

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年7月12日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 菅野 暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	酒井 隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	たわらノーロード 最適化バランス（保守型） たわらノーロード 最適化バランス（安定型） たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型） たわらノーロード 最適化バランス（成長型） たわらノーロード 最適化バランス（積極型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	たわらノーロード 最適化バランス（保守型） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス（安定型） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス（成長型） 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス（積極型） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

（以下、総称して「ファンド」という場合、あるいは個別に「各ファンド」という場合があります。また、「たわらノーロード 最適化バランス（保守型）」は「（保守型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（安定型）」は「（安定型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）」は「（安定成長型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（成長型）」は「（成長型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（積極型）」は「（積極型）」という場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」により収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2022年7月13日から2023年1月12日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（９）【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金再投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 ファンドごとに目標とするリスク水準(標準偏差)*1、*2を設定します。

*1 各ファンドが目標とするリスク水準(標準偏差)とは、ファンドの月次収益率の標準偏差(年率)の目安を指し、各ファンドにおける資産別の投資比率を決定する際の目標値として使用します。このため各ファンドの実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。

*2 標準偏差とは、リターンのおぼつき度合いを定量的に表したものです。標準偏差の値が大きいほど、価格変動の幅が大きく、リスクが高いとされ、逆に値が小さいほど、価格変動の幅が狭く、リスクは小さいとされます。

●目標リスク水準に応じて、5つのファンドを用意しました。

ファンド名	(保守型)	(安定型)	(安定成長型)	(成長型)	(積極型)
目標リスク水準 (年率標準偏差)	約2%程度	約5%程度	約7%程度	約10%程度	約13%程度

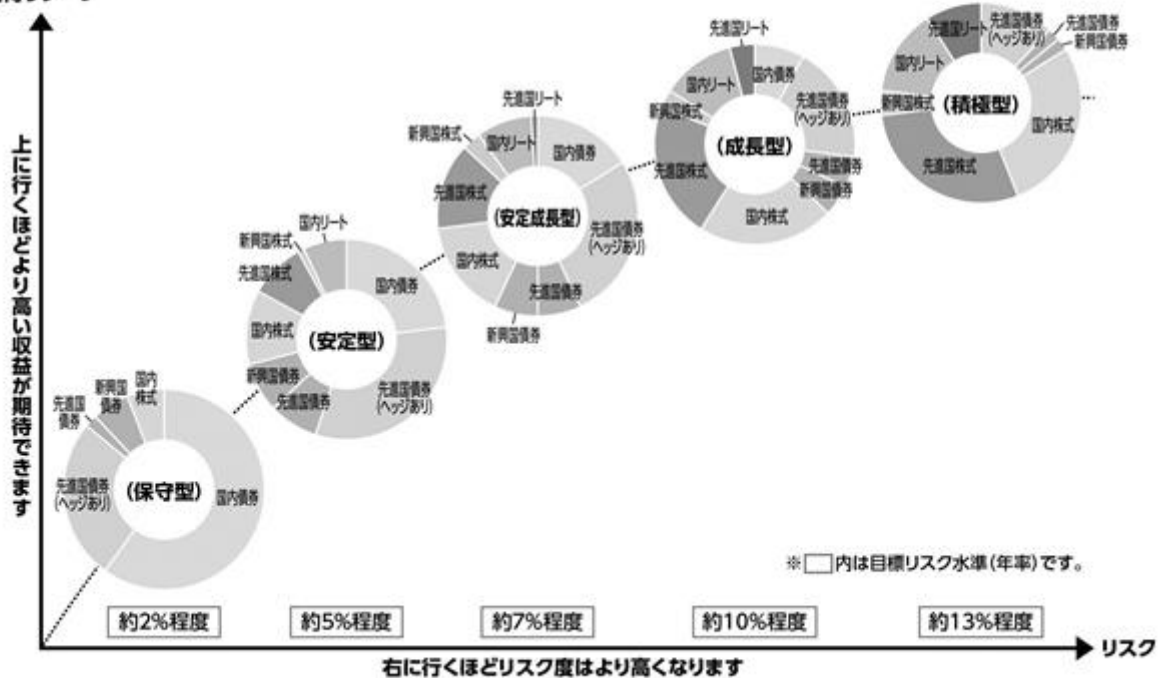
※目標リスク水準は今後変更される場合があります。

<各ファンドの目標とするリスク水準とリターン特性および資産別の投資配分のイメージ>

※各ファンドの資産別の投資配分のイメージは、2022年4月末現在のものです。

※各ファンドにおける実際の基準価額の変動幅が、目標リスク水準の大きさの順になることを保証するものではありません。

期待リターン



※上記はイメージ図であり、リスク水準とリターン特性を正確に表すものではなく、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。

2 主としてマザーファンド*1、*2への投資を通じて、実質的に国内外の株式、公社債および不動産投資信託証券に投資します。

*1 各マザーファンドは各資産クラスの代表的な指数（インデックス）に連動した投資成果をめざして運用を行います。

*2 各ファンドが投資するマザーファンドは下記のとおりです。また、「DIAMマネーマザーファンド」および短期金融資産等に直接投資する場合があります（以下および「DIAMマネーマザーファンド」を総称して「マザーファンド」あるいは個別に「各マザーファンド」といいます。）。

マザーファンド	マザーファンドが連動対象とする指数	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）	先進国株式*
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）	先進国債券*
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）	先進国債券*（ヘッジあり）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	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）	新興国株式
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	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）	新興国債券
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）	国内リート
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）	先進国リート*

*先進国株式、先進国債券、先進国リートについては日本を除きます（以下同じ。）。

3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 実質組入外貨建資産のうち、先進国株式については、各ファンドにおいて対円での為替ヘッジを行うことがあります。なお、一部の通貨については委託会社はその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。
- 実質組入外貨建資産のうち、先進国債券については、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて対円での為替ヘッジを行います。

4 各ファンドごとに目標とするリスク水準に応じて、各資産別の投資比率を決定します。

- 各ファンドにおける資産別の投資比率は、各資産に期待される収益率や過去一定期間における資産価格変動性（標準偏差）等、客観的に入手しうるデータに基づき、最適化計算（目標リスク水準に対してリターンが最大化されるような投資比率を求める計算）を行い定量的に算出し、決定され、この投資比率に基づき、各マザーファンドへの投資を行いポートフォリオを構築します。投資比率の決定は原則として年2回行います。
なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。
- 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。

運用プロセス

投資資産配分案の助言

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社が、各資産の期待リターン、リスク等をもとに、資産配分案を助言

ポートフォリオの構築

委託会社は、助言された投資配分案をもとに各マザーファンド等への投資を行います。

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社（FT社）について

- FT社は数理科学をベースとした総合リスク管理やデリバティブズおよび投資・運用手法などの金融技術の開発を総合的に行う会社です。
- 資産運用に関連した業務としては、先端的な金融工学技術を活用し、精緻なリスク制御手法に基づいて資産運用商品の開発、コンサルティング、投資助言などを行なっています。

■ 分配方針

年1回の決算時(毎年10月12日(休業日の場合は翌営業日))に、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

< 商品分類 >

- ・ 商品分類表
各ファンド

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

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

< 属性区分 >

・属性区分表

各ファンド

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

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

(注2) 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

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

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

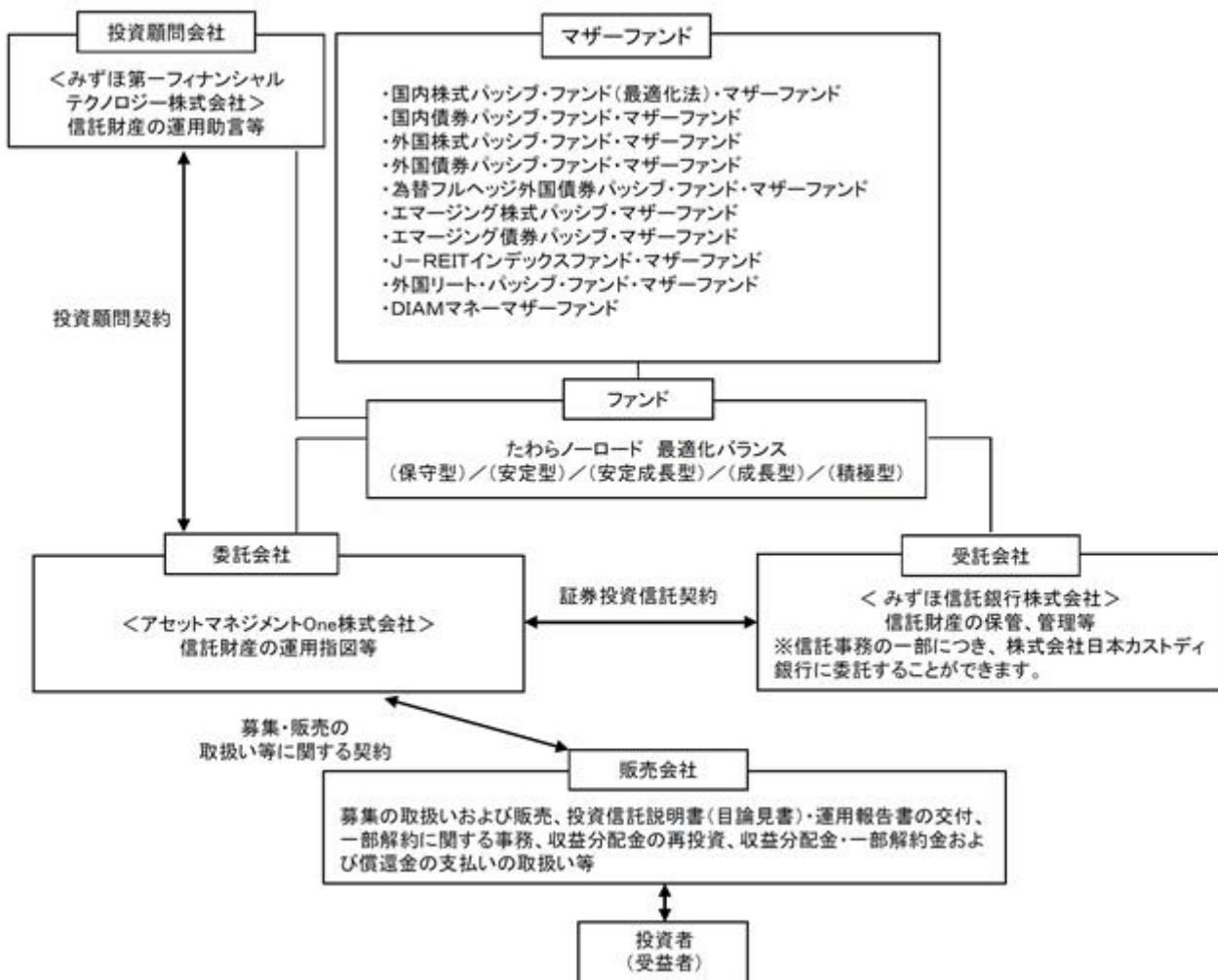
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

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

（2）【ファンドの沿革】

2018年1月24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

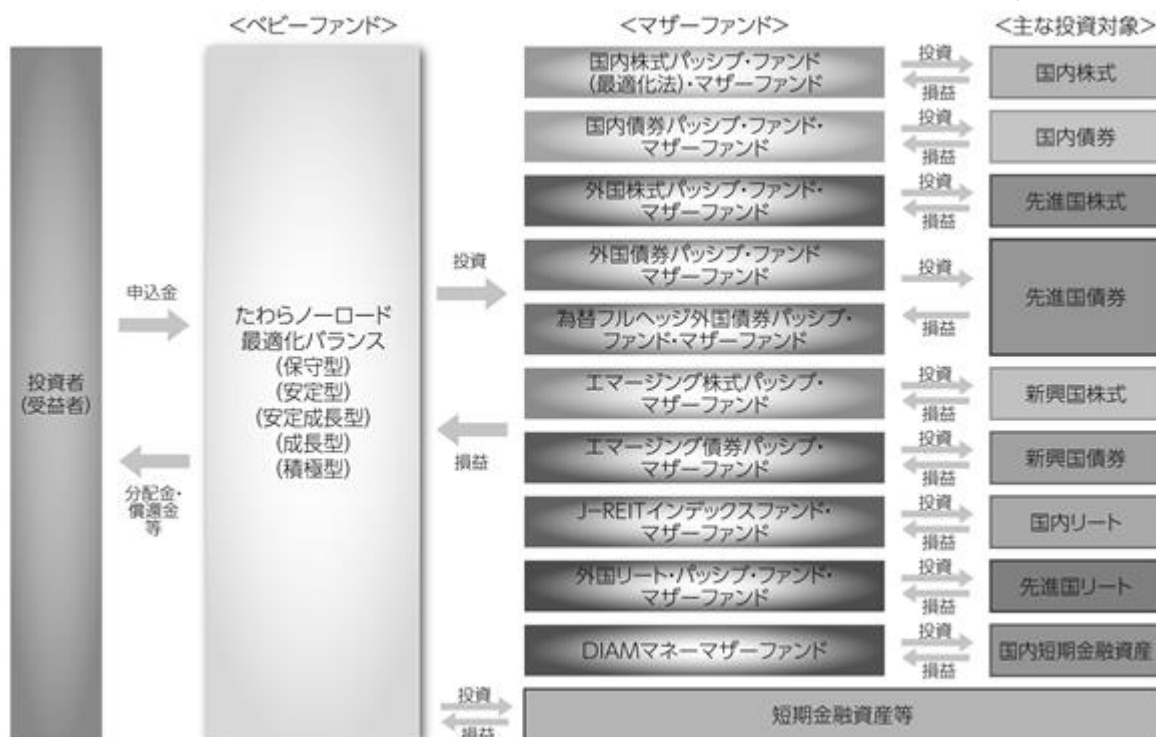
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、運用にかかる助言契約が締結されております。

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

ファミリーファンド方式とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2022年4月28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

(2022年4月28日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「国内債券パッシブ・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、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券および短期金融資産等に直接投資する場合があります。

<投資態度>

主として次のマザーファンド受益証券への投資を通じて、各資産クラスの代表的な指数に連動する投資成果をめざして運用を行い、実質的に国内株式、国内債券、国内リート、先進国株式（除く日本）、先進国債券（除く日本）、先進国債券（除く日本、ヘッジあり）、先進国リート（除く日本）、新興国株式、新興国債券へ投資します。なお、先進国株式（除く日本）については、各ファンドにおいて部分的に為替ヘッジ^(注)を行う場合があります。

(注)一部の通貨については流動性の観点等から対円での為替ヘッジが困難であるため、主要国通貨で代替的にヘッジする場合があります。

マザーファンド	マザーファンドが連動対象とする指数	資産クラス
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	東証株価指数（TOPIX）（配当込み）	国内株式
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	NOMURA-BPI総合	国内債券
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	M S C I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）	先進国株式（除く日本）
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	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）	先進国債券（除く日本）
為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）	先進国債券（除く日本、ヘッジあり）
エマージング株式パッシブ・マザーファンド	M S C I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）	新興国株式
エマージング債券パッシブ・マザーファンド	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）	新興国債券
J-REITインデックスファンド・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）	国内リート
外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	S&P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）	先進国リート（除く日本）

上記マザーファンドおよびD I A Mマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」または総称して「マザーファンド」ということがあります。

ファンドごとに目標とするリスク水準（標準偏差）を設定します。

<各ファンドの目標リスク水準（注）>

ファンド名	目標リスク水準 （年率標準偏差）
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	年率約2%程度
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	年率約5%程度
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	年率約7%程度
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	年率約10%程度
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	年率約13%程度

（注）目標とするリスク水準（標準偏差）とは、ファンドの月次収益率の標準偏差（年率）の用途を指し、各ファンドにおける保有資産比率を決定する際の目標値として使用します。このため各ファンドの実際のリスク水準が目標リスク水準を上回る場合や下回る場合があります。また目標リスク水準は今後変更される場合があります。

各ファンドにおける資産別の投資比率は、各資産に期待される収益率や過去一定期間における資産価格変動性（標準偏差）等、客観的に入手しうるデータに基づき、最適化計算（目標リスク水準に対してリターンが最大化されるような投資比率を求める計算）を行い定量的に算出されます。

決定された投資比率に基づき、各マザーファンド受益証券への投資を行いポートフォリオを構築します。投資比率の見直しは原則として年2回行うこととします。

なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

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

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

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。)

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証券

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

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

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.~11.の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。)
 15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
 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せん。)
 21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

(参考)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	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。 <p>東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)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・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>JPX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東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>JPX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、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>JPXは、当社または本件商品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および計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p>
------	---

<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。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定
<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>

<p>ファンド名</p>	<p>国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド</p>
--------------	------------------------------

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> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <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> </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 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</p> <p>1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>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>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 <div style="margin-top: 20px;"> </div>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りません。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、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	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

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

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

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

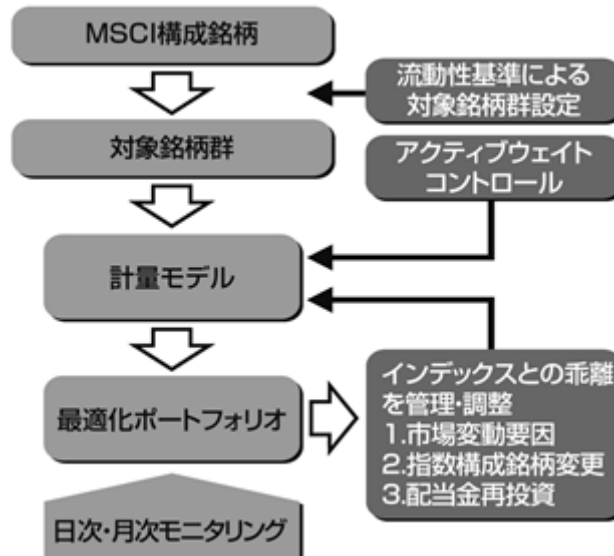
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

ファンド名	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	<ol style="list-style-type: none"> 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。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産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。 <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

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。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

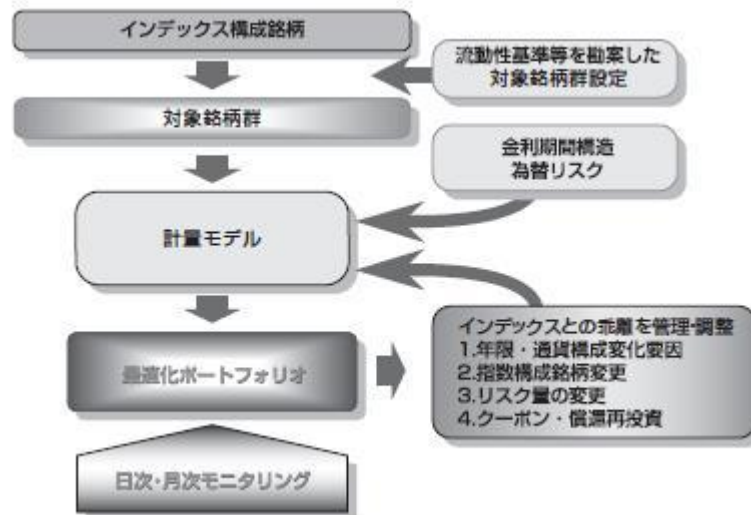
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

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。

- ・ 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ません。</p> <p>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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div data-bbox="357 1559 1394 1951" style="border: 1px solid black; padding: 5px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B F --> C G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> C H --> B subgraph H_Box [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1. 年限・通貨構成変化要因] H2[2. インデックス構成銘柄変更] H3[3. リスク量の変更] H4[4. クーポン・償還再投資] end </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 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。 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。 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 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。 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。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド

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

投資態度	<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、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
------	---

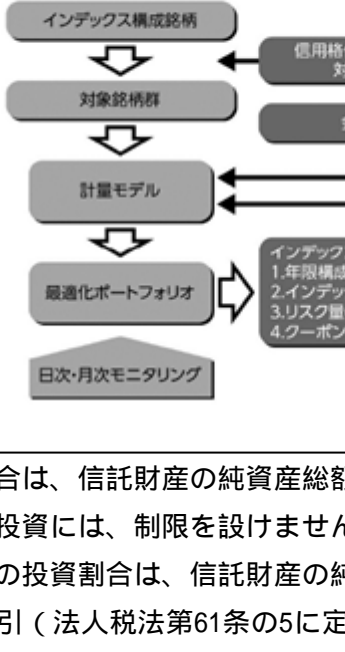
本ファンドは、MSCI Inc. (以下、「MSCI」といいます。)、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者(以下、総称して「MSCI関係者」といいます。)によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する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

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

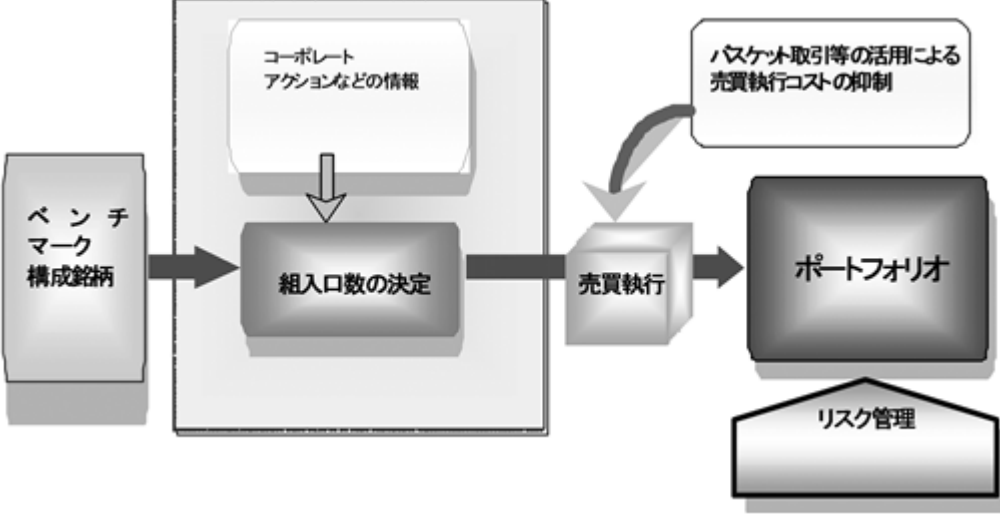
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者ま

	<p>たは団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。</p>
<p>運用プロセス</p>	<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。 日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[MSCI構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] E[アクティブウェイトコントロール] --> C E --> D F["インデックスとの乖離を管理・調整 1.市場変動要因 2.指数構成銘柄変更 3.配当金再投資"] --> D G[日々・月次モニタリング] --> D </pre>
<p>主な投資制限</p>	<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。

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>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。</p>

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

ファンド名	J-REITインデックスファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.東京証券取引所に上場し、東証REIT指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証REIT指数(配当込み)が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証REIT指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>JPXは、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p> </div>

運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証REIT指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 3. 株式への投資は行いません。 4. 外貨建資産への投資は行いません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

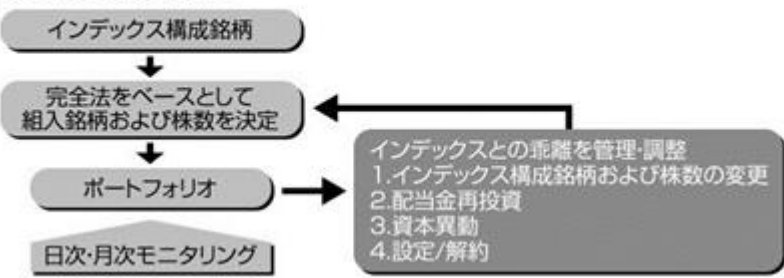
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とします。 海外の証券取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券とします。

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。ただし、金利・為替状況によってはヘッジを行う場合があります。
------	--

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

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

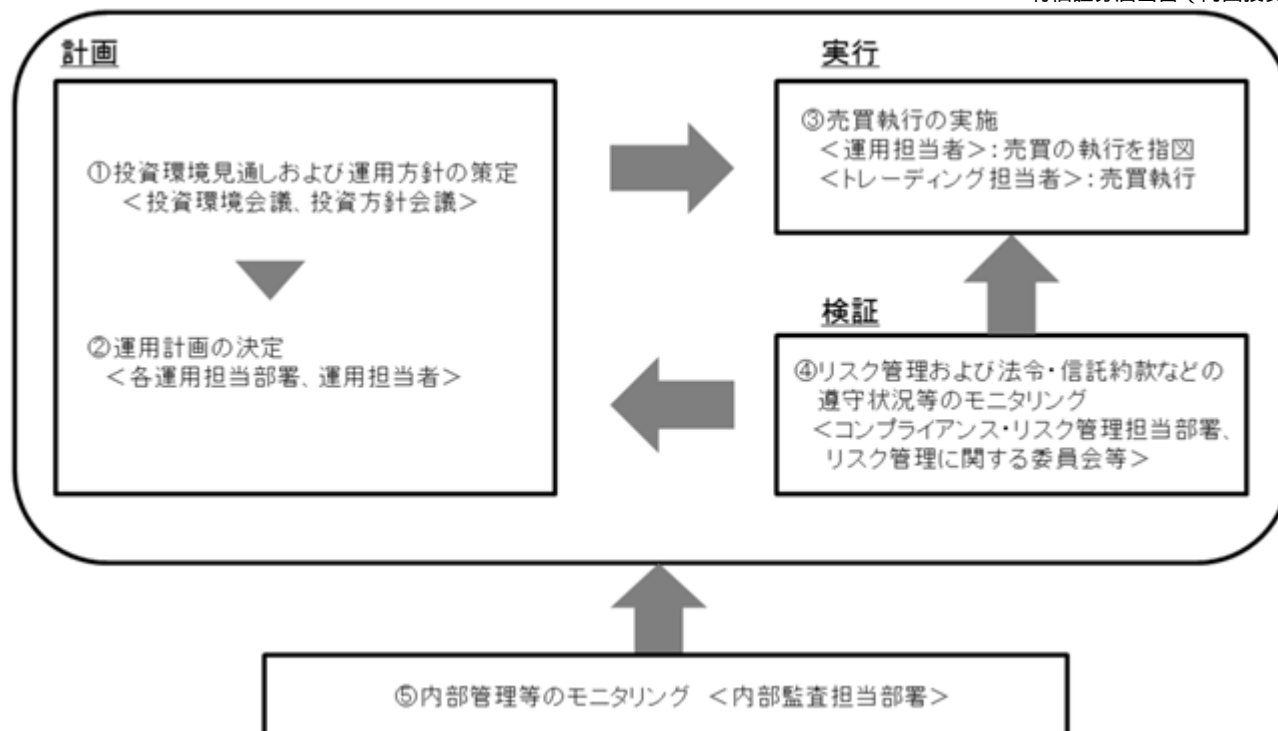
	<p>して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日々・月次モニタリング] C --> E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] E --> B </pre>
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との運動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス(除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	D I A Mマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにC D、C P、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がA A -格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のC D、C Pを主要投資対象とします。</p> <p>(*) 主要格付機関とは、R & I、J C R、M o o d y ' s、S & Pとします。</p> <p>2. 国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。</p> <p>3. ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。</p>
運用プロセス	マクロ経済分析を主体としたファンダメンタルズ分析、投資家の需給動向等分析および信用リスク市場の分析等に基づき、短期金利の方向性見通し、セクター別のクレジットスプレッドの拡縮等を予測し、ファンドのデュレーションおよびセクター配分を決定します（トップダウンアプローチ）。
主な投資制限	<p>1. 株式への投資割合は、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は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>3. 同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>4. 新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>5. 投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>6. 外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>7. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>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。</p>

