360	
	オーストラリア・ドル 小計	6,912,215		145,942,068.200 (11,994,978,585)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,568	67.290	1,653,180.720	
	ALIMENTATION COUCHE TARD INC	77,136	47.680	3,677,844.480	
	BARRICK GOLD CORP	166,482	23.090	3,844,069.380	
	ATCO LTD	7,193	41.300	297,070.900	

BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	17.010	361,836.720	
BANK OF MONTREAL	61,854	130.700	8,084,317.800	
BANK OF NOVA SCOTIA	117,072	78.370	9,174,932.640	
NATIONAL BANK OF CANADA	31,031	100.440	3,116,753.640	
BCE INC	7,275	63.190	459,707.250	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	122,499	70.250	8,605,554.750	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	34.740	979,390.080	
SAPUTO INC	25,395	31.280	794,355.600	
BLACKBERRY LTD	46,671	11.700	546,050.700	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	66,161	18.100	1,197,514.100	
CGI INC	23,623	109.320	2,582,466.360	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	65.610	1,007,638.380	
CAE INC	30,443	37.780	1,150,136.540	
CAMECO CORP	41,733	26.590	1,109,680.470	
ROGERS COMM-CL B	35,510	59.080	2,097,930.800	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,616	146.100	6,226,197.600	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	112,396	49.620	5,577,089.520	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	182.650	1,075,625.850	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,291	34.800	566,926.800	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,145	145.830	9,937,585.350	
YAMANA GOLD INC	84,317	5.120	431,703.040	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	44.970	936,050.550	
OPEN TEXT CORP	22,918	61.330	1,405,560.940	
EMPIRE CO LTD	15,093	38.000	573,534.000	
KINROSS GOLD CORP	118,575	7.080	839,511.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,963	79.450	791,560.350	
FORTIS INC	47,849	55.760	2,668,060.240	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	25.500	1,451,307.000	
TELUS CORP	31,890	27.610	880,482.900	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	38.860	981,215.000	
IMPERIAL OIL LTD	21,542	42.560	916,827.520	
ENBRIDGE INC	193,965	51.590	10,006,654.350	
IGM FINANCIAL INC	6,069	45.240	274,561.560	
MANULIFE FINANCIAL CORP	181,665	24.650	4,478,042.250	
LOBLAW CO LTD	13,233	89.960	1,190,440.680	
MAGNA INTERNATIONAL INC	26,541	103.460	2,745,931.860	
SUN LIFE FINANCIAL INC	53,950	68.500	3,695,575.000	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,743	525.490	1,441,419.070	
METRO INC	25,305	61.460	1,555,245.300	
EMERA INC	26,674	57.950	1,545,758.300	
ONEX CORP	6,646	89.810	596,877.260	

PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	29.920	561,478.720	
POWER CORP OF CANADA	55,860	42.560	2,377,401.600	
QUEBECOR INC-B	16,042	30.510	489,441.420	
ROYAL BANK OF CANADA	138,565	128.410	17,793,131.650	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	62,986	86.240	5,431,912.640	
SHAW COMM INC-B	47,913	37.030	1,774,218.390	
SUNCOR ENERGY INC	139,932	28.810	4,031,440.920	
LUNDIN MINING CORP	64,310	9.360	601,941.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	52,980	33.280	1,763,174.400	
THOMSON REUTERS CORP	16,826	141.940	2,388,282.440	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,070	107.370	973,845.900	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	176,072	86.290	15,193,252.880	
TC ENERGY CORP	93,385	62.120	5,801,076.200	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,298	108.470	1,008,554.060	
WESTON (GEORGE) LTD	7,886	135.760	1,070,603.360	
INTACT FINANCIAL CORP	17,922	166.100	2,976,844.200	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	47,399	47.630	2,257,614.370	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,861	2,084.530	3,879,310.330	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	17,537	169.040	2,964,454.480	
B2GOLD CORP	101,675	4.540	461,604.500	
KEYERA CORP	23,772	31.620	751,670.640	
PARKLAND CORP	14,497	36.930	535,374.210	
ALTAGAS LTD	24,236	25.010	606,142.360	
PEMBINA PIPELINE CORP	51,071	41.060	2,096,975.260	
DOLLARAMA INC	32,298	55.760	1,800,936.480	
CENOVUS ENERGY INC W/I	139,645	14.060	1,963,408.700	
NORTHLAND POWER INC	23,490	38.240	898,257.600	
TMX GROUP LTD	5,058	133.450	674,990.100	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	54.070	1,458,321.970	
IVANHOE MINES LTD	61,930	8.680	537,552.400	
INTER PIPELINE LTD	5,884	19.960	117,444.640	
NUTRIEN LTD	52,435	87.520	4,589,111.200	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,346	108.140	1,226,956.440	
WSP GLOBAL INC	12,587	157.750	1,985,599.250	
IA FINANCIAL CORP INC	11,660	72.600	846,516.000	
GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	48.700	802,819.500	
NUVEI CORP	4,960	164.820	817,507.200	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	47.530	515,462.850	
AIR CANADA	17,940	23.090	414,234.600	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	29,456	77.590	2,285,491.040	
SHOPIFY INC	10,821	1,717.340	18,583,336.140	
FIRSTSERVICE CORP	3,503	228.880	801,766.640	

	CANOPY GROWTH CORP	18,634	16.460	306,715.640	
	HYDRO ONE LTD	38,647	30.070	1,162,115.290	
カナダ・ドル 小計		3,931,178		233,108,464.810 (20,998,410,510)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	204,600	3.890	795,894.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	174,700	30.430	5,316,121.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.090	258,076.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.530	656,617.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.725	525,045.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.260	709,574.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	321,553	11.620	3,736,445.860	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.490	2,012,970.780	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.130	810,796.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	114,200	26.290	3,002,318.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.030	284,715.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	17.690	371,490.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.380	794,532.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	203,215	3.390	688,898.850	
シンガポール・ドル 小計		3,192,040		19,963,493.990 (1,657,369,271)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	232,651	9.634	2,241,359.730	
	LOGITECH INTL-REG	18,464	82.140	1,516,632.960	
	NESTLE SA-REGISTERED	278,181	112.460	31,284,235.260	
	CIE FINANC RICHEMONT	49,443	100.200	4,954,188.600	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	67,280	360.600	24,261,168.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	248.700	1,025,141.400	
	SIKA INHABER	14,436	302.700	4,369,777.200	
	SGS SA-REG	646	2,697.000	1,742,262.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	215,524	76.600	16,509,138.400	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	143.300	610,314.700	
	BARRY CALLEBAUT AG	401	2,116.000	848,516.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	17.410	347,834.390	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	537.000	1,336,593.000	
	ABB LTD	164,213	30.690	5,039,696.970	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,053	48.350	582,762.550	
	GEBERIT AG	3,295	687.400	2,264,983.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,019	691.600	4,854,340.400	
	LINDT & SPRUENGLI PART	83	10,770.000	893,910.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	111,000.000	1,221,000.000	
	GIVAUDAN-REG	945	4,262.000	4,027,590.000	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,455	387.500	5,601,312.500		
ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	394.800	1,422,859.200		

	HOLCIM LTD	47,857	44.960	2,151,650.720	
	TEMENOS GROUP	6,753	125.550	847,839.150	
	SONOVA HOLDING AG	5,191	340.100	1,765,459.100	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,894	297.700	1,456,943.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,032	1,669.500	1,722,924.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	245.400	733,991.400	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	48.300	221,793.600	
	SCHINDLER NAMEN	1,671	240.800	402,376.800	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	480.800	1,485,672.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	71.000	177,500.000	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	122.450	643,597.200	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	891.500	501,914.500	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	91.150	732,846.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,105	1,445.000	3,041,725.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,176	63.400	1,469,358.400	
	SWISS RE LTD	27,674	80.700	2,233,291.800	
	ALCON INC	47,022	72.900	3,427,903.800	
	UBS GROUP AG	347,797	15.550	5,408,243.350	
スイス・フラン	小計	1,655,757		145,380,646.880 (17,604,142,531)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	65,891	534.800	35,238,506.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	34,819	448.800	15,626,767.200	
	ERICSSON LM-B SHS	276,371	102.460	28,316,972.660	
	LUNDBERGS B	7,382	480.600	3,547,789.200	
	SKF AB-B SHS	35,049	212.800	7,458,427.200	
	SANDVIK AB	117,110	207.300	24,276,903.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,441	126.100	20,483,810.100	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	217.100	6,871,866.300	
	SWEDBANK AB	89,378	181.580	16,229,257.240	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	48,398	138.000	6,678,924.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	102.500	14,271,075.000	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	199.700	4,731,092.700	
	VOLVO AB-B SHS	127,767	196.980	25,167,543.660	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	75.900	12,017,171.100	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	125.000	5,881,875.000	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	277.200	3,362,713.200	
	INDUSTRIVARDEN C	18,886	268.900	5,078,445.400	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,395	185.800	2,860,391.000	
	SECURITAS AB-B SHS	35,948	139.050	4,998,569.400	
	INVESTOR AB-B SHS	185,463	187.680	34,807,695.840	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	167.380	11,866,572.480	
	ASSA ABLOY AB-B	92,064	249.700	22,988,380.800	
	TELIA CO AB	269,954	35.900	9,691,348.600	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	336.200	6,980,184.400	

	BOLIDEN AB	28,603	293.100	8,383,539.300	
	ALFA LAVAL AB	29,835	321.800	9,600,903.000	
	KINNEVIK AB-B	21,722	308.200	6,694,720.400	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	534.200	4,790,171.400	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	400.200	3,605,401.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,442	104.550	3,496,361.100	
	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	105.450	14,525,421.150	
	HEXAGON AB-B SHS	180,841	129.300	23,382,741.300	
	EPIROC AB-A	70,906	182.600	12,947,435.600	
	EPIROC AB-B	38,943	155.400	6,051,742.200	
	ESSITY AB-B	53,059	265.100	14,065,940.900	
	EQT AB	31,042	362.000	11,237,204.000	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	77.020	3,784,916.840	
	ELECTROLUX AB	15,395	16.976	261,345.520	
	EVOLUTION AB	17,548	1,268.800	22,264,902.400	
	NORDEA BANK ABP	309,007	105.660	32,649,679.620	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	269.100	4,021,699.500	
	SINCH AB	56,299	157.950	8,892,427.050	
スウェーデン・クローナ 小計		3,192,515		520,088,835.360 (6,683,141,534)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,585	1,079.500	11,426,507.500	
	A P MOLLER A/S	568	17,430.000	9,900,240.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	16,530.000	5,636,730.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	107.700	7,401,682.500	
	GENMAB A/S	5,911	2,773.000	16,391,203.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	431.400	8,744,909.400	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,617.000	2,127,621.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	161,686	632.200	102,217,889.200	
	GN STORE NORD A/S	13,407	420.000	5,630,940.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	94,335	222.500	20,989,537.500	
	COLOPLAST-B	10,577	990.000	10,471,230.000	
	DSV A/S	18,937	1,494.000	28,291,878.000	
	DEMANT A/S	10,739	294.500	3,162,635.500	
	TRYG A/S	35,784	147.450	5,276,350.800	
	PANDORA A/S	9,639	814.000	7,846,146.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,263	509.800	6,251,677.400	
	AMBU A/S B	14,156	172.400	2,440,494.400	
	ORSTED A/S	18,161	851.800	15,469,539.800	
デンマーク・クローネ 小計		506,898		269,677,212.000 (4,711,260,894)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.900	870,785.400	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	14.930	738,273.570	
	A2 MILK CO LTD	62,165	6.310	392,261.150	
	FISHER & PAYKEL	57,388	30.250	1,735,987.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.680	747,035.640	

	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.325	390,467.550	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.865	604,048.130	
ニュージーランド・ドル 小計		624,747		5,478,858.440 (427,186,593)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	225.300	9,733,410.600	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	64.080	8,268,626.880	
	TELENOR ASA	67,591	138.600	9,368,112.600	
	SCHIBSTED ASA	7,537	430.900	3,247,693.300	
	ORKLA ASA	60,009	78.160	4,690,303.440	
	EQUINOR ASA	94,630	224.800	21,272,824.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	420.700	6,391,695.100	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	194.900	3,251,516.700	
	ADEVINTA ASA	22,265	149.350	3,325,277.750	
	DNB BANK ASA	91,214	206.000	18,790,084.000	
	SCHIBSTED ASA	7,445	381.800	2,842,501.000	
	ノルウェー・クローネ 小計		554,805		91,182,045.370 (1,199,043,897)
ユーロ	CRH PLC	80,795	40.680	3,286,740.600	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,136	168.900	2,556,470.400	
	KERRY GROUP PLC-A	15,455	116.350	1,798,189.250	
	KINGSPAN GROUP PLC	16,773	87.100	1,460,928.300	
	UMICORE	21,964	50.400	1,106,985.600	
	AIR LIQUIDE	45,651	139.300	6,359,184.300	
	AIRBUS SE	56,165	113.220	6,359,001.300	
	AXA SA	185,618	24.190	4,490,099.420	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	59,416	26.060	1,548,380.960	
	ADIDAS AG	18,120	262.300	4,752,876.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	115,980	18.795	2,179,844.100	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	92.350	272,432.500	
	DANONE	61,596	56.890	3,504,196.440	
	SAFRAN SA	32,279	115.120	3,715,958.480	
	INTESA SANPAOLO	1,547,296	2.517	3,894,544.030	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	35,037	84.680	2,966,933.160	
	ACCOR SA	17,380	31.590	549,034.200	
	BOUYGUES	21,417	35.390	757,947.630	
	BNP PARIBAS	107,999	57.000	6,155,943.000	
	THALES SA	10,448	84.620	884,109.760	
	CAPGEMINI SA	15,126	176.300	2,666,713.800	
	UNICREDIT SPA	217,091	11.994	2,603,789.450	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,356	173.950	2,845,126.200	
	COMMERZBANK AG	106,215	6.257	664,587.250	
	EIFFAGE	8,477	87.180	739,024.860	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	39,680	40.590	1,610,611.200	
	UNITED INTERNET	9,882	32.420	320,374.440	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	38.100	211,302.600	