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見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2022年4月28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10月12日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

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

収益の分配方式

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5)【投資制限】

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

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

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

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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

信用取引の指図範囲（約款第22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ます。）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（上記5.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図（約款第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を回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、 で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 2) 委託会社は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対

象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金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、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。

2)スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3)スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、当該純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第25条)

1) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクや為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下3)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。以下3)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4) 上記3)においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5) 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。以下5)において同じ。)が、信託財産にかかるヘッジ対象とする外貨建資産(「ヘッジ対象外貨建資産」といいます。以下5)において同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(「ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えるこ

となった場合には、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26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27条)

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

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

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

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

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第28条)

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

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

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

公社債の借入れの指図および範囲(約款第29条)

1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。

- 2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 3)信託財産の一部解約等の事由により、上記2)の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- 4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30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31条)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産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。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

資金の借入れ(約款第37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。

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

不動産投資信託証券(リート)の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

為替相場は、各国の政治情勢、経済状況等の様々な要因により変動し、外貨建資産の円換算価格に影響をおよぼします。各ファンドは一部の実質組入外貨建資産について、対円での為替ヘッジを行います。

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

為替ヘッジを行う資産については、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。各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、各ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

流動性リスク

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

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

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドの受益権口数が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信託を終了(繰上償還)する場合があります。

注意事項

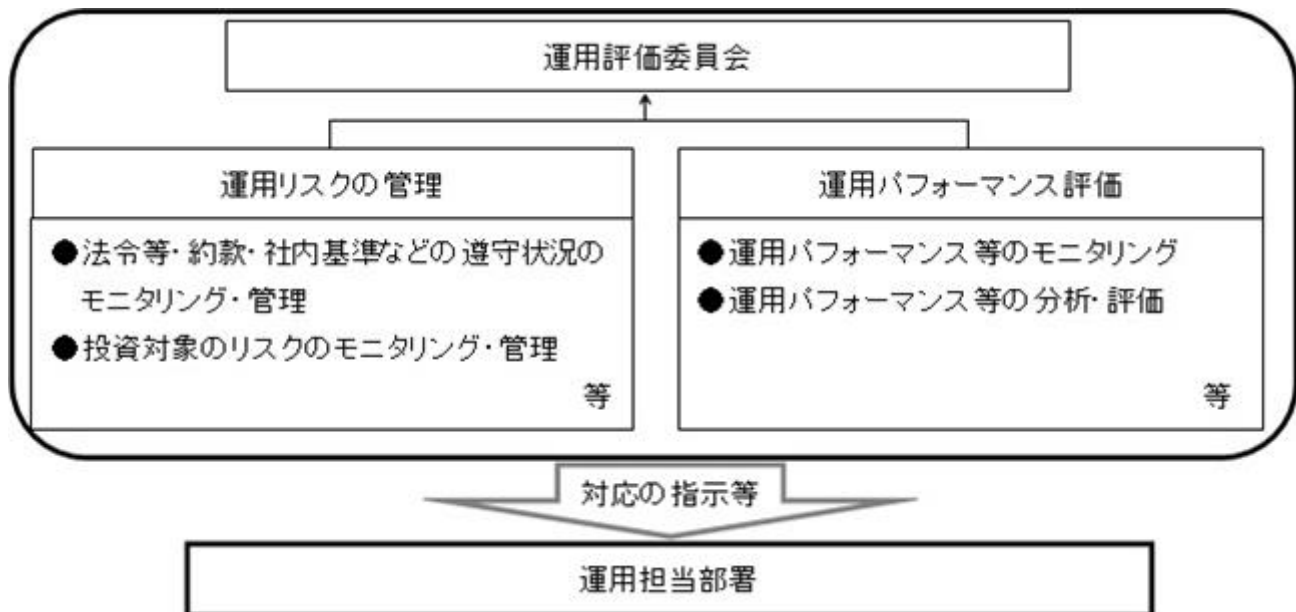
- ・各ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。

- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・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。



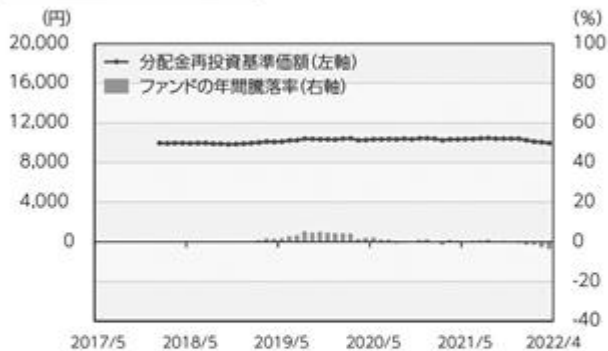
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2022年4月28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

（保守型）



（安定型）



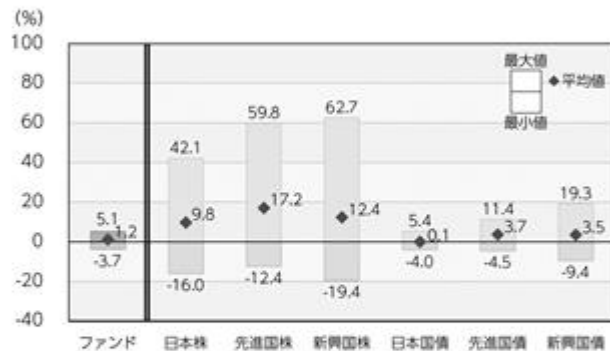
（安定成長型）



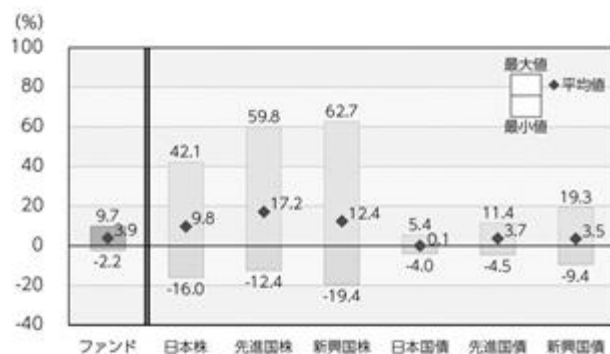
*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

*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。

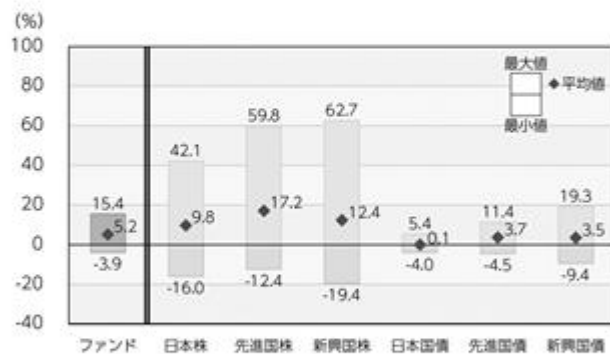
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2019年1月～2022年4月
代表的な資産クラス:2017年5月～2022年4月



ファンド:2019年1月～2022年4月
代表的な資産クラス:2017年5月～2022年4月



ファンド:2019年1月～2022年4月
代表的な資産クラス:2017年5月～2022年4月

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

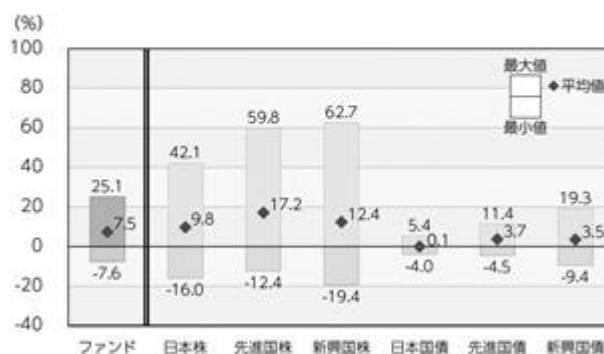
<参考情報>

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

(成長型)

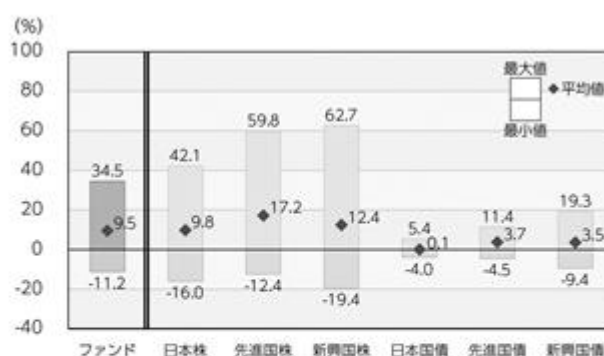


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2019年1月~2022年4月
代表的な資産クラス:2017年5月~2022年4月

(積極型)



ファンド:2019年1月~2022年4月
代表的な資産クラス:2017年5月~2022年4月

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

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)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・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPX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・ディバースィファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバースィファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(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0.55%（税抜0.50%）以内

2022年7月12日現在は、年率0.55%（税抜0.50%）になります。

配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.23%	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0.23%	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0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、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（各ファンドの純資産総額に対して年率0.03795%（税抜0.0345%））が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

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

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

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

マザーファンドで負担する有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外国での資産の保管等に要する費用は、間接的に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、定期的に見直されるものや売買条件等により異なるものがあるため、事前に料率・上限額等を示すことができません。

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

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。

公募株式投資信託は税法上、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)」の適用対象です。また、販

売会社によっては非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「愛称：つみたてNISA（つみたてニーサ）」の適用対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAまたはつみたてNISA（いずれかの選択）、およびジュニアNISAをご利用の場合、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。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記は、2022年4月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

2022年4月28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	38,451,196	99.44
内 日本	38,451,196	99.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	216,293	0.56
純資産総額	38,667,489	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。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

2022年4月28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	79,447,959	99.49
内 日本	79,447,959	99.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	409,770	0.51
純資産総額	79,857,729	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。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

2022年4月28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	849,114,503	99.40
内 日本	849,114,503	99.40
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,111,432	0.60
純資産総額	854,225,935	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。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

2022年4月28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	90,949,734	99.48
内 日本	90,949,734	99.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	473,729	0.52
純資産総額	91,423,463	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。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

2022年4月28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	223,292,626	99.46
内 日本	223,292,626	99.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,211,905	0.54
純資産総額	224,504,531	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）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	346,269,026,100	96.18
内 日本	346,269,026,100	96.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,751,986,691	3.82
純資産総額	360,021,012,791	100.00

その他資産の投資状況

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	13,968,020,000	3.88
内 日本	13,968,020,000	3.88

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	492,999,027,300	84.36
内 日本	492,999,027,300	84.36
地方債証券	30,735,431,587	5.26
内 日本	30,735,431,587	5.26
特殊債券	28,216,204,683	4.83
内 日本	28,216,204,683	4.83
社債券	27,940,731,410	4.78
内 日本	27,143,295,410	4.64
内 フランス	797,436,000	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,530,548,188	0.78
純資産総額	584,421,943,168	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

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	689,202,089,490	95.32
内 アメリカ	485,227,817,203	67.11
内 イギリス	30,298,522,000	4.19
内 カナダ	27,527,009,400	3.81
内 スイス	24,078,610,381	3.33
内 フランス	21,429,844,306	2.96
内 ドイツ	16,360,607,960	2.26
内 オーストラリア	15,487,212,272	2.14
内 アイルランド	12,852,729,781	1.78
内 オランダ	12,243,002,213	1.69
内 スウェーデン	6,784,275,407	0.94

内 デンマーク	5,702,118,260	0.79
内 スペイン	4,998,655,795	0.69
内 香港	4,471,939,492	0.62
内 イタリア	3,591,830,205	0.50
内 ジャージー	2,694,559,902	0.37
内 フィンランド	2,533,613,524	0.35
内 シンガポール	2,280,943,499	0.32
内 ベルギー	1,775,293,528	0.25
内 ノルウェー	1,590,072,461	0.22
内 ケイマン諸島	1,471,702,574	0.20
内 イスラエル	1,449,191,240	0.20
内 バミューダ	989,206,061	0.14
内 オランダ領キュラソー	761,629,942	0.11
内 ルクセンブルグ	630,511,993	0.09
内 ニュージーランド	551,551,957	0.08
内 オーストリア	436,421,099	0.06
内 ポルトガル	355,545,647	0.05
内 リベリア	272,012,171	0.04
内 パナマ	209,201,954	0.03
内 マン島	146,457,263	0.02
投資信託受益証券	1,339,593,746	0.19
内 オーストラリア	1,028,474,531	0.14
内 シンガポール	311,119,215	0.04
投資証券	16,976,389,671	2.35
内 アメリカ	15,856,311,523	2.19
内 イギリス	463,870,207	0.06
内 フランス	310,008,523	0.04
内 香港	266,825,577	0.04
内 カナダ	79,373,841	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	15,556,983,027	2.15
純資産総額	723,075,055,934	100.00

その他資産の投資状況

2022年4月28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）	16,103,280,134	2.23
内 アメリカ	11,850,674,330	1.64
内 ドイツ	2,265,709,598	0.31
内 カナダ	880,203,170	0.12
内 イギリス	741,896,681	0.10
内 オーストラリア	364,796,355	0.05

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	178,308,770,459	98.98

内 アメリカ	88,467,746,968	49.11
内 フランス	16,571,735,048	9.20
内 イタリア	14,726,765,201	8.18
内 ドイツ	12,349,897,207	6.86
内 スペイン	9,819,953,714	5.45
内 イギリス	9,466,640,882	5.26
内 ベルギー	3,751,015,369	2.08
内 カナダ	3,629,568,589	2.01
内 オランダ	3,213,222,734	1.78
内 オーストラリア	2,844,113,278	1.58
内 中国	2,647,210,479	1.47
内 オーストリア	2,437,939,030	1.35
内 メキシコ	1,301,380,926	0.72
内 アイルランド	1,246,945,705	0.69
内 フィンランド	1,033,787,422	0.57
内 マレーシア	869,176,773	0.48
内 イスラエル	763,737,136	0.42
内 ポーランド	762,365,250	0.42
内 シンガポール	737,242,208	0.41
内 デンマーク	725,725,314	0.40
内 スウェーデン	476,466,938	0.26
内 ノルウェー	466,134,288	0.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,833,919,815	1.02
純資産総額	180,142,690,274	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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	449,655,449,630	134.04
内 アメリカ	222,498,735,404	66.32
内 フランス	42,060,221,177	12.54
内 イタリア	37,215,570,006	11.09
内 ドイツ	31,263,715,607	9.32
内 スペイン	24,929,098,095	7.43
内 イギリス	24,021,268,950	7.16
内 ベルギー	9,382,361,675	2.80
内 カナダ	9,122,052,442	2.72
内 オランダ	8,076,675,565	2.41
内 オーストラリア	7,200,321,260	2.15
内 中国	6,680,152,955	1.99
内 オーストリア	6,155,117,155	1.83
内 メキシコ	3,293,602,636	0.98
内 アイルランド	3,204,084,514	0.96
内 フィンランド	2,430,394,178	0.72
内 マレーシア	2,148,721,635	0.64
内 イスラエル	1,944,889,418	0.58
内 ポーランド	1,933,856,348	0.58
内 シンガポール	1,897,353,919	0.57

内 デンマーク	1,793,864,746	0.53
内 スウェーデン	1,233,952,228	0.37
内 ノルウェー	1,169,439,717	0.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	114,185,092,427	34.04
純資産総額	335,470,357,203	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

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	50,386,145,097	83.96
内 ケイマン諸島	8,133,206,157	13.55
内 台湾	7,724,690,358	12.87
内 インド	7,105,575,091	11.84
内 韓国	6,295,783,166	10.49
内 中国	6,019,386,671	10.03
内 ブラジル	2,719,142,461	4.53
内 サウジアラビア	2,434,145,272	4.06
内 南アフリカ	1,832,977,484	3.05
内 インドネシア	1,011,414,377	1.69
内 タイ	963,072,332	1.60
内 メキシコ	925,174,011	1.54
内 マレーシア	806,353,815	1.34
内 アラブ首長国連邦	771,134,171	1.28
内 香港	583,173,576	0.97
内 カタール	538,917,186	0.90
内 クエート	439,769,365	0.73
内 フィリピン	406,581,273	0.68
内 ポーランド	317,358,764	0.53
内 チリ	249,833,921	0.42
内 バミューダ	239,908,205	0.40
内 アメリカ	167,563,346	0.28
内 トルコ	164,985,032	0.27
内 ギリシャ	123,708,300	0.21
内 コロンビア	112,786,301	0.19
内 ハンガリー	97,499,892	0.16
内 チェコ	79,465,995	0.13
内 エジプト	37,233,742	0.06
内 ルクセンブルグ	34,920,791	0.06
内 マン島	25,488,100	0.04
内 ベルー	14,611,686	0.02
内 シンガポール	10,284,256	0.02
内 オランダ	0	0.00
内 ロシア	0	0.00
内 キプロス	0	0.00
内 イギリス領バージン諸島	0	0.00
投資信託受益証券	334,658,500	0.56
内 メキシコ	215,269,357	0.36
内 ブラジル	119,389,143	0.20

投資証券		45,327,573	0.08
	内 メキシコ	23,973,773	0.04
	内 南アフリカ	21,353,800	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		9,248,302,944	15.41
純資産総額		60,014,434,114	100.00

その他資産の投資状況

2022年4月28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）	9,245,257,855	15.41	
	内 アメリカ	9,245,257,855	15.41

（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

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
国債証券	116,480,369,829	89.43	
	内 メキシコ	13,218,096,932	10.15
	内 インドネシア	12,732,624,761	9.78
	内 ブラジル	10,907,373,767	8.37
	内 フィリピン	10,484,364,619	8.05
	内 コロンビア	9,202,761,965	7.07
	内 パナマ	9,079,196,165	6.97
	内 南アフリカ	8,501,501,104	6.53
	内 ベルギー	8,438,457,661	6.48
	内 サウジアラビア	6,007,406,935	4.61
	内 ハンガリー	5,190,869,981	3.99
	内 カタール	4,746,929,216	3.64
	内 アラブ首長国連邦	4,681,687,652	3.59
	内 ルーマニア	4,433,514,117	3.40
	内 チリ	2,906,613,833	2.23
	内 クロアチア	2,370,824,911	1.82
	内 ドミニカ共和国	1,792,633,112	1.38
	内 ウルグアイ	1,082,114,736	0.83
	内 中国	703,398,362	0.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	13,772,713,416	10.57	
純資産総額	130,253,083,245	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
投資証券	177,471,311,700	92.33	
	内 日本	177,471,311,700	92.33
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,745,887,826	7.67	
純資産総額	192,217,199,526	100.00	

その他資産の投資状況

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	4,606,227,000	2.40
内 日本	4,606,227,000	2.40

（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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	7,645,701,415	8.66
内 オーストラリア	5,022,682,901	5.69
内 シンガポール	2,565,600,237	2.91
内 香港	57,418,277	0.07
投資証券	67,925,713,777	76.97
内 アメリカ	58,141,529,560	65.89
内 イギリス	3,848,770,669	4.36
内 カナダ	1,400,081,096	1.59
内 フランス	1,293,065,050	1.47
内 香港	987,353,949	1.12
内 ベルギー	958,701,121	1.09
内 スペイン	305,106,490	0.35
内 ニューージーランド	261,711,326	0.30
内 ガーンジー	210,563,403	0.24
内 韓国	173,842,720	0.20
内 オランダ	135,587,834	0.15
内 アイルランド	88,239,450	0.10
内 イスラエル	57,405,433	0.07
内 ドイツ	42,427,708	0.05
内 イタリア	21,327,968	0.02
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	12,673,248,296	14.36
純資産総額	88,244,663,488	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

2022年4月28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	17,914,908	1.3036 23,355,544	1.2832 22,988,409	- -	59.45

2	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,615,478	1.4189 10,806,085	1.3160 10,021,969	- -	25.92
3	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	733,348	3.2595 2,390,406	3.1831 2,334,320	- -	6.04
4	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,172,989	2.1509 2,523,096	1.9862 2,329,790	- -	6.03
5	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	370,014	2.0655 764,269	2.0758 768,075	- -	1.99
6	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	1,447	5.5791 8,073	5.9665 8,633	- -	0.02

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.44
合計	99.44

（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。

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

2022年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	19,388,916	1.4172 27,479,313	1.3160 25,515,813	- -	31.95
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	14,055,418	1.3028 18,312,429	1.2832 18,035,912	- -	22.59
3	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,019,423	3.2586 9,839,189	3.1831 9,611,125	- -	12.04
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	1,174,465	5.7288 6,728,372	5.9665 7,007,445	- -	8.77
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	3,209,028	2.1576 6,924,010	1.9862 6,373,771	- -	7.98

6	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	3,062,120	2.0565 6,297,415	2.0758 6,356,348	- -	7.96
7	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,322,296	2.3980 5,569,051	2.3935 5,558,415	- -	6.96
8	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	540,265	1.4498 783,321	1.3836 747,510	- -	0.94
9	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	126,975	1.5814 200,810	1.9029 241,620	- -	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.49
合計	99.49

(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。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

2022年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	176,344,556	1.4126 249,106,643	1.3160 232,069,435	- -	27.17
2	国内株式パッシブ・ファン ド(最適化法)・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	43,276,099	3.2597 141,069,493	3.1831 137,752,150	- -	16.13
3	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	103,471,359	1.3018 134,705,135	1.2832 132,774,447	- -	15.54
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	19,627,439	5.7189 112,248,539	5.9665 117,107,114	- -	13.71
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	31,919,226	2.4121 76,994,063	2.3935 76,398,667	- -	8.94
6	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	30,076,752	2.1446 64,505,038	1.9862 59,738,444	- -	6.99
7	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	28,700,669	2.0570 59,039,078	2.0758 59,576,848	- -	6.97

8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	18,338,143	1.4503 26,597,409	1.3836 25,372,654	- -	2.97
9	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,374,767	1.6214 7,093,339	1.9029 8,324,744	- -	0.97

(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

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.40
合計	99.40

(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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

2022年4月28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	6,377,732	3.2669 20,835,972	3.1831 20,300,958	- -	22.21
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,314,740	5.6750 18,811,193	5.9665 19,777,396	- -	21.63
3	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	13,233,446	1.4168 18,749,524	1.3160 17,415,214	- -	19.05
4	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,607,376	2.4197 11,148,819	2.3935 11,027,754	- -	12.06
5	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,421,468	1.3029 7,063,775	1.2832 6,956,827	- -	7.61
6	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,214,418	2.0597 4,561,144	2.0758 4,596,688	- -	5.03
7	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,300,476	2.1611 4,971,699	1.9862 4,569,205	- -	5.00
8	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,879,525	1.6090 3,024,286	1.9029 3,576,548	- -	3.91
9	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,972,495	1.4568 2,873,533	1.3836 2,729,144	- -	2.99

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.48
合計	99.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

2022年4月28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	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	10,745,613	5.6998 61,248,153	5.9665 64,113,699	- -	28.56
2	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	19,962,324	3.2743 65,363,075	3.1831 63,542,073	- -	28.30
3	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	13,175,334	2.4292 32,006,656	2.3935 31,535,161	- -	14.05
4	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	19,564,301	1.4166 27,715,499	1.3160 25,746,620	- -	11.47
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	10,467,879	1.6182 16,939,252	1.9029 19,919,326	- -	8.87
6	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	6,488,105	1.4561 9,447,459	1.3836 8,976,942	- -	4.00
7	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,174,323	2.0618 4,483,228	2.0758 4,513,459	- -	2.01
8	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,222,210	2.1577 4,794,904	1.9862 4,413,753	- -	1.97
9	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	414,272	1.3053 540,769	1.2832 531,593	- -	0.24

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.46

合計	99.46
----	-------

(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)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2022年4月28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	6,664,500	2,243.53 14,952,034,027	2,235.50 14,898,489,750	- -	4.14
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	852,500	12,668.18 10,799,626,003	11,220.00 9,565,050,000	- -	2.66
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	123,300	58,267.92 7,184,434,721	52,850.00 6,516,405,000	- -	1.81
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,231,700	754.04 6,207,053,177	754.30 6,209,171,310	- -	1.72
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,430,200	3,411.59 4,879,263,428	3,847.00 5,501,979,400	- -	1.53
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	86,400	56,610.16 4,891,118,645	55,480.00 4,793,472,000	- -	1.33
7	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	979,400	5,639.10 5,522,934,790	4,818.00 4,718,749,200	- -	1.31
8	任天堂 日本	株式 その他製品	76,800	59,436.46 4,564,720,309	59,910.00 4,601,088,000	- -	1.28
9	KDDI 日本	株式 情報・通信業	973,600	3,833.99 3,732,776,702	4,335.00 4,220,556,000	- -	1.17
10	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	800,800	5,344.24 4,279,669,950	5,269.00 4,219,415,200	- -	1.17
11	三菱商事 日本	株式 卸売業	962,600	4,094.22 3,941,101,696	4,383.00 4,219,075,800	- -	1.17
12	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,069,700	3,488.77 3,731,941,212	3,769.00 4,031,699,300	- -	1.12
13	信越化学工業 日本	株式 化学	223,000	18,932.42 4,221,929,882	17,985.00 4,010,655,000	- -	1.11
14	日立製作所 日本	株式 電気機器	654,600	5,936.86 3,886,270,252	6,072.00 3,974,731,200	- -	1.10
15	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,046,100	3,426.16 3,584,114,500	3,419.00 3,576,615,900	- -	0.99