PUBLICIS GROUPE	19,379	56.860	1,101,889.940	
FAURECIA	10,774	43.130	464,682.620	
IBERDROLA SA	567,470	9.436	5,354,646.920	
ENI SPA	237,532	11.858	2,816,654.450	
JERONIMO MARTINS	34,337	18.105	621,671.380	
KESKO OYJ-B	30,812	29.360	904,640.320	
KBC GROUPE	23,789	80.100	1,905,498.900	
HANNOVER RUECK SE	5,923	153.600	909,772.800	
WARTSILA OYJ	48,612	10.485	509,696.820	
L'OREAL	24,400	357.600	8,725,440.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,708	627.700	16,764,611.600	
GEA GROUP AG	13,061	39.100	510,685.100	
BOLLORE	110,900	5.025	557,272.500	
MEDIOBANCA SPA	57,442	10.220	587,057.240	
MICHELIN(CGDE) -B	15,740	133.500	2,101,290.000	
CONTINENTAL AG	9,904	97.160	962,272.640	
DEUTSCHE POST AG-REG	94,619	52.920	5,007,237.480	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	19.705	417,864.230	
OMV AG	12,817	52.160	668,534.720	
VERBUND AG	6,916	88.550	612,411.800	
PERNOD-RICARD	19,790	197.450	3,907,535.500	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,524	84.080	1,305,257.920	
RENAULT SA	19,019	31.445	598,052.450	
REPSOL SA	152,723	11.582	1,768,837.780	
REMY COINTREAU	1,860	171.600	319,176.000	
MERCK KGAA	12,629	186.450	2,354,677.050	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	47,480	59.890	2,843,577.200	
RWE AG	63,738	30.950	1,972,691.100	
SEB SA	2,439	119.600	291,704.400	
SOCIETE GENERALE-A	74,556	28.255	2,106,579.780	
VINCI S.A.	50,480	90.370	4,561,877.600	
SODEXO	9,325	77.500	722,687.500	
SOFINA	1,382	354.600	490,057.200	
SOLVAY SA	7,183	105.050	754,574.150	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,786	140.760	7,289,397.360	
VIVENDI SE	73,788	11.050	815,357.400	
SAP SE	100,811	117.440	11,839,243.840	
TELEFONICA S.A	527,117	4.025	2,121,645.920	
TOTALENERGIES SE	240,839	43.350	10,440,370.650	
VALEO	19,653	25.850	508,030.050	
E.ON SE	226,220	10.808	2,444,985.760	
VOEST-ALPINE AG	9,875	31.160	307,705.000	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	73.550	762,419.300	
SIEMENS AG-REG	73,572	137.660	10,127,921.520	
UPM-KYMMENE OYJ	54,222	31.110	1,686,846.420	

ING GROEP NV-CVA	372,531	12.640	4,708,791.840	
PUMA AG	10,448	98.500	1,029,128.000	
BAYER AG	93,727	47.750	4,475,464.250	
STORA ENSO OYJ-R SHS	65,747	14.570	957,933.790	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,941	79.260	1,342,743.660	
DAIMLER AG	82,325	80.680	6,641,981.000	
BASF SE	87,434	63.680	5,567,797.120	
BEIERSDORF AG	10,342	93.140	963,253.880	
HEIDELBERGCEMENT AG	15,297	63.740	975,030.780	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	60.360	1,192,351.440	
ASM INTERNATIONAL NV	4,578	319.600	1,463,128.800	
ORANGE	186,186	9.448	1,759,085.320	
SAMPO OYJ-A SHS	44,704	45.090	2,015,703.360	
RANDSTAD NV	11,017	61.760	680,409.920	
ALLIANZ SE	39,827	198.580	7,908,845.660	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.463	1,198,922.460	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,517	29.105	2,838,232.280	
HERMES INTL	3,027	1,212.500	3,670,237.500	
ENDESA S.A.	27,736	18.500	513,116.000	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	75,751	5.769	437,007.510	
ERSTE GROUP BANK AG	25,385	38.940	988,491.900	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,095	243.500	3,188,632.500	
ARCELOR MITTAL (NL)	66,045	25.125	1,659,380.620	
DASSAULT SYSTEMES SA	68,574	43.940	3,013,141.560	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	22.760	520,680.520	
HEINEKEN NV	24,889	91.000	2,264,899.000	
AKZO NOBEL	18,548	92.420	1,714,206.160	
ASML HOLDING NV	40,392	634.600	25,632,763.200	
AEGON NV	189,323	4.557	862,744.910	
VOLKSWAGEN AG	2,753	269.000	740,557.000	
VOLKSWAGEN AG PFD	18,625	190.000	3,538,750.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	627,420	5.930	3,720,600.600	
KERING	7,153	627.000	4,484,931.000	
CNP ASSURANCES	13,987	14.125	197,566.370	
FORTUM OYJ	39,409	26.630	1,049,461.670	
AGEAS	17,055	41.360	705,394.800	
UCB SA	12,778	97.700	1,248,410.600	
NEMETSCHEK SE	5,095	81.920	417,382.400	
CARREFOUR SA	61,189	16.030	980,859.670	
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,156	21.850	746,308.600	
ATOS SE	8,972	44.750	401,497.000	
NOKIA OYJ	509,241	5.075	2,584,398.070	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	86,552	37.275	3,226,225.800	

WOLTERS KLUWER-CVA	24,545	90.320	2,216,904.400	
SANOFI	109,582	84.300	9,237,762.600	
STMICROELECTRONICS NV	71,332	36.030	2,570,091.960	
ELISA OYJ	13,642	53.960	736,122.320	
BANCO SANTANDER SA	1,643,883	3.350	5,507,008.050	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	17.720	840,867.160	
QIAGEN N.V.	21,144	44.050	931,393.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	197,931	11.444	2,265,122.360	
BMW VORZUG	4,471	68.500	306,263.500	
ENEL SPA	779,544	6.919	5,393,664.930	
COLRUYT NV	4,673	43.190	201,826.870	
VOPAK (KON.)	5,364	34.490	185,004.360	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	321,587	16.766	5,391,727.640	
SARTORIUS AG	2,391	503.400	1,203,629.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	48.660	374,000.760	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	124,000	35.700	4,426,800.000	
RATIONAL AG	479	734.000	351,586.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	161.850	610,336.350	
BECHTLE AG	7,533	53.800	405,275.400	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.702	922,589.790	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,226	105.800	1,399,310.800	
TELEPERFORMANCE	5,344	338.800	1,810,547.200	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,819	146.700	2,614,047.300	
EURAZEO	3,008	82.050	246,806.400	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,395	96.200	1,192,399.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,883	75.900	826,019.700	
INDITEX	102,245	31.320	3,202,313.400	
ESSILORLUXOTTICA	27,129	163.660	4,439,932.140	
SNAM SPA	198,963	4.789	952,833.800	
CREDIT AGRICOLE SA	127,883	12.830	1,640,738.890	
ORPEA	4,932	91.220	449,897.040	
ENAGAS	23,477	19.500	457,801.500	
WENDEL	2,220	118.300	262,626.000	
TENARIS SA	52,985	9.586	507,914.210	
TELECOM ITALIA SPA	1,123,551	0.343	385,377.990	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.357	177,641.770	
ATLANTIA SPA	45,299	16.190	733,390.810	
PROXIMUS	13,739	17.445	239,676.850	
TERNA SPA	108,374	6.244	676,687.250	
BIOMERIEUX	3,248	98.100	318,628.800	
GRIFOLS SA	30,687	20.300	622,946.100	
FERROVIAL SA	46,794	26.120	1,222,259.280	
LANXESS AG	7,194	56.380	405,597.720	
NESTE OYJ	39,808	47.630	1,896,055.040	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	24.100	431,655.100	
RECORDATI SPA	10,303	48.890	503,713.670	

DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	12.415	686,599.160	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,809	200.600	964,685.400	
KONE OYJ	35,976	60.160	2,164,316.160	
ELIA GROUP	2,862	104.300	298,506.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,771	434.200	1,203,168.200	
ENGIE	178,037	11.598	2,064,873.120	
ALSTOM	30,600	31.260	956,556.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	12.135	664,731.030	
IPSEN SA	3,646	85.340	311,149.640	
DEUTSCHE WOHNEN	30,724	52.920	1,625,914.080	
ARKEMA SA	6,393	110.200	704,508.600	
LEGRAND SA	24,356	90.200	2,196,911.200	
AMPLIFON SPA	11,372	41.300	469,663.600	
ADP	2,313	111.350	257,552.550	
ORION OYJ	8,051	34.730	279,611.230	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.065	403,485.720	
SYMRISE AG	12,698	112.600	1,429,794.800	
SCOR SE	15,667	23.820	373,187.940	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	45.010	1,090,502.280	
PRYSMIAN SPA	28,236	29.460	831,832.560	
DIASORIN SPA	2,223	172.100	382,578.300	
CAIXABANK	496,448	2.721	1,350,835.000	
BUREAU VERITAS SA	29,810	26.400	786,984.000	
GETLINK	50,458	13.335	672,857.430	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	20.520	573,985.440	
SUEZ SA	34,245	19.720	675,311.400	
AMADEUS IT GROUP SA	42,083	58.260	2,451,755.580	
BRENTAG SE	13,072	82.040	1,072,426.880	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	27.240	635,781.600	
EDENRED	24,865	46.510	1,156,471.150	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.311	227,367.730	
LEG IMMOBILIEN SE	8,287	123.100	1,020,129.700	
KION GROUP AG	7,508	80.060	601,090.480	
VONOVIA SE	51,295	51.380	2,635,537.100	
KNORR-BREMSE AG	6,860	90.820	623,025.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	26,679	55.520	1,481,218.080	
FERRARI NV	12,037	184.500	2,220,826.500	
CNH INDUSTRIAL NV	101,681	14.375	1,461,664.370	
AROUNDTOWN SA	106,018	5.922	627,838.590	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	44.000	356,048.000	
MONCLER SPA	21,870	56.440	1,234,342.800	
NEXI SPA	43,586	16.235	707,618.710	
TEAMVIEWER AG	13,668	15.900	217,321.200	
PROSUS NV	88,845	71.750	6,374,628.750	
JDE PEET'S BV	7,308	25.170	183,942.360	

	SIEMENS ENERGY AG	46,176	22.010	1,016,333.760	
	INPOST SA	20,395	13.600	277,372.000	
	WORLDLINE SA	23,570	67.010	1,579,425.700	
	NN GROUP NV	28,556	45.530	1,300,154.680	
	FINECOBANK SPA	51,807	15.805	818,809.630	
	ARGENX SE	4,403	255.300	1,124,085.900	
	DEUTSCHE LUFTHANSA AG-RTS	27,990	2.150	60,178.500	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	73,788	25.050	1,848,389.400	
	ZALANDO SE	20,080	77.280	1,551,782.400	
	STELLANTIS NV	194,081	16.674	3,236,106.590	
	AENA SME SA	7,240	144.400	1,045,456.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	47,032	52.020	2,446,604.640	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,807	66.330	1,114,808.310	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	12.076	413,615.070	
	EXOR NV	9,966	73.340	730,906.440	
	SCOUT24 AG	9,670	58.340	564,147.800	
	COVESTRO AG	19,158	57.500	1,101,585.000	
	HELLOFRESH SE	15,029	80.000	1,202,320.000	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,646	47.515	3,451,774.690	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	12.180	679,022.820	
	AMUNDI SA	5,924	74.500	441,338.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	39,494	9.466	373,850.200	
	ADYEN NV	1,886	2,397.000	4,520,742.000	
	UNIPER SE	10,427	36.680	382,462.360	
	DELIVERY HERO SE	16,642	108.000	1,797,336.000	
	ユーロ 小計	18,623,386		461,815,356.980 (60,035,996,407)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.780	2,915,920.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	75.150	12,174,300.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	45,000	43.300	1,948,500.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	114,740	472.000	54,157,280.000	
	MTR CORP	179,500	42.500	7,628,750.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	141.800	10,748,440.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	123,450	32.300	3,987,435.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	45.850	6,694,100.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,041,456	11.760	12,247,522.560	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	39.950	8,948,800.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	431,500	24.300	10,485,450.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	34.150	5,568,703.900	
	SINO LAND CO	273,400	10.780	2,947,252.000	

SUN HUNG KAI PROPERTIES	116,000	101.700	11,797,200.000	
SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	49.000	2,425,500.000	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	142,000	150.800	21,413,600.000	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	21.350	3,544,100.000	
SJM HOLDINGS LTD	156,000	5.400	842,400.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	6.510	809,844.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	15.820	3,436,104.000	
AIA GROUP LTD	1,160,627	90.000	104,456,430.000	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.700	4,761,500.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	16.020	4,037,040.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	23.350	3,105,550.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	20.750	2,162,150.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	41.350	6,192,162.500	
ESR CAYMAN LTD	203,800	22.950	4,677,210.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.720	1,775,600.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	20.350	3,064,710.000	
WH GROUP LTD	897,000	5.380	4,825,860.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	254,332	52.600	13,377,863.200	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	45.550	10,241,097.600	
香港・ドル 小計	8,320,153		347,398,374.760 (5,012,958,548)	
合計	106,473,159		579,243,944,914 (579,243,944,914)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	118,215.000	1,235,346.750	
		GOODMAN GROUP	151,155.000	3,210,532.200	
		GPT GROUP	207,292.000	1,034,387.080	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,192,680.000	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,460,602.500	
		STOCKLAND	243,481.000	1,085,925.260	
	VICINITY CENTRES	371,711.000	637,484.360		
	オーストラリア・ドル 小計		1,991,229.000	9,856,958.150 (810,143,391)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	241,306.000	721,504.940	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		556,577.000	1,179,943.240		

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	401,907.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	534,798.000	
	シンガポール・ドル	小計	1,260,283.000	2,838,153.180 (235,623,477)	
投資信託受益証券 合計			3,251,512	1,045,766,868 (1,045,766,868)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,214.000	712,729.680	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,037.000	2,701,280.280	
		AMERICAN TOWER CORP	43,878.000	11,499,546.240	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	129,689.000	1,102,356.500	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,168.000	2,947,656.800	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,656,403.650	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,581.000	1,294,100.610	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	41,582.000	7,061,455.240	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	26,819.000	3,772,360.540	
		DUKE REALTY TRUST	35,962.000	1,812,484.800	
		EQUINIX INC	8,562.000	6,429,719.520	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,134.000	1,534,929.480	
		EQUITY RESIDENTIAL	33,311.000	2,755,819.030	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,408.000	2,092,916.880	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,714.000	2,174,983.980	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,781,893.620	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,637.000	1,063,925.020	
		INVITATION HOMES INC	50,968.000	1,963,287.360	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,212,397.200	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	49,268.000	971,564.960	
		MID AMERICA	11,430.000	2,185,187.400	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	590,052.450	
		PROLOGIS INC	71,279.000	9,161,489.870	
		PUBLIC STORAGE	15,087.000	4,521,875.640	
		REALTY INCOME CORP	34,406.000	2,312,083.200	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	1,006,665.570	
SBA COMMUNICATIONS CORP	10,323.000	3,405,144.780			
SIMON PROPERTY GROUP INC	31,326.000	4,137,538.080			
SUN COMMUNITIES INC	10,801.000	2,026,375.610			
UDR INC	25,993.000	1,378,668.720			
VENTAS INC	40,460.000	2,208,306.800			
VEREIT INC	25,604.000	1,203,644.040			
VICI PROPERTIES INC	59,521.000	1,739,798.830			

	VORNADO REALTY TRUST	17,313.000	758,482.530	
	WELLTOWER INC	39,658.000	3,279,320.020	
	WEYERHAEUSER CO	71,903.000	2,607,202.780	
	WP CAREY INC	15,064.000	1,125,582.080	
アメリカ・ドル	小計	1,213,584.000	100,189,229.790 (11,251,250,504)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	111,148.000	547,515.040	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	510,052.920	
	SEGR0 PLC	116,375.000	1,397,663.750	
イギリス・ポンド	小計	301,551.000	2,455,231.710 (376,067,841)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	481,692.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	298,967.400	
カナダ・ドル	小計	21,687.000	780,659.400 (70,321,799)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	336,388.820	
	GECINA SA	4,763.000	559,414.350	
	KLEPIERRE	17,099.000	325,650.450	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	813,960.000	
ユーロ	小計	39,445.000	2,035,413.620 (264,603,771)	
香港・ドル	LINK REIT	186,700.000	12,415,550.000	
香港・ドル	小計	186,700.000	12,415,550.000 (179,156,387)	
投資証券	合計	1,762,967	12,141,400,302 (12,141,400,302)	
合計			13,187,167,170 (13,187,167,170)	

(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 598銘柄	70.22	-	-	73.14
	投資証券 37銘柄	-	-	1.87	
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	4.36	-	-	4.49
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シェケル	株式 8銘柄	0.11	-	-	0.11
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	2.00	-	-	2.16
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.49	-	-	3.56

	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	2.93	-	-	2.97
スウェーデン・クローナ	株式	42銘柄	1.11	-	-	1.13
デンマーク・クローネ	株式	18銘柄	0.78	-	-	0.80
ニュージーランド・ドル	株式	7銘柄	0.07	-	-	0.07
ノルウェー・クローネ	株式	11銘柄	0.20	-	-	0.20
ユーロ	株式	232銘柄	9.99	-	-	10.18
	投資証券	4銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式	32銘柄	0.83	-	-	0.88
	投資証券	1銘柄	-	-	0.03	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

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10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,796,693,899
コール・ローン	240,351,313
国債証券	109,729,406,777
派生商品評価勘定	28,853
未収利息	804,077,591
前払費用	404,393,703
流動資産合計	112,974,952,136
資産合計	112,974,952,136
負債の部	
流動負債	
未払解約金	5,284,000
流動負債合計	5,284,000
負債合計	5,284,000
純資産の部	
元本等	
元本	52,108,476,220
剰余金	
剰余金又は欠損金()	60,861,191,916
元本等合計	112,969,668,136
純資産合計	112,969,668,136
負債純資産合計	112,974,952,136

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4月13日 至 2021年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	72,336,650,576円
同期中追加設定元本額	41,253,795,027円
同期中一部解約元本額	61,481,969,383円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	194,420,613円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,320,051,429円
たわらノーロード バランス（堅実型）	103,654,063円
たわらノーロード バランス（標準型）	274,694,713円
たわらノーロード バランス（積極型）	111,530,367円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	915,550円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,174,235円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	17,433,156円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,898,683円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,438,597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
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	204,918,926円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	287,009,284円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	572,420,121円
投資のソムリエ	9,266,814,487円
クルーズコントロール	152,509,762円
投資のソムリエ<DC年金>	475,951,576円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	231,321,435円
D I A Mコア資産設計ファンド（堅実型）	982,226円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	2,851,407円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	414,183,657円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,902,289,843円
ワールドアセットバランス（基本コース）	616,051,120円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,913,576,171円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	20,518,834円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,786,293円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,066,652円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	64,563,147円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,598,607,111円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	205,554,731円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	16,347,448円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,896,649円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,421,939円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	59,263円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	20,906,365,986円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	253,561,940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)	2,823,407,922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)	650,181,306円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,684,952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)	8,830,345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)	176,970,863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)	86,593,605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)	2,718,644,711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	52,108,476,220円
2. 受益権の総数	52,108,476,220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4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月11日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	3,037,525,648	
合計	3,037,525,648	

(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10月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月11日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	400,000,000	-	400,028,853	28,853
	400,000,000	-	400,028,853	28,853
合計	400,000,000	-	400,028,853	28,853

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表さ

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2021年10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1680円 (21,680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10月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	7,000,000.000	7,155,470.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	12,000,000.000	11,589,480.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	8,180,800.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	12,800,000.000	13,445,696.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	13,000,000.000	11,467,430.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	10,025,532.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	7,100,000.000	7,151,901.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	9,600,000.000	9,531,936.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,800,000.000	8,945,703.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	5,300,000.000	6,364,584.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	4,200,000.000	5,532,240.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,887,200.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	6,639,325.000	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	10,000,000.000	9,422,600.000	
		COLOMBIA 3.875 02/15/61	5,000,000.000	4,113,900.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,100,000.000	6,388,255.500	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	4,387,250.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	9,000,000.000	9,658,215.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	7,000,000.000	7,427,490.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,000,000.000	13,869,100.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	7,001,400.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,000,000.000	8,479,120.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	10,000,000.000	11,134,650.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	8,400,000.000	8,987,403.600	
		CROATIA 6.0 01/26/24	10,400,000.000	11,589,084.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	8,358,000.000	8,901,687.900	
HUNGARY 5.375 03/25/24	9,380,000.000	10,393,771.640			
HUNGARY 5.75 11/22/23	11,000,000.000	12,146,552.000			

HUNGARY 7.625 03/29/41	5,000,000.000	8,214,625.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	5,000,000.000	4,739,400.000	
INDONESIA 2.85 02/14/30	4,000,000.000	4,106,440.000	
INDONESIA 3.05 03/12/51	6,000,000.000	5,580,330.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,000,000.000	3,202,905.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	5,200,000.000	5,604,274.000	
INDONESIA 3.7 10/30/49	3,000,000.000	2,977,019.730	
INDONESIA 3.85 10/15/30	5,000,000.000	5,529,825.650	
INDONESIA 4.1 04/24/28	6,000,000.000	6,691,200.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	8,800,000.000	9,601,196.000	
INDONESIA 4.2 10/15/50	6,000,000.000	6,501,300.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,612,586.500	
INDONESIA 4.35 01/11/48	6,000,000.000	6,503,910.000	
INDONESIA 4.45 04/15/70	4,000,000.000	4,433,569.800	
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,800,000.000	8,821,098.000	
INDONESIA 4.75 02/11/29	6,000,000.000	6,945,330.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	6,400,000.000	7,569,805.760	
INDONESIA 5.25 01/17/42	7,300,000.000	8,699,705.650	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	3,737,941.350	
INDONESIA 5.875 01/15/24	7,200,000.000	8,003,376.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	4,237,552.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,500,000.000	9,195,355.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	9,519,640.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	9,000,000.000	8,381,340.000	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	8,175,200.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,569,096.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,100,000.000	6,602,365.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	9,000,000.000	9,562,050.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	9,902,826.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	6,900,000.000	9,045,210.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	5,856,048.000	
PERU 1.862 12/01/32	7,000,000.000	6,396,320.000	
PERU 2.392 01/23/26	6,000,000.000	6,132,360.000	
PERU 2.78 12/01/60	9,000,000.000	7,648,290.000	
PERU 2.783 01/23/31	13,000,000.000	13,000,130.000	
PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,061,800.000	
PERU 3.3 03/11/41	5,000,000.000	4,895,600.000	
PERU 5.625 11/18/50	9,000,000.000	12,163,680.000	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	4,000,000.000	3,763,084.360	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	2,000,000.000	2,024,630.000	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	5,000,000.000	4,466,344.900	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	4,000,000.000	3,725,351.800	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	10,590,600.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	6,205,770.000	

PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,517,475.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,247,508.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,800,000.000	6,214,961.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,800,000.000	5,773,326.090	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	8,000,000.000	10,846,316.960	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	11,474,500.500	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,800,000.000	10,396,564.600	
ROMANIA 3.0 02/14/31	6,000,000.000	6,043,500.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	9,000,000.000	8,847,099.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	5,600,000.000	6,068,092.800	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	5,348,259.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	6,400,000.000	8,216,172.800	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	9,243,000.000	10,744,987.500	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,400,000.000	10,430,935.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	12,400,000.000	13,990,920.000	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	14,400,000.000	16,174,195.200	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,400,000.000	9,047,186.400	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	14,000,000.000	16,553,264.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	22,000,000.000	27,426,300.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	11,000,000.000	14,044,437.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,200,000.000	6,933,160.000	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	8,200,000.000	8,244,444.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	9,000,000.000	9,238,230.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	7,400,000.000	7,902,948.400	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,200,000.000	3,959,424.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	9,000,000.000	8,465,400.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,094,665.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	7,400,000.000	8,143,182.000	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	10,307,192.400	

	SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	3,000,000.000	3,052,710.000	
	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	12,000,000.000	11,520,120.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	8,000,000.000	8,191,280.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,200,000.000	7,842,816.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	7,200,000.000	7,814,340.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	10,000,000.000	8,649,800.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	10,000,000.000	8,818,850.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	5,000,000.000	5,502,300.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	8,000,000.000	8,962,560.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	9,400,000.000	10,592,719.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	7,000,000.000	7,095,200.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	11,000,000.000	12,323,575.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,000,000.000	8,283,120.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	7,400,000.000	7,656,225.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	12,000,000.000	13,434,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	7,000,000.000	7,659,890.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	11,114,964.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	8,900,000.000	10,886,213.000	
	アメリカ・ドル 小計	898,481,000.000 (100,899,416,300)	977,109,588.390 (109,729,406,777)	
国債証券	合計	100,899,416,300 (100,899,416,300)	109,729,406,777 (109,729,406,777)	
合計			109,729,406,777 (109,729,406,777)	

(注)

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

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
----	-----	---------------------	----------------------------

アメリカ・ドル	国債証券	119銘柄	97.13	100.00
---------	------	-------	-------	--------

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年10月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,009,423,658
コール・ローン	175,863,750
株式	55,018,005,321
投資信託受益証券	361,904,326
投資証券	52,624,417
派生商品評価勘定	35,373,593
未収入金	418,282
未収配当金	79,010,443
差入委託証拠金	2,811,448,422
流動資産合計	62,544,072,212
資産合計	
62,544,072,212	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	155,924,206
未払金	190,036
未払解約金	12,721,000
流動負債合計	168,835,242
負債合計	
168,835,242	
純資産の部	
元本等	
元本	43,180,746,428
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,194,490,542
元本等合計	62,375,236,970
純資産合計	
62,375,236,970	
負債純資産合計	
62,544,072,212	

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4月13日 至 2021年10月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	39,218,738,833円
同期中追加設定元本額	18,820,625,906円
同期中一部解約元本額	14,858,618,311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>	7,743,205,706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)	339,970,661円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,331,193円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	9,322,518円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	17,289,832円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,190,775円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,140,253円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,141,080円
たわらノーロード 新興国株式	8,209,456,678円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,588,725,078円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,025,874,786円
たわらノーロード バランス(堅実型)	19,827,635円
たわらノーロード バランス(標準型)	69,939,418円
たわらノーロード バランス(積極型)	113,849,915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)	93,091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)	76,329,615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)	242,431,675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)	155,343,308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)	259,462,599円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	396,725円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,558,466円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,728,452円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,935,782円
たわらノーロード 全世界株式	79,039,899円
One DC 新興国株式インデックスファンド	327,284,758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)	440,413,913円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	870,992,125円
投資のソムリエ	8,904,846,709円
クルーズコントロール	389,636,125円
投資のソムリエ<DC年金>	381,656,777円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	354,164,633円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	3,634,373円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	10,431,178円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	169,068,363円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,721,776,183円
ワールドアセットバランス(基本コース)	852,740,991円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,764,363,298円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	45,636,921円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	23,991,159円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,620,763円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	52,401,860円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,183,601,888円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	314,746,527円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	32,529,600円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	17,557,227円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,279,653円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	132,614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)	13,425,708円

投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	207,878,970円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,216,082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)	271,018,513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)	132,363,000円
計	43,180,746,428円
2. 受益権の総数	43,180,746,428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4月13日 至 2021年10月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月11日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,797,015,262	
投資信託受益証券	22,130,497	
投資証券	2,112,571	
合計	2,821,258,330	

(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10月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,595,644	-	1,604,214	8,570
ブラジル・リアル	1,595,644	-	1,604,214	8,570
買建	267,065,164	-	267,411,825	346,661
アメリカ・ドル	267,065,164	-	267,411,825	346,661
合計	268,660,808	-	269,016,039	338,091

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2021年10月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	7,250,658,484	-	7,129,769,780	120,888,704
合計	7,250,658,484	-	7,129,769,780	120,888,704

(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10月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4445円 (14,445円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	31,008	31.820	986,674.560	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,584	7.700	143,096.800	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.560	134,607.600	
	CREDICORP LTD	4,299	126.940	545,715.060	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	35,762	9.580	342,599.960	
	NETEASE INC-ADR	24,534	96.320	2,363,114.880	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,706	58.600	334,371.600	
	YPF SA ADR	4,248	4.820	20,475.360	
	LUKOIL SPON ADR	26,074	100.900	2,630,866.600	
	GAZPROM PAO ADR	373,371	10.180	3,800,916.780	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	128,421	2.745	352,515.640	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.918	88,484.180	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	53,984	5.015	270,729.760	
	51JOB INC ADR	2,101	69.340	145,683.340	