16	三井住友フィナンシャルグループ	株式	909,800	4,312.77	3,915.00	-	0.99
	日本	銀行業		3,923,765,682	3,561,867,000	-	
17	伊藤忠商事	株式	892,900	3,813.25	3,932.00	-	0.98
	日本	卸売業		3,404,854,835	3,510,882,800	-	
18	HOYA	株式	265,500	15,157.31	12,990.00	-	0.96
	日本	精密機器		4,024,268,100	3,448,845,000	-	
19	第一三共	株式	1,042,200	2,396.64	3,262.00	-	0.94
	日本	医薬品		2,497,785,390	3,399,656,400	-	
20	ダイキン工業	株式	165,100	22,549.73	20,045.00	-	0.92
	日本	機械		3,722,960,618	3,309,429,500	-	
21	三井物産	株式	1,017,900	3,048.12	3,150.00	-	0.89
	日本	卸売業		3,102,688,058	3,206,385,000	-	
22	ソフトバンク	株式	2,022,700	1,460.11	1,515.00	-	0.85
	日本	情報・通信業		2,953,376,562	3,064,390,500	-	
23	村田製作所	株式	390,300	8,242.00	7,794.00	-	0.84
	日本	電気機器		3,216,856,002	3,041,998,200	-	
24	オリエンタルランド	株式	148,600	21,623.87	19,775.00	-	0.82
	日本	サービス業		3,213,307,287	2,938,565,000	-	
25	東京海上ホールディングス	株式	411,800	7,169.41	7,019.00	-	0.80
	日本	保険業		2,952,363,830	2,890,424,200	-	
26	日本電産	株式	335,900	9,963.39	8,539.00	-	0.80
	日本	電気機器		3,346,704,562	2,868,250,100	-	
27	セブン&アイ・ホールディングス	株式	499,400	5,738.21	5,718.00	-	0.79
	日本	小売業		2,865,663,054	2,855,569,200	-	
28	みずほフィナンシャルグループ	株式	1,681,000	1,625.53	1,578.50	-	0.74
	日本	銀行業		2,732,519,588	2,653,458,500	-	
29	SMC	株式	39,900	65,075.48	63,050.00	-	0.70
	日本	機械		2,596,511,820	2,515,695,000	-	
30	ファナック	株式	119,400	22,169.04	20,165.00	-	0.67
	日本	電気機器		2,646,984,143	2,407,701,000	-	

(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

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	96.18
合計	96.18

(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

2022年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	16.81
情報・通信業		8.49
輸送用機器		8.01
化学		6.21

卸売業	5.73
サービス業	5.43
銀行業	5.22
医薬品	5.09
機械	5.01
小売業	4.01
食料品	3.22
陸運業	2.98
精密機器	2.46
その他製品	2.33
保険業	2.12
建設業	2.10
不動産業	1.93
電気・ガス業	1.17
その他金融業	1.09
鉄鋼	0.79
非鉄金属	0.75
証券、商品先物取引業	0.72
ガラス・土石製品	0.69
ゴム製品	0.65
海運業	0.56
金属製品	0.54
石油・石炭製品	0.46
繊維製品	0.42
空運業	0.39
鉱業	0.32
パルプ・紙	0.20
倉庫・運輸関連業	0.17
水産・農林業	0.09
合計	96.18

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28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	3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	7,120,000,000	101.18 7,204,633,000	101.21 7,206,792,800	0.3 2025/12/20	1.23
2	1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年) 日本	国債証券	7,050,000,000	100.42 7,079,640,000	100.47 7,083,417,000	0.1 2025/9/20	1.21
3	3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	6,690,000,000	100.38 6,715,757,000	100.51 6,724,119,000	0.1 2026/12/20	1.15
4	3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年) 日本	国債証券	6,630,000,000	101.27 6,714,765,000	101.25 6,713,073,900	0.6 2024/3/20	1.15

5	141回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,610,000,000	100.35 6,633,333,000	100.35 6,633,663,800	0.1 2024/9/20	1.14
6	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,350,000,000	100.46 6,379,698,000	100.51 6,382,829,500	0.1 2026/6/20	1.09
7	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,100,000,000	100.23 6,114,635,000	100.21 6,112,993,000	0.1 2028/6/20	1.05
8	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,040,000,000	99.31 5,998,607,000	99.29 5,997,599,200	0.1 2030/9/20	1.03
9	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,810,000,000	99.00 5,752,160,700	98.82 5,741,500,100	0.1 2031/12/20	0.98
10	137回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,700,000,000	100.25 5,714,250,000	100.24 5,714,193,000	0.1 2023/9/20	0.98
11	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,690,000,000	100.29 5,706,523,000	100.40 5,712,930,700	0.1 2027/9/20	0.98
12	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,530,000,000	100.30 5,546,938,000	100.36 5,550,184,500	0.1 2027/12/20	0.95
13	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,500,000,000	99.21 5,456,556,000	99.19 5,455,615,000	0.1 2030/12/20	0.93
14	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,430,000,000	100.32 5,447,571,000	100.46 5,455,032,300	0.1 2027/6/20	0.93
15	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,340,000,000	100.03 5,341,630,000	100.12 5,346,781,800	0.1 2028/9/20	0.91
16	332回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,280,000,000	101.17 5,342,132,000	101.10 5,338,344,000	0.6 2023/12/20	0.91
17	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,300,000,000	99.23 5,259,479,000	98.96 5,245,357,000	0.1 2031/6/20	0.90
18	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,210,000,000	100.20 5,220,846,000	100.29 5,225,265,300	0.1 2028/3/20	0.89
19	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,200,000,000	100.37 5,219,631,000	100.45 5,223,660,000	0.1 2025/6/20	0.89
20	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,140,000,000	101.46 5,215,152,000	101.39 5,211,908,600	0.6 2024/6/20	0.89
21	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,140,000,000	99.16 5,097,236,300	99.08 5,092,917,600	0.1 2031/3/20	0.87

22	138回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,000,000,000	100.27 5,013,800,000	100.28 5,014,300,000	0.1 2023/12/20	0.86
23	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,000,000,000	98.89 4,944,652,000	98.89 4,944,800,000	0.1 2031/9/20	0.85
24	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,660,000,000	99.97 4,658,770,000	100.00 4,660,000,000	0.1 2029/3/20	0.80
25	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,510,000,000	101.35 4,571,022,000	101.39 4,572,959,600	0.4 2025/6/20	0.78
26	143回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	100.42 4,519,162,000	100.43 4,519,440,000	0.1 2025/3/20	0.77
27	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,480,000,000	100.37 4,496,728,000	100.50 4,502,624,000	0.1 2026/3/20	0.77
28	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,410,000,000	99.89 4,405,324,000	99.85 4,403,737,800	0.1 2029/6/20	0.75
29	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	101.26 4,384,558,000	101.29 4,386,203,400	0.4 2025/3/20	0.75
30	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,290,000,000	100.34 4,304,586,000	100.50 4,311,621,600	0.1 2026/9/20	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

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.36
地方債証券	5.26
特殊債券	4.83
社債券	4.78
合計	99.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2022年4月28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	1,768,650	21,713.32 38,403,272,907	20,175.61 35,683,592,980	- -	4.93

2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	768,762	38,059.66 29,258,825,522	36,495.72 28,056,529,771	- -	3.88
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	49,187	400,869.07 19,717,547,014	356,083.99 17,514,703,334	- -	2.42
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	91,958	113,607.32 10,447,102,643	113,591.37 10,445,635,993	- -	1.44
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	32,387	349,416.10 11,316,539,282	294,559.78 9,539,907,769	- -	1.32
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	30,851	348,992.49 10,766,767,375	296,430.83 9,145,187,616	- -	1.26
7	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケ ア・プロ バイ ダー/ヘル スケ ア・サー ビス	101,431	61,465.63 6,234,520,869	66,209.55 6,715,701,535	- -	0.93
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	283,884	21,425.62 6,082,391,869	23,465.40 6,661,453,316	- -	0.92
9	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	269,156	31,430.05 8,459,588,808	23,729.56 6,386,955,873	- -	0.88
10	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	140,677	40,878.62 5,750,682,345	42,469.67 5,974,507,004	- -	0.83
11	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	254,714	27,908.67 7,108,730,358	22,544.05 5,742,286,934	- -	0.79
12	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	260,624	20,114.83 5,242,409,121	20,535.12 5,351,947,616	- -	0.74

13	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	303,569	15,637.24 4,746,982,137	16,639.07 5,051,108,876	- -	0.70
14	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	318,197	19,418.19 6,178,812,382	15,646.18 4,978,567,919	- -	0.69
15	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	179,802	28,837.65 5,185,067,705	27,590.21 4,960,775,765	- -	0.69
16	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	454,626	10,216.53 4,644,704,188	10,906.71 4,958,474,122	- -	0.69
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	94,448	47,713.00 4,506,398,291	46,591.91 4,400,512,734	- -	0.61
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	112,295	44,816.14 5,032,628,651	38,864.17 4,364,252,643	- -	0.60
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	207,097	17,987.81 3,725,222,947	20,133.08 4,169,501,794	- -	0.58
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	603,972	6,428.93 3,882,897,930	6,409.49 3,871,156,359	- -	0.54
21	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	189,808	18,627.21 3,535,595,317	20,310.91 3,855,173,812	- -	0.53
22	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	441,612	7,825.47 3,455,822,835	8,448.06 3,730,765,379	- -	0.52
23	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	791,799	6,033.43 4,777,270,678	4,671.17 3,698,631,693	- -	0.51
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	75,230	45,820.33 3,447,064,162	48,408.82 3,641,795,904	- -	0.50
25	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	47,402	65,892.93 3,123,456,680	71,398.74 3,384,443,490	- -	0.47
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	148,763	21,414.35 3,185,663,309	22,531.17 3,351,804,591	- -	0.46
27	WALMART INC アメリカ	株式 食品・生活必需品 小売り	165,404	17,367.32 2,872,624,245	19,875.36 3,287,465,104	- -	0.45
28	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	87,481	30,888.51 2,702,157,919	36,736.69 3,213,763,025	- -	0.44
29	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製 造装置	44,310	74,742.46 3,311,838,817	72,102.32 3,194,853,994	- -	0.44

30	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	44,435	76,809.07 3,413,011,074	71,813.32 3,191,024,918	- -	0.44
----	-------------------------	---------------------------	--------	----------------------------	----------------------------	--------	------

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（％）
株式	95.32
投資信託受益証券	0.19
投資証券	2.35
合計	97.85

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年4月28日現在

業種	国内／外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	7.04
銀行		5.72
医薬品		5.31
コンピュータ・周辺機器		5.20
石油・ガス・消耗燃料		4.42
半導体・半導体製造装置		4.34
情報技術サービス		3.75
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.66
保険		3.13
資本市場		3.07
インターネット販売・通信販売		2.75
ヘルスケア機器・用品		2.38
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.34
化学		2.12
自動車		2.06
電力		1.87
バイオテクノロジー		1.84
飲料		1.80
ホテル・レストラン・レジャー		1.77
食品		1.70
金属・鉱業		1.69
食品・生活必需品小売り		1.61
専門小売り		1.59
機械		1.59
航空宇宙・防衛		1.51
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.37
繊維・アパレル・贅沢品		1.29
各種電気通信サービス		1.23
家庭用品		1.21
陸運・鉄道		1.10
娯楽		1.06
各種金融サービス		1.05

コングロマリット	0.97
総合公益事業	0.94
メディア	0.89
電気設備	0.78
タバコ	0.74
専門サービス	0.70
通信機器	0.66
航空貨物・物流サービス	0.56
電子装置・機器・部品	0.54
複合小売り	0.53
建設関連製品	0.53
パーソナル用品	0.53
消費者金融	0.47
商業サービス・用品	0.46
不動産管理・開発	0.38
商社・流通業	0.35
無線通信サービス	0.29
容器・包装	0.29
家庭用耐久財	0.28
建設資材	0.24
エネルギー設備・サービス	0.23
建設・土木	0.21
自動車部品	0.19
運送インフラ	0.14
ガス	0.14
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
水道	0.12
紙製品・林産品	0.11
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	0.09
旅客航空輸送業	0.06
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	95.32

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28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 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,112,061,800	94.47 1,050,578,073	87.22 970,013,274	1.25 2031/8/15	0.54
2	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	984,490,400	97.80 962,884,289	90.52 891,194,543	1.625 2031/5/15	0.49
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	999,953,600	93.65 936,495,704	86.92 869,256,531	1.125 2031/2/15	0.48
4	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	819,549,600	102.26 838,142,233	100.49 823,583,316	2.75 2023/11/15	0.46

5	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証 券	974,181,600	90.30 879,751,171	83.84 816,790,383	0.625 2030/8/15	0.45
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証 券	900,731,400	95.97 864,454,248	87.96 792,291,777	1.375 2031/11/15	0.44
7	US T N/B 2.75 02/15/24 アメリカ	国債証 券	777,025,800	102.49 796,396,567	100.42 780,364,576	2.75 2024/2/15	0.43
8	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証 券	806,663,600	97.56 786,983,180	96.06 774,901,220	0.125 2024/1/15	0.43
9	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証 券	902,020,000	90.80 819,051,371	85.33 769,782,450	0.875 2030/11/15	0.43
10	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証 券	765,428,400	98.82 756,417,820	94.12 720,459,481	1.5 2027/1/31	0.40
11	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証 券	694,555,400	101.72 706,555,644	98.85 686,633,125	2.25 2024/11/15	0.38
12	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証 券	710,018,600	97.47 692,123,224	95.83 680,425,243	0.25 2024/3/15	0.38
13	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証 券	708,730,000	97.64 692,007,294	95.83 679,245,718	0.375 2024/4/15	0.38
14	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証 券	675,226,400	105.95 715,411,000	100.10 675,912,172	2.875 2028/5/15	0.38
15	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証 券	657,186,000	102.14 671,261,144	99.84 656,159,146	2.5 2024/5/15	0.36
16	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証 券	649,454,400	101.00 655,949,318	98.02 636,617,524	2 2025/2/15	0.35
17	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証 券	637,857,000	101.78 649,274,279	98.15 626,096,510	2.25 2025/11/15	0.35
18	US T N/B 2.0 08/15/51 アメリカ	国債証 券	758,985,400	92.44 701,634,344	81.83 621,122,810	2 2051/8/15	0.34
19	US T N/B 2.125 03/31/24 アメリカ	国債証 券	623,682,400	101.29 631,737,482	99.19 618,688,062	2.125 2024/3/31	0.34
20	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証 券	622,393,800	104.90 652,949,989	98.62 613,860,193	2.625 2029/2/15	0.34
21	US T N/B 2.0 05/31/24 アメリカ	国債証 券	614,662,200	100.97 620,664,756	98.80 607,339,070	2 2024/5/31	0.34
22	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証 券	632,702,600	95.75 605,825,393	95.82 606,257,604	1.125 2025/1/15	0.34
23	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証 券	533,811,900	117.25 625,930,055	111.24 593,836,163	2.5 2030/5/25	0.33
24	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証 券	605,642,000	102.64 621,682,045	97.89 592,914,050	2.375 2027/5/15	0.33
25	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証 券	618,528,000	97.41 602,531,478	95.83 592,772,103	0.125 2024/2/15	0.33
26	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証 券	608,219,200	99.89 607,582,038	97.09 590,566,584	2.25 2027/8/15	0.33
27	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証 券	594,044,600	101.93 605,534,410	99.31 589,960,543	2.375 2024/8/15	0.33
28	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証 券	590,178,800	102.86 607,068,866	99.42 586,812,931	2.75 2028/2/15	0.33
29	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証 券	586,313,000	101.99 597,989,572	99.99 586,267,190	2.5 2024/1/31	0.33

30	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	529,737,000	113.93 603,538,627	110.43 585,004,461	2.75 2027/10/25	0.32
----	----------------------------------	------	-------------	-----------------------	-----------------------	--------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.98
合計	98.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28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 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	2,765,335,600	92.99 2,571,713,458	87.22 2,412,107,169	1.25 2031/8/15	0.72
2	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	2,631,321,200	93.01 2,447,642,957	87.96 2,314,534,782	1.375 2031/11/15	0.69
3	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	2,489,575,200	96.11 2,392,870,331	90.52 2,253,649,036	1.625 2031/5/15	0.67
4	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	2,480,555,000	87.58 2,172,716,320	86.92 2,156,338,696	1.125 2031/2/15	0.64
5	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	2,068,203,000	99.75 2,063,158,517	99.84 2,064,971,432	2.5 2024/5/15	0.62
6	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	2,410,970,600	88.06 2,123,322,194	85.33 2,057,518,524	0.875 2030/11/15	0.61
7	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	2,061,760,000	99.23 2,045,930,837	99.31 2,047,585,400	2.375 2024/8/15	0.61
8	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	2,099,129,400	95.90 2,013,245,769	94.12 1,975,805,547	1.5 2027/1/31	0.59
9	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	2,355,560,800	86.27 2,032,301,972	83.84 1,974,990,508	0.625 2030/8/15	0.59
10	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,872,335,800	109.55 2,051,304,757	98.62 1,846,664,314	2.625 2029/2/15	0.55
11	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	2,012,793,200	100.45 2,021,990,157	89.16 1,794,688,174	2.375 2051/5/15	0.53
12	US T N/B 1.75 03/15/25 アメリカ	国債証券	1,816,926,000	97.34 1,768,747,745	97.28 1,767,599,292	1.75 2025/3/15	0.53
13	US T N/B 1.875 02/15/41 アメリカ	国債証券	2,126,190,000	83.30 1,771,315,130	82.54 1,755,103,400	1.875 2041/2/15	0.52
14	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	1,568,836,500	117.68 1,846,358,922	111.24 1,745,243,692	2.5 2030/5/25	0.52
15	US T N/B 0.75 11/15/24 アメリカ	国債証券	1,809,194,400	95.88 1,734,680,074	95.18 1,722,126,919	0.75 2024/11/15	0.51
16	DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25 ドイツ	国債証券	1,655,767,700	100.94 1,671,395,797	100.62 1,666,116,248	0.5 2025/2/15	0.50

17	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	1,657,139,600	111.10 1,841,107,979	100.10 1,658,952,095	2.875 2028/8/15	0.49
18	US T N/B 1.875 02/15/51 アメリカ	国債証券	2,028,256,400	85.73 1,738,932,367	79.39 1,610,245,429	1.875 2051/2/15	0.48
19	FRANCE OAT 4.5 04/25/41 フランス	国債証券	1,096,148,100	160.21 1,756,192,537	146.31 1,603,827,996	4.5 2041/4/25	0.48
20	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証券	1,667,448,400	96.28 1,605,468,415	95.82 1,597,754,258	1.125 2025/1/15	0.48
21	US T N/B 2.0 08/15/51 アメリカ	国債証券	1,947,074,600	96.16 1,872,397,201	81.83 1,593,406,742	2 2051/8/15	0.47
22	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,546,320,000	100.58 1,555,407,207	99.42 1,537,501,136	2.75 2028/2/15	0.46
23	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	1,547,103,700	101.21 1,565,891,596	99.27 1,535,840,785	0.75 2028/5/25	0.46
24	US T N/B 1.875 11/15/51 アメリカ	国債証券	1,931,611,400	84.36 1,629,638,391	79.44 1,534,574,700	1.875 2051/11/15	0.46
25	US T N/B 0.75 08/31/26 アメリカ	国債証券	1,675,180,000	92.03 1,541,831,806	91.56 1,533,836,687	0.75 2026/8/31	0.46
26	US T N/B 2.25 02/15/52 アメリカ	国債証券	1,764,093,400	87.69 1,547,027,299	86.94 1,533,796,510	2.25 2052/2/15	0.46
27	US T N/B 0.25 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,582,400,800	99.81 1,579,433,798	96.73 1,530,787,331	0.25 2023/11/15	0.46
28	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	1,546,320,000	97.79 1,512,299,027	97.89 1,513,823,111	2.375 2027/5/15	0.45
29	FRANCE OAT 2.75 10/25/27 フランス	国債証券	1,369,166,400	111.48 1,526,444,581	110.43 1,512,011,530	2.75 2027/10/25	0.45
30	US T N/B 0.875 09/30/26 アメリカ	国債証券	1,610,750,000	91.82 1,479,042,838	91.89 1,480,128,241	0.875 2026/9/30	0.44

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	134.04
合計	134.04

（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

2022年4月28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	1,445,083	2,461.55 3,557,158,509	2,303.87 3,329,297,822	- -	5.55

2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	280,268	6,793.19 1,903,916,577	6,630.00 1,858,176,840	- -	3.10
3	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	337,500	6,147.64 2,074,831,200	5,497.41 1,855,377,900	- -	3.09
4	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	889,468	1,568.10 1,394,783,665	1,388.31 1,234,858,208	- -	2.06
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	167,592	4,312.28 722,705,054	4,695.41 786,913,404	- -	1.31
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	239,100	2,548.38 609,318,614	2,428.51 580,658,653	- -	0.97
7	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	240,589	2,449.61 589,349,802	2,185.73 525,864,624	- -	0.88
8	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	197,888	2,955.04 584,768,835	2,624.23 519,304,022	- -	0.87
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	5,679,530	96.22 546,491,192	89.98 511,053,196	- -	0.85
10	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	72,319	6,111.21 441,957,029	6,159.38 445,440,925	- -	0.74
11	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	116,935	3,717.48 434,704,459	3,609.11 422,031,979	- -	0.70
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵 当・不動 産金融	100,869	4,019.66 405,459,588	3,749.60 378,218,705	- -	0.63
13	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	301,709	1,288.20 388,662,288	1,245.02 375,634,644	- -	0.63

14	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	31,810	11,016.00 350,418,960	11,067.00 352,041,270	- -	0.59
15	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	129,916	2,584.19 335,727,757	2,580.75 335,280,717	- -	0.56
16	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	54,628	6,188.69 338,076,057	6,018.42 328,774,684	- -	0.55
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	737,225	451.13 332,591,686	438.00 322,904,550	- -	0.54
18	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	89,507	3,644.15 326,177,829	3,539.03 316,768,853	- -	0.53
19	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	371,000	940.86 349,061,286	803.75 298,194,589	- -	0.50
20	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	48,533	6,109.79 296,526,923	5,916.00 287,121,228	- -	0.48
21	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	120,200	2,471.21 297,039,442	2,308.65 277,499,970	- -	0.46
22	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,339,235	77.99 260,443,633	76.02 253,864,005	- -	0.42
23	BAIDU INC -SPON ADR ケイマン諸島	株式 インタ ラクティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	16,128	16,695.10 269,258,598	15,272.48 246,314,673	- -	0.41
24	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC アラブ首長国連邦	株式 各種電気 通信サー ビス	203,341	1,300.17 264,379,901	1,210.92 246,230,578	- -	0.41
25	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	3,272,900	69.30 226,811,970	73.80 241,540,020	- -	0.40
26	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	4,787,200	51.23 245,250,170	49.91 238,961,704	- -	0.40

27	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	1,808,878	139.66 252,643,946	131.96 238,703,393	- -	0.40
28	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP サウジアラビア	株式 化学	53,693	4,459.53 239,445,866	4,438.88 238,337,320	- -	0.40
29	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	288,512	831.78 239,980,892	799.60 230,694,775	- -	0.38
30	QATAR NATIONAL BANK カタール	株式 銀行	270,478	842.25 227,812,259	820.72 221,988,056	- -	0.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	83.96
投資信託受益証券	0.56
投資証券	0.08
合計	84.59

(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

2022年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	13.90
半導体・半導体製造装置		8.02
コンピュータ・周辺機器		4.52
インターネット販売・通信販売		4.41
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.33
石油・ガス・消耗燃料		4.26
金属・鉱業		3.82
化学		2.89
自動車		2.42
電子装置・機器・部品		2.35
保険		2.35
情報技術サービス		2.11
不動産管理・開発		1.78
食品		1.71
無線通信サービス		1.61
各種電気通信サービス		1.44
飲料		1.10
食品・生活必需品小売り		1.10
医薬品		1.05
繊維・アパレル・贅沢品		0.90
娯楽		0.90
電力		0.88
コングロマリット		0.88
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.86
資本市場		0.85

建設資材	0.83
各種金融サービス	0.77
ホテル・レストラン・レジャー	0.74
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.73
電気設備	0.72
パーソナル用品	0.66
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.65
貯蓄・抵当・不動産金融	0.63
運送インフラ	0.61
バイオテクノロジー	0.58
消費者金融	0.56
専門小売り	0.54
建設・土木	0.51
海運業	0.50
ガス	0.48
自動車部品	0.42
機械	0.37
家庭用耐久財	0.34
タバコ	0.30
航空貨物・物流サービス	0.27
陸運・鉄道	0.25
複合小売り	0.24
ソフトウェア	0.22
ヘルスケア機器・用品	0.19
紙製品・林産品	0.18
メディア	0.15
旅客航空輸送業	0.14
航空宇宙・防衛	0.14
通信機器	0.13
商社・流通業	0.13
水道	0.10
レジャー用品	0.07
商業サービス・用品	0.07
家庭用品	0.06
エネルギー設備・サービス	0.06
各種消費者サービス	0.05
建設関連製品	0.04
容器・包装	0.03
総合公益事業	0.03
専門サービス	0.03
ヘルスケア・テクノロジー	0.00
合計	83.96

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年4月28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	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,319,480,000	90.12 2,090,431,350	87.96 2,040,260,997	2.783 2031/1/23	1.57
2	HUNGARY 5.375 03/25/24 ハンガリー	国債証券	1,595,286,800	104.29 1,663,763,596	103.64 1,653,442,980	5.375 2024/3/25	1.27
3	PERU 5.625 11/18/50 ペルー	国債証券	1,417,460,000	117.02 1,658,796,739	112.33 1,592,317,865	5.625 2050/11/18	1.22
4	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,675,180,000	90.26 1,512,168,234	90.32 1,513,173,342	3.875 2030/6/12	1.16
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45 コロンビア	国債証券	1,932,900,000	78.84 1,523,937,018	77.00 1,488,506,961	5 2045/6/15	1.14
6	HUNGARY 5.75 11/22/23 ハンガリー	国債証券	1,417,460,000	104.32 1,478,708,446	103.73 1,470,399,296	5.75 2023/11/22	1.13
7	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	1,804,040,000	85.67 1,545,521,068	81.24 1,465,602,096	5.75 2049/9/30	1.13
8	PANAMA 6.7 01/26/36 パナマ	国債証券	1,275,714,000	118.42 1,510,828,090	114.50 1,460,692,530	6.7 2036/1/26	1.12
9	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,391,688,000	99.88 1,390,066,168	98.77 1,374,646,780	4.625 2028/1/13	1.06
10	SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25 南アフリカ	国債証券	1,314,372,000	105.83 1,391,072,178	104.50 1,373,518,740	5.875 2025/9/16	1.05
11	PANAMA 2.252 09/29/32 パナマ	国債証券	1,675,180,000	84.50 1,415,677,866	81.75 1,369,493,153	2.252 2032/9/29	1.05
12	PANAMA 4.5 04/16/50 パナマ	国債証券	1,456,118,000	92.85 1,352,020,124	88.61 1,290,353,526	4.5 2050/4/16	0.99
13	CROATIA 5.5 04/04/23 クロアチア	国債証券	1,211,284,000	103.00 1,247,743,648	102.45 1,240,990,740	5.5 2023/4/4	0.95
14	PANAMA 4.5 04/01/56 パナマ	国債証券	1,417,460,000	92.37 1,309,378,675	86.55 1,226,887,308	4.5 2056/4/1	0.94
15	PHILIPPINES 6.375 10/23/34 フィリピン	国債証券	1,030,880,000	121.12 1,248,616,882	117.40 1,210,287,736	6.375 2034/10/23	0.93
16	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,288,600,000	96.50 1,243,499,000	93.81 1,208,887,204	4.85 2029/9/30	0.93
17	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	1,546,320,000	80.32 1,242,081,540	78.10 1,207,691,383	4.75 2050/1/14	0.93
18	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32 メキシコ	国債証券	1,159,740,000	101.54 1,177,634,788	99.64 1,155,657,715	4.75 2032/4/27	0.89
19	ROMANIA 6.125 01/22/44 ルーマニア	国債証券	1,082,424,000	110.57 1,196,906,574	104.85 1,134,972,437	6.125 2044/1/22	0.87
20	CROATIA 6.0 01/26/24 クロアチア	国債証券	1,082,424,000	105.13 1,138,043,455	104.37 1,129,834,171	6 2024/1/26	0.87
21	PHILIPPINES 3.0 02/01/28 フィリピン	国債証券	1,159,740,000	98.16 1,138,468,222	96.64 1,120,811,332	3 2028/2/1	0.86
22	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31 メキシコ	国債証券	1,288,600,000	87.18 1,123,491,682	85.44 1,101,082,928	2.659 2031/5/24	0.85