X5 RETAIL GROUP NV GDR	9,970	33.630	335,291.100	
NOVATEK PJSC GDR	5,665	265.500	1,504,057.500	
BAIDU INC -SPON ADR	17,099	162.090	2,771,576.910	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	10,730	30.820	330,698.600	
MMC NORILSK NICKEL ADR	39,954	31.560	1,260,948.240	
ROSNEFT OIL CO GDR	82,771	8.776	726,398.290	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	92,139	2.140	197,177.460	
SEVERSTAL GDR	15,471	22.060	341,290.260	
TATNEFT ADR	14,663	47.450	695,759.350	
VTB BANK OJSC GDR	112,000	1.480	165,760.000	
MAGNIT PJSC GDR	24,369	17.645	429,991.000	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,455	11.300	344,141.500	
21VIANET GROUP INC ADR	8,615	17.340	149,384.100	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	4.760	117,229.280	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	9,858	20.380	200,906.040	
YANDEX NV	18,811	79.630	1,497,919.930	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,716	36.380	62,428.080	
SBERBANK ADR	171,838	20.740	3,563,920.120	
PHOSAGRO PJSC GDR	11,773	24.200	284,906.600	
ADECOAGRO SA	5,000	8.780	43,900.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	10,564	49.020	517,847.280	
JOYY INC-ADR	3,647	55.780	203,429.660	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	3,303	56.000	184,968.000	
GDS HOLDINGS LTD ADR	5,777	59.800	345,464.600	
ZAI LAB LTD ADR	5,172	102.350	529,354.200	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	7,429	99.400	738,442.600	
HUYA INC ADR	4,204	9.550	40,148.200	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	21.250	123,526.250	
BILIBILI INC ADR	10,935	70.960	775,947.600	
NIO INC ADR	84,613	35.830	3,031,683.790	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	46,711	7.690	359,207.590	
AUTOHOME INC ADR	4,096	50.650	207,462.400	
UP FINTECH HOLDING LTD ADR	5,517	10.700	59,031.900	
GAOTU TECHEDU INC ADR	4,275	3.360	14,364.000	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNOLOGY CO LTD ADR	7,893	3.840	30,309.120	
I-MAB ADR	2,148	71.010	152,529.480	
WEIBO CORP ADR	4,386	48.560	212,984.160	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	28.450	82,817.950	
BURNING ROCK BIOTECH LTD ADR	2,868	16.230	46,547.640	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	36,000	4.860	174,960.000	

	DIDI GLOBAL INC ADR	18,000	8.170	147,060.000	
	KE HOLDINGS INC ADR	24,318	19.400	471,769.200	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	9.350	59,241.600	
	DADA NEXUS LTD ADR	4,179	20.570	85,962.030	
	JD.COM INC ADR	53,917	78.610	4,238,415.370	
	AGORA INC ADR	3,131	27.680	86,666.080	
	LI AUTO INC ADR	33,077	28.490	942,363.730	
	XPENG INC ADR	23,630	37.660	889,905.800	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	2,945	49.260	145,070.700	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	11,272	7.530	84,878.160	
	GLOBANT SA	2,499	271.320	678,028.680	
	HELLO GROUP INC ADR	12,641	11.280	142,590.480	
	BAOZUN INC-SPN ADR	4,490	19.350	86,881.500	
	PINDUODUO INC ADR	27,210	96.220	2,618,146.200	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	25,809	59.300	1,530,473.700	
	IQIYI INC ADR	15,440	8.790	135,717.600	
	POLYUS PJSC GDR	5,259	86.000	452,274.000	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	6,136	33.250	204,022.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	26,464	31.710	839,173.440	
	BEIGENE LTD ADR	2,832	363.240	1,028,695.680	
アメリカ・ドル	小計	2,104,062		49,881,898.850 (5,601,737,241)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	5.630	643,334.470	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	99,831	4.950	494,163.450	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	107,901	24.680	2,662,996.680	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	176,404	7.570	1,335,378.280	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	271,412	17.520	4,755,138.240	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	202,262	3.990	807,025.380	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	224,384	4.090	917,730.560	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	153,780	13.000	1,999,140.000	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	159,897	4.270	682,760.190	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,510,140		14,297,667.250 (437,794,571)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	22,504	12.795	287,938.680	
イギリス・ポンド	小計	22,504		287,938.680 (44,103,568)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	177,831	2,671.250	475,031,058.750	

BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50,649	449.450	22,764,193.050	
ASIAN PAINTS LTD	23,422	3,306.900	77,454,211.800	
EICHER MOTORS LTD	8,743	2,817.950	24,637,336.850	
GRASIM INDUSTRIES LTD	14,918	1,598.800	23,850,898.400	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	52,685	877.800	46,246,893.000	
SHREE CEMENT LTD	756	27,757.150	20,984,405.400	
ICICI BANK LTD	317,600	703.400	223,399,840.000	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	37,298	318.050	11,862,628.900	
STATE BANK OF INDIA LTD	108,404	458.000	49,649,032.000	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,888	685.050	12,939,224.400	
TATA STEEL LTD	42,591	1,301.150	55,417,279.650	
TATA MOTORS LTD	99,865	382.950	38,243,301.750	
JSW STEEL LTD	56,966	665.850	37,930,811.100	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	37,935	818.750	31,059,281.250	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	6,220	3,883.300	24,154,126.000	
NESTLE INDIA LTD	1,991	18,986.450	37,802,021.950	
GAIL INDIA LTD	119,463	158.150	18,893,073.450	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	34,219	1,936.350	66,259,960.650	
VEDANTA LTD	77,294	294.050	22,728,300.700	
AXIS BANK LTD	139,811	781.950	109,325,211.450	
TITAN COMPANY LTD	21,784	2,358.200	51,371,028.800	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	155,474	160.950	25,023,540.300	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	6,531	1,687.650	11,022,042.150	
BHARAT ELECTRONICS LTD	82,654	200.150	16,543,198.100	
LUPIN LTD	17,003	947.300	16,106,941.900	
ACC LTD	5,706	2,240.900	12,786,575.400	
BAJAJ FINANCE LTD	16,713	7,732.200	129,228,258.600	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	106,400	2,720.650	289,477,160.000	
INFOSYS LTD	211,991	1,723.850	365,440,685.350	
WIPRO LTD	83,147	661.150	54,972,639.050	
MRF LTD	160	85,860.450	13,737,672.000	
INDIAN OIL CORP LTD	125,755	131.800	16,574,509.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	50,910	2,640.050	134,404,945.500	
TRENT LTD	9,385	1,103.350	10,354,939.750	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	5,713	4,379.250	25,018,655.250	
HCL TECHNOLOGIES LTD	66,381	1,322.150	87,765,639.150	
DABUR INDIA LTD	39,316	607.000	23,864,812.000	
HERO MOTOCORP LTD	7,629	2,842.100	21,682,380.900	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,578.900	16,394,067.300	

DR REDDYS LABORATORIES LTD	6,974	4,849.200	33,818,320.800	
IPCA LABORATORIES LTD	5,552	2,334.700	12,962,254.400	
BHARTI AIRTEL LTD	153,370	695.500	106,668,835.000	
UNITED SPIRITS LTD	16,044	914.350	14,669,831.400	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	50,456	821.400	41,444,558.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	7,881	5,071.300	39,966,915.300	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,311	7,430.000	61,750,730.000	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,868	714.750	13,485,903.000	
HAVELLS INDIA LTD	14,378	1,371.450	19,718,708.100	
INDRAPRASTHA GAS LTD	22,037	518.400	11,423,980.800	
BIOCON LTD	21,168	358.750	7,594,020.000	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	88,501	237.150	20,988,012.150	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,071	1,330.950	18,727,797.450	
PETRONET LNG LTD	52,703	227.800	12,005,743.400	
CIPLA LTD/INDIA	30,575	917.100	28,040,332.500	
LARSEN & TOUBRO LTD	42,199	1,726.900	72,873,453.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,984	7,335.750	43,897,128.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	57,472	3,935.650	226,189,676.800	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,203	1,547.900	26,628,523.700	
NTPC LTD	292,756	141.100	41,307,871.600	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,805	2,736.250	15,883,931.250	
YES BANK LTD	714,850	13.200	9,436,020.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	48,819	403.050	19,676,497.950	
BHARAT FORGE LTD	18,024	758.600	13,673,006.400	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	91,923	473.650	43,539,328.950	
ITC LTD	181,602	231.700	42,077,183.400	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,676	2,441.600	21,183,321.600	
UNITED PHOSPHORUS LTD	31,183	738.000	23,013,054.000	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,929	3,075.300	12,082,853.700	
SIEMENS INDIA LTD	3,637	2,223.450	8,086,687.650	
INFO EDGE INDIA LTD	4,882	6,670.950	32,567,577.900	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	25,397	1,019.300	25,887,162.100	
TECH MAHINDRA LTD	37,689	1,439.950	54,270,275.550	
MARICO LTD	37,095	563.800	20,914,161.000	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	36,715.800	13,878,572.400	
DLF LTD	33,709	415.850	14,017,887.650	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	188,388	187.700	35,360,427.600	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,292	739.900	23,152,950.800	
REC LTD	45,037	157.750	7,104,586.750	
BAJAJ FINSERV LTD	2,291	17,549.450	40,205,789.950	

BAJAJ AUTO LTD	4,914	3,815.550	18,749,612.700	
JUBILANT FOODWORKS LTD	5,592	4,006.800	22,406,025.600	
MUTHOOT FINANCE LTD	8,810	1,519.650	13,388,116.500	
COAL INDIA LTD	100,287	188.450	18,899,085.150	
INDUS TOWERS LTD	37,374	305.000	11,399,070.000	
PI INDUSTRIES LTD	6,020	3,282.350	19,759,747.000	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	3,823	5,983.550	22,875,111.650	
ADANI GREEN ENERGY LTD	23,447	1,176.550	27,586,567.850	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	55,353	722.100	39,970,401.300	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,012	2,893.750	11,609,725.000	
BANDHAN BANK LTD	38,990	345.800	13,482,742.000	
ADANI TOTAL GAS LTD	16,897	1,394.100	23,556,107.700	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,249	569.100	15,507,405.900	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	16,624	1,139.850	18,948,866.400	
BHARTI AIRTEL LTD-RTS	11,863	208.750	2,476,401.250	
BERGER PAINTS INDIA LTD	12,556	830.350	10,425,874.600	
ADANI TRANSMISSIONS LTD	16,803	1,678.700	28,207,196.100	
AVENUE SUPERMARTS LTD	9,719	4,407.950	42,840,866.050	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	16,026	1,529.400	24,510,164.400	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	27,604	660.150	18,222,780.600	
INTERGLOBE AVIATION LTD	4,893	1,962.500	9,602,512.500	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	26,396	1,196.450	31,581,494.200	
インド・ルピー 小計	5,362,919		4,528,582,527.950 (6,792,873,792)	
インドネシ ア・ルピア				
ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,340.000	1,337,778,000.000	
BARITO PACIFIC TBK PT	1,470,900	965.000	1,419,418,500.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	133,301	26,125.000	3,482,488,625.000	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,700.000	2,364,430,000.000	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	480,500	4,760.000	2,287,180,000.000	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,306,700	5,900.000	7,709,530,000.000	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	2,985,200	3,800.000	11,343,760,000.000	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	392,800	6,300.000	2,474,640,000.000	
GUDANG GARAM TBK PT	32,400	34,650.000	1,122,660,000.000	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	67,800	10,175.000	689,865,000.000	

	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	8,600.000	1,640,880,000.000	
	BANK MANDIRI	1,183,100	6,900.000	8,163,390,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,140,500	4,160.000	17,224,480,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	572,200	6,150.000	3,519,030,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	959,700	1,380.000	1,324,386,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	149,800	8,075.000	1,209,635,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	678,100	36,450.000	24,716,745,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,815.000	1,695,391,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,900.000	1,468,500,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	2,910.000	1,551,903,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,250.000	2,147,875,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	825,100	2,740.000	2,260,774,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	19,844,201		101,154,739,625.000 (799,122,443)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	100.660	889,029.120	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	11.470	68,131.800	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	37.070	111,210.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	12.180	146,160.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	5,200	156.900	815,880.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	7,540	24.860	187,444.400	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	7.630	124,369.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.900	227,290.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	23.250	93,000.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	173.320	207,984.000	
	JOYOUNG CO LTD	5,100	22.270	113,577.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	3,900	37.380	145,782.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	29.020	217,650.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	288.150	605,115.000	

ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	23.050	238,106.500	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	16.640	109,824.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	47.560	252,068.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	14.720	86,848.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	20.890	398,999.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	3.480	82,824.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	17.350	114,510.000	
GEM CO LTD	29,100	11.220	326,502.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	126.140	327,964.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	59.660	411,654.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	7.450	138,570.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	6,500	150.200	976,300.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	23.640	202,547.520	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	34.900	206,049.600	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	26.630	185,344.800	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	16.870	44,874.200	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	22.230	146,718.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	38.290	130,186.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	33.410	170,391.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	14.990	22,485.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	13.110	34,086.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	67.290	309,534.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	3,000	46.230	138,690.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	12.880	141,680.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	20.960	176,064.000	

MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,800	54.700	918,960.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	7,200	146.140	1,052,208.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	17.690	318,420.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	15.660	159,732.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	13.710	153,552.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	8.760	275,064.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.390	63,784.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	5.080	72,644.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	14.520	39,639.600	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	18.320	47,632.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	28.550	222,690.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	19.270	968,317.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	29.360	176,160.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	192.960	617,472.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	29.080	103,815.600	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	17.030	253,747.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.020	127,254.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	8.520	73,272.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	9.440	346,448.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	23,381	53.180	1,243,401.580	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	37.120	400,896.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	71.480	40,028.800	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	27.360	188,784.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.790	259,378.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	35.490	173,901.000	

GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.270	157,131.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	8.020	168,420.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	32.650	244,875.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	50.390	251,950.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	21.470	141,702.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	4,800	225.330	1,081,584.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	64.160	712,176.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.100	121,095.000	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.730	154,521.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	15,300	46.200	706,860.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	14.870	88,327.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,320	26.580	141,405.600	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	4.830	77,280.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	122.100	256,410.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	9.660	352,396.800	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.560	136,708.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	37.680	1,155,042.720	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.620	182,050.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	7.630	339,535.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	14.910	296,709.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	24.100	575,990.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.740	29,412.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	54.820	740,070.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.770	290,019.000	
GOERTEK INC	8,700	42.700	371,490.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.810	166,353.000	