23	SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28 南アフリカ	国債証券	1,185,512,000	95.19 1,128,554,333	92.80 1,100,273,687	4.3 2028/10/12	0.84
24	SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30 南アフリカ	国債証券	1,082,424,000	102.81 1,112,883,411	100.43 1,087,175,841	5.875 2030/6/22	0.83
25	COLOMBIA 4.5 03/15/29 コロンビア	国債証券	1,159,740,000	93.95 1,089,645,314	92.67 1,074,731,058	4.5 2029/3/15	0.83
26	PANAMA 3.16 01/23/30 パナマ	国債証券	1,159,740,000	94.86 1,100,129,364	92.25 1,069,860,150	3.16 2030/1/23	0.82
27	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29 メキシコ	国債証券	1,030,880,000	101.99 1,051,482,136	100.41 1,035,163,306	4.5 2029/4/22	0.79
28	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	1,288,600,000	81.17 1,046,033,936	79.99 1,030,802,684	3.125 2031/4/15	0.79
29	COLOMBIA 3.25 04/22/32 コロンビア	国債証券	1,288,600,000	80.40 1,036,085,944	78.67 1,013,793,164	3.25 2032/4/22	0.78
30	PHILIPPINES 9.5 02/02/30 フィリピン	国債証券	747,388,000	138.02 1,031,549,005	135.57 1,013,274,800	9.5 2030/2/2	0.78

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	89.43
合計	89.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	18,917	699,267.77 13,228,048,557	674,000.00 12,750,058,000	- -	6.63
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	16,226	669,446.47 10,862,438,531	629,000.00 10,206,154,000	- -	5.31
3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	26,547	360,778.26 9,577,580,506	360,500.00 9,570,193,500	- -	4.98
4	GLP投資法人 日本	投資証券	52,551	187,891.01 9,873,860,499	175,800.00 9,238,465,800	- -	4.81
5	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	52,470	170,328.89 8,937,156,884	163,000.00 8,552,610,000	- -	4.45
6	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	81,867	108,462.42 8,879,493,636	103,300.00 8,456,861,100	- -	4.40

7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	24,363	329,471.00 8,026,902,128	315,000.00 7,674,345,000	- -	3.99
8	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	16,223	359,509.17 5,832,317,292	356,500.00 5,783,499,500	- -	3.01
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	32,329	192,008.22 6,207,433,754	175,300.00 5,667,273,700	- -	2.95
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	36,527	149,020.25 5,443,262,805	142,100.00 5,190,486,700	- -	2.70
11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	11,087	416,493.81 4,617,666,939	394,500.00 4,373,821,500	- -	2.28
12	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	23,035	202,192.26 4,657,498,746	186,700.00 4,300,634,500	- -	2.24
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	49,252	87,366.60 4,302,980,107	76,200.00 3,753,002,400	- -	1.95
14	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	5,603	643,116.71 3,603,382,972	639,000.00 3,580,317,000	- -	1.86
15	アクティブア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	8,648	460,420.94 3,981,720,300	414,000.00 3,580,272,000	- -	1.86
16	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	6,391	588,733.87 3,762,598,225	558,000.00 3,566,178,000	- -	1.86
17	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	19,863	185,003.04 3,674,715,484	175,800.00 3,491,915,400	- -	1.82
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	10,940	327,442.08 3,582,216,450	318,000.00 3,478,920,000	- -	1.81
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	5,019	756,750.13 3,798,128,947	681,000.00 3,417,939,000	- -	1.78
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	49,708	63,962.19 3,179,433,037	66,100.00 3,285,698,800	- -	1.71
21	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	71,416	42,198.62 3,013,657,111	42,450.00 3,031,609,200	- -	1.58
22	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	5,688	504,695.64 2,870,708,844	503,000.00 2,861,064,000	- -	1.49
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	19,082	156,070.90 2,978,144,963	149,500.00 2,852,759,000	- -	1.48
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	19,080	156,606.78 2,988,057,465	147,700.00 2,818,116,000	- -	1.47
25	大和証券オフィス投資法人 日本	投資証券	3,430	757,300.67 2,597,541,306	736,000.00 2,524,480,000	- -	1.31
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	21,925	116,986.48 2,564,928,719	114,700.00 2,514,797,500	- -	1.31

27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	7,548	338,249.13 2,553,104,439	324,000.00 2,445,552,000	- -	1.27
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	15,137	176,737.73 2,675,279,097	161,400.00 2,443,111,800	- -	1.27
29	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	11,610	222,015.21 2,577,596,627	209,600.00 2,433,456,000	- -	1.27
30	NTT都市開発リート投資法人 日本	投資証券	15,553	158,722.96 2,468,618,260	150,100.00 2,334,505,300	- -	1.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年4月28日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	92.33
合計	92.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	273,336	19,644.09 5,369,438,806	21,605.95 5,905,685,643	- -	6.69
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	33,250	96,397.45 3,205,215,358	92,508.59 3,075,910,750	- -	3.49
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	56,332	46,265.86 2,606,248,895	50,433.22 2,841,004,532	- -	3.22
4	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	104,759	18,895.79 1,979,504,234	19,102.20 2,001,128,040	- -	2.27
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	160,676	11,453.87 1,840,363,358	12,014.90 1,930,507,100	- -	2.19
6	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	208,839	8,705.85 1,818,122,511	9,234.10 1,928,441,797	- -	2.19
7	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	121,301	17,612.32 2,136,392,468	15,737.67 1,908,995,327	- -	2.16
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,580	30,963.25 1,597,084,850	31,026.91 1,600,368,059	- -	1.81
9	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	126,101	11,215.87 1,414,332,813	11,093.55 1,398,908,681	- -	1.59
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	627,292	2,114.02 1,326,111,657	2,166.87 1,359,260,843	- -	1.54

11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	49,400	25,260.98 1,247,892,681	26,284.86 1,298,472,222	- -	1.47
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	53,702	25,369.20 1,362,376,844	24,145.78 1,296,677,042	- -	1.47
13	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	220,151	5,232.09 1,151,850,457	5,374.75 1,183,256,719	- -	1.34
14	MID AMERICA アメリカ	投資証券	42,544	26,405.90 1,123,413,018	26,090.28 1,109,985,051	- -	1.26
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	147,238	7,368.35 1,084,901,937	7,377.23 1,086,209,326	- -	1.23
16	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	140,470	7,261.68 1,020,049,574	7,631.08 1,071,939,099	- -	1.21
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	24,066	43,094.13 1,037,103,525	44,064.96 1,060,467,462	- -	1.20
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	42,769	23,593.39 1,009,066,061	23,361.02 999,127,866	- -	1.13
19	SEGRO PLC イギリス	投資証券	443,436	2,114.86 937,806,682	2,192.09 972,055,080	- -	1.10
20	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	231,892	3,647.56 845,842,055	3,810.39 883,599,004	- -	1.00
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	198,837	4,365.56 868,035,930	4,351.60 865,259,526	- -	0.98
22	LINK REIT 香港	投資証券	778,020	1,116.68 868,806,049	1,103.42 858,485,940	- -	0.97
23	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	52,404	15,695.14 822,488,285	15,751.84 825,459,758	- -	0.94
24	UDR INC アメリカ	投資証券	110,241	7,231.66 797,225,870	7,211.00 794,948,468	- -	0.90
25	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	37,670	20,949.50 789,167,695	20,837.95 784,965,599	- -	0.89
26	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	70,252	10,209.11 717,210,758	10,830.68 760,877,142	- -	0.86
27	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	106,717	6,447.41 688,049,146	7,012.56 748,359,493	- -	0.85
28	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	227,265	3,045.89 692,224,992	3,252.42 739,162,685	- -	0.84
29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	263,108	2,323.88 611,432,639	2,713.79 714,020,280	- -	0.81
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	63,606	9,999.10 636,003,174	10,107.77 642,915,352	- -	0.73

（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

2022年4月28日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	8.66
投資証券	76.97
合計	85.64

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

該当事項はありません。

（参考）

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。

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。

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。

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2022年4月28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 0406月	買建	734	14,115,622,220	13,968,020,000	3.88

(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。

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。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28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 Jun22	買建	440	12,559,037,079	11,850,674,330	1.64
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun22	買建	456	2,337,093,696	2,265,709,598	0.31
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun22	買建	35	919,826,677	880,203,170	0.12
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun22	買建	62	752,087,431	741,896,681	0.10
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Jun22	買建	22	373,574,337	364,796,355	0.05

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

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

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年4月28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 Jun22	買建	1,382	9,802,092,197	9,245,257,855	15.41

(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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指 数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0406月	買建	2,337	4,354,321,770	4,606,227,000	2.40

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

直近日(2022年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年10月12日)	2	2	0.9833	0.9833
第2計算期間末 (2019年10月15日)	15	15	1.0351	1.0351
第3計算期間末 (2020年10月12日)	21	21	1.0398	1.0398
第4計算期間末 (2021年10月12日)	33	33	1.0379	1.0379
2021年4月末日	30	-	1.0345	-
5月末日	32	-	1.0368	-
6月末日	33	-	1.0393	-
7月末日	34	-	1.0448	-
8月末日	31	-	1.0466	-
9月末日	32	-	1.0420	-
10月末日	33	-	1.0412	-
11月末日	34	-	1.0406	-
12月末日	35	-	1.0402	-
2022年1月末日	36	-	1.0263	-

2月末日	37	-	1.0130	-
3月末日	38	-	1.0062	-
4月末日	38	-	0.9966	-

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

直近日（2022年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2018年10月12日）	3	3	0.9790	0.9790
第2計算期間末 （2019年10月15日）	33	33	1.0636	1.0636
第3計算期間末 （2020年10月12日）	37	37	1.0639	1.0639
第4計算期間末 （2021年10月12日）	59	59	1.1257	1.1257
2021年4月末日	38	-	1.1082	-
5月末日	40	-	1.1151	-
6月末日	43	-	1.1248	-
7月末日	47	-	1.1294	-
8月末日	50	-	1.1363	-
9月末日	53	-	1.1302	-
10月末日	61	-	1.1382	-
11月末日	69	-	1.1287	-
12月末日	75	-	1.1388	-
2022年1月末日	75	-	1.1088	-
2月末日	77	-	1.0894	-
3月末日	79	-	1.1024	-
4月末日	79	-	1.0843	-

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

直近日（2022年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2018年10月12日）	21	21	0.9769	0.9769
第2計算期間末 （2019年10月15日）	50	50	1.0707	1.0707
第3計算期間末 （2020年10月12日）	92	92	1.0644	1.0644
第4計算期間末 （2021年10月12日）	546	546	1.1651	1.1651
2021年4月末日	140	-	1.1403	-
5月末日	182	-	1.1486	-
6月末日	257	-	1.1619	-
7月末日	332	-	1.1648	-
8月末日	429	-	1.1750	-

9月末日	505	-	1.1693	-
10月末日	568	-	1.1832	-
11月末日	631	-	1.1694	-
12月末日	713	-	1.1867	-
2022年1月末日	714	-	1.1487	-
2月末日	758	-	1.1293	-
3月末日	830	-	1.1560	-
4月末日	854	-	1.1341	-

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

直近日（2022年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2018年10月12日）	11	11	0.9720	0.9720
第2計算期間末 （2019年10月15日）	20	20	1.0764	1.0764
第3計算期間末 （2020年10月12日）	40	40	1.0631	1.0631
第4計算期間末 （2021年10月12日）	82	82	1.2298	1.2298
2021年4月末日	52	-	1.1910	-
5月末日	60	-	1.2021	-
6月末日	64	-	1.2211	-
7月末日	79	-	1.2231	-
8月末日	78	-	1.2384	-
9月末日	80	-	1.2323	-
10月末日	85	-	1.2577	-
11月末日	75	-	1.2389	-
12月末日	85	-	1.2673	-
2022年1月末日	86	-	1.2144	-
2月末日	86	-	1.1961	-
3月末日	91	-	1.2470	-
4月末日	91	-	1.2200	-

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

直近日（2022年4月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 （分配落） （百万円）	純資産総額 （分配付） （百万円）	1口当たりの 純資産額 （分配落）（円）	1口当たりの 純資産額 （分配付）（円）
第1計算期間末 （2018年10月12日）	25	25	0.9689	0.9689
第2計算期間末 （2019年10月15日）	41	41	1.0762	1.0762
第3計算期間末 （2020年10月12日）	71	71	1.0582	1.0582
第4計算期間末 （2021年10月12日）	177	177	1.2864	1.2864

2021年4月末日	91	-	1.2332	-
5月末日	96	-	1.2469	-
6月末日	134	-	1.2713	-
7月末日	144	-	1.2709	-
8月末日	153	-	1.2922	-
9月末日	167	-	1.2881	-
10月末日	183	-	1.3233	-
11月末日	197	-	1.2979	-
12月末日	217	-	1.3381	-
2022年1月末日	216	-	1.2696	-
2月末日	205	-	1.2539	-
3月末日	226	-	1.3312	-
4月末日	224	-	1.2995	-

【分配の推移】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

	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
2021年10月13日～2022年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

	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
2021年10月13日～2022年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

	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
2021年10月13日～2022年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

	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
2021年10月13日～2022年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(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
2021年10月13日～2022年4月12日	-

【収益率の推移】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.3
第3計算期間	0.5
第4計算期間	0.2
2021年10月13日～2022年4月12日	4.1

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

	収益率(%)
第1計算期間	2.1
第2計算期間	8.6
第3計算期間	0.0
第4計算期間	5.8
2021年10月13日～2022年4月12日	3.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

	収益率(%)
第1計算期間	2.3
第2計算期間	9.6
第3計算期間	0.6
第4計算期間	9.5
2021年10月13日～2022年4月12日	2.5

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	10.7
第3計算期間	1.2
第4計算期間	15.7
2021年10月13日～2022年4月12日	0.5

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	3.1
第2計算期間	11.1
第3計算期間	1.7
第4計算期間	21.6
2021年10月13日～2022年4月12日	1.5

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	2,977,556	174,550
第2計算期間	22,730,963	10,540,865
第3計算期間	17,938,395	12,483,397
第4計算期間	24,844,256	13,204,883
2021年10月13日～ 2022年4月12日	9,387,646	2,787,508

(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。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,904,625	582,727
第2計算期間	36,969,409	8,563,355
第3計算期間	42,156,996	38,919,319
第4計算期間	33,732,331	15,446,236
2021年10月13日～ 2022年4月12日	37,586,926	17,784,949

(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。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	25,984,069	4,188,524
第2計算期間	41,599,021	16,390,022
第3計算期間	82,404,947	42,671,397
第4計算期間	444,800,840	62,559,806
2021年10月13日～ 2022年4月12日	381,093,698	97,833,783

(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。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	13,018,896	1,605,269
第2計算期間	14,012,274	6,756,536
第3計算期間	36,439,613	16,975,790
第4計算期間	51,733,528	22,607,245
2021年10月13日～ 2022年4月12日	23,078,133	16,166,788

(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。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	31,119,190	5,281,700
第2計算期間	28,388,516	15,995,569
第3計算期間	62,838,030	33,055,430

第4計算期間	99,789,186	30,094,855
2021年10月13日 ~ 2022年4月12日	77,621,221	41,626,091

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

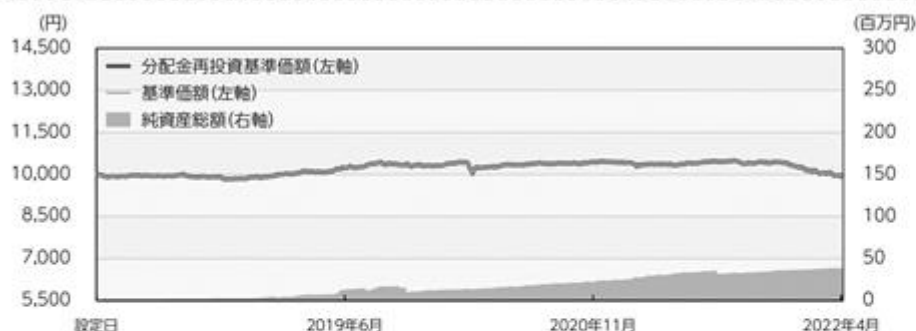
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2022年4月28日

(保守型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2022年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2018年1月24日)

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10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	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	59.45
2	為替フルヘッジ外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.92
3	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.04
4	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	6.03
5	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.99
6	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.02

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。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2022年については年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。

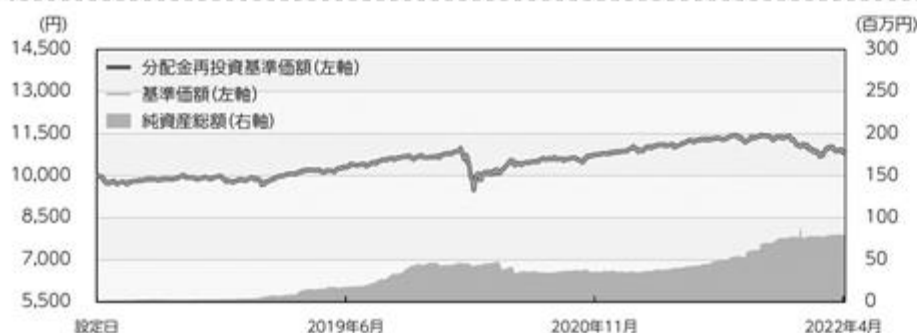
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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:2022年4月28日

(安定型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2022年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2018年1月24日)

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
設定来累計	0円

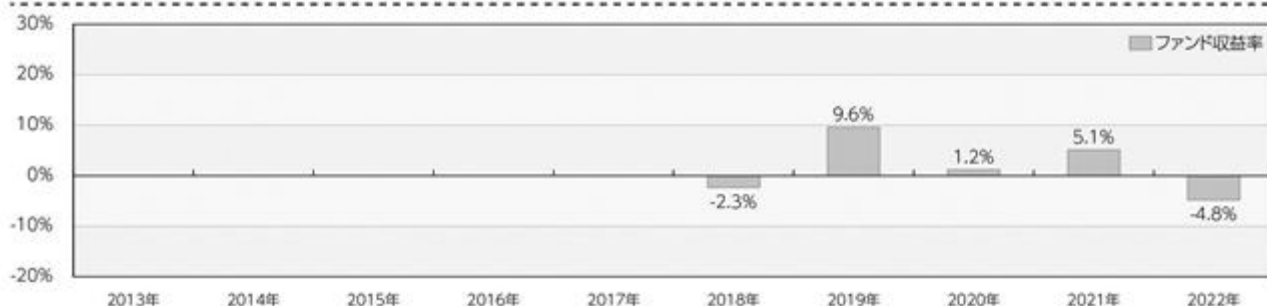
※分配金は1万口当たりです。

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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	31.95
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	22.59
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	12.04
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.77
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.98
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.96
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.96
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	0.94
9	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.30

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2022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。

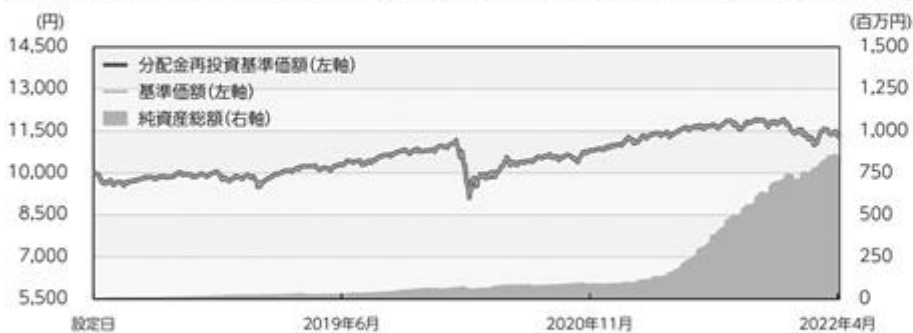
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○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。

(安定成長型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2022年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2018年1月24日)

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10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	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	27.17
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	16.13
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.54
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	13.71
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	8.94
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	6.99
7	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	6.97
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.97
9	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.97

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2022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。

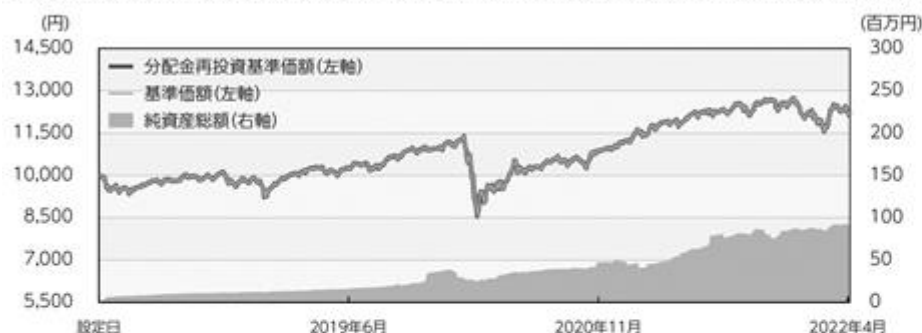
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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:2022年4月28日

(成長型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2022年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2018年1月24日)

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
設定来累計	0円

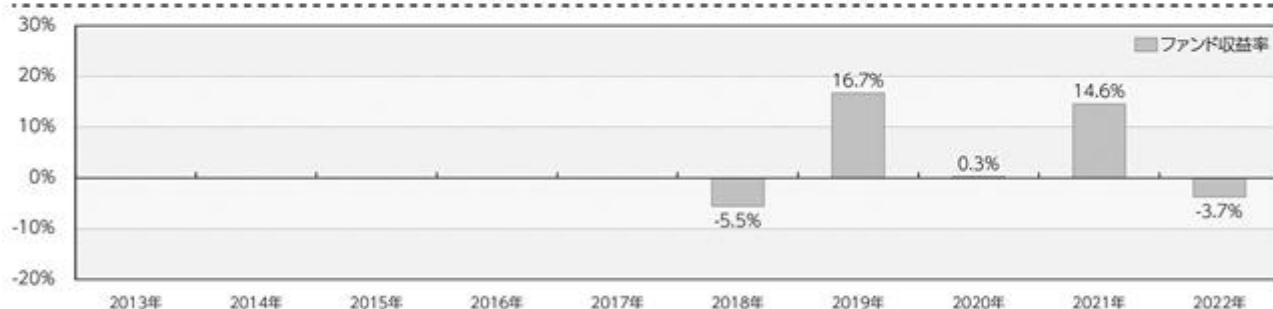
※分配金は1万口当たりです。

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	22.21
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	21.63
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.05
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	12.06
5	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	7.61
6	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.03
7	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.00
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.91
9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.99

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2022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:2022年4月28日

(積極型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2022年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

(設定日:2018年1月24日)

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
設定来累計	0円

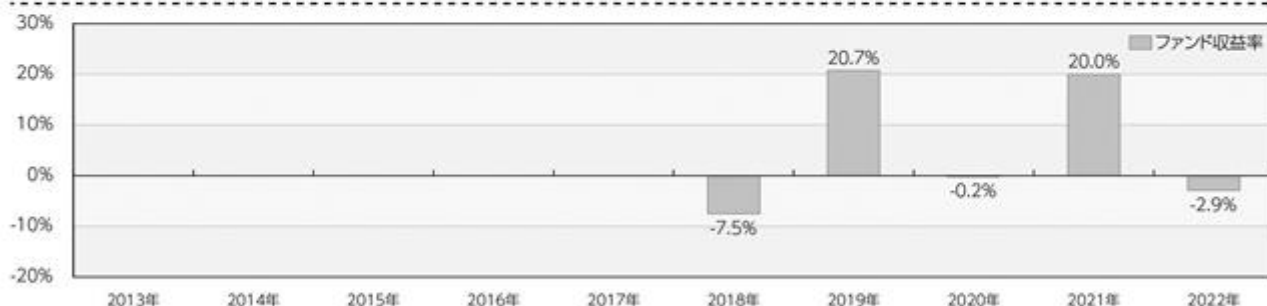
※分配金は1万口当たりです。

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	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.56
2	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	28.30
3	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	14.05
4	為替フルヘッジ外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.47
5	外国リート/パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.87
6	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	4.00
7	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.01
8	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	1.97
9	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.24

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および2022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:2022年4月28日

主要な資産の状況

■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	4.14
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.66
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.81
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.72
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.53

■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	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.3	2025/12/20	1.23
2	145回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/9/20	1.21
3	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	1.15
4	333回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.15
5	141回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2024/9/20	1.14

■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	4.93
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.88
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.42
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.44
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	1.32

■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 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.54
2	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.49
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.48
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.46
5	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.45

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.72
2	US T N/B 1.375 11/15/31	国債証券	アメリカ	1.375	2031/11/15	0.69
3	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.67
4	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.64
5	US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	アメリカ	2.5	2024/5/15	0.62

○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:2022年4月28日

■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	5.55
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.10
3	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.09
4	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	2.06
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.31

■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	PERU 2.783 01/23/31	国債証券	ペルー	2.783	2031/1/23	1.57
2	HUNGARY 5.375 03/25/24	国債証券	ハンガリー	5.375	2024/3/25	1.27
3	PERU 5.625 11/18/50	国債証券	ペルー	5.625	2050/11/18	1.22
4	BRAZIL 3.875 06/12/30	国債証券	ブラジル	3.875	2030/6/12	1.16
5	COLOMBIA 5.0 06/15/45	国債証券	コロンビア	5	2045/6/15	1.14

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.63
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.31
3	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.98
4	GLP投資法人	投資証券	日本	4.81
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.45

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	6.69
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	3.49
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.22
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	アメリカ	2.27
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.19

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

確定拠出年金制度のご利用によるお申込みの場合には、確定拠出年金制度にかかる手続きが必要となります。この場合、「分配金再投資コース」でのお申込みとなります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

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

ありません。

・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、1口単位となります。

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約の受付を中止することおよびすでに受付けた解約の請求の受付を取り消すことができます。解約の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に

行った当日の解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約の請求を受付けたものとして、下記に準じて計算した価額とします。

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2018年1月24日から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12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、各ファンドにおいて受益権口数が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れている受益者に対し、書面をもっ
てこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が
属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.にお
いて同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、

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

ロ. 信託約款の変更等

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

八. 関係法人との契約の更改

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

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10月12日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

- たわらノーロード 最適化バランス(保守型)
- たわらノーロード 最適化バランス(安定型)
- たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)
- たわらノーロード 最適化バランス(成長型)
- たわらノーロード 最適化バランス(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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年10月13日から2021年10月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【たわらノーロード 最適化バランス(保守型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	160,387	268,921
親投資信託受益証券	21,150,432	33,126,904
流動資産合計	21,310,819	33,395,825
資産合計	21,310,819	33,395,825
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1	-
未払受託者報酬	3,792	7,188
未払委託者報酬	44,180	83,332
その他未払費用	248	549
流動負債合計	48,221	91,069
負債合計	48,221	91,069
純資産の部		
元本等		
元本	20,448,102	32,087,475
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	814,496	1,217,281
(分配準備積立金)	208,464	336,175
元本等合計	21,262,598	33,304,756
純資産合計	21,262,598	33,304,756
負債純資産合計	21,310,819	33,395,825

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2019年10月16日 至 2020年10月12日	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		178,819		121,472
営業収益合計		178,819		121,472
営業費用				
支払利息		9		6
受託者報酬		6,558		12,581
委託者報酬		76,488		146,131
その他費用		431		939
営業費用合計		83,486		159,657
営業利益又は営業損失()		95,333		38,185
経常利益又は経常損失()		95,333		38,185
当期純利益又は当期純損失()		95,333		38,185
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()		8,955		32,750
期首剰余金又は期首欠損金()		525,622		814,496
剰余金増加額又は欠損金減少額		616,217		1,000,587
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		616,217		1,000,587
剰余金減少額又は欠損金増加額		431,631		526,867
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		431,631		526,867
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()		814,496		1,217,281

(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4期	
	自 2020年10月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期
	2020年10月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	14,993,104円	20,448,102円
期中追加設定元本額	17,938,395円	24,844,256円
期中一部解約元本額	12,483,397円	13,204,883円
2. 受益権の総数	20,448,102口	32,087,475口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(139,896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(606,032円)及び分配準備積立金(68,568円)より分配対象収益は814,496円(1万口当たり398.32円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(207,381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(881,106円)及び分配準備積立金(128,794円)より分配対象収益は1,217,281円(1万口当たり379.36円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	137,033	27,052
合計	137,033	27,052

（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3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1,0398円 (10,398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12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	596,652	1,955,407	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	920,163	2,011,200	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	15,470,543	20,189,058	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,447	8,073	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	161,833	333,100	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	6,052,789	8,630,066	
親投資信託受益証券 合計		23,203,427	33,126,904	
合計			33,126,904	

（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。

【たわらノーロード 最適化バランス(安定型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	298,452	461,672
親投資信託受益証券	37,007,676	59,621,736
流動資産合計	37,306,128	60,083,408
資産合計	37,306,128	60,083,408
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,955	11,519
未払受託者報酬	8,228	10,041
未払委託者報酬	95,194	116,036
その他未払費用	620	813
流動負債合計	106,997	138,409
負債合計	106,997	138,409
純資産の部		
元本等		
元本	34,965,629	53,251,724
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,233,502	6,693,275
(分配準備積立金)	955,955	2,159,651
元本等合計	37,199,131	59,944,999
純資産合計	37,199,131	59,944,999
負債純資産合計	37,306,128	60,083,408

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2019年10月16日 至 2020年10月12日	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		181,586		2,337,060
営業収益合計		181,586		2,337,060
営業費用				
支払利息		145		6
受託者報酬		17,765		17,980
委託者報酬		205,540		207,790
その他費用		1,398		1,390
営業費用合計		224,848		227,166
営業利益又は営業損失()		406,434		2,109,894
経常利益又は経常損失()		406,434		2,109,894
当期純利益又は当期純損失()		406,434		2,109,894
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()		672,831		377,184
期首剰余金又は期首欠損金()		2,018,067		2,233,502
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,300,967		3,790,295
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		2,300,967		3,790,295
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,351,929		1,063,232
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,351,929		1,063,232
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		2,233,502		6,693,275

(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4期	
	自 2020年10月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期
	2020年10月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	31,727,952円	34,965,629円
期中追加設定元本額	42,156,996円	33,732,331円
期中一部解約元本額	38,919,319円	15,446,236円
2. 受益権の総数	34,965,629口	53,251,724口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(558,958円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,277,547円)及び分配準備積立金(396,997円)より分配対象収益は2,233,502円(1万口当たり638.77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(686,595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(857,843円)、信託約款に規定される収益調整金(4,533,624円)及び分配準備積立金(615,213円)より分配対象収益は6,693,275円(1万口当たり1,256.91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3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	546,337	1,690,988
合計	546,337	1,690,988

（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3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0639円 (10,639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12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	2,321,858	7,609,425	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	2,199,605	4,807,676	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	10,800,079	14,094,103	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	1,702,564	4,142,508	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	763,072	4,257,789	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,632,649	5,418,781	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	126,975	200,810	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	12,977,189	18,502,876	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	400,879	587,768	
親投資信託受益証券 合計		33,924,870	59,621,736	
合計			59,621,736	

（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。

【たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	804,508	4,482,757
親投資信託受益証券	91,847,916	543,352,929
未収入金	25,000	-
流動資産合計	92,677,424	547,835,686
資産合計	92,677,424	547,835,686
負債の部		
流動負債		
未払解約金	126,984	550,951
未払受託者報酬	18,003	67,873
未払委託者報酬	207,397	781,080
その他未払費用	1,540	5,948
流動負債合計	353,924	1,405,852
負債合計	353,924	1,405,852
純資産の部		
元本等		
元本	86,738,094	468,979,128
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	5,585,406	77,450,706
(分配準備積立金)	2,665,178	10,155,195
元本等合計	92,323,500	546,429,834
純資産合計	92,323,500	546,429,834
負債純資産合計	92,677,424	547,835,686

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2019年10月16日 至 2020年10月12日	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日
営業収益				
受取利息		-		5
有価証券売買等損益		3,230		11,874,013
営業収益合計		3,230		11,874,018
営業費用				
支払利息		212		333
受託者報酬		32,129		89,949
委託者報酬		370,307		1,035,631
その他費用		2,743		7,819
営業費用合計		405,391		1,133,732
営業利益又は営業損失()		408,621		10,740,286
経常利益又は経常損失()		408,621		10,740,286
当期純利益又は当期純損失()		408,621		10,740,286
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()		1,242,199		1,996,852
期首剰余金又は期首欠損金()		3,322,397		5,585,406
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,298,434		69,541,934
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		4,298,434		69,541,934
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,869,003		6,420,068
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,869,003		6,420,068
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()		5,585,406		77,450,706

(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4期	
	自 2020年10月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期
	2020年10月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	47,004,544円	86,738,094円
期中追加設定元本額	82,404,947円	444,800,840円
期中一部解約元本額	42,671,397円	62,559,806円
2. 受益権の総数	86,738,094口	468,979,128口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,326,582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(4,236,584円)及び分配準備積立金(1,338,596円)より分配対象収益は6,901,762円(1万口当たり795.70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(3,897,058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(4,525,949円)、信託約款に規定される収益調整金(67,295,511円)及び分配準備積立金(1,732,188円)より分配対象収益は77,450,706円(1万口当たり1,651.47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3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,252,555	10,153,470
合計	1,252,555	10,153,470

（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3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0644円 (10,644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12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	27,745,345	90,929,819	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	17,621,348	38,514,980	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	69,185,703	90,287,342	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	20,061,487	48,811,604	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	11,985,466	66,876,503	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	21,415,668	44,079,869	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	7,042,892	11,138,333	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	99,261,252	141,526,693	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	7,630,464	11,187,786	
親投資信託受益証券 合計		281,949,625	543,352,929	
合計			543,352,929	

（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。

【たわらノーロード 最適化バランス(成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	508,087	859,698
親投資信託受益証券	40,311,850	82,197,914
未収入金	149,000	100,000
流動資産合計	40,968,937	83,157,612
資産合計	40,968,937	83,157,612
負債の部		
流動負債		
未払解約金	333,449	250,384
未払受託者報酬	7,732	15,145
未払委託者報酬	89,533	174,559
その他未払費用	629	1,254
流動負債合計	431,343	441,342
負債合計	431,343	441,342
純資産の部		
元本等		
元本	38,133,188	67,259,471
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,404,406	15,456,799
(分配準備積立金)	1,355,142	6,338,724
元本等合計	40,537,594	82,716,270
純資産合計	40,537,594	82,716,270
負債純資産合計	40,968,937	83,157,612

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2019年10月16日 至 2020年10月12日	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日
営業収益				
有価証券売買等損益		787,369		7,637,064
営業収益合計		787,369		7,637,064
営業費用				
支払利息		27		15
受託者報酬		14,093		24,933
委託者報酬		163,080		287,616
その他費用		1,133		2,058
営業費用合計		178,333		314,622
営業利益又は営業損失()		609,036		7,322,442
経常利益又は経常損失()		609,036		7,322,442
当期純利益又は当期純損失()		609,036		7,322,442
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()		259,077		1,632,290
期首剰余金又は期首欠損金()		1,426,133		2,404,406
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,003,658		9,373,515
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		2,003,658		9,373,515
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,375,344		2,011,274
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,375,344		2,011,274
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		2,404,406		15,456,799

(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4期	
	自 2020年10月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期
	2020年10月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	18,669,365円	38,133,188円
期中追加設定元本額	36,439,613円	51,733,528円
期中一部解約元本額	16,975,790円	22,607,245円
2. 受益権の総数	38,133,188口	67,259,471口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(638,867円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(2,370,468円)及び分配準備積立金(716,275円)より分配対象収益は3,725,610円(1万口当たり976.99円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,165,968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(4,348,441円)、信託約款に規定される収益調整金(9,118,075円)及び分配準備積立金(824,315円)より分配対象収益は15,456,799円(1万口当たり2,298.08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3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	529,696	5,734,678
合計	529,696	5,734,678

（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3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1,0631円 (10,631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12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	5,177,945	16,969,679	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	1,900,990	4,154,993	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,383,504	7,025,472	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	3,704,054	9,012,333	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	3,017,595	16,837,576	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,426,202	4,993,851	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	3,191,762	5,047,771	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	10,956,644	15,621,983	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	1,728,452	2,534,256	
親投資信託受益証券 合計		37,487,148	82,197,914	
合計			82,197,914	

（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。

【たわらノーロード 最適化バランス(積極型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	552,132	1,277,770
親投資信託受益証券	71,602,573	176,238,141
流動資産合計	72,154,705	177,515,911
資産合計	72,154,705	177,515,911
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,959	7,596
未払受託者報酬	14,111	28,844
未払委託者報酬	162,818	332,135
その他未払費用	1,210	2,463
流動負債合計	186,098	371,038
負債合計	186,098	371,038
純資産の部		
元本等		
元本	68,013,037	137,707,368
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,955,570	39,437,505
(分配準備積立金)	3,117,649	15,899,987
元本等合計	71,968,607	177,144,873
純資産合計	71,968,607	177,144,873
負債純資産合計	72,154,705	177,515,911

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2019年10月16日 至 2020年10月12日	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		18,114		17,132,568
営業収益合計		18,114		17,132,569
営業費用				
支払利息		136		79
受託者報酬		26,196		45,432
委託者報酬		302,271		523,442
その他費用		2,235		3,840
営業費用合計		330,838		572,793
営業利益又は営業損失()		312,724		16,559,776
経常利益又は経常損失()		312,724		16,559,776
当期純利益又は当期純損失()		312,724		16,559,776
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()		924,393		2,302,579
期首剰余金又は期首欠損金()		2,914,720		3,955,570
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,801,407		23,927,705
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		2,801,407		23,927,705
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,372,226		2,702,967
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,372,226		2,702,967
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()		3,955,570		39,437,505

(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4期	
	自 2020年10月13日	至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第3期	第4期
	2020年10月12日現在	2021年10月12日現在
1. 期首元本額	38,230,437円	68,013,037円
期中追加設定元本額	62,838,030円	99,789,186円
期中一部解約元本額	33,055,430円	30,094,855円
2. 受益権の総数	68,013,037口	137,707,368口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,297,535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(4,765,698円)及び分配準備積立金(1,820,114円)より分配対象収益は7,883,347円(1万口当たり1,159.09円)であります が、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,355,397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(11,438,466円)、信託約款に規定される収益調整金(23,537,518円)及び分配準備積立金(2,106,124円)より分配対象収益は39,437,505円(1万口当たり2,863.86円)であります が、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	第4期
	自 2019年10月16日 至 2020年10月12日	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	933,545	15,350,292
合計	933,545	15,350,292

（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3期 2020年10月12日現在	第4期 2021年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1,0582円 (10,582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12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	14,796,859	48,493,746	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	2,445,055	5,344,156	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	678,061	884,869	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	9,382,465	22,828,475	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	8,730,973	48,717,083	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	2,599,917	5,351,409	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	10,260,959	16,227,706	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	14,831,498	21,146,749	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	4,940,628	7,243,948	
親投資信託受益証券 合計		68,666,415	176,238,141	
合計			176,238,141	

（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）

「たわらノーロード 最適化バランス（保守型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（安定型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（成長型）」、「たわらノーロード 最適化バランス（積極型）」は、「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、「国内債券パッシブ・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、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「J-REITインデックスファンド・マザーファンド」受益証券及び「外国リート・パッシブ・ファンド・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12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	11,922,264,359
株式	393,970,303,892
派生商品評価勘定	31,479,690
未収入金	118,518
未収配当金	3,032,262,349
前払金	166,605,000
差入委託証拠金	500,775,000
流動資産合計	409,623,808,808
資産合計	
409,623,808,808	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	327,120,280
未払金	3,036,120,800
未払解約金	46,464,000
流動負債合計	3,409,705,080
負債合計	
3,409,705,080	
純資産の部	
元本等	
元本	123,946,519,436
剰余金	
剰余金又は欠損金()	282,267,584,292
元本等合計	406,214,103,728
純資産合計	
406,214,103,728	
負債純資産合計	
409,623,808,808	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	103,987,218,101円
同期中追加設定元本額	116,999,484,109円
同期中一部解約元本額	97,040,182,774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	2,749,814,990円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,946,116,960円
One DC 国内株式インデックスファンド	18,753,272,622円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	5,034,248,733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)	24,043,922円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	27,708,305円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,925,295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	1,154,781,700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)	362,997,603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)	348,979,582円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	596,652円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,321,858円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	27,745,345円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,177,945円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,796,859円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,715,172,036円
Oneグローバルバランス	849,790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	3,600,891,042円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	329,247,832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	447,221,358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>	467,634,686円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	5,165,969円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	14,325,482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>	274,725,574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)	4,158,490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)	5,689,400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)	558,463,697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)	1,791,577,060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)	74,456,576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)	345,020,586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)	167,926,953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	696,649,474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	123,946,519,436円
2. 受益権の総数	123,946,519,436口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	9,236,170,351	
合計	9,236,170,351	

(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12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2021年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	12,593,455,000	-		12,298,020,000	295,435,000
合計	12,593,455,000	-		12,298,020,000	295,435,000

(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12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.2773円 (32,773円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	

極洋	6,400	3,010.00	19,264,000
日本水産	182,400	622.00	113,452,800
マルハニチロ	30,800	2,610.00	80,388,000
ハウスイ	700	944.00	660,800
雪国まいたけ	16,200	1,491.00	24,154,200
カネコ種苗	5,100	1,440.00	7,344,000
サカタのタネ	23,600	3,440.00	81,184,000
ホクト	16,700	1,958.00	32,698,600
ホクリヨウ	2,900	769.00	2,230,100
ヒノキヤグループ	4,400	2,172.00	9,556,800
ショーボンドホールディングス	28,100	4,845.00	136,144,500
ミライト・ホールディングス	68,000	2,169.00	147,492,000
タマホーム	11,800	2,500.00	29,500,000
サンヨーホームズ	2,500	727.00	1,817,500
日本アクア	7,600	580.00	4,408,000
ファーストコーポレーション	6,100	815.00	4,971,500
ベステラ	3,700	1,446.00	5,350,200
Robot Home	33,400	278.00	9,285,200
キャンディル	3,500	530.00	1,855,000
スペースバリューホールディングス	23,900	852.00	20,362,800
住石ホールディングス	31,000	162.00	5,022,000
日鉄鉱業	4,400	6,590.00	28,996,000
三井松島ホールディングス	8,000	1,499.00	11,992,000
I N P E X	789,200	982.00	774,994,400
石油資源開発	25,600	2,262.00	57,907,200
K & O エナジーグループ	9,800	1,608.00	15,758,400
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,944.00	6,998,400
第一カッター興業	4,800	1,263.00	6,062,400
明豊ファシリティワークス	7,800	891.00	6,949,800
安藤・間	126,300	791.00	99,903,300
東急建設	57,300	804.00	46,069,200
コムシスホールディングス	69,700	2,898.00	201,990,600
ピーアールホールディングス	26,100	441.00	11,510,100
高松コンストラクショングループ	12,600	2,015.00	25,389,000
東建コーポレーション	6,000	9,420.00	56,520,000
ソネック	1,900	1,072.00	2,036,800
ヤマウラ	8,700	912.00	7,934,400
オリエンタル白石	64,700	278.00	17,986,600
大成建設	141,500	3,625.00	512,937,500
大林組	454,800	944.00	429,331,200
清水建設	426,000	844.00	359,544,000
飛島建設	13,200	1,087.00	14,348,400
長谷工コーポレーション	148,900	1,477.00	219,925,300
松井建設	18,000	736.00	13,248,000
銭高組	1,700	4,045.00	6,876,500
鹿島建設	333,200	1,447.00	482,140,400
不動テトラ	11,100	1,757.00	19,502,700
大末建設	5,800	945.00	5,481,000
鉄建建設	9,400	1,824.00	17,145,600
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	3,760.00	37,224,000
佐田建設	7,500	484.00	3,630,000
ナカノフドー建設	11,400	347.00	3,955,800
奥村組	25,000	2,995.00	74,875,000
東鉄工業	19,800	2,510.00	49,698,000
イチケン	3,200	1,944.00	6,220,800
富士ピー・エス	6,100	562.00	3,428,200
浅沼組	5,400	4,565.00	24,651,000
戸田建設	189,200	758.00	143,413,600
熊谷組	21,100	2,851.00	60,156,100
北野建設	3,000	2,204.00	6,612,000
植木組	4,100	1,491.00	6,113,100
矢作建設工業	20,400	782.00	15,952,800
ピーエス三菱	14,800	676.00	10,004,800
日本ハウスホールディングス	30,500	433.00	13,206,500
大東建託	49,600	12,840.00	636,864,000
新日本建設	19,800	860.00	17,028,000
N I P P O	37,500	4,065.00	152,437,500
東亜道路工業	2,800	5,000.00	14,000,000
日本道路	4,400	8,170.00	35,948,000
東亜建設工業	12,100	2,467.00	29,850,700
日本国土開発	45,000	603.00	27,135,000
若築建設	8,000	2,029.00	16,232,000
東洋建設	50,600	593.00	30,005,800
五洋建設	193,000	767.00	148,031,000
世紀東急工業	21,900	835.00	18,286,500
福田組	4,800	4,810.00	23,088,000
日本ドライケミカル	3,400	2,135.00	7,259,000
住友林業	116,200	2,116.00	245,879,200
日本基礎技術	13,600	546.00	7,425,600
巴コーポレーション	20,200	454.00	9,170,800
大和ハウス工業	419,800	3,721.00	1,562,075,800
ライト工業	26,000	1,993.00	51,818,000
積水ハウス	493,100	2,384.50	1,175,796,950
日特建設	11,500	707.00	8,130,500
北陸電気工事	8,000	1,242.00	9,936,000
ユアテック	26,100	711.00	18,557,100
日本リーテック	9,600	1,506.00	14,457,600
四電工	4,800	1,637.00	7,857,600
中電工	21,300	2,270.00	48,351,000
関電工	74,200	914.00	67,818,800
きんでん	92,700	1,886.00	174,832,200
東京エネシス	15,200	1,053.00	16,005,600
トーエネック	4,700	3,535.00	16,614,500
住友電設	12,900	2,181.00	28,134,900
日本電設工業	25,100	1,887.00	47,363,700
エクシオグループ	68,700	2,662.00	182,879,400
新日本空調	12,000	2,327.00	27,924,000
日本工営	8,100	3,305.00	26,770,500

九電工	31,900	3,610.00	115,159,000
三機工業	32,100	1,474.00	47,315,400
日揮ホールディングス	151,900	1,077.00	163,596,300
中外炉工業	4,900	1,710.00	8,379,000
ヤマト	14,600	739.00	10,789,400
太平電業	10,200	2,775.00	28,305,000
高砂熱学工業	41,100	2,169.00	89,145,900
三晃金属工業	1,800	2,499.00	4,498,200
NECネットスアイ	46,700	2,016.00	94,147,200
朝日工業社	2,300	3,275.00	7,532,500
明星工業	29,800	724.00	21,575,200
大気社	22,200	3,295.00	73,149,000
ダイダン	10,200	2,526.00	25,765,200
日比谷総合設備	14,800	1,900.00	28,120,000
ニッポン	42,900	1,641.00	70,398,900
日清製粉グループ本社	164,500	1,845.00	303,502,500
日東富士製粉	1,600	3,205.00	5,128,000
昭和産業	12,800	2,819.00	36,083,200
鳥越製粉	13,200	751.00	9,913,200
中部飼料	17,700	1,123.00	19,877,100
フィード・ワン	19,900	748.00	14,885,200
東洋精糖	1,900	1,193.00	2,266,700
日本甜菜製糖	7,900	1,642.00	12,971,800
DM三井製糖ホールディングス	11,900	2,032.00	24,180,800
塩水港精糖	16,100	223.00	3,590,300
日新製糖	7,400	1,692.00	12,520,800
LIFULL	43,800	359.00	15,724,200
ミクシィ	35,100	2,581.00	90,593,100
ジェイエイシーリクルートメント	11,000	2,210.00	24,310,000
日本M&Aセンターホールディングス	227,000	3,260.00	740,020,000
メンバーズ	4,600	3,030.00	13,938,000
中広	1,300	393.00	510,900
UTグループ	20,000	3,415.00	68,300,000
アイティメディア	4,800	2,274.00	10,915,200
E・Jホールディングス	7,100	1,344.00	9,542,400
夢真ビーネックスグループ	36,800	1,381.00	50,820,800
コシダカホールディングス	36,600	665.00	24,339,000
アルトナー	3,200	861.00	2,755,200
パソナグループ	14,900	3,280.00	48,872,000
CDS	2,600	1,582.00	4,113,200
リンクアンドモチベーション	30,300	1,070.00	32,421,000
エス・エム・エス	47,000	4,070.00	191,290,000
サニーサイドアップグループ	4,600	771.00	3,546,600
パーソルホールディングス	138,400	2,804.00	388,073,600
リニカル	7,700	755.00	5,813,500
クックパッド	42,300	243.00	10,278,900
エスクリ	4,000	584.00	2,336,000
アイ・ケイ・ケイ	7,000	695.00	4,865,000
森永製菓	34,200	4,060.00	138,852,000
中村屋	2,700	3,780.00	10,206,000

江崎グリコ	40,100	4,160.00	166,816,000
名糖産業	6,400	1,710.00	10,944,000
井村屋グループ	8,400	2,246.00	18,866,400
不二家	8,500	2,382.00	20,247,000
山崎製パン	109,000	1,900.00	207,100,000
第一屋製パン	3,400	780.00	2,652,000
モロゾフ	1,900	5,410.00	10,279,000
亀田製菓	8,400	4,555.00	38,262,000
寿スピリッツ	14,000	7,080.00	99,120,000
カルビー	66,300	2,692.00	178,479,600
森永乳業	26,900	6,490.00	174,581,000
六甲バター	10,700	1,637.00	17,515,900
ヤクルト本社	100,100	5,700.00	570,570,000
明治ホールディングス	96,200	7,180.00	690,716,000
雪印メグミルク	35,100	2,203.00	77,325,300
プリマハム	20,500	2,742.00	56,211,000
日本ハム	55,600	4,000.00	222,400,000
林兼産業	4,000	586.00	2,344,000
丸大食品	14,400	1,717.00	24,724,800
S Foods	13,100	2,931.00	38,396,100
柿安本店	5,100	2,650.00	13,515,000
伊藤ハム米久ホールディングス	94,200	708.00	66,693,600
学情	5,400	1,254.00	6,771,600
スタジオアリス	6,900	2,190.00	15,111,000
クロスキャット	3,300	1,273.00	4,200,900
シミックホールディングス	7,700	1,468.00	11,303,600
エブコ	3,000	836.00	2,508,000
システナ	50,500	2,068.00	104,434,000
NJS	3,000	2,044.00	6,132,000
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	3,575.00	73,287,500
総合警備保障	55,100	4,940.00	272,194,000
キューブシステム	7,000	1,002.00	7,014,000
いちご	159,400	366.00	58,340,400
WOW WORLD	4,500	1,791.00	8,059,500
日本駐車場開発	155,000	154.00	23,870,000
コア	5,600	1,500.00	8,400,000
カカクコム	102,200	3,810.00	389,382,000
アイロムグループ	4,900	2,002.00	9,809,800
セントケア・ホールディング	10,200	886.00	9,037,200
サイネックス	2,500	660.00	1,650,000
ルネサンス	8,500	1,174.00	9,979,000
ディップ	21,600	4,200.00	90,720,000
SBSホールディングス	10,700	4,080.00	43,656,000
デジタルホールディングス	9,400	1,796.00	16,882,400
新日本科学	17,500	910.00	15,925,000
キャリアデザインセンター	3,300	1,130.00	3,729,000
ベネフィット・ワン	50,300	5,770.00	290,231,000
エムスリー	244,300	7,163.00	1,749,920,900
ツカダ・グローバルホールディング	10,600	340.00	3,604,000