BANK OF NINGBO CO LTD	19,100	36.260	692,566.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	21.210	309,666.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	6.480	307,152.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.740	219,042.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	7.210	271,096.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	17,360	17.700	307,272.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.360	189,772.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	8,200	28.050	230,010.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	98.960	376,048.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	45,508	34.590	1,574,121.720	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,600	178.230	1,354,548.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,900	228.220	3,628,698.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	6.890	143,312.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	5.140	121,818.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,600	5.310	666,936.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	18,800	12.930	243,084.000	
MIDEA GROUP CO LTD	14,100	72.500	1,022,250.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	12.080	205,360.000	
PING AN BANK CO LTD	83,400	18.640	1,554,576.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	9,280	15.330	142,262.400	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	70,200	5.510	386,802.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,300	21.240	877,212.000	
ZTE CORP	24,300	33.860	822,798.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	8.330	237,405.000	
WEICHAI POWER CO LTD	17,000	17.200	292,400.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	38.780	162,876.000	
GF SECURITIES CO LTD	17,600	21.100	371,360.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	16.230	342,453.000	

BYD CO LTD	7,700	253.000	1,948,100.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.580	224,378.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	4,830	138.000	666,540.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	29.210	321,310.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	25.840	462,536.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	6.770	87,333.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	47.720	138,388.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	38.220	305,760.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,500	353.010	529,515.000	
JIANGXI ZHENGHANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	10.040	36,144.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	15.060	83,583.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	244.900	293,880.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	11.640	181,584.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	62.710	413,886.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	49.300	29,580.000	
NINESTAR CORP	5,700	36.950	210,615.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	19.750	138,645.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	4.180	141,284.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	10.780	129,360.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	70.100	471,072.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	97.020	155,232.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	425.320	212,660.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	2,300	255.100	586,730.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	7.900	119,290.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	15.910	84,323.000	
SF HOLDING CO LTD	15,000	69.530	1,042,950.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	132.600	238,680.000	

FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	7.280	171,808.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	128.500	321,250.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	7.450	475,235.500	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	12.010	467,189.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	151.880	349,324.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	31.230	424,728.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	165.000	485,100.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	16,400	26.450	433,780.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	130.640	404,984.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.550	282,375.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	43.590	68,000.400	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	31.150	161,980.000	
ZHEJIANG SATELLITE PETROCHEMICAL CO LTD	10,200	38.290	390,558.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	84.390	265,828.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	252.110	831,963.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	80.620	217,674.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	66.730	206,863.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	132.430	278,103.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	6.490	153,164.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	101.790	439,732.800	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	16.160	153,520.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	35.060	105,180.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	17.910	139,698.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	95.580	80,287.200	
ZHEJIANG WOLWO BIO- PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	59.110	159,597.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	2,080	42.840	89,107.200	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	58.600	77,938.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	87.110	113,243.000	

WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	64.800	194,400.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	106.870	213,740.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	10.880	138,176.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	12.360	333,720.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	104.740	199,006.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	10.060	98,588.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	12.120	174,528.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,600	376.350	1,731,210.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	11.200	59,360.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.700	150,350.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	233.300	279,960.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	80.760	327,885.600	
SG MICRO CORP	900	321.680	289,512.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	8,600	534.000	4,592,400.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	149.700	511,375.200	
WUXI APPTec CO LTD	10,872	149.620	1,626,668.640	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,500	95.800	335,300.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,600	358.780	574,048.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	16.050	582,615.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	205.000	676,500.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.220	517,192.380	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	236.480	898,624.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	1,700	256.450	435,965.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.580	462,178.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	4.680	382,356.000	

AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	33.430	357,701.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	178.650	160,785.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	4.950	859,815.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.120	551,424.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	72.220	440,542.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,200	57.320	68,784.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	6,200	59.360	368,032.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	1,900	219.000	416,100.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	192.420	115,452.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	284.000	694,948.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	455	730.860	332,541.300	
PETROCHINA CO LTD	110,900	6.280	696,452.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	4.710	997,578.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	2.960	812,224.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.070	257,880.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.590	193,239.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	31.300	313,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	21.400	331,700.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	86,100	50.930	4,385,073.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	42,100	52.100	2,193,410.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	72,000	18.680	1,344,960.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	97,800	9.080	888,024.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	3.960	547,272.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	23,900	19.550	467,245.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,700	1,839.600	8,646,120.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.550	575,575.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	25.750	1,454,875.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	29.300	899,510.000	

SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	6.110	234,013.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	75,500	21.950	1,657,225.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	109,700	3.450	378,465.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	135,100	4.850	655,235.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	21,500	12.410	266,815.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	5.660	469,214.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	30,400	39.620	1,204,448.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.460	392,034.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	90,100	4.180	376,618.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	64,800	8.620	558,576.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	41.280	577,920.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	18.420	617,070.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	7.440	58,032.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	14,100	53.400	752,940.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	13.550	611,105.000	
CRRC CORP LTD	77,000	6.280	483,560.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	25,152	54.190	1,362,986.880	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	18,900	44.230	835,947.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	23,900	17.320	413,948.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	156,800	5.670	889,056.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	42.180	628,482.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	26.700	742,260.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	28,100	26.160	735,096.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	6.040	62,212.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	51.500	406,850.000	
GEMDALE CORP	10,600	10.870	115,222.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	34.090	753,389.000	

WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	13,500	107.340	1,449,090.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	10.260	951,102.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	8.270	566,495.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	11.380	359,608.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	30,120	35.530	1,070,163.600	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.180	154,364.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,300	270.300	1,973,190.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	235,900	3.080	726,572.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	600	83.800	50,280.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.900	97,500.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	31,500	7.550	237,825.000	
AIR CHINA LTD	28,400	7.890	224,076.000	
TBEA CO LTD	26,700	21.850	583,395.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	45,700	4.280	195,596.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	7.620	642,366.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	13,700	24.890	340,993.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	47.000	155,100.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	30.350	209,415.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	17,200	24.340	418,648.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.170	177,331.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	23.530	195,299.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	11.560	171,088.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	13.770	66,096.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	13.440	318,528.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	27,900	19.340	539,586.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	14,400	51.290	738,576.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	9.190	267,429.000	

JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	16.300	123,880.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	42,970	16.800	721,896.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	60,200	6.010	361,802.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	8.500	277,950.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	9.870	278,334.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	19.860	189,067.200	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	52.500	399,000.000	
BBMG CORP	54,200	2.850	154,470.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	4.090	120,246.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	27.200	505,920.000	
YUTONG BUS CO LTD	12,500	11.500	143,750.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	4.900	189,140.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	25.560	40,896.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	16.470	247,362.930	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	14.330	110,341.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	7,896	58.750	463,890.000	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	34.270	556,887.500	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.070	198,489.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.850	227,150.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,800	43.100	77,580.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	8.680	164,052.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.440	164,864.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	55.260	254,196.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	9.650	162,120.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.710	224,974.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	10.080	197,568.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	395.950	712,710.000	

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	10.800	97,200.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	5,180	325.000	1,683,500.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	17.890	21,468.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	31,560	5.370	169,477.200	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.440	261,000.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	49.980	154,938.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	14.370	324,762.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	4.360	114,232.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	32.070	173,178.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	9.160	115,416.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	7.220	216,600.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	33.450	140,490.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.930	110,361.900	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.750	138,650.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	22.190	99,855.000	
TONGWEI CO LTD	21,000	50.460	1,059,660.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,430	68.130	97,425.900	
JCET GROUP CO LTD	10,900	32.410	353,269.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	56.400	383,520.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	136.300	340,750.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	47.090	249,577.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	20.440	114,464.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	33.570	405,861.300	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	17.730	474,206.580	

JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	7,324	83.570	612,066.680	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	17.100	335,160.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	22.060	346,342.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	104.130	177,021.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	49.850	244,265.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,420	79.550	1,942,611.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	183.950	331,110.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	14.410	466,177.910	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	13,224	112.000	1,481,088.000	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	47.120	235,600.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	17.490	20,988.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	62.300	361,340.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	11.650	153,780.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	20,900	18.700	390,830.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	7.120	425,064.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	52.690	179,146.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	5.410	89,265.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	5.870	534,757.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	14.960	353,056.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	900	36.770	33,093.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	54.570	78,035.100	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	18.750	37,500.000	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	111.840	134,208.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	60.700	91,050.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.620	416,304.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	10,016	9.060	90,744.960	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	306.000	244,800.000	

	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,700	126.500	594,550.000	
	TOLY BREAD CO LTD	5,040	29.410	148,226.400	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	51.640	147,690.400	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	71.200	209,328.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	14.910	289,254.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	4,200	55.870	234,654.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.750	252,000.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	70.450	422,700.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	30,660	4.700	144,102.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	35.750	382,525.000	
オフショア・人民元 小計		8,353,704		162,089,800.220 (2,824,593,068)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	301,308	19.400	5,845,375.200	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	160,065	6.130	981,198.450	
	OOREDOO QSC	81,049	7.254	587,929.440	
	QATAR FUEL QSC	28,478	17.890	509,471.420	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24,605	16.940	416,808.700	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.675	493,695.900	
	INDUSTRIES QATAR QSC	90,288	15.400	1,390,435.200	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,819	18.210	1,380,663.990	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	138,961	3.121	433,697.280	
	MASRAF AL RAYAN	242,381	4.570	1,107,681.170	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.154	436,668.140	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	251,921	2.328	586,472.080	
カタール・リアル 小計		1,584,352		14,170,096.970 (436,155,585)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	296,394	0.817	242,153.890	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	126,248	0.600	75,748.800	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	445,843	0.950	423,550.850	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	89,203	0.976	87,062.120	
	MABANEE CO KPSC	19,432	0.764	14,846.040	

	BOUBYAN BANK KSCP	48,757	0.766	37,347.860	
クウェート・ディナール 小計		1,025,877		880,709.560 (328,583,930)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	24,435	22,650.000	553,452,750.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,908.000	817,816,840.000	
	BANCOLOMBIA SA	12,950	33,400.000	432,530,000.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	33,390.000	1,172,957,310.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	8,537	22,020.000	187,984,740.000	
コロンビア・ペソ 小計		362,281		3,164,741,640.000 (94,309,301)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	15,478	73.500	1,137,633.000	
	JARIR MARKETING CO	4,004	205.800	824,023.200	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	88.900	369,379.500	
	ETIHAD ETISALAT CO	28,728	30.650	880,513.200	
	SAUDI BRITISH BANK	56,694	33.200	1,882,240.800	
	AL RAJHI BANK	76,273	134.200	10,235,836.600	
	ARAB NATIONAL BANK	34,464	23.040	794,050.560	
	BANK ALBILAD	26,491	42.150	1,116,595.650	
	BANK AL-JAZIRA	17,287	19.000	328,453.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	34,261	42.050	1,440,675.050	
	RIYAD BANK	80,010	27.400	2,192,274.000	
	SAUDI TELECOM CO	37,253	119.600	4,455,458.800	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	12,524	172.200	2,156,632.800	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	55,968	127.800	7,152,710.400	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	59.400	384,733.800	
	SAUDI ELECTRICITY CO	57,882	27.050	1,565,708.100	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	10,245	38.350	392,895.750	
	SAVOLA GROUP	14,538	36.900	536,452.200	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	22.520	507,330.560	
	ALMARAI CO JSC	16,575	54.400	901,680.000	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	12.800	362,380.800	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	19,255	43.300	833,741.500	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	72.500	608,637.500	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	40,406	19.080	770,946.480		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	10.000	310,110.000		
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	27.350	293,109.950		

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	21,818	13.700	298,906.600	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,677	144.000	385,488.000	
	ALINMA BANK	61,501	24.500	1,506,774.500	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	113.000	397,308.000	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,062	82.900	2,243,439.800	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	47.600	405,361.600	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	177.000	597,729.000	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	142,503	36.950	5,265,485.850	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,712	168.800	457,785.600	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	136,420	64.400	8,785,448.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,160,032		62,777,930.150 (1,882,710,125)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	103,700	33.500	3,473,950.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	103,600	11.700	1,212,120.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	34,200	46.500	1,590,300.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	43,200	125.000	5,400,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	509,355	4.100	2,088,355.500	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	12,400	180.500	2,238,200.000	
	SHIN CORP PCL	59,600	76.500	4,559,400.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	25.500	7,650,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	80,400	193.500	15,557,400.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	272,320	14.500	3,948,640.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	21,000	456.000	9,576,000.000	
	PTT PCL	598,600	39.750	23,794,350.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	147,100	20.800	3,059,680.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	67,700	56.500	3,825,050.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	722,300	8.000	5,778,400.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	52,450	406.000	21,294,700.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	259,800	64.250	16,692,150.000	

CENTRAL PATTANA PCL NVDR	145,500	54.750	7,966,125.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	659,800	22.400	14,779,520.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	140.500	5,591,900.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	173,610	33.750	5,859,337.500	
THAI OIL PCL NVDR	83,100	56.250	4,674,375.000	
CP ALL PCL NVDR	351,400	63.500	22,313,900.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	336,000	9.650	3,242,400.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	94,645	121.500	11,499,367.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	131,322	45.250	5,942,320.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	147,408	65.000	9,581,520.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	76,000	63.000	4,788,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	316,200	9.050	2,861,610.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	41.500	2,348,900.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	44.500	8,762,050.000	
OSOTSPA PCL NVDR	29,300	34.000	996,200.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	18.500	1,948,050.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	4.680	1,654,848.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	91,933	34.750	3,194,671.750	
SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	61.500	5,559,600.000	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	30,300	65.000	1,969,500.000	
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	36,600	30.750	1,125,450.000	
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	28.750	5,652,250.000	
CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	122.500	3,209,500.000	
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	62.500	3,818,750.000	
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	76.000	3,731,600.000	
タイ・パーツ 小計	7,266,443		274,810,440.750 (915,118,768)	
チェコ・コル ナ	KOMERCNI BANKA AS	3,251	899.500	2,924,274.500
	CEZ	10,929	770.000	8,415,330.000
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	90.000	2,429,010.000