プラス	1,700	737.00	1,252,900
アウトソーシング	79,100	1,954.00	154,561,400
ウェルネット	13,700	520.00	7,124,000
ワールドホールディングス	5,400	2,912.00	15,724,800
ディー・エヌ・エー	58,400	2,130.00	124,392,000
博報堂DYホールディングス	192,800	1,808.00	348,582,400
ぐるなび	23,800	538.00	12,804,400
タカミヤ	17,100	458.00	7,831,800
ジャパンベストレスキューシステム	9,900	1,146.00	11,345,400
ファンコミュニケーションズ	34,900	452.00	15,774,800
ライク	3,600	1,821.00	6,555,600
ビジネス・ブレークスルー	5,700	428.00	2,439,600
エスプール	38,700	1,184.00	45,820,800
WDBホールディングス	6,200	3,390.00	21,018,000
手間いらず	1,900	5,980.00	11,362,000
ティア	8,000	488.00	3,904,000
CDG	1,400	1,522.00	2,130,800
アドウェイズ	23,300	767.00	17,871,100
バリューコマース	10,700	4,600.00	49,220,000
インフォマート	151,400	1,015.00	153,671,000
サッポロホールディングス	49,700	2,567.00	127,579,900
アサヒグループホールディングス	342,200	5,453.00	1,866,016,600
麒麟ホールディングス	534,800	2,076.50	1,110,512,200
宝ホールディングス	107,700	1,569.00	168,981,300
オエノンホールディングス	42,000	371.00	15,582,000
養命酒製造	4,700	1,848.00	8,685,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	102,100	1,622.00	165,606,200
サントリー食品インターナショナル	97,300	4,570.00	444,661,000
ダイドーグループホールディングス	8,200	5,620.00	46,084,000
伊藤園	44,100	7,100.00	313,110,000
キーコーヒー	14,400	2,197.00	31,636,800
ユニカフェ	4,600	1,064.00	4,894,400
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	3,030.00	55,449,000
不二製油グループ本社	35,600	2,626.00	93,485,600
かどや製油	1,100	4,135.00	4,548,500
J-オイルミルズ	13,800	1,827.00	25,212,600
ローソン	36,200	5,310.00	192,222,000
サンエー	10,900	4,035.00	43,981,500
カワチ薬品	9,900	2,251.00	22,284,900
エービーシー・マート	22,300	6,040.00	134,692,000
ハードオフコーポレーション	6,400	778.00	4,979,200
高千穂交易	5,200	1,170.00	6,084,000
アスクル	23,000	1,610.00	37,030,000
ゲオホールディングス	19,000	1,220.00	23,180,000
アダストリア	19,700	1,917.00	37,764,900
ジーフット	10,600	399.00	4,229,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2,200	403.00	886,600
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	5,190.00	16,608,000	
くら寿司	14,800	3,570.00	52,836,000	
キャンドウ	6,800	1,905.00	12,954,000	
エレマテック	11,500	1,105.00	12,707,500	
アイケイ	4,000	533.00	2,132,000	
パルグループホールディングス	12,400	1,699.00	21,067,600	
JALUX	4,000	1,719.00	6,876,000	
エディオン	60,500	1,084.00	65,582,000	
あらた	11,400	4,175.00	47,595,000	
サーラコーポレーション	29,400	621.00	18,257,400	
ワッツ	6,800	876.00	5,956,800	
トーメンデバイス	1,800	5,000.00	9,000,000	
ハローズ	5,700	2,780.00	15,846,000	
J Pホールディングス	39,000	258.00	10,062,000	
フジオフードグループ本社	12,100	1,367.00	16,540,700	
あみやき亭	3,200	2,995.00	9,584,000	
東京エレクトロン デバイス	4,600	6,860.00	31,556,000	
ひらまつ	25,700	216.00	5,551,200	
フィールズ	12,300	518.00	6,371,400	
双日	157,400	1,977.00	311,179,800	
アルフレッサ ホールディングス	148,000	1,613.00	238,724,000	
大黒天物産	4,500	6,650.00	29,925,000	
ハニーズホールディングス	11,100	1,021.00	11,333,100	
ファーマライズホールディングス	3,700	779.00	2,882,300	
キッコーマン	104,700	8,720.00	912,984,000	
味の素	346,000	3,303.00	1,142,838,000	
ブルドックソース	6,400	2,265.00	14,496,000	
キュービー	81,000	2,490.00	201,690,000	
ハウス食品グループ本社	54,400	3,345.00	181,968,000	
カゴメ	55,300	2,851.00	157,660,300	
焼津水産化学工業	5,400	996.00	5,378,400	
アリアケジャパン	13,300	7,010.00	93,233,000	
ピエトロ	1,300	1,781.00	2,315,300	
エバラ食品工業	2,600	2,500.00	6,500,000	
やまみ	1,200	2,148.00	2,577,600	
ニチレイ	69,300	2,887.00	200,069,100	
横浜冷凍	41,900	881.00	36,913,900	
東洋水産	74,900	4,850.00	363,265,000	
イトアンドホールディングス	4,900	2,384.00	11,681,600	
大冷	1,800	1,930.00	3,474,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,100	732.00	5,929,200	
日清食品ホールディングス	57,100	8,760.00	500,196,000	
永谷園ホールディングス	7,500	2,084.00	15,630,000	
一正蒲鉾	5,800	921.00	5,341,800	
フジッコ	16,200	1,907.00	30,893,400	
ロック・フィールド	15,500	1,744.00	27,032,000	
日本たばこ産業	780,400	2,230.00	1,740,292,000	
ケンコーマヨネーズ	9,000	1,535.00	13,815,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,400	2,305.00	21,667,000	
なとり	8,400	1,931.00	16,220,400	

イフジ産業	2,600	922.00	2,397,200
ピククルスコーポレーション	6,800	1,819.00	12,369,200
ファーマフーズ	13,600	2,589.00	35,210,400
北の達人コーポレーション	50,400	431.00	21,722,400
ユージェナ	73,800	848.00	62,582,400
紀文食品	8,400	1,272.00	10,684,800
スター・マイカ・ホールディングス	7,700	1,386.00	10,672,200
SREホールディングス	2,100	6,940.00	14,574,000
ADワークスグループ	29,500	160.00	4,720,000
片倉工業	17,300	1,726.00	29,859,800
グンゼ	10,400	4,205.00	43,732,000
ヒューリック	303,400	1,152.00	349,516,800
神栄	3,100	1,025.00	3,177,500
ラサ商事	7,800	941.00	7,339,800
アルペン	10,800	2,830.00	30,564,000
ハブ	4,400	767.00	3,374,800
ラクーンホールディングス	10,200	1,574.00	16,054,800
クオールホールディングス	19,100	1,425.00	27,217,500
アルコニックス	15,100	1,697.00	25,624,700
神戸物産	110,700	3,645.00	403,501,500
ソリトンシステムズ	6,900	1,428.00	9,853,200
ジinzホールディングス	9,700	7,040.00	68,288,000
ビックカメラ	84,900	1,032.00	87,616,800
DCMホールディングス	88,200	1,103.00	97,284,600
ペッパーフードサービス	19,100	397.00	7,582,700
ハイパー	2,200	549.00	1,207,800
Monotaro	180,300	2,528.00	455,798,400
東京一番フーズ	4,100	585.00	2,398,500
DDホールディングス	7,300	514.00	3,752,200
あいホールディングス	20,400	2,157.00	44,002,800
ディーブイエックス	4,400	1,065.00	4,686,000
きちりホールディングス	3,700	631.00	2,334,700
アークランドサービスホールディングス	10,800	2,288.00	24,710,400
J.フロントリテイリング	170,300	1,017.00	173,195,100
ドトール・日レスホールディングス	22,600	1,734.00	39,188,400
マツキヨココカラ&カンパニー	80,520	5,560.00	447,691,200
ブロンコビリー	8,100	2,478.00	20,071,800
ZOZO	84,000	4,070.00	341,880,000
トレジャー・ファクトリー	3,900	944.00	3,681,600
物語コーポレーション	7,600	7,380.00	56,088,000
三越伊勢丹ホールディングス	249,500	802.00	200,099,000
東洋紡	56,100	1,356.00	76,071,600
ユニチカ	41,300	364.00	15,033,200
富士紡ホールディングス	6,900	3,960.00	27,324,000
日清紡ホールディングス	88,400	880.00	77,792,000
倉敷紡績	12,300	1,905.00	23,431,500
ダイワボウホールディングス	64,900	1,924.00	124,867,600
シキボウ	8,100	931.00	7,541,100
日東紡績	21,600	3,345.00	72,252,000

トヨタ紡織	42,100	2,066.00	86,978,600
マクニカ・富士エレホールディングス	34,000	2,468.00	83,912,000
H a m e e	3,500	1,444.00	5,054,000
マーケットエンタープライズ	500	731.00	365,500
ラクト・ジャパン	5,700	2,782.00	15,857,400
ウエルシアホールディングス	75,500	4,130.00	311,815,000
クリエイトSDホールディングス	21,100	3,670.00	77,437,000
グリムス	4,100	3,050.00	12,505,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,800	757.00	18,773,600
八洲電機	11,200	958.00	10,729,600
メディアスホールディングス	8,200	888.00	7,281,600
レスターホールディングス	15,100	1,859.00	28,070,900
ジューテックホールディングス	3,400	1,110.00	3,774,000
丸善CHIホールディングス	20,400	372.00	7,588,800
大光	6,000	698.00	4,188,000
OCHIホールディングス	3,900	1,266.00	4,937,400
TOKAIホールディングス	69,100	883.00	61,015,300
黒谷	3,700	642.00	2,375,400
ミサワ	2,600	664.00	1,726,400
ティーライフ	1,900	1,425.00	2,707,500
Cominix	1,900	722.00	1,371,800
エー・ピーホールディングス	2,100	464.00	974,400
三洋貿易	14,200	1,127.00	16,003,400
チムニー	4,400	1,456.00	6,406,400
シュッピン	9,600	1,221.00	11,721,600
ビューティガレージ	2,600	3,710.00	9,646,000
オイシックス・ラ・大地	18,700	4,550.00	85,085,000
ウイン・パートナーズ	10,700	966.00	10,336,200
ネクステージ	28,600	2,006.00	57,371,600
ジョイフル本田	41,800	1,572.00	65,709,600
鳥貴族ホールディングス	5,100	2,003.00	10,215,300
ホットランド	10,700	1,363.00	14,584,100
すかいらーくホールディングス	184,200	1,586.00	292,141,200
SFPホールディングス	7,000	1,439.00	10,073,000
綿半ホールディングス	10,800	1,225.00	13,230,000
日本毛織	43,000	946.00	40,678,000
ダイトウボウ	21,600	99.00	2,138,400
トーア紡コーポレーション	4,500	427.00	1,921,500
ダイドーリミテッド	18,500	170.00	3,145,000
ヨシックスホールディングス	2,700	2,178.00	5,880,600
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	1,038.00	43,180,800
三栄建築設計	5,600	2,018.00	11,300,800
野村不動産ホールディングス	82,000	2,789.00	228,698,000
三重交通グループホールディングス	29,200	543.00	15,855,600
サムティ	20,300	2,346.00	47,623,800
ディア・ライフ	18,300	581.00	10,632,300
コーセーアールイー	4,300	668.00	2,872,400
日本商業開発	9,100	1,736.00	15,797,600

プレサンスコーポレーション	23,500	1,871.00	43,968,500
フィル・カンパニー	2,500	3,045.00	7,612,500
THEグローバル社	9,200	211.00	1,941,200
ハウスコム	1,300	1,285.00	1,670,500
日本管理センター	7,000	1,192.00	8,344,000
サンセイランディック	3,900	827.00	3,225,300
エストラスト	1,400	652.00	912,800
フージャースホールディングス	23,100	661.00	15,269,100
オープンハウス	45,300	6,960.00	315,288,000
東急不動産ホールディングス	388,500	674.00	261,849,000
飯田グループホールディングス	119,200	2,757.00	328,634,400
イーグランド	2,600	1,515.00	3,939,000
ムゲンエステート	9,700	485.00	4,704,500
帝国繊維	16,100	1,988.00	32,006,800
日本コークス工業	120,400	156.00	18,782,400
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,100	1,312.00	10,627,200
ミタチ産業	3,800	875.00	3,325,000
B E E N O S	7,200	2,931.00	21,103,200
あさひ	10,500	1,318.00	13,839,000
日本調剤	8,700	1,600.00	13,920,000
コスモス薬品	14,400	17,550.00	252,720,000
シップヘルスケアホールディングス	50,300	2,820.00	141,846,000
トーエル	7,100	842.00	5,978,200
ソフトクリエイトホールディングス	5,800	3,290.00	19,082,000
オンリー	2,900	770.00	2,233,000
セブン&アイ・ホールディングス	558,500	4,755.00	2,655,667,500
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	76,600	922.00	70,625,200
明治電機工業	3,400	1,322.00	4,494,800
ツルハホールディングス	31,100	13,790.00	428,869,000
デリカフーズホールディングス	6,100	631.00	3,849,100
スターティアホールディングス	3,600	1,454.00	5,234,400
サンマルクホールディングス	11,200	1,586.00	17,763,200
フェリシモ	3,000	1,447.00	4,341,000
トリドールホールディングス	35,300	2,661.00	93,933,300
帝人	133,600	1,579.00	210,954,400
東レ	1,028,100	725.70	746,092,170
クラレ	207,900	1,068.00	222,037,200
旭化成	941,100	1,184.00	1,114,262,400
T O K Y O B A S E	15,900	689.00	10,955,100
稲葉製作所	8,000	1,332.00	10,656,000
宮地エンジニアリンググループ	4,500	2,597.00	11,686,500
トーカロ	37,000	1,238.00	45,806,000
アルファ	5,000	1,206.00	6,030,000
S U M C O	182,800	2,162.00	395,213,600
川田テクノロジーズ	2,900	3,910.00	11,339,000
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	721.00	5,407,500
ピーロット	9,400	548.00	5,151,200

ファーストブラザーズ	3,300	1,015.00	3,349,500
ハウスドゥ	7,000	1,002.00	7,014,000
シーアールイー	3,600	1,941.00	6,987,600
プロパティエージェント	2,500	2,638.00	6,595,000
ケイアイスター不動産	4,800	5,960.00	28,608,000
アグレ都市デザイン	3,700	1,386.00	5,128,200
グッドコムアセット	6,200	1,394.00	8,642,800
ジェイ・エス・ビー	2,800	2,898.00	8,114,400
テンポイノベーション	3,700	950.00	3,515,000
グローバル・リンク・マネジメント	2,200	1,099.00	2,417,800
フェイスネットワーク	1,100	1,260.00	1,386,000
住江織物	2,300	1,850.00	4,255,000
日本フェルト	6,200	450.00	2,790,000
イチカワ	1,400	1,331.00	1,863,400
エコナックホールディングス	23,100	92.00	2,125,200
日東製網	1,400	1,470.00	2,058,000
芦森工業	2,600	1,029.00	2,675,400
アツギ	11,000	637.00	7,007,000
ウイルプラスホールディングス	2,100	1,031.00	2,165,100
J Mホールディングス	9,800	1,932.00	18,933,600
コメダホールディングス	31,000	2,103.00	65,193,000
サツドラホールディングス	1,700	2,248.00	3,821,600
アレンザホールディングス	10,900	1,251.00	13,635,900
串カツ田中ホールディングス	3,600	2,260.00	8,136,000
バロックジャパンリミテッド	9,900	874.00	8,652,600
クスリのアオキホールディングス	14,200	7,370.00	104,654,000
ダイニック	4,000	738.00	2,952,000
共和レザー	7,700	685.00	5,274,500
ピーバンドットコム	1,700	676.00	1,149,200
力の源ホールディングス	6,900	611.00	4,215,900
FOOD & LIFE COMPANIES	83,500	4,950.00	413,325,000
アセンテック	3,200	1,265.00	4,048,000
セーレン	34,900	2,126.00	74,197,400
ソトー	6,700	857.00	5,741,900
東海染工	1,400	1,134.00	1,587,600
小松マテール	23,300	916.00	21,342,800
ワコールホールディングス	35,500	2,302.00	81,721,000
ホギメディカル	19,100	3,130.00	59,783,000
クラウディアホールディングス	2,600	283.00	735,800
T S Iホールディングス	42,600	359.00	15,293,400
マツオカコーポレーション	4,500	1,401.00	6,304,500
ワールド	18,500	1,354.00	25,049,000
T I S	142,000	2,941.00	417,622,000
J N Sホールディングス	9,500	543.00	5,158,500
グリー	86,200	838.00	72,235,600
G M Oペパボ	1,800	2,790.00	5,022,000
コーエーテクモホールディングス	37,800	5,010.00	189,378,000
三菱総合研究所	5,900	4,355.00	25,694,500
ボルテージ	3,000	448.00	1,344,000

電算	1,100	2,337.00	2,570,700
A G S	6,800	871.00	5,922,800
ファインデックス	11,600	965.00	11,194,000
ブレインパッド	3,600	5,410.00	19,476,000
K L a b	25,800	657.00	16,950,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	18,700	1,030.00	19,261,000
イーブックイニシアティブジャパン	2,500	4,900.00	12,250,000
ネクソン	320,400	1,854.00	594,021,600
アイスタイル	42,700	419.00	17,891,300
エムアップホールディングス	4,400	3,445.00	15,158,000
エイチーム	9,700	1,599.00	15,510,300
エニグモ	13,200	1,143.00	15,087,600
テクノスジャパン	10,700	591.00	6,323,700
e n i s h	8,600	433.00	3,723,800
コロプラ	46,800	822.00	38,469,600
オルトプラス	10,800	407.00	4,395,600
ブロードリーフ	69,500	555.00	38,572,500
クロス・マーケティンググループ	7,300	837.00	6,110,100
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	936.00	9,360,000
メディアドゥ	5,400	4,330.00	23,382,000
じげん	34,700	408.00	14,157,600
ブイキューブ	14,100	1,572.00	22,165,200
エンカレッジ・テクノロジー	2,500	604.00	1,510,000
サイバーリンクス	6,600	1,350.00	8,910,000
ディー・エル・イー	10,900	285.00	3,106,500
フィックスターズ	14,600	761.00	11,110,600
C A R T A H O L D I N G S	5,500	2,354.00	12,947,000
オブティム	9,800	1,961.00	19,217,800
セレス	5,300	2,841.00	15,057,300
S H I F T	7,200	21,850.00	157,320,000
特種東海製紙	8,800	4,425.00	38,940,000
ティーガイア	15,200	2,046.00	31,099,200
セック	1,900	2,304.00	4,377,600
テクマトリックス	21,800	1,797.00	39,174,600
プロシップ	3,800	1,733.00	6,585,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	38,600	2,064.00	79,670,400
G M O ペイメントゲートウェイ	27,500	13,750.00	378,125,000
ザップラス	10,300	532.00	5,479,600
システムリサーチ	3,800	1,903.00	7,231,400
インターネットイニシアティブ	37,700	3,805.00	143,448,500
さくらインターネット	14,500	604.00	8,758,000
ヴィンクス	3,600	957.00	3,445,200
G M O グローバルサイン・ホールディングス	3,100	4,470.00	13,857,000
S R A ホールディングス	7,300	2,818.00	20,571,400
システムインテグレータ	3,600	626.00	2,253,600
朝日ネット	11,000	728.00	8,008,000

e B A S E	16,600	803.00	13,329,800
アバント	16,200	1,565.00	25,353,000
アドソル日進	4,700	2,143.00	10,072,100
ODKソリューションズ	7,200	704.00	5,068,800
フリービット	8,200	1,299.00	10,651,800
コムチュア	12,900	2,889.00	37,268,100
サイバーコム	2,300	1,225.00	2,817,500
アステリア	12,900	708.00	9,133,200
アイル	7,800	1,759.00	13,720,200
王子ホールディングス	639,100	563.00	359,813,300
日本製紙	62,900	1,225.00	77,052,500
三菱製紙	21,500	361.00	7,761,500
北越コーポレーション	101,400	734.00	74,427,600
中越パルプ工業	5,400	1,196.00	6,458,400
巴川製紙所	4,700	868.00	4,079,600
大王製紙	68,500	2,017.00	138,164,500
阿波製紙	4,200	388.00	1,629,600
マークライnz	7,100	3,030.00	21,513,000
メディカル・データ・ビジョン	17,800	1,458.00	25,952,400
g u m i	19,400	850.00	16,490,000
ショーケース	2,600	604.00	1,570,400
モバイルファクトリー	2,800	1,063.00	2,976,400
テラスカイ	4,400	1,972.00	8,676,800
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5,900	1,687.00	9,953,300
P C Iホールディングス	6,000	1,038.00	6,228,000
パイプドHD	4,100	2,797.00	11,467,700
アイビーシー	2,100	930.00	1,953,000
ネオジャパン	2,500	1,380.00	3,450,000
P R T I M E S	3,700	3,095.00	11,451,500
ラクス	42,600	3,230.00	137,598,000
ランドコンピュータ	2,550	802.00	2,045,100
ダブルスタンダード	3,500	3,565.00	12,477,500
オーブンドア	8,400	2,646.00	22,226,400
マイネット	4,700	655.00	3,078,500
アカツキ	5,500	3,190.00	17,545,000
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	2,657.00	11,956,500
カナミックネットワーク	15,000	620.00	9,300,000
ノムラシステムコーポレーション	6,600	291.00	1,920,600
レンゴー	146,500	863.00	126,429,500
トーモク	8,800	1,953.00	17,186,400
ザ・バック	10,800	2,906.00	31,384,800
チェンジ	26,000	2,212.00	57,512,000
シンクロ・フード	7,800	385.00	3,003,000
オークネット	7,700	2,209.00	17,009,300
キャピタル・アセット・プランニング	2,600	901.00	2,342,600
セグエグループ	3,200	781.00	2,499,200
エイトレッド	2,500	2,359.00	5,897,500
マクロミル	28,900	816.00	23,582,400

ビーグリー	3,100	1,600.00	4,960,000
オロ	4,300	3,600.00	15,480,000
ユーザーローカル	4,000	1,792.00	7,168,000
テモナ	2,700	747.00	2,016,900
ニーズウェル	2,500	683.00	1,707,500
マネーフォワード	21,500	7,700.00	165,550,000
サインポスト	3,300	1,127.00	3,719,100
昭和電工	123,000	2,724.00	335,052,000
住友化学	1,117,300	574.00	641,330,200
住友精化	7,000	3,400.00	23,800,000
日産化学	77,200	6,360.00	490,992,000
ラサ工業	4,500	1,802.00	8,109,000
クレハ	12,100	7,240.00	87,604,000
多木化学	5,500	6,320.00	34,760,000
テイカ	10,600	1,302.00	13,801,200
石原産業	25,200	1,210.00	30,492,000
片倉コープアグリ	2,600	1,185.00	3,081,000
日本曹達	19,400	3,410.00	66,154,000
東ソー	219,400	2,010.00	440,994,000
トクヤマ	42,100	2,113.00	88,957,300
セントラル硝子	27,300	2,079.00	56,756,700
東亜合成	80,900	1,284.00	103,875,600
大阪ソーダ	14,600	2,610.00	38,106,000
関東電化工業	33,600	978.00	32,860,800
デンカ	51,800	3,850.00	199,430,000
イビデン	69,600	5,750.00	400,200,000
信越化学工業	262,500	19,030.00	4,995,375,000
日本カーバイド工業	5,200	1,364.00	7,092,800
電算システムホールディングス	5,600	2,593.00	14,520,800
堺化学工業	9,900	2,288.00	22,651,200
第一稀元素化学工業	14,000	1,440.00	20,160,000
エア・ウォーター	144,700	1,707.00	247,002,900
日本酸素ホールディングス	117,000	2,719.00	318,123,000
日本化学工業	3,900	2,863.00	11,165,700
東邦アセチレン	2,100	1,255.00	2,635,500
日本パーカライジング	72,100	1,104.00	79,598,400
高圧ガス工業	22,700	763.00	17,320,100
チタン工業	1,700	1,831.00	3,112,700
四国化成工業	18,700	1,395.00	26,086,500
戸田工業	2,900	3,010.00	8,729,000
ステラ ケミファ	7,700	2,858.00	22,006,600
保土谷化学工業	4,100	5,020.00	20,582,000
日本触媒	25,800	5,780.00	149,124,000
大日精化工業	11,800	2,646.00	31,222,800
カネカ	36,700	4,480.00	164,416,000
協和キリン	170,100	3,685.00	626,818,500
三菱瓦斯化学	142,200	2,222.00	315,968,400
三井化学	122,400	3,580.00	438,192,000
J S R	142,400	3,830.00	545,392,000
東京応化工業	24,300	6,450.00	156,735,000

大阪有機化学工業	12,000	3,345.00	40,140,000
三菱ケミカルホールディングス	949,000	983.10	932,961,900
KHネオケム	23,400	3,020.00	70,668,000
ダイセル	191,000	870.00	166,170,000
住友ベークライト	22,400	4,890.00	109,536,000
積水化学工業	297,300	1,854.00	551,194,200
日本ゼオン	128,000	1,499.00	191,872,000
アイカ工業	39,600	3,570.00	141,372,000
宇部興産	71,800	2,196.00	157,672,800
積水樹脂	21,600	2,074.00	44,798,400
タキロンシーアイ	30,800	608.00	18,726,400
旭有機材	8,100	1,400.00	11,340,000
ニチバン	7,600	1,789.00	13,596,400
リケンテクノス	34,500	555.00	19,147,500
大倉工業	7,200	2,161.00	15,559,200
積水化成成品工業	19,400	583.00	11,310,200
群栄化学工業	3,200	3,070.00	9,824,000
タイガースポリマー	8,000	421.00	3,368,000
ミライアル	4,400	1,461.00	6,428,400
ダイキアクシス	5,300	967.00	5,125,100
ダイキョーニシカワ	30,100	651.00	19,595,100
竹本容器	5,100	912.00	4,651,200
森六ホールディングス	7,800	2,024.00	15,787,200
恵和	3,600	4,495.00	16,182,000
日本化薬	87,900	1,210.00	106,359,000
カーリットホールディングス	13,700	769.00	10,535,300
ソルクシーズ	11,000	518.00	5,698,000
レグス	3,500	1,724.00	6,034,000
プレステージ・インターナショナル	51,800	757.00	39,212,600
フェイス	4,000	709.00	2,836,000
プロトコーポレーション	16,800	1,477.00	24,813,600
ハイマックス	3,700	1,148.00	4,247,600
アミューズ	7,600	2,293.00	17,426,800
野村総合研究所	246,900	4,000.00	987,600,000
ドリームインキュベータ	4,100	827.00	3,390,700
サイバネットシステム	9,200	636.00	5,851,200
クイック	8,400	1,366.00	11,474,400
TAC	7,100	239.00	1,696,900
CEホールディングス	7,000	561.00	3,927,000
日本システム技術	3,200	1,850.00	5,920,000
電通グループ	142,800	4,185.00	597,618,000
インテージホールディングス	17,500	1,681.00	29,417,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	1,284.00	7,960,800
東邦システムサイエンス	3,300	1,030.00	3,399,000
ぴあ	3,900	4,210.00	16,419,000
イオンファンタジー	5,200	1,856.00	9,651,200
ソースネクスト	65,600	229.00	15,022,400
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	904.00	4,248,800
インフォコム	12,800	2,324.00	29,747,200

メディカルシステムネットワーク	12,200	670.00	8,174,000	
日本精化	10,200	2,148.00	21,909,600	
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	3,140.00	41,134,000	
HEROZ	3,900	1,924.00	7,503,600	
ラクスル	15,400	5,650.00	87,010,000	
I P S	3,200	2,072.00	6,630,400	
F I G	14,000	283.00	3,962,000	
システムサポート	3,900	1,336.00	5,210,400	
A D E K A	65,200	2,338.00	152,437,600	
日油	53,400	6,030.00	322,002,000	
ミヨシ油脂	5,700	1,335.00	7,609,500	
新日本理化	22,400	317.00	7,100,800	
ハリマ化成グループ	10,900	868.00	9,461,200	
イーソル	8,400	889.00	7,467,600	
アルテリア・ネットワークス	15,300	1,647.00	25,199,100	
E D U L A B	1,200	2,668.00	3,201,600	
東海ソフト	1,900	1,195.00	2,270,500	
ウイングアーク1st	7,900	2,347.00	18,541,300	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,760.00	6,864,000	
サーバーワークス	1,300	4,105.00	5,336,500	
東名	700	1,200.00	840,000	
ヴィッツ	1,200	1,622.00	1,946,400	
トピラシステムズ	2,500	1,196.00	2,990,000	
S a n s a n	12,600	12,070.00	152,082,000	
L i n k - U	2,300	1,208.00	2,778,400	
ギフトイ	12,300	4,020.00	49,446,000	
花王	320,800	6,586.00	2,112,788,800	
第一工業製薬	4,800	3,050.00	14,640,000	
石原ケミカル	7,100	1,363.00	9,677,300	
日華化学	4,700	973.00	4,573,100	
ニイタカ	2,900	2,255.00	6,539,500	
三洋化成工業	8,500	5,640.00	47,940,000	
ベース	2,600	4,620.00	12,012,000	
武田薬品工業	1,206,000	3,241.00	3,908,646,000	
アステラス製薬	1,256,800	1,953.50	2,455,158,800	
大日本住友製薬	107,400	1,888.00	202,771,200	
塩野義製薬	182,200	7,560.00	1,377,432,000	
わかもと製薬	16,800	338.00	5,678,400	
日本新薬	41,100	8,830.00	362,913,000	
中外製薬	453,300	3,916.00	1,775,122,800	
科研製薬	24,800	4,380.00	108,624,000	
エーザイ	160,100	7,956.00	1,273,755,600	
理研ビタミン	13,700	1,810.00	24,797,000	
ロート製薬	69,100	3,360.00	232,176,000	
小野薬品工業	332,900	2,414.00	803,620,600	
久光製薬	42,200	3,975.00	167,745,000	
有機合成薬品工業	10,300	325.00	3,347,500	
持田製薬	20,200	3,240.00	65,448,000	

参天製薬	252,200	1,496.00	377,291,200
扶桑薬品工業	4,600	2,464.00	11,334,400
日本ケミファ	1,300	2,172.00	2,823,600
ツムラ	48,300	3,365.00	162,529,500
日医工	40,900	897.00	36,687,300
テルモ	444,400	4,974.00	2,210,445,600
H・U・グループホールディングス	38,700	2,824.00	109,288,800
キッセイ薬品工業	25,600	2,400.00	61,440,000
生化学工業	25,600	1,024.00	26,214,400
栄研化学	25,400	1,912.00	48,564,800
日水製薬	5,600	977.00	5,471,200
鳥居薬品	8,200	2,961.00	24,280,200
JCRファーマ	40,800	2,800.00	114,240,000
東和薬品	20,800	3,320.00	69,056,000
富士製薬工業	9,100	1,126.00	10,246,600
ゼリア新薬工業	26,400	2,028.00	53,539,200
第一三共	1,139,000	2,930.50	3,337,839,500
キョーリン製薬ホールディングス	31,900	1,778.00	56,718,200
大幸薬品	21,700	884.00	19,182,800
ダイト	9,200	3,140.00	28,888,000
大塚ホールディングス	301,300	4,786.00	1,442,021,800
大正製薬ホールディングス	35,800	6,340.00	226,972,000
ペプチドリーム	76,000	2,700.00	205,200,000
大日本塗料	16,300	859.00	14,001,700
日本ペイントホールディングス	533,400	1,180.00	629,412,000
関西ペイント	159,500	2,641.00	421,239,500
神東塗料	10,400	192.00	1,996,800
中国塗料	31,000	883.00	27,373,000
日本特殊塗料	10,700	1,022.00	10,935,400
藤倉化成	19,300	532.00	10,267,600
太陽ホールディングス	20,900	2,686.00	56,137,400
DIC	60,100	3,105.00	186,610,500
サカタインクス	28,500	1,129.00	32,176,500
東洋インキSCホールディングス	30,200	2,027.00	61,215,400
T&K TOKA	10,400	806.00	8,382,400
アルプス技研	12,200	2,074.00	25,302,800
サニックス	21,100	331.00	6,984,100
ダイオーズ	3,200	1,002.00	3,206,400
日本空調サービス	14,400	815.00	11,736,000
オリエンタルランド	147,300	17,790.00	2,620,467,000
フォーカスシステムズ	8,800	984.00	8,659,200
ダスキン	32,100	2,676.00	85,899,600
パーク24	76,600	1,822.00	139,565,200
明光ネットワークジャパン	15,800	646.00	10,206,800
ファルコホールディングス	6,600	1,715.00	11,319,000
クレスコ	10,800	1,951.00	21,070,800
フジ・メディア・ホールディングス	147,500	1,175.00	173,312,500
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	1,455.00	68,530,500

リゾートトラスト	63,400	2,046.00	129,716,400
オービック	44,700	21,030.00	940,041,000
ジャストシステム	20,200	5,690.00	114,938,000
TDCソフト	14,500	1,309.00	18,980,500
Zホールディングス	1,953,500	692.20	1,352,212,700
ビー・エム・エル	17,700	4,015.00	71,065,500
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	1,198.00	25,158,000
IDホールディングス	7,500	926.00	6,945,000
リソー教育	69,500	466.00	32,387,000
日本オラクル	28,800	10,150.00	292,320,000
早稲田アカデミー	5,700	995.00	5,671,500
アルファシステムズ	3,400	4,285.00	14,569,000
フューチャー	15,500	2,739.00	42,454,500
CAC Holdings	8,400	1,619.00	13,599,600
SBテクノロジー	4,900	2,809.00	13,764,100
トーセ	3,700	774.00	2,863,800
ユー・エス・エス	155,100	1,768.00	274,216,800
オービックビジネスコンサルタント	13,500	5,750.00	77,625,000
伊藤忠テクノソリューションズ	64,500	3,500.00	225,750,000
アイティフォー	17,300	836.00	14,462,800
東京個別指導学院	11,900	649.00	7,723,100
東計電算	2,100	4,730.00	9,933,000
サイバーエージェント	341,000	2,106.00	718,146,000
楽天グループ	710,500	1,108.00	787,234,000
エクスネット	6,200	1,012.00	6,274,400
クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,868.00	13,262,800
モーニングスター	19,700	517.00	10,184,900
テー・オー・ダブリュー	23,800	341.00	8,115,800
大塚商会	76,800	5,560.00	427,008,000
サイボウズ	18,700	2,350.00	43,945,000
山田コンサルティンググループ	8,000	1,103.00	8,824,000
セントラルスポーツ	5,100	2,411.00	12,296,100
バラカ	3,700	1,631.00	6,034,700
電通国際情報サービス	20,500	3,960.00	81,180,000
ACCESS	17,400	911.00	15,851,400
デジタルガレージ	23,500	4,910.00	115,385,000
イーエムシステムズ	23,200	762.00	17,678,400
ウェザーニューズ	4,200	6,660.00	27,972,000
C I J	8,800	849.00	7,471,200
ビジネスエンジニアリング	1,900	3,475.00	6,602,500
日本エンタープライズ	12,900	202.00	2,605,800
WOWOW	6,900	2,431.00	16,773,900
スカラ	15,700	730.00	11,461,000
インテリジェント ウェイブ	7,800	603.00	4,703,400
フルキャストホールディングス	11,700	2,600.00	30,420,000
エン・ジャパン	24,600	4,325.00	106,395,000
あすか製薬ホールディングス	16,300	1,004.00	16,365,200
サワイグループホールディングス	31,700	5,150.00	163,255,000
富士フイルムホールディングス	254,800	8,919.00	2,272,561,200

コニカミノルタ	293,800	619.00	181,862,200	
資生堂	270,000	7,419.00	2,003,130,000	
ライオン	175,000	1,846.00	323,050,000	
高砂香料工業	9,100	2,901.00	26,399,100	
マンダム	30,400	1,567.00	47,636,800	
ミルボン	17,800	6,560.00	116,768,000	
ファンケル	52,700	3,690.00	194,463,000	
コーセー	27,200	13,560.00	368,832,000	
コタ	9,100	1,560.00	14,196,000	
シーボン	1,400	1,852.00	2,592,800	
ポーラ・オルビスホールディングス	61,900	2,462.00	152,397,800	
ノエビアホールディングス	12,300	5,320.00	65,436,000	
アジュバンホールディングス	3,300	1,180.00	3,894,000	
新日本製薬	3,900	1,815.00	7,078,500	
エステー	9,500	1,705.00	16,197,500	
アグロ カネショウ	5,000	1,475.00	7,375,000	
コニシ	23,900	1,801.00	43,043,900	
長谷川香料	25,000	2,687.00	67,175,000	
星光PMC	8,200	800.00	6,560,000	
小林製薬	40,600	8,590.00	348,754,000	
荒川化学工業	12,300	1,233.00	15,165,900	
メック	10,800	2,885.00	31,158,000	
日本高純度化学	3,900	2,896.00	11,294,400	
タカラバイオ	37,900	2,883.00	109,265,700	
JCU	16,300	4,165.00	67,889,500	
新田ゼラチン	9,900	625.00	6,187,500	
OATアグリオ	2,900	2,149.00	6,232,100	
デクセリアルズ	40,300	2,079.00	83,783,700	
アース製薬	11,900	6,660.00	79,254,000	
北興化学工業	13,300	1,024.00	13,619,200	
大成ラミック	4,100	2,732.00	11,201,200	
クミアイ化学工業	54,300	849.00	46,100,700	
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	1,333.00	22,927,600	
ユシロ化学工業	8,300	1,172.00	9,727,600	
ビービー・カストロール	5,300	1,425.00	7,552,500	
富士石油	34,000	298.00	10,132,000	
MORESCO	5,300	1,245.00	6,598,500	
出光興産	160,900	3,300.00	530,970,000	
ENEOSホールディングス	2,181,300	463.80	1,011,686,940	
コスモエネルギーホールディングス	45,700	2,573.00	117,586,100	
テスホールディングス	8,200	2,102.00	17,236,400	
インフロニア・ホールディングス	177,764	928.00	164,964,992	
横浜ゴム	83,900	2,059.00	172,750,100	
TOYO TIRE	76,300	1,934.00	147,564,200	
ブリヂストン	417,500	5,326.00	2,223,605,000	
住友ゴム工業	130,100	1,466.00	190,726,600	
藤倉コンポジット	12,000	772.00	9,264,000	
オカモト	8,700	4,055.00	35,278,500	

アキレス	10,200	1,299.00	13,249,800
フコク	6,000	1,027.00	6,162,000
ニッタ	15,100	2,625.00	39,637,500
クリエートメディック	4,600	982.00	4,517,200
住友理工	28,200	739.00	20,839,800
三ツ星ベルト	17,700	1,989.00	35,205,300
パンドー化学	25,600	880.00	22,528,000
A G C	133,000	5,900.00	784,700,000
日本板硝子	73,500	567.00	41,674,500
石塚硝子	2,300	2,088.00	4,802,400
有沢製作所	19,800	875.00	17,325,000
日本山村硝子	6,600	898.00	5,926,800
日本電気硝子	58,200	2,760.00	160,632,000
オハラ	5,700	1,394.00	7,945,800
住友大阪セメント	26,100	3,395.00	88,609,500
太平洋セメント	82,300	2,434.00	200,318,200
リソルホールディングス	1,900	4,025.00	7,647,500
日本ヒューム	13,900	751.00	10,438,900
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	7,220.00	49,096,000
アジアパイルホールディングス	22,700	465.00	10,555,500
東海カーボン	121,200	1,394.00	168,952,800
日本カーボン	7,500	4,185.00	31,387,500
東洋炭素	9,400	2,850.00	26,790,000
ノリタケカンパニーリミテド	8,000	4,790.00	38,320,000
T O T O	103,500	5,290.00	547,515,000
日本碍子	159,700	1,893.00	302,312,100
日本特殊陶業	110,200	1,737.00	191,417,400
ダントーホールディングス	9,600	261.00	2,505,600
M A R U W A	5,000	10,450.00	52,250,000
品川リフラクトリーズ	3,300	3,870.00	12,771,000
黒崎播磨	2,400	4,540.00	10,896,000
ヨータイ	10,300	1,260.00	12,978,000
イソライト工業	5,900	875.00	5,162,500
東京窯業	19,000	324.00	6,156,000
ニッカトー	6,700	799.00	5,353,300
フジインコーポレーテッド	11,600	6,390.00	74,124,000
クニミネ工業	4,600	1,099.00	5,055,400
エーアンドエーマテリアル	2,600	976.00	2,537,600
ニチアス	36,600	2,557.00	93,586,200
日本製鉄	684,200	1,969.00	1,347,189,800
神戸製鋼所	261,900	669.00	175,211,100
中山製鋼所	19,700	427.00	8,411,900
合同製鐵	7,900	1,534.00	12,118,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	414,500	1,691.00	700,919,500
東京製鐵	55,700	1,078.00	60,044,600
共英製鋼	16,300	1,396.00	22,754,800
大和工業	30,500	3,480.00	106,140,000
東京鐵鋼	5,500	1,554.00	8,547,000

大阪製鐵	8,000	1,124.00	8,992,000
淀川製鋼所	19,000	2,380.00	45,220,000
丸一鋼管	46,800	2,566.00	120,088,800
モリ工業	4,300	2,391.00	10,281,300
大同特殊鋼	23,500	4,690.00	110,215,000
日本高周波鋼業	4,400	401.00	1,764,400
日本冶金工業	11,100	2,598.00	28,837,800
山陽特殊製鋼	17,200	1,762.00	30,306,400
愛知製鋼	8,200	2,691.00	22,066,200
日立金属	135,200	2,155.00	291,356,000
日本金属	3,500	1,002.00	3,507,000
大平洋金属	9,700	2,051.00	19,894,700
新日本電工	91,800	335.00	30,753,000
栗本鐵工所	6,700	1,657.00	11,101,900
虹 技	1,400	1,090.00	1,526,000
日本鑄鉄管	1,500	1,299.00	1,948,500
日本製鋼所	43,400	2,945.00	127,813,000
三菱製鋼	10,400	1,143.00	11,887,200
日亜鋼業	22,000	293.00	6,446,000
日本精線	2,000	4,730.00	9,460,000
エンビプロ・ホールディングス	7,700	2,330.00	17,941,000
大紀アルミニウム工業所	21,400	1,897.00	40,595,800
日本軽金属ホールディングス	39,300	1,968.00	77,342,400
三井金属鉱業	38,600	3,165.00	122,169,000
東邦亜鉛	7,900	2,855.00	22,554,500
三菱マテリアル	94,900	2,224.00	211,057,600
住友金属鉱山	183,200	4,275.00	783,180,000
DOWAホールディングス	36,300	4,375.00	158,812,500
古河機械金属	24,200	1,212.00	29,330,400
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	801.00	12,015,000
東邦チタニウム	25,600	1,224.00	31,334,400
UACJ	21,800	2,836.00	61,824,800
CKサンエツ	2,300	2,948.00	6,780,400
古河電気工業	44,500	2,449.00	108,980,500
住友電気工業	500,400	1,530.00	765,612,000
フジクラ	172,800	656.00	113,356,800
昭和電線ホールディングス	13,800	2,135.00	29,463,000
東京特殊電線	1,700	2,797.00	4,754,900
タツタ電線	25,200	528.00	13,305,600
カナレ電気	2,500	1,709.00	4,272,500
平河ヒューテック	8,100	1,171.00	9,485,100
リョービ	17,700	1,236.00	21,877,200
アーレスティ	17,100	441.00	7,541,100
アサヒホールディングス	53,700	2,157.00	115,830,900
東洋製罐グループホールディングス	91,100	1,382.00	125,900,200
ホッカンホールディングス	7,500	1,458.00	10,935,000
コロナ	9,000	912.00	8,208,000
横河ブリッジホールディングス	24,600	2,341.00	57,588,600
駒井ハルテック	2,800	1,682.00	4,709,600

高田機工	800	2,712.00	2,169,600	
三和ホールディングス	135,100	1,376.00	185,897,600	
文化シャッター	42,000	1,123.00	47,166,000	
三協立山	18,600	762.00	14,173,200	
アルインコ	9,600	989.00	9,494,400	
東洋シャッター	2,600	663.00	1,723,800	
L I X I L	197,400	2,924.00	577,197,600	
日本フィルコン	9,600	546.00	5,241,600	
ノーリツ	27,400	1,829.00	50,114,600	
長府製作所	14,800	2,043.00	30,236,400	
リンナイ	27,900	11,440.00	319,176,000	
ユニプレス	23,800	927.00	22,062,600	
ダイニチ工業	6,800	779.00	5,297,200	
日東精工	17,700	646.00	11,434,200	
三洋工業	1,400	1,876.00	2,626,400	
岡部	30,000	680.00	20,400,000	
ジーテクト	17,700	1,418.00	25,098,600	
東プレ	26,700	1,292.00	34,496,400	
高周波熱錬	27,500	612.00	16,830,000	
東京製綱	10,100	906.00	9,150,600	
サンコール	12,300	446.00	5,485,800	
モリテックスチール	10,900	437.00	4,763,300	
パイオラックス	21,600	1,567.00	33,847,200	
エイチワン	13,800	752.00	10,377,600	
日本発条	143,000	848.00	121,264,000	
中央発條	6,800	1,036.00	7,044,800	
アドバネクス	1,800	1,341.00	2,413,800	
三浦工業	62,100	4,235.00	262,993,500	
タクマ	48,600	1,470.00	71,442,000	
テクノプロ・ホールディングス	82,800	3,620.00	299,736,000	
アトラグループ	2,700	313.00	845,100	
インターワークス	3,900	405.00	1,579,500	
アイ・アールジャパンホールディングス	5,500	11,610.00	63,855,000	
K e e P e r 技研	8,800	3,430.00	30,184,000	
ファーストロジック	2,500	799.00	1,997,500	
三機サービス	2,600	1,101.00	2,862,600	
G u n o s y	8,300	685.00	5,685,500	
デザインワン・ジャパン	3,900	270.00	1,053,000	
イー・ガーディアン	5,400	3,055.00	16,497,000	
リブセンス	7,000	211.00	1,477,000	
ジャパンマテリアル	42,700	1,392.00	59,438,400	
ベクトル	17,000	1,117.00	18,989,000	
ウチヤマホールディングス	6,300	374.00	2,356,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,000	1,742.00	19,162,000	
キャリアリンク	5,100	1,572.00	8,017,200	
I B J	12,300	1,091.00	13,419,300	
アサンテ	4,800	1,737.00	8,337,600	
バリューHR	5,400	1,717.00	9,271,800	
M & A キャピタルパートナーズ	11,400	6,100.00	69,540,000	

ライドオンエクスプレスホールディングス	5,200	1,506.00	7,831,200	
E R Iホールディングス	4,800	1,430.00	6,864,000	
アビスト	2,100	2,866.00	6,018,600	
シグマクシス・ホールディングス	7,500	2,704.00	20,280,000	
ウィルグループ	10,000	1,299.00	12,990,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	20,100	217.00	4,361,700	
メドピア	10,600	3,575.00	37,895,000	
レアジョブ	2,500	1,315.00	3,287,500	
リクルートホールディングス	992,100	7,097.00	7,040,933,700	
エラン	18,800	1,188.00	22,334,400	
ツガミ	29,500	1,508.00	44,486,000	
オークマ	16,700	5,300.00	88,510,000	
芝浦機械	14,800	2,622.00	38,805,600	
アマダ	210,100	1,128.00	236,992,800	
アイダエンジニアリング	37,600	979.00	36,810,400	
滝澤鉄工所	4,400	1,122.00	4,936,800	
F U J I	57,200	2,562.00	146,546,400	
牧野フライス製作所	16,800	3,990.00	67,032,000	
オーエスジー	66,400	1,779.00	118,125,600	
ダイジェット工業	1,100	1,195.00	1,314,500	
旭ダイヤモンド工業	37,600	669.00	25,154,400	
D M G森精機	85,000	1,916.00	162,860,000	
ソディック	31,800	844.00	26,839,200	
ディスコ	19,600	28,930.00	567,028,000	
日東工器	7,000	1,931.00	13,517,000	
日進工具	11,400	1,376.00	15,686,400	
パンチ工業	11,900	617.00	7,342,300	
富士ダイス	7,100	645.00	4,579,500	
土木管理総合試験所	6,200	350.00	2,170,000	
ネットマーケティング	6,100	510.00	3,111,000	
日本郵政	1,048,700	937.70	983,365,990	
ベルシステム24ホールディングス	23,300	1,656.00	38,584,800	
鎌倉新書	13,700	905.00	12,398,500	
S M N	2,900	725.00	2,102,500	
一蔵	1,900	540.00	1,026,000	
グローバルキッズCOMPANY	2,300	840.00	1,932,000	
エアトリ	8,900	4,120.00	36,668,000	
アトラエ	9,600	2,412.00	23,155,200	
ストライク	5,100	4,135.00	21,088,500	
ソラスト	33,900	1,383.00	46,883,700	
セラク	5,500	2,202.00	12,111,000	
インソース	13,300	2,186.00	29,073,800	
豊田自動織機	117,300	9,050.00	1,061,565,000	
豊和工業	7,900	811.00	6,406,900	
O K K	5,400	307.00	1,657,800	
石川製作所	3,700	1,536.00	5,683,200	
東洋機械金属	10,700	522.00	5,585,400	
津田駒工業	2,600	857.00	2,228,200	
エンシュウ	2,600	740.00	1,924,000	

島精機製作所	21,100	2,191.00	46,230,100	
オプトラン	18,000	2,225.00	40,050,000	
NCホールディングス	5,400	1,175.00	6,345,000	
イワキ	9,400	934.00	8,779,600	
フリー	13,800	1,633.00	22,535,400	
ヤマシンフィルタ	28,800	608.00	17,510,400	
日阪製作所	18,100	844.00	15,276,400	
やまびこ	27,800	1,197.00	33,276,600	
野村マイクロ・サイエンス	3,000	4,450.00	13,350,000	
平田機工	6,800	6,650.00	45,220,000	
ペガサスミシン製造	14,600	476.00	6,949,600	
マルマエ	6,000	1,900.00	11,400,000	
タツモ	6,700	1,515.00	10,150,500	
ナプテスコ	81,700	3,865.00	315,770,500	
三井海洋開発	15,300	1,942.00	29,712,600	
レオン自動機	14,100	1,453.00	20,487,300	
S M C	42,400	62,110.00	2,633,464,000	
ホソカワミクロン	10,100	3,130.00	31,613,000	
ユニオンツール	5,300	3,595.00	19,053,500	
オイレス工業	20,500	1,647.00	33,763,500	
日精エー・エス・ビー機械	4,800	3,775.00	18,120,000	
サトーホールディングス	18,800	2,531.00	47,582,800	
技研製作所	12,600	4,480.00	56,448,000	
日本エアータック	6,400	1,233.00	7,891,200	
カワタ	3,800	1,126.00	4,278,800	
日精樹脂工業	11,000	1,089.00	11,979,000	
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	868.00	4,774,000	
小松製作所	656,800	2,699.00	1,772,703,200	
住友重機械工業	83,000	2,919.00	242,277,000	
日立建機	67,800	3,190.00	216,282,000	
日工	21,600	657.00	14,191,200	
巴工業	5,700	2,502.00	14,261,400	
井関農機	13,300	1,577.00	20,974,100	
T O W A	13,400	2,289.00	30,672,600	
丸山製作所	2,600	1,515.00	3,939,000	
北川鉄工所	6,400	1,567.00	10,028,800	
シンニッタン	17,300	237.00	4,100,100	
ローツェ	6,300	9,160.00	57,708,000	
タカキタ	5,100	657.00	3,350,700	
クボタ	707,000	2,322.00	1,641,654,000	
荏原実業	6,600	2,765.00	18,249,000	
東洋エンジニアリング	18,800	884.00	16,619,200	
三菱化工機	4,500	2,409.00	10,840,500	
月島機械	27,000	1,122.00	30,294,000	
帝国電機製作所	10,200	1,404.00	14,320,800	
東京機械製作所	5,600	2,000.00	11,200,000	
新東工業	34,900	748.00	26,105,200	
澁谷工業	12,800	2,964.00	37,939,200	
アイチコーポレーション	25,000	762.00	19,050,000	

小森コーポレーション	37,200	792.00	29,462,400	
鶴見製作所	11,300	1,709.00	19,311,700	
住友精密工業	2,100	2,300.00	4,830,000	
日本ギア工業	6,700	307.00	2,056,900	
酒井重工業	2,500	2,549.00	6,372,500	
荏原製作所	60,200	5,640.00	339,528,000	
石井鐵工所	1,300	2,979.00	3,872,700	
西島製作所	14,600	878.00	12,818,800	
北越工業	15,100	943.00	14,239,300	
ダイキン工業	184,600	24,395.00	4,503,317,000	
オルガノ	4,600	6,380.00	29,348,000	
トーヨーカネツ	5,400	2,692.00	14,536,800	
栗田工業	78,400	5,250.00	411,600,000	
椿本チエイン	20,800	3,335.00	69,368,000	
大同工業	6,900	1,031.00	7,113,900	
日機装	43,500	975.00	42,412,500	
木村化工機	11,700	713.00	8,342,100	
レイズネクスト	25,300	1,210.00	30,613,000	
アネスト岩田	24,600	908.00	22,336,800	
ダイフク	79,700	9,820.00	782,654,000	
サムコ	3,600	2,701.00	9,723,600	
加藤製作所	8,100	849.00	6,876,900	
油研工業	1,900	1,741.00	3,307,900	
タダノ	69,900	1,133.00	79,196,700	
フジテック	49,900	2,532.00	126,346,800	
C K D	33,600	2,111.00	70,929,600	
キトー	12,200	1,542.00	18,812,400	
平和	40,600	2,076.00	84,285,600	
理想科学工業	10,600	2,330.00	24,698,000	
SANKYO	34,500	2,771.00	95,599,500	
日本金銭機械	15,900	738.00	11,734,200	
マースグループホールディングス	9,600	1,620.00	15,552,000	
フクシマガリレイ	10,000	4,680.00	46,800,000	
オーイズミ	6,300	384.00	2,419,200	
ダイコク電機	6,600	1,209.00	7,979,400	
竹内製作所	24,200	2,696.00	65,243,200	
アマノ	38,000	2,625.00	99,750,000	
JUKI	20,100	819.00	16,461,900	
サンデンホールディングス	20,600	290.00	5,974,000	
ジャノメ	13,000	740.00	9,620,000	
ブラザー工業	177,100	2,347.00	415,653,700	
マックス	19,400	1,758.00	34,105,200	
モリタホールディングス	23,600	1,461.00	34,479,600	
グローリー	37,300	2,376.00	88,624,800	
新晃工業	13,400	2,054.00	27,523,600	
大和冷機工業	21,200	1,247.00	26,436,400	
セガサミーホールディングス	131,800	1,564.00	206,135,200	
日本ピストンリング	5,000	1,371.00	6,855,000	
リケン	6,700	2,733.00	18,311,100	
T P R	19,600	1,465.00	28,714,000	