チェコ・コルナ 小計		41,169		13,768,614.500 (70,339,721)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,300,437	39.690	210,374,344.530	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	2,773	30,555.000	84,729,015.000	
	BANCO DE CHILE	2,874,683	71.220	204,734,923.260	
	EMPRESAS CMPC SA	60,153	1,321.000	79,462,113.000	
	EMPRESAS COPEC SA	23,509	6,182.000	145,332,638.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	6,912.000	73,135,872.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,596,888	96.610	154,275,349.680	
	COLBUN SA	580,423	70.600	40,977,863.800	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	7,862	42,401.000	333,356,662.000	
	FALABELLA SA	48,873	2,532.000	123,746,436.000	
	CENCOSUD SA	81,121	1,490.000	120,870,290.000	
	CENCOSUD SHOPPING SA	29,231	880.000	25,723,280.000	
ENEL CHILE SA	991,175	35.260	34,948,830.500		
チリ・ペソ 小計		11,607,709		1,631,667,617.770 (222,068,331)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	5.260	1,256,282.620	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	15.770	708,041.460	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	17.070	1,641,895.020	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	154.300	720,272.400	
	KOC HOLDING AS	53,770	22.160	1,191,543.200	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	8.020	721,800.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	47,391	15.060	713,708.460	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	181,455	9.300	1,687,531.500	
	TURKIYE IS BANKASI	66,205	5.190	343,603.950	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,201	123.000	762,723.000	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,755	61.850	1,716,646.750	
トルコ・リラ 小計		857,366		11,464,048.360 (143,887,564)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	8,393	8,590.000	72,095,870.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	26,296	2,684.000	70,578,464.000	
	OTP BANK NYRT	13,598	18,590.000	252,786,820.000	
ハンガリー・フォリント 小計		48,287		395,461,154.000 (142,495,727)	
パキスタン・ ルピー	LUCKY CEMENT LTD	7,000	660.480	4,623,360.000	
	MCB BANK LTD	12,400	150.200	1,862,480.000	

	HABIB BANK LTD	19,300	110.260	2,128,018.000	
パキスタン・ルビー 小計		38,700		8,613,858.000 (5,685,146)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	432,900	33.850	14,653,665.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	94,330	46.700	4,405,211.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	107,520	81.050	8,714,496.000	
	AYALA CORP	17,253	801.000	13,819,653.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,420	3,088.000	4,384,960.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	73,840	182.100	13,446,264.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	61.200	12,218,580.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	33,940	205.000	6,957,700.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,275	46.500	7,127,287.500	
	BDO UNIBANK INC	125,723	121.000	15,212,483.000	
	PLDT INC	5,260	1,670.000	8,784,200.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	689,175	33.250	22,915,068.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	54,840	131.000	7,184,040.000	
	SM INVESTMENTS CORP	12,583	966.000	12,155,178.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.680	3,318,992.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	288.000	5,100,480.000	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	532.000	3,511,732.000		
フィリピン・ペソ 小計		2,927,920		163,909,990.250 (363,978,524)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,292	26.330	1,245,198.360	
	VALE SA	244,121	79.850	19,493,061.850	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	15,100	6.650	100,415.000	
	RAIA DROGASIL SA	70,100	23.220	1,627,722.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,750	38.440	797,630.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	38.080	750,176.000	
	BANCO DO BRASIL SA	52,000	30.960	1,609,920.000	
	ITAUSA SA	259,660	11.320	2,939,351.200	
	GERDAU SA	69,130	27.180	1,878,953.400	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	225,310	29.790	6,711,984.900	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	64,600	24.710	1,596,266.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	296,812	29.120	8,643,165.440	
	CCR SA	90,920	12.320	1,120,134.400	
	WEG SA	102,744	38.650	3,971,055.600	
	BANCO BRADESCO SA PREF	305,093	20.850	6,361,189.050	
BANCO BRADESCO SA	78,457	17.930	1,406,734.010		

CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,106	28.320	1,192,441.920	
BRADSPAR SA	17,958	53.320	957,520.560	
SUZANO SA	50,775	49.310	2,503,715.250	
CPFL ENERGIA SA	20,700	26.030	538,821.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	298,347	24.660	7,357,237.020	
AMERICANAS SA	28,371	33.740	957,237.540	
BRASKEM SA	12,300	57.890	712,047.000	
ENGIE BRASIL SA	16,587	37.580	623,339.460	
ALPARGATAS SA	8,500	47.290	401,965.000	
LOCALIZA RENT A CAR	41,489	55.050	2,283,969.450	
LOJAS RENNER SA	57,237	34.700	1,986,123.900	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	55,904	14.700	821,788.800	
COSAN SA	73,300	23.370	1,713,021.000	
TOTVS SA	35,600	34.660	1,233,896.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	62,400	24.620	1,536,288.000	
JBS SA	52,200	37.390	1,951,758.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	56,717	14.130	801,411.210	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,098	37.870	1,026,201.260	
HYPERA SA	17,400	29.370	511,038.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	372,648	12.490	4,654,373.520	
MAGAZINE LUIZA SA	199,100	14.970	2,980,527.000	
TELEFONICA BRASIL SA	32,628	45.000	1,468,260.000	
VIA S/A	68,300	8.060	550,498.000	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	42,300	20.060	848,538.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	29,900	72.000	2,152,800.000	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	79,800	12.870	1,027,026.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	18.090	540,891.000	
AMBEV SA	284,895	15.360	4,375,987.200	
NATURA &CO HOLDING SA	52,500	44.910	2,357,775.000	
TIM SA	72,100	12.120	873,852.000	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	22,700	66.480	1,509,096.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA-RTS	4,007	0.020	80.140	
XP INC	7,453	220.630	1,644,355.390	
RUMO SA	80,500	18.240	1,468,320.000	
ブラジル・リアル 小計	4,315,509		115,815,156.830 (2,360,602,434)	

ポーランド・ズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,664	153.750	1,178,340.000	
	BANK PEKAO SA	13,136	119.650	1,571,722.400	
	ORANGE POLSKA SA	30,783	8.155	251,035.360	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	18,695	84.220	1,574,492.900	
	LPP SA	67	12,790.000	856,930.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,756	341.400	599,498.400	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	194.860	902,786.380	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	52,035	46.900	2,440,441.500	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	129,398	6.516	843,157.360	
	CYFROWY POLSAT SA	20,000	36.400	728,000.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	9.800	511,481.600	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	37,670	39.000	1,469,130.000	
	DINO POLSKA SA	3,464	348.900	1,208,589.600	
	ALLEGRO.EU SA	21,992	58.790	1,292,909.680	
ポーランド・ズロチ 小計	393,485		15,428,515.180 (435,499,155)		
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	73,400	3.180	233,412.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	374,800	4.900	1,836,520.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.320	1,016,496.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	6.800	610,096.000	
	RHB BANK BHD	140,880	5.330	750,890.400	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	8.050	255,185.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	382,300	2.780	1,062,794.000	
	GENTING BHD	171,300	5.110	875,343.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	5,856	17.900	104,822.400	
	HONG LEONG BANK BHD	34,908	18.600	649,288.800	
	IOI CORP BHD	190,813	4.060	774,700.780	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	22,600	22.460	507,596.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	27.580	319,928.000	
	MALAYAN BANKING BHD	254,375	8.050	2,047,718.750	
	MISC BHD	100,880	6.990	705,151.200	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	134.000	549,400.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	18.580	859,510.800	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	19.680	438,864.000	
PETRONAS GAS BHD	55,400	16.800	930,720.000		
GENTING MALAYSIA BHD	219,800	3.130	687,974.000		

	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.760	342,720.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	139,650	9.710	1,356,001.500	
	QL RESOURCES BHD	28,450	5.290	150,500.500	
	DIALOG GROUP BHD	233,944	2.840	664,400.960	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	888,750	4.080	3,626,100.000	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	2.340	193,752.000	
	SUPERMAX CORP BHD	74,571	2.330	173,750.430	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.300	320,850.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	107,200	5.890	631,408.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	3.990	678,699.000	
	MAXIS BHD	130,800	4.680	612,144.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	135,700	8.680	1,177,876.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	113,100	6.630	749,853.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	35,700	4.440	158,508.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	229,700	6.090	1,398,873.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	93,400	4.240	396,016.000	
	マレーシア・リンギット 小計	5,131,157		27,847,863.520 (750,753,337)	
メキシコ・ペ ソ	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,000	58.750	4,993,750.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,905	222.150	2,422,545.750	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	141.180	2,521,474.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	72.850	2,542,465.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	158,500	134.960	21,391,160.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	78,425	53.060	4,161,230.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,865	262.460	2,064,247.900	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	86,300	32.530	2,807,339.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,040	398.190	4,794,207.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	186,952	84.600	15,816,139.200	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,142,778	17.950	38,462,865.100	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	172,000	20.410	3,510,520.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	23,100	125.210	2,892,351.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	322,900	70.390	22,728,931.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,410	257.610	6,288,260.100	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	17.670	1,365,891.000	
BECLÉ SAB DE CV	38,400	44.360	1,703,424.000		

メキシコ・ペソ 小計		3,479,635		140,466,801.950 (761,596,953)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	130,000	1.117	145,210.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,162	16.080	211,644.960	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.841	153,011.540	
	OPAP SA	15,554	13.500	209,979.000	
	JUMBO SA	9,601	14.150	135,854.150	
ユーロ 小計		353,387		855,699.650 (111,240,955)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,472	157,500.000	231,840,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,014	22,400.000	112,313,600.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD- 2ND PFD	2,226	96,100.000	213,918,600.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	1,915	241,000.000	461,515,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,450	66,100.000	228,045,000.000	
	COWAY CO LTD	3,621	73,900.000	267,591,900.000	
	KT&G CORP	7,021	80,700.000	566,594,700.000	
	S-1 CORPORATION	794	84,100.000	66,775,400.000	
	CJ CORP	1,001	97,200.000	97,297,200.000	
	KAKAO CORP	19,061	117,500.000	2,239,667,500.000	
	CJ ENM CO LTD	761	170,200.000	129,522,200.000	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,497	23,800.000	59,428,600.000	
	SK TELECOM CO LTD	444	304,500.000	135,198,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	20,059	8,430.000	169,097,370.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,105	578,000.000	638,690,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,606	14,450.000	211,056,700.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	18,508	19,100.000	353,502,800.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	566	1,384,000.000	783,344,000.000	
	LG CHEM LTD	2,826	764,000.000	2,159,064,000.000	
	LG CHEM LTD	499	365,000.000	182,135,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	662,000.000	67,524,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	26,149	39,100.000	1,022,425,900.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	17,493	29,050.000	508,171,650.000	
	S-OIL CORP	2,501	106,000.000	265,106,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	8,260	42,000.000	346,920,000.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	4,720.000	95,589,440.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,618	46,100.000	212,889,800.000		

POSCO CHEMICAL CO LTD	1,996	157,500.000	314,370,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,117	238,500.000	266,404,500.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,675	90,700.000	151,922,500.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,505	93,800.000	234,969,000.000	
HYUNDAI MOBIS	4,005	266,000.000	1,065,330,000.000	
SK HYNIX INC	33,813	94,000.000	3,178,422,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	4,534	49,950.000	226,473,300.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	97,400.000	147,561,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	8,513	205,000.000	1,745,165,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,059	45,550.000	275,987,450.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,371	10,600.000	194,732,600.000	
KIA CORPORATION	16,131	81,900.000	1,321,128,900.000	
KOREA ZINC CO LTD	614	531,000.000	326,034,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	15,823	22,800.000	360,764,400.000	
KOREAN AIR CO LTD	9,959	31,300.000	311,716,700.000	
CJ LOGISTICS	451	147,000.000	66,297,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	178,000.000	213,422,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	1,020	95,500.000	97,410,000.000	
HLB INC	6,789	52,000.000	353,028,000.000	
LG ELECTRONICS INC	6,429	120,000.000	771,480,000.000	
LG CORP	5,966	91,900.000	548,275,400.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	12,550.000	114,995,650.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,631	40,950.000	189,639,450.000	
NAVER CORP	7,526	388,500.000	2,923,851,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,932	83,900.000	245,994,800.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,347	49,750.000	116,763,250.000	
KANGWON LAND INC	4,370	28,300.000	123,671,000.000	
POSCO	4,478	320,000.000	1,432,960,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,811	24,300.000	214,107,300.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,379	686,000.000	2,317,994,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,196	166,500.000	532,134,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	272,500.000	111,725,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	297,700	71,500.000	21,285,550,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	26,770	6,640.000	177,752,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	51,156	66,300.000	3,391,642,800.000	

SHINSEGAE CO LTD	596	257,500.000	153,470,000.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	60,900.000	95,186,700.000	
YUHAN CORP	2,084	59,500.000	123,998,000.000	
HANON SYSTEMS	9,612	15,100.000	145,141,200.000	
GS HOLDINGS CORP	2,879	43,800.000	126,100,200.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,712	17,900.000	263,344,800.000	
CELLTRION INC	5,921	224,000.000	1,326,304,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	17,583	44,600.000	784,201,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,132	172,000.000	194,704,000.000	
CELLTRION PHARM INC	988	124,900.000	123,401,200.000	
LOTTE SHOPPING CO	538	102,500.000	55,145,000.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	4,275	71,500.000	305,662,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,347	181,500.000	425,980,500.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,090	248,000.000	766,320,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	466	399,000.000	185,934,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	20,172	6,690.000	134,950,680.000	
LG INNOTEK CO LTD	764	197,000.000	150,508,000.000	
SK INC	2,165	257,000.000	556,405,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	23,883	55,100.000	1,315,953,300.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,999	31,550.000	189,268,450.000	
HANMI PHARM CO LTD	548	260,500.000	142,754,000.000	
FILA HOLDINGS CORP	2,425	39,950.000	96,878,750.000	
SEEGENE INC	1,958	51,000.000	99,858,000.000	
E-MART CO LTD	1,426	158,000.000	225,308,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,261	42,750.000	224,907,750.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	3,784	62,300.000	235,743,200.000	
BGF RETAIL CO LTD	344	180,000.000	61,920,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,760	117,000.000	205,920,000.000	
SK CHEMICALS CO LTD	409	300,500.000	122,904,500.000	
NETMARBLE CORP	1,478	121,500.000	179,577,000.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	32,854	11,600.000	381,106,400.000	
ECOPRO BM CO LTD	639	423,200.000	270,424,800.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,002	100,000.000	200,200,000.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	770	202,000.000	155,540,000.000	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,200	221,000.000	265,200,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD-RTS	77	220.000	16,940.000	
HYBE CO LTD	934	281,000.000	262,454,000.000	
KAKAObANK CORP	3,450	57,000.000	196,650,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,198	160,500.000	352,779,000.000	

	ALTEOGEN INC	2,026	70,700.000	143,238,200.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,041	122,000.000	615,002,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,001	830,000.000	830,830,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	88,000.000	183,040,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,922	38,750.000	113,227,500.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,712	89,000.000	508,368,000.000	
韓国・ウォン	小計	965,242		70,670,726,530.000 (6,650,115,366)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	14.000	938,000.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	7.830	704,700.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	180,000	4.710	847,800.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	102.360	655,104.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	73,500	43.000	3,160,500.000	
	BEIJING ENTERPRISES	20,000	30.900	618,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	342,000	3.720	1,272,240.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	236,000	11.360	2,680,960.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	13.620	953,400.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	46,900	27.700	1,299,130.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	43,500	43.300	1,883,550.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	3.650	518,300.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	537,600	9.170	4,929,792.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	260,620	17.440	4,545,212.800	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	196,888	31.750	6,251,194.000	
	CITIC LTD	351,000	8.030	2,818,530.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	96,000	4.830	463,680.000	
	LENOVO GROUP LTD	428,000	8.810	3,770,680.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,240,000	4.060	5,034,400.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	12.380	1,369,104.200	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,515,200	3.990	6,045,648.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	49,000	14.620	716,380.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	144,000	25.900	3,729,600.000	

ENN ENERGY HOLDINGS LTD	47,900	119.500	5,724,050.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	276,000	7.290	2,012,040.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	78,000	7.100	553,800.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	63,200	7.310	461,992.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	66,000	13.560	894,960.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	244,000	5.570	1,359,080.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	87,000	26.500	2,305,500.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	10.200	984,300.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	44,000	9.340	410,960.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	186,000	20.950	3,896,700.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	35.250	1,568,625.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	361,000	22.200	8,014,200.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	1.980	427,680.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	54,000	38.500	2,079,000.000	
BYD CO LTD	48,000	246.000	11,808,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	7.970	940,460.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,030,000	0.870	896,100.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	6.080	1,712,079.360	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	152,000	12.600	1,915,200.000	
MMG LTD	184,000	3.340	614,560.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	5.490	384,300.000	
CHINA YOUZAN LTD	1,000,000	1.060	1,060,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	397,788	7.500	2,983,410.000	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	4.730	638,550.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	115,200	19.400	2,234,880.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	196,000	29.350	5,752,600.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	501,000	13.480	6,753,480.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	381,000	9.630	3,669,030.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	156,000	14.180	2,212,080.000	
WEICHAH POWER CO LTD	127,440	15.820	2,016,100.800	

TINGYI HOLDING CORP	140,000	14.860	2,080,400.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	62.550	2,376,900.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	188,000	10.000	1,880,000.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	238,000	3.720	885,360.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	87,333	57.350	5,008,547.550	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	68,000	6.440	437,920.000	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	71,000	14.780	1,049,380.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	619,250	5.920	3,665,960.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	192,000	47.500	9,120,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	358,300	481.800	172,628,940.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	391,500	57.850	22,648,275.000	
LI NING CO LTD	138,500	80.950	11,211,575.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	260,000	3.320	863,200.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	0.790	544,499.600	
CHINA POWER INTERNATIONAL	207,000	3.700	765,900.000	
AIR CHINA / HONG KONG	76,000	5.500	418,000.000	
ZTE CORP	44,288	25.550	1,131,558.400	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	214,500	17.460	3,745,170.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	203,250	11.440	2,325,180.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	574,205	4.700	2,698,763.500	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	8.230	907,357.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,000	31.950	1,309,950.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,017,530	5.490	33,036,239.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	51,000	153.000	7,803,000.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	206,000	7.070	1,456,420.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	6.860	672,280.000	
MINTH GROUP LTD	54,000	28.750	1,552,500.000	
SSY GROUP LTD	138,000	4.020	554,760.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	84,000	9.650	810,600.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	242,000	10.240	2,478,080.000	

BANK OF CHINA LTD	5,025,200	2.730	13,718,796.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	99,500	13.820	1,375,090.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	11.280	676,800.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	5.370	532,704.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	235,470	60.300	14,198,841.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,531,235	4.370	15,431,496.950	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	49,500	5.490	271,755.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	12.820	685,870.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	4.300	720,680.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	33,000	23.750	783,750.000	
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	34.050	1,065,765.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	447,142	7.750	3,465,350.500	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	4.790	1,135,230.000	
CHINA CITIC BANK-H	602,800	3.500	2,109,800.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65,000	7.360	478,400.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,400	200.200	8,688,680.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	66,400	131.400	8,724,960.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	23.250	465,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	9.220	1,558,438.160	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	276,000	2.630	725,880.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	3.690	313,650.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	5.210	844,020.000	
KINGSOFT CORP LTD	60,000	31.500	1,890,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	12.160	425,600.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	168,000	4.000	672,000.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	7.260	805,860.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	47,500	26.200	1,244,500.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	320,000	5.820	1,862,400.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	151,200	24.900	3,764,880.000	

CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	14.080	1,295,360.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	65,500	4.060	265,930.000	
SINOPHARM GROUP CO	86,000	20.750	1,784,500.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	120,000	7.430	891,600.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	178,527	7.110	1,269,326.970	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	9.720	1,462,860.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	5.510	595,080.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	2.840	562,320.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	210,000	16.460	3,456,600.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	30,100	15.240	458,724.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	148,000	14.900	2,205,200.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	62,000	6.900	427,800.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	9.300	837,000.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	122,500	34.850	4,269,125.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	43,100	24.000	1,034,400.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	364,656	3.190	1,163,252.640	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	125,000	1.840	230,000.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	31,000	15.220	471,820.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	81,000	12.020	973,620.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.750	687,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,717,000	2.670	4,584,390.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,000	60.850	2,373,150.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	7.680	791,040.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	44,600	39.800	1,775,080.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	143,000	19.960	2,854,280.000	

SEAZEN GROUP LIMITED	108,000	6.370	687,960.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	194,000	7.200	1,396,800.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	461,000	2.470	1,138,670.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	34,500	36.750	1,267,875.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	226,000	5.050	1,141,300.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	216,500	4.530	980,745.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	76,000	8.570	651,320.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	548,000	5.310	2,909,880.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	36,000	41.250	1,485,000.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	28.700	2,353,400.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	94,000	60.950	5,729,300.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.050	372,600.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	33,000	51.700	1,706,100.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	13.160	684,320.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.980	524,250.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	44,250	28.450	1,258,912.500	
CHINA TOWER CORP LTD	2,538,000	1.020	2,588,760.000	
XIAOMI CORP	890,000	21.150	18,823,500.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	19,112	174.700	3,338,866.400	
WEIMOB INC	105,000	11.580	1,215,900.000	
MEITUAN	250,900	256.000	64,230,400.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	71,200	18.980	1,351,376.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	67,000	27.100	1,815,700.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	294,000	14.540	4,274,760.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	71,000	76.100	5,403,100.000	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	42,000	15.800	663,600.000	

CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.360	904,400.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	40,000	40.150	1,606,000.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	8.450	870,350.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	36.900	3,782,250.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	46.200	267,960.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	78,000	12.000	936,000.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	27,000	8.380	226,260.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	214.400	1,329,280.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	116,000	8.500	986,000.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	86,000	19.620	1,687,320.000	
CHINA FEIHE LTD	249,000	12.920	3,217,080.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	946,068	155.500	147,113,574.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,700	161.400	1,242,780.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	109,000	33.550	3,656,950.000	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	42.200	654,100.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	22.200	1,110,000.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	16,200	83.750	1,356,750.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	131,600	27.750	3,651,900.000	
AKESO INC	20,000	41.000	820,000.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	42,000	16.260	682,920.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	27.200	680,000.000	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	15.800	647,800.000	
NONGFU SPRING CO LTD	34,000	38.450	1,307,300.000	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	294,500	3.100	912,950.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	20,350	72.900	1,483,515.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	33,000	43.150	1,423,950.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	9,600	160.400	1,539,840.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	118,961	21.150	2,516,025.150	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	37,000	39.250	1,452,250.000	
CGN POWER CO LTD	450,000	2.270	1,021,500.000	

	GF SECURITIES CO LTD	68,200	13.260	904,332.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	38.200	1,818,320.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	92,400	12.160	1,123,584.000	
	3SBIO INC	90,500	7.350	665,175.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	3.830	360,020.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	0.510	235,110.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	57.000	1,618,800.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	33.650	1,144,100.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.490	657,785.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	3.790	242,560.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	6.460	419,900.000	
	BOC AVIATION LTD	10,700	69.000	738,300.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	31.000	1,054,000.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	90,000	12.540	1,128,600.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	112,800	20.600	2,323,680.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	223,000	112.000	24,976,000.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	17,000	138.400	2,352,800.000	
	香港・ドル 小計	55,448,963		911,756,958.680 (13,156,652,911)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	31,000	257.500	7,982,500.000	
	ACER INC	202,532	24.650	4,992,413.800	
	ASUSTEK COMPUTER INC	47,554	338.000	16,073,252.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	26,616	480.500	12,788,988.000	
	ASIA CEMENT CORP	145,928	45.850	6,690,798.800	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	19,000	148.000	2,812,000.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	62,000	147.000	9,114,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	49,000	137.000	6,713,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	74,000	130.000	9,620,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	155,858	78.500	12,234,853.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	43,760	164.000	7,176,640.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	247,208	16.300	4,029,490.400	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	137,169	34.400	4,718,613.600	

CHINA STEEL CORP	719,058	33.200	23,872,725.600	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN	150,973	29.250	4,415,960.250	
ADVANTECH CO LTD	26,675	350.500	9,349,587.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	208,304	24.150	5,030,541.600	
DELTA ELECTRONICS INC	118,663	250.500	29,725,081.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	90,000	61.600	5,544,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	249,427	111.500	27,811,110.500	
AU OPTRONICS CORP	537,194	17.100	9,186,017.400	
TAIWAN MOBILE CO LTD	109,800	98.900	10,859,220.000	
EVERGREEN MARINE CORP	153,820	100.000	15,382,000.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	160,824	29.450	4,736,266.800	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	31,768	210.000	6,671,280.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	11,322	571.000	6,464,862.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,285	389.000	13,336,865.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	230,633	118.000	27,214,694.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	206,594	84.400	17,436,533.600	
GIANT MANUFACTURING	21,151	301.000	6,366,451.000	
MEDIATEK INC	94,507	910.000	86,001,370.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	462,829	75.300	34,851,023.700	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	575,752	20.150	11,601,402.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	20,000	585.000	11,700,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	89,000	61.700	5,491,300.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	648,146	24.450	15,847,169.700	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	478,941	57.100	27,347,531.100	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	882,403	14.150	12,486,002.450	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	723,798	26.000	18,818,748.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	774,225	108.000	83,616,300.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	711,495	32.250	22,945,713.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	2,005.000	12,471,100.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	586,132	17.950	10,521,069.400	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	774,345	9.350	7,240,125.750	
INVENTEC CO LTD	115,005	26.700	3,070,633.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	140,845	64.000	9,014,080.000	

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	544,443	13.800	7,513,313.400	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,125,048	22.900	25,763,599.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	689,806	22.400	15,451,654.400	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	37,560	100.500	3,774,780.000	
NAN YA PLASTICS CORP	309,828	91.300	28,287,296.400	
WISTRON CORP	157,916	28.400	4,484,814.400	
POU CHEN CORP	157,990	32.900	5,197,871.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	290,297	68.000	19,740,196.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	35,392	287.000	10,157,504.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	64,480	101.500	6,544,720.000	
PHISON ELECTRONICS CORP	11,658	376.500	4,389,237.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	65,224	56.800	3,704,723.200	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	73,588	70.100	5,158,518.800	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	101,899	52.200	5,319,127.800	
TAIWAN CEMENT CORP	292,171	50.400	14,725,418.400	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,536,083	575.000	883,247,725.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	729,525	61.100	44,573,977.500	
WAN HAI LINES LTD	38,500	169.500	6,525,750.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	180,000	25.550	4,599,000.000	
YAGEO CORP	25,160	410.000	10,315,600.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	111,000	96.800	10,744,800.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	90,000	29.100	2,619,000.000	
INNOLUX CORPORATION	550,345	16.350	8,998,140.750	
WPG HOLDINGS CO LTD	118,203	49.000	5,791,947.000	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	14,000	430.000	6,020,000.000	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	16,969	298.500	5,065,246.500	
PEGATRON CORP	138,554	66.800	9,255,407.200	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	816.000	6,528,000.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	23,000	305.500	7,026,500.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	77,593	236.000	18,311,948.000	
ONENESS BIOTECH CO LTD	9,000	168.500	1,516,500.000	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,565.000	3,130,000.000	

	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	52,385	94.300	4,939,905.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	551,393	22.000	12,130,646.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	199,993	43.500	8,699,695.500	
	WIWYNN CORP	5,000	827.000	4,135,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	197,903	96.200	19,038,268.600	
	SILERGY CORP	5,000	4,040.000	20,200,000.000	
	MOMO.COM INC	3,000	1,555.000	4,665,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	15,000	782.000	11,730,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	11,000	375.000	4,125,000.000	
	台湾・ドル 小計	20,051,665		1,985,519,148.050 (7,940,091,073)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	196.770	1,409,463.510	
	BIDVEST GROUP LTD	15,345	186.880	2,867,673.600	
	CLICKS GROUP LTD	16,368	270.510	4,427,707.680	
	DISCOVERY LTD	30,465	135.310	4,122,219.150	
	GOLD FIELDS LTD	52,261	130.450	6,817,447.450	
	REMGRO LTD	37,513	136.000	5,101,768.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	28,537	51.420	1,467,372.540	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,115	182.790	2,580,080.850	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,828	1,677.710	8,099,983.880	
	MTN GROUP LTD	103,790	143.000	14,841,970.000	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	24,592	263.900	6,489,828.800	
	FIRSTRAND LTD	303,860	60.970	18,526,344.200	
	NASPERS LTD	13,492	2,555.130	34,473,813.960	
	NEDBANK GROUP LTD	26,060	168.210	4,383,552.600	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,800	1,504.500	5,717,100.000	
	SASOL LTD	38,173	287.210	10,963,667.330	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	31,242	178.630	5,580,758.460	
	MR PRICE GROUP LTD	17,459	199.800	3,488,308.200	
	STANDARD BANK GROUP LTD	75,693	137.390	10,399,461.270	
	SPAR GROUP LTD/THE	9,125	189.750	1,731,468.750	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,648	56.600	4,111,876.800	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	25,010	240.360	6,011,403.600	
	ABSA GROUP LTD	49,397	143.400	7,083,529.800	
	TIGER BRANDS LTD	12,981	185.070	2,402,393.670	
	SANLAM LTD	107,156	61.300	6,568,662.800	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	54,034	202.490	10,941,344.660	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,497	482.650	2,170,477.050	

RMI HOLDINGS	35,836	37.880	1,357,467.680	
VODACOM GROUP PTY LTD	38,342	138.230	5,300,014.660	
NEPI ROCKCASTLE PLC	22,770	103.050	2,346,448.500	
OLD MUTUAL LTD	304,247	16.390	4,986,608.330	
REINET INVESTMENTS SCA	7,743	279.170	2,161,613.310	
MULTICHOICE GROUP LTD	27,072	115.420	3,124,650.240	
SIBANYE STILLWATER LTD	169,143	53.300	9,015,321.900	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	22,064	228.490	5,041,403.360	
BID CORP LTD	19,281	330.010	6,362,922.810	
南アフリカ・ランド 小計	1,826,102		232,476,129.400 (1,745,895,732)	
合計	156,082,811		55,018,005,321 (55,018,005,321)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	35,610.000	0.000	
		BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	71,220.000	0.000	
	タイ・パーツ 小計	106,830.000	0.000 (0)		
新株予約権証券 合計			106,830	0 (0)	
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	69,900.000	1,787,343.000	
		BANCO INTER SA	23,700.000	1,185,237.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,100.000	781,755.000	
		ENERGISA SA	15,800.000	703,416.000	
		KLABIN SA	50,500.000	1,131,200.000	
	ブラジル・リアル 小計	181,000.000	5,588,951.000 (113,916,794)		
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	910,575.000	12,392,925.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,951,200.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	118,600.000	20,398,014.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	157,800.000	7,500,234.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	25,000.000	1,495,750.000	
メキシコ・ペソ 小計	1,247,175.000	45,738,123.750 (247,987,532)			
投資信託受益証券 合計			1,428,175	361,904,326 (361,904,326)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	5,075,224.000	
	メキシコ・ペソ 小計		235,400.000	5,075,224.000	

				(27,517,357)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	235,102.000	3,343,150.440	
	南アフリカ・ランド	小計	235,102.000	3,343,150.440	(25,107,060)
投資証券	合計		470,502	52,624,417	(52,624,417)
合計				414,528,743	(414,528,743)

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入新株 予約権証 券 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証 券 時価比率 (%)	有価証券の合計金 額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 74銘柄	8.98	-	-	-	10.11
アラブ首長国連邦・ディル ハム	株式 9銘柄	0.70	-	-	-	0.79
イギリス・ポンド	株式 1銘柄	0.07	-	-	-	0.08
インド・ルピー	株式 102銘柄	10.89	-	-	-	12.25
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.28	-	-	-	1.44
オフショア・人民元	株式 368銘柄	4.53	-	-	-	5.10
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.70	-	-	-	0.79
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.53	-	-	-	0.59
コロンビア・ペソ	株式 5銘柄	0.15	-	-	-	0.17
サウジアラビア・リアル	株式 36銘柄	3.02	-	-	-	3.40
タイ・バーツ	株式 42銘柄 新株予約権証 券 2銘柄	1.47 -	- 0.00	-	-	1.65
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.11	-	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式 13銘柄	0.36	-	-	-	0.40
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	0.23	-	-	-	0.26
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	0.58	-	-	-	0.66
ブラジル・レアル	株式 50銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	3.78 -	- -	- 0.18	-	4.46
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.70	-	-	-	0.79
マレーシア・リングgit	株式 36銘柄	1.20	-	-	-	1.35
メキシコ・ペソ	株式 17銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	1.22 -	- -	- 0.40	-	1.87

	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	
ユーロ	株式	6銘柄	0.18	-	-	-	0.20
韓国・ウォン	株式	107銘柄	10.66	-	-	-	12.00
香港・ドル	株式	212銘柄	21.09	-	-	-	23.73
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.73	-	-	-	14.32
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	2.80	-	-	-	3.19
	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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)

2021年10月29日現在

資産総額	112,555,276円
負債総額	63,337円
純資産総額(-)	112,491,939円
発行済数量	96,541,531口
1口当たり純資産額(/)	1.1652円

D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)

2021年10月29日現在

資産総額	204,089,111円
負債総額	116,762円
純資産総額(-)	203,972,349円
発行済数量	169,006,176口
1口当たり純資産額(/)	1.2069円

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	492,693,476,970円
負債総額	3,726,727,000円
純資産総額(-)	488,966,749,970円
発行済数量	374,558,885,443口
1口当たり純資産額(/)	1.3054円

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	484,778,073,320円
負債総額	9,475,858,650円
純資産総額(-)	475,302,214,670円
発行済数量	143,675,610,760口
1口当たり純資産額(/)	3.3082円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	155,974,741,582円
負債総額	3,113,471,000円
純資産総額(-)	152,861,270,582円
発行済数量	73,213,658,139口
1口当たり純資産額(/)	2.0879円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	679,652,173,492円
負債総額	101,088,264円
純資産総額(-)	679,551,085,228円
発行済数量	115,483,851,488口
1口当たり純資産額(/)	5.8844円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	171,531,760,897円
負債総額	6,134,355,575円
純資産総額(-)	165,397,405,322円
発行済数量	74,581,092,639口
1口当たり純資産額(/)	2.2177円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2021年10月29日現在

資産総額	74,833,390,132円
負債総額	53,852,381円
純資産総額(-)	74,779,537,751円
発行済数量	50,276,470,451口
1口当たり純資産額(/)	1.4874円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2021年10月29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10月29日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

各ファンドの運用は「投資環境会議」および「投資方針会議」における協議の内容を踏まえて、ファンド毎に個別に任命された運用担当者が行います。運用担当者は月次で運用計画書

を作成し、運用本部長の承認を受けます。運用担当者は承認を受けた運用計画に基づき、運用を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年10月29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	1,389,726,868,805
追加型株式投資信託	831	15,977,901,845,268
単位型公社債投資信託	28	60,426,385,134
単位型株式投資信託	220	1,327,861,039,257
合計	1,105	18,755,916,138,464

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。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）、ならびに同規則第38条及び第57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．委託者の財務諸表及び中間財務諸表に掲記される科目その他の事項の金額については、従来、千円単位で記載しておりましたが、第37期事業年度の中間会計期間より百万円単位で記載することに変更いたしました。その結果、第36期事業年度の財務諸表の金額については千円未満の端数を、第37期事業年度の中間財務諸表の金額については百万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、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、第37期中間会計期間（自2021年4月1日至2021年9月30日）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

(単位:千円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

重要な会計方針

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

1. 有形固定資産の減価償却累計額

（千円）

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

（損益計算書関係）

1. 固定資産除却損の内訳

（千円）

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

（株主資本等変動計算書関係）

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬及び(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、投資信託は基準価額によっております。

負 債

(1) 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(2020年3月31日現在)

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

第36期(2021年3月31日現在)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

第35期(2020年3月31日現在)

(千円)

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

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

第36期(2021年3月31日現在)

(千円)

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

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

3. 当該事業年度中に売却したその他有価証券

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

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

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（千円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（千円）

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(千円)

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
流動資産	- 千円	- 千円
固定資産	94,605,736千円	84,609,003千円
資産合計	94,605,736千円	84,609,003千円
流動負債	- 千円	- 千円
固定負債	8,278,713千円	5,570,814千円
負債合計	8,278,713千円	5,570,814千円
純資産	86,327,023千円	79,038,188千円
(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。		
のれん	62,885,491千円	59,074,249千円
顧客関連資産	34,810,031千円	29,793,358千円

(2) 損益計算書項目

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

(資産除去債務関係)

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

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

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当はありません。

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

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

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

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

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

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		28,648
金銭の信託		25,866
未収委託者報酬		18,882
未収運用受託報酬		2,911
未収投資助言報酬		319
未収収益		15
前払費用		996
その他		2,470
	流動資産計	80,112
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	792
器具備品	1	184
無形固定資産		
ソフトウェア		4,193
ソフトウェア仮勘定		3,475
電話加入権		714
電話加入権		3
投資その他の資産		
投資有価証券		10,724
関係会社株式		261
長期差入保証金		5,299
繰延税金資産		1,273
繰延税金資産		3,311
その他		578
	固定資産計	15,895
資産合計		96,007

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	1,845
未払金	7,922
未払収益分配金	0
未払償還金	9
未払手数料	7,759
その他未払金	153
未払費用	7,337
未払法人税等	3,423
未払消費税等	1,234
契約負債	20
賞与引当金	836
役員賞与引当金	33
	流動負債計
	22,653
固定負債	
退職給付引当金	2,391
時効後支払損引当金	147
	固定負債計
	2,538
負債合計	25,192
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	49,261
利益準備金	123
その他利益剰余金	49,138
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	17,458
	株主資本計
	70,814
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
	評価・換算差額等計
	0
純資産合計	70,814
負債・純資産合計	96,007

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	54,995	
運用受託報酬	7,193	
投資助言報酬	569	
その他営業収益	6	
		営業収益計 62,765
営業費用		
支払手数料	22,800	
広告宣伝費	126	
公告費	0	
調査費	17,656	
調査費	4,722	
委託調査費	12,934	
委託計算費	281	
営業雑経費	437	
通信費	17	
印刷費	315	
協会費	33	
諸会費	17	
支払販売手数料	52	
		営業費用計 41,301
一般管理費		
給料	4,865	
役員報酬	82	
給料・手当	4,565	
賞与	217	
交際費	1	
寄付金	4	
旅費交通費	13	
租税公課	292	
不動産賃借料	892	
退職給付費用	248	
固定資産減価償却費	1 670	
福利厚生費	16	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	836	
役員賞与引当金繰入額	33	
機器リース料	0	
事務委託費	1,971	
事務用消耗品費	26	
器具備品費	0	
諸経費	99	
		一般管理費計 9,973
営業利益		11,490

(単位:百万円)

	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
営業外収益		
受取利息	7	
受取配当金	548	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	10	
為替差益	26	
金銭の信託運用益	288	
雑収入	2	
営業外収益計		884
経常利益		12,374
特別損失		
固定資産除却損	5	
ゴルフ会員権売却損	3	
オフィス再編費用	5	
特別損失計		13
税引前中間純利益		12,360
法人税、住民税及び事業税		3,254
法人税等調整額		364
法人税等合計		3,619
中間純利益		8,741

(3) 中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
					別途 積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996
当中間期変動額							
剰余金の配当							11,280
中間純利益							8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	2,538
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	17,458

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	51,800	73,353	0	0	73,353
当中間期変動額					
剰余金の配当	11,280	11,280			11,280
中間純利益	8,741	8,741			8,741
株主資本以外 の項目の 当中間期変 動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	2,538	2,538	0	0	2,538
当中間期末残高	49,261	70,814	0	0	70,814

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ：移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの：中間決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの：移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。 ただし、平成28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。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 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中間会計期間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。 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、それぞれ発生の日翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 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。

会計上の見積りの変更

第37期中間会計期間

(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

当社は、当中間会計期間において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当中間会計期間において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ124百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識基準に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。当該会計方針の変更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の適用

「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。以下「時価算定会計基準」という。）等を当中間会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「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）第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

また、「金融商品関係」注記において、金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項等の注記を行うことといたしました。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

項目	第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	520百万円
	器具備品	1,004百万円

(中間損益計算書関係)

項目	第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.減価償却実施額	有形固定資産	156百万円
	無形固定資産	514百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自2021年4月1日至2021年9月30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)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 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 (百万円)	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	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

(2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの
該当事項はありません。

（金融商品関係）

第37期中間会計期間末（2021年9月30日現在）

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、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。

	中間貸借対照表計上額 （百万円）	時価 （百万円）	差額 （百万円）
(1) 金銭の信託	25,866	25,866	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,868	25,868	-

（注）現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	5,844	-	5,844
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	5,844	-	5,844

「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。以下、「時価算定適用指針」という）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。中間貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託20,021百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、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。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。
これらについては、「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)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開
示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券(その他有価証券)	
非上場株式	259
関係会社株式	
非上場株式	5,299

(有価証券関係)

第37期中間会計期間末 (2021年9月30日現在)			
1. 子会社株式 関係会社株式(中間貸借対照表計上額5,299百万円)で市場価格のあるものはありません。			
2. その他有価証券			
区 分	中間貸借対照表 計上額(百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0
(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上 表に含めておりません。			

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2021年4月1日から2021年9月30日まで

(2) 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 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

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

(4) 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 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

(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。

(5) 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 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

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

流動資産	- 百万円
固定資産	80,759百万円
資産合計	80,759百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	5,228百万円
負債合計	5,228百万円
純資産	75,530百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額57,168百万円及び顧客関連資産の金額27,484百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,214百万円
経常利益	4,214百万円
税引前中間純利益	4,214百万円
中間純利益	3,507百万円
1株当たり中間純利益	87,690円34銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,309百万円が含まれております。

(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。

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第37期中間会計期間
 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

委託者報酬	54,819百万円
運用受託報酬	7,193百万円
投資助言報酬	569百万円
成功報酬(注)	175百万円
その他営業収益	6百万円
合計	62,765百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において委託者報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6. 重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

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

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,770,364円46銭
1株当たり中間純利益金額	218,536円02銭

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

1株当たり中間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37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
中間純利益金額	8,741百万円
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中間純利益金額	8,741百万円
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
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

- (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円(2021年3月末日現在)
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
信金中央金庫	(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。
GMOクリック証券株式会社	4,346	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2021年3月末日現在

(1) 出資の総額

(3) 投資顧問会社

名称	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社
資本金の額	200百万円(2021年3月末日現在)
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

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

「販売会社」は、以下の業務を行います。

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

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2021年7月12日	有価証券報告書
2021年7月12日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

2021年5月26日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド(堅実型)の2021年4月13日から2021年10月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)の2021年10月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2021年11月19日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているDIAMコア資産設計ファンド（積極型）の2021年4月13日から2021年10月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、DIAMコア資産設計ファンド（積極型）の2021年10月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年11月25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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

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。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

(注2) X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。