ツバキ・ナカシマ	31,700	1,477.00	46,820,900
ホシザキ	42,400	9,670.00	410,008,000
大豊工業	11,600	825.00	9,570,000
日本精工	297,800	776.00	231,092,800
NTN	335,200	256.00	85,811,200
ジェイテクト	139,100	1,005.00	139,795,500
不二越	12,300	4,175.00	51,352,500
ミネベアミツミ	249,800	2,745.00	685,701,000
日本トムソン	39,300	525.00	20,632,500
THK	84,200	2,352.00	198,038,400
ユーシン精機	10,000	765.00	7,650,000
前澤給装工業	10,300	1,020.00	10,506,000
イーグル工業	17,900	1,212.00	21,694,800
前澤工業	8,100	774.00	6,269,400
日本ピラー工業	14,500	2,437.00	35,336,500
キッツ	48,800	739.00	36,063,200
日立製作所	696,800	6,529.00	4,549,407,200
東芝	286,800	4,905.00	1,406,754,000
三菱電機	1,449,800	1,527.00	2,213,844,600
富士電機	87,300	4,775.00	416,857,500
東洋電機製造	5,800	1,097.00	6,362,600
安川電機	156,000	4,850.00	756,600,000
シンフォニアテクノロジー	18,700	1,143.00	21,374,100
明電舎	24,500	2,385.00	58,432,500
オリジン	4,200	1,297.00	5,447,400
山洋電気	7,000	6,290.00	44,030,000
デンヨー	12,400	2,006.00	24,874,400
ベイカレント・コンサルティング	9,100	46,250.00	420,875,000
Orchestra Holdings	3,300	4,140.00	13,662,000
アイモバイル	5,000	1,435.00	7,175,000
キャリアインデックス	6,900	934.00	6,444,600
MS-Japan	5,400	995.00	5,373,000
船場	1,800	800.00	1,440,000
グレイステクノロジー	13,700	1,071.00	14,672,700
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	39,700	2,403.00	95,399,100
フルテック	2,100	1,434.00	3,011,400
グリーンズ	4,900	549.00	2,690,100
ツナググループ・ホールディングス	2,700	377.00	1,017,900
GAMewith	3,900	512.00	1,996,800
ソウルドアウト	3,300	1,580.00	5,214,000
MS&Consulting	2,100	732.00	1,537,200
ウェルビー	5,000	1,545.00	7,725,000
エル・ティー・エス	1,700	3,300.00	5,610,000
ミダックホールディングス	5,900	5,290.00	31,211,000
日総工産	10,600	724.00	7,674,400
キュービーネットホールディングス	6,200	1,838.00	11,395,600
RPAホールディングス	16,200	572.00	9,266,400
三櫻工業	19,800	1,029.00	20,374,200

マキタ	189,100	5,610.00	1,060,851,000	
東芝テック	15,600	4,675.00	72,930,000	
芝浦メカトロニクス	2,500	6,340.00	15,850,000	
マブチモーター	34,000	3,775.00	128,350,000	
日本電産	348,900	11,825.00	4,125,742,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,900	642.00	5,071,800	
トレックス・セミコンダクター	7,800	2,382.00	18,579,600	
東光高岳	7,200	1,463.00	10,533,600	
ダブル・スコープ	41,500	842.00	34,943,000	
宮越ホールディングス	5,200	1,169.00	6,078,800	
ダイヘン	15,800	4,500.00	71,100,000	
ヤーマン	23,500	1,201.00	28,223,500	
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	941.00	12,138,900	
I - P E X	6,700	1,986.00	13,306,200	
日新電機	34,100	1,298.00	44,261,800	
大崎電気工業	28,700	547.00	15,698,900	
オムロン	120,600	10,140.00	1,222,884,000	
日東工業	21,300	1,677.00	35,720,100	
I D E C	19,300	2,034.00	39,256,200	
正興電機製作所	4,400	1,384.00	6,089,600	
不二電機工業	2,600	1,271.00	3,304,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	52,000	2,518.00	130,936,000	
サクサホールディングス	3,000	1,430.00	4,290,000	
メルコホールディングス	4,900	4,570.00	22,393,000	
テクノメディカ	3,400	1,598.00	5,433,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,300	2,160.00	9,288,000	
日本電気	184,100	6,040.00	1,111,964,000	
富士通	130,400	19,775.00	2,578,660,000	
沖電気工業	58,900	956.00	56,308,400	
岩崎通信機	7,000	895.00	6,265,000	
電気興業	7,000	2,459.00	17,213,000	
サンケン電気	16,900	5,410.00	91,429,000	
ナカヨ	2,100	1,417.00	2,975,700	
アイホン	8,100	2,347.00	19,010,700	
ルネサスエレクトロニクス	784,300	1,285.00	1,007,825,500	
セイコーエプソン	179,800	2,193.00	394,301,400	
ワコム	104,800	710.00	74,408,000	
アルバック	26,600	6,070.00	161,462,000	
アクセル	6,000	703.00	4,218,000	
E I Z O	12,300	4,315.00	53,074,500	
ジャパンディスプレイ	494,200	36.00	17,791,200	
日本信号	34,000	950.00	32,300,000	
京三製作所	31,000	468.00	14,508,000	
能美防災	19,300	2,036.00	39,294,800	
ホーチキ	10,800	1,191.00	12,862,800	
星和電機	6,600	516.00	3,405,600	
エレコム	33,300	1,781.00	59,307,300	
パナソニック	1,545,800	1,380.00	2,133,204,000	

シャープ	192,800	1,371.00	264,328,800
アンリツ	87,100	1,951.00	169,932,100
富士通ゼネラル	44,200	2,810.00	124,202,000
ソニーグループ	908,000	12,330.00	11,195,640,000
T D K	210,000	3,705.00	778,050,000
帝国通信工業	6,200	1,323.00	8,202,600
タムラ製作所	51,800	726.00	37,606,800
アルプスアルパイン	118,500	1,138.00	134,853,000
池上通信機	4,900	789.00	3,866,100
日本電波工業	13,800	885.00	12,213,000
鈴木	6,300	869.00	5,474,700
メイコー	10,800	2,873.00	31,028,400
日本トリム	3,100	3,510.00	10,881,000
ローランド ディー・ジー・	8,500	2,886.00	24,531,000
フォスター電機	14,800	915.00	13,542,000
S M K	3,800	2,169.00	8,242,200
ヨコオ	11,800	2,375.00	28,025,000
ティアック	8,100	122.00	988,200
ホシデン	37,800	949.00	35,872,200
ヒロセ電機	22,400	17,580.00	393,792,000
日本航空電子工業	33,300	1,603.00	53,379,900
T O A	17,300	809.00	13,995,700
マクセル	28,800	1,323.00	38,102,400
古野電気	18,600	1,232.00	22,915,200
ユニデンホールディングス	3,300	3,095.00	10,213,500
スミダコーポレーション	13,500	1,229.00	16,591,500
アイコム	6,100	2,361.00	14,402,100
リオン	6,000	2,423.00	14,538,000
本多通信工業	11,500	453.00	5,209,500
横河電機	145,100	2,072.00	300,647,200
新電元工業	5,500	3,660.00	20,130,000
アズビル	98,000	4,390.00	430,220,000
東亜ディーケーケー	7,300	860.00	6,278,000
日本光電工業	59,900	3,530.00	211,447,000
チノー	4,700	1,419.00	6,669,300
共和電業	14,500	389.00	5,640,500
日本電子材料	5,800	1,755.00	10,179,000
堀場製作所	26,800	7,550.00	202,340,000
アドバンテスト	107,700	8,740.00	941,298,000
小野測器	4,700	519.00	2,439,300
エスベック	12,900	2,254.00	29,076,600
キーエンス	142,300	64,820.00	9,223,886,000
日置電機	7,000	9,080.00	63,560,000
シスメックス	113,100	13,595.00	1,537,594,500
日本マイクロニクス	25,200	1,307.00	32,936,400
メガチップス	14,500	3,390.00	49,155,000
O B A R A G R O U P	7,000	3,600.00	25,200,000
I M A G I C A G R O U P	12,100	523.00	6,328,300
澤藤電機	1,500	2,046.00	3,069,000
デンソー	319,200	7,532.00	2,404,214,400

原田工業	5,500	951.00	5,230,500
コーセル	17,500	900.00	15,750,000
イリソ電子工業	12,200	4,405.00	53,741,000
オブテックスグループ	23,800	1,436.00	34,176,800
千代田インテグレ	6,100	2,131.00	12,999,100
アイ・オー・データ機器	5,300	928.00	4,918,400
レーザーテック	63,600	23,230.00	1,477,428,000
スタンレー電気	101,600	2,741.00	278,485,600
岩崎電気	5,200	2,072.00	10,774,400
ウシオ電機	74,300	2,049.00	152,240,700
岡谷電機産業	9,900	345.00	3,415,500
ヘリオス テクノ ホールディング	14,100	325.00	4,582,500
エノモト	3,800	1,773.00	6,737,400
日本セラミック	13,600	2,904.00	39,494,400
遠藤照明	7,500	1,146.00	8,595,000
古河電池	10,300	1,557.00	16,037,100
双信電機	6,700	759.00	5,085,300
山一電機	9,400	1,606.00	15,096,400
図研	9,400	4,020.00	37,788,000
日本電子	27,400	7,930.00	217,282,000
カシオ計算機	116,600	1,621.00	189,008,600
ファナック	127,200	22,800.00	2,900,160,000
日本シイエムケイ	31,300	421.00	13,177,300
エンプラス	6,600	3,010.00	19,866,000
大真空	4,800	4,055.00	19,464,000
ローム	60,300	9,660.00	582,498,000
浜松ホトニクス	104,000	6,400.00	665,600,000
三井ハイテック	14,200	7,140.00	101,388,000
新光電気工業	48,600	3,555.00	172,773,000
京セラ	221,000	6,673.00	1,474,733,000
協栄産業	1,700	1,373.00	2,334,100
太陽誘電	64,400	6,040.00	388,976,000
村田製作所	425,800	8,577.00	3,652,086,600
双葉電子工業	25,400	753.00	19,126,200
日東電工	87,600	7,770.00	680,652,000
北陸電気工業	5,500	1,015.00	5,582,500
東海理化電機製作所	38,300	1,635.00	62,620,500
ニチコン	45,400	1,024.00	46,489,600
日本ケミコン	14,600	1,989.00	29,039,400
K O A	20,000	1,616.00	32,320,000
三井E & Sホールディングス	55,800	541.00	30,187,800
日立造船	114,500	844.00	96,638,000
三菱重工業	227,800	3,010.00	685,678,000
川崎重工業	113,300	2,583.00	292,653,900
I H I	97,400	2,801.00	272,817,400
名村造船所	42,500	238.00	10,115,000
サノヤスホールディングス	17,200	133.00	2,287,600
スプリックス	3,600	1,138.00	4,096,800
マネジメントソリューションズ	7,100	3,700.00	26,270,000
プロレド・パートナーズ	2,800	1,489.00	4,169,200

and factory	2,500	473.00	1,182,500	
テノ・ホールディングス	4,500	944.00	4,248,000	
フロンティア・マネジメント	3,400	989.00	3,362,600	
ピアラ	2,000	735.00	1,470,000	
コプロ・ホールディングス	1,600	1,209.00	1,934,400	
ギークス	2,100	1,432.00	3,007,200	
カーブスホールディングス	37,900	958.00	36,308,200	
フォーラムエンジニアリング	9,600	945.00	9,072,000	
日本車輛製造	5,400	2,070.00	11,178,000	
三菱ロジスネクスト	19,200	1,085.00	20,832,000	
近畿車輛	1,800	1,089.00	1,960,200	
一家ホールディングス	2,800	572.00	1,601,600	
フルサト・マルカホールディングス	13,647	1,938.00	26,447,886	
ヤマエグループホールディングス	10,400	1,084.00	11,273,600	
F P G	47,800	711.00	33,985,800	
島根銀行	4,700	584.00	2,744,800	
じもとホールディングス	10,000	670.00	6,700,000	
全国保証	37,200	5,320.00	197,904,000	
めぶきフィナンシャルグループ	741,700	246.00	182,458,200	
ジャパンインベストメントアドバイザ	11,000	1,312.00	14,432,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	17,700	1,566.00	27,718,200	
九州フィナンシャルグループ	292,300	400.00	116,920,000	
かんぽ生命保険	177,300	1,987.00	352,295,100	
ゆうちょ銀行	405,800	954.00	387,133,200	
あんしん保証	4,200	317.00	1,331,400	
富山第一銀行	34,500	296.00	10,212,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	870,600	471.00	410,052,600	
ジェイリース	5,600	2,190.00	12,264,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	93,500	709.00	66,291,500	
イントラスト	3,700	789.00	2,919,300	
日本モーゲージサービス	7,200	1,050.00	7,560,000	
C A S A	3,600	952.00	3,427,200	
アルヒ	21,000	1,303.00	27,363,000	
プレミアグループ	7,200	3,335.00	24,012,000	
日産自動車	1,709,600	578.20	988,490,720	
いすゞ自動車	384,700	1,560.00	600,132,000	
トヨタ自動車	7,341,800	2,002.50	14,701,954,500	
日野自動車	180,900	1,110.00	200,799,000	
三菱自動車工業	536,100	332.00	177,985,200	
エフテック	10,000	631.00	6,310,000	
レシップホールディングス	5,800	572.00	3,317,600	
G M B	4,500	889.00	4,000,500	
ファルテック	2,600	713.00	1,853,800	
武蔵精密工業	32,100	1,978.00	63,493,800	
日産車体	21,500	798.00	17,157,000	
新明和工業	41,100	946.00	38,880,600	
極東開発工業	25,000	1,631.00	40,775,000	

トピー工業	12,000	1,218.00	14,616,000
ティラド	4,400	3,075.00	13,530,000
曙ブレーキ工業	79,000	220.00	17,380,000
タチエス	22,200	1,324.00	29,392,800
NOK	70,100	1,306.00	91,550,600
フタバ産業	36,300	479.00	17,387,700
KYB	16,100	3,095.00	49,829,500
市光工業	19,600	575.00	11,270,000
大同メタル工業	30,100	601.00	18,090,100
プレス工業	71,200	335.00	23,852,000
ミクニ	18,500	324.00	5,994,000
太平洋工業	30,200	1,170.00	35,334,000
河西工業	19,900	360.00	7,164,000
アイシン	106,100	4,145.00	439,784,500
マツダ	454,600	996.00	452,781,600
今仙電機製作所	12,800	684.00	8,755,200
本田技研工業	1,141,300	3,440.00	3,926,072,000
スズキ	287,300	5,011.00	1,439,660,300
SUBARU	415,500	2,178.50	905,166,750
安永	7,000	1,191.00	8,337,000
ヤマハ発動機	189,100	3,200.00	605,120,000
小糸製作所	86,900	6,560.00	570,064,000
TBK	17,800	408.00	7,262,400
エクセディ	19,700	1,750.00	34,475,000
ミツバ	26,400	635.00	16,764,000
豊田合成	46,900	2,281.00	106,978,900
愛三工業	22,400	824.00	18,457,600
盟和産業	1,800	1,026.00	1,846,800
日本プラスト	11,900	648.00	7,711,200
ヨロズ	12,500	1,198.00	14,975,000
エフ・シー・シー	23,800	1,647.00	39,198,600
新家工業	3,400	1,687.00	5,735,800
シマノ	58,400	30,270.00	1,767,768,000
テイ・エス テック	67,500	1,492.00	100,710,000
三十三フィナンシャルグループ	12,300	1,414.00	17,392,200
第四北越フィナンシャルグループ	23,300	2,629.00	61,255,700
ひろぎんホールディングス	211,000	649.00	136,939,000
マーキュリアホールディングス	4,800	743.00	3,566,400
おきなわフィナンシャルグループ	13,000	2,500.00	32,500,000
ダイレクトマーケティングミックス	7,400	4,180.00	30,932,000
ポピンズホールディングス	3,200	3,360.00	10,752,000
LITALICO	11,100	3,200.00	35,520,000
十六フィナンシャルグループ	17,800	2,138.00	38,056,400
北國フィナンシャルホールディングス	13,300	2,053.00	27,304,900
ジャムコ	8,400	1,039.00	8,727,600
小野建	12,800	1,608.00	20,582,400
はるやまホールディングス	7,200	580.00	4,176,000
南陽	2,300	1,922.00	4,420,600
ノジマ	25,400	2,866.00	72,796,400
佐鳥電機	9,200	931.00	8,565,200

カッパ・クリエイト	20,100	1,359.00	27,315,900
エコートレーディング	2,900	636.00	1,844,400
伯東	8,500	1,816.00	15,436,000
コンドーテック	11,500	973.00	11,189,500
中山福	8,000	413.00	3,304,000
ライトオン	10,700	695.00	7,436,500
ナガイレーベン	19,000	2,320.00	44,080,000
三菱食品	15,700	2,910.00	45,687,000
良品計画	164,200	2,260.00	371,092,000
三城ホールディングス	16,600	260.00	4,316,000
松田産業	10,300	3,255.00	33,526,500
第一興商	27,100	4,055.00	109,890,500
メディバルホールディングス	143,100	2,070.00	296,217,000
アドヴァングループ	14,900	948.00	14,125,200
S P K	6,100	1,391.00	8,485,100
萩原電気ホールディングス	5,300	2,106.00	11,161,800
アルビス	4,700	2,347.00	11,030,900
アズワン	10,200	15,160.00	154,632,000
スズデン	5,100	1,508.00	7,690,800
尾家産業	3,300	1,100.00	3,630,000
シモジマ	8,800	1,145.00	10,076,000
ドウシシャ	13,600	1,685.00	22,916,000
小津産業	2,600	1,923.00	4,999,800
コナカ	16,300	342.00	5,574,600
高速	7,700	1,537.00	11,834,900
ハウス オブ ローゼ	1,300	1,665.00	2,164,500
G - 7ホールディングス	14,700	2,125.00	31,237,500
たけびし	5,100	1,466.00	7,476,600
イオン北海道	18,800	1,152.00	21,657,600
コジマ	24,300	600.00	14,580,000
ヒマラヤ	4,700	1,018.00	4,784,600
コーナン商事	20,200	3,480.00	70,296,000
ネットワンシステムズ	58,000	3,490.00	202,420,000
エコス	5,200	1,972.00	10,254,400
ワタミ	18,600	1,021.00	18,990,600
マルシェ	3,900	478.00	1,864,200
リックス	2,500	1,500.00	3,750,000
システムソフト	38,600	148.00	5,712,800
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	285,400	2,488.00	710,075,200
丸文	12,700	730.00	9,271,000
西松屋チェーン	31,100	1,439.00	44,752,900
ゼンショーホールディングス	76,700	2,608.00	200,033,600
ハビネット	11,900	1,488.00	17,707,200
幸楽苑ホールディングス	9,100	1,490.00	13,559,000
ハークスレイ	6,000	481.00	2,886,000
橋本総業ホールディングス	2,800	2,138.00	5,986,400
日本ライフライン	46,300	1,295.00	59,958,500
サイゼリヤ	21,100	2,738.00	57,771,800
タカショー	10,700	818.00	8,752,600

VTホールディングス	53,300	518.00	27,609,400
アルゴグラフィックス	11,100	3,155.00	35,020,500
魚力	4,400	2,024.00	8,905,600
IDOM	47,800	877.00	41,920,600
日本エム・ディ・エム	8,300	2,133.00	17,703,900
ポブラ	3,700	217.00	802,900
フジ・コーポレーション	7,600	1,194.00	9,074,400
ユナイテッドアローズ	16,200	2,047.00	33,161,400
進和	8,600	2,276.00	19,573,600
エスケイジャパン	7,600	553.00	4,202,800
ダイترون	5,900	2,125.00	12,537,500
ハイデイ日高	20,600	1,666.00	34,319,600
シークス	20,500	1,184.00	24,272,000
YU-WA CREATION HOLDINGS	9,100	251.00	2,284,100
コロワイド	53,600	1,697.00	90,959,200
ピーシーデポコーポレーション	16,600	446.00	7,403,600
田中商事	3,400	662.00	2,250,800
オーハシテクニカ	7,500	1,514.00	11,355,000
壱番屋	10,200	4,545.00	46,359,000
白銅	5,000	3,105.00	15,525,000
トップカルチャー	5,400	337.00	1,819,800
PLANT	3,700	746.00	2,760,200
スギホールディングス	28,400	7,890.00	224,076,000
ダイコー通産	1,200	1,195.00	1,434,000
薬王堂ホールディングス	6,200	2,396.00	14,855,200
島津製作所	186,500	4,620.00	861,630,000
JMS	12,200	782.00	9,540,400
クボテック	3,400	303.00	1,030,200
長野計器	10,400	1,355.00	14,092,000
ブイ・テクノロジー	6,800	4,500.00	30,600,000
スター精密	22,400	1,506.00	33,734,400
東京計器	9,300	1,016.00	9,448,800
愛知時計電機	1,300	4,675.00	6,077,500
インターアクション	7,200	2,511.00	18,079,200
オーバル	12,600	258.00	3,250,800
東京精密	24,500	4,250.00	104,125,000
マニー	57,700	1,991.00	114,880,700
ニコン	221,400	1,244.00	275,421,600
トプコン	73,000	1,849.00	134,977,000
オリンパス	760,100	2,357.00	1,791,555,700
理研計器	12,800	2,969.00	38,003,200
SCREENホールディングス	25,100	9,030.00	226,653,000
キャノン電子	13,600	1,607.00	21,855,200
タムロン	11,200	2,474.00	27,708,800
HOYA	282,800	16,720.00	4,728,416,000
シード	5,800	678.00	3,932,400
ノーリツ鋼機	13,000	2,280.00	29,640,000
エー・アンド・デイ	12,000	996.00	11,952,000
朝日インテック	158,900	2,818.00	447,780,200

キヤノン	720,200	2,742.50	1,975,148,500	
リコー	368,500	1,170.00	431,145,000	
シチズン時計	183,500	503.00	92,300,500	
リズム	4,300	1,476.00	6,346,800	
大研医器	11,700	589.00	6,891,300	
メニコン	44,500	3,990.00	177,555,000	
シンシア	1,300	585.00	760,500	
中本パックス	3,400	1,743.00	5,926,200	
スノーピーク	9,400	4,625.00	43,475,000	
パラマウントベッドホールディングス	27,900	2,104.00	58,701,600	
トランザクション	7,800	1,105.00	8,619,000	
粧美堂	5,300	415.00	2,199,500	
ニホンフラッシュ	12,400	1,079.00	13,379,600	
前田工織	15,900	3,145.00	50,005,500	
永大産業	20,000	298.00	5,960,000	
アートネイチャー	14,000	727.00	10,178,000	
バンダイナムコホールディングス	119,800	8,107.00	971,218,600	
アイフィスジャパン	3,600	695.00	2,502,000	
共立印刷	24,400	168.00	4,099,200	
SHOEI	13,500	4,695.00	63,382,500	
フランスベッドホールディングス	19,000	910.00	17,290,000	
マーベラス	22,500	699.00	15,727,500	
パイロットコーポレーション	24,500	4,150.00	101,675,000	
萩原工業	9,400	1,562.00	14,682,800	
エイベックス	24,300	1,530.00	37,179,000	
トッパン・フォームズ	26,000	1,016.00	26,416,000	
フジシールインターナショナル	29,800	2,429.00	72,384,200	
タカラトミー	64,900	1,074.00	69,702,600	
広済堂ホールディングス	9,900	1,107.00	10,959,300	
エステールホールディングス	4,200	659.00	2,767,800	
レック	17,300	1,088.00	18,822,400	
タカノ	5,000	743.00	3,715,000	
三光合成	14,800	454.00	6,719,200	
プロネクサス	11,500	1,048.00	12,052,000	
ホクシン	9,600	169.00	1,622,400	
ウッドワン	4,700	1,147.00	5,390,900	
大建工業	9,700	2,217.00	21,504,900	
きもと	21,100	240.00	5,064,000	
凸版印刷	220,400	1,827.00	402,670,800	
大日本印刷	171,300	2,743.00	469,875,900	
共同印刷	4,400	2,616.00	11,510,400	
N I S S H A	29,600	1,707.00	50,527,200	
光村印刷	800	1,573.00	1,258,400	
藤森工業	13,000	4,620.00	60,060,000	
ヴィア・ホールディングス	18,600	189.00	3,515,400	
TAKARA & COMPANY	7,100	1,761.00	12,503,100	
前澤化成工業	9,100	1,257.00	11,438,700	
未来工業	5,400	1,603.00	8,656,200	
アシックス	128,100	2,518.00	322,555,800	
ツツミ	3,600	2,205.00	7,938,000	

ウェーブロックホールディングス	4,900	673.00	3,297,700	
J S P	8,800	1,604.00	14,115,200	
ニチハ	20,200	3,050.00	61,610,000	
ローランド	10,100	5,310.00	53,631,000	
エフピコ	26,700	3,855.00	102,928,500	
小松ウオール工業	4,500	1,890.00	8,505,000	
ヤマハ	86,300	6,970.00	601,511,000	
河合楽器製作所	4,000	3,430.00	13,720,000	
クリナップ	13,500	548.00	7,398,000	
ビジョン	87,600	2,640.00	231,264,000	
天馬	10,900	2,723.00	29,680,700	
兼松サステック	700	1,784.00	1,248,800	
キングジム	11,900	866.00	10,305,400	
象印マホービン	39,200	1,546.00	60,603,200	
リンテック	31,300	2,450.00	76,685,000	
信越ポリマー	22,700	987.00	22,404,900	
東リ	38,600	238.00	9,186,800	
イトーキ	26,700	377.00	10,065,900	
任天堂	82,900	51,450.00	4,265,205,000	
三菱鉛筆	24,000	1,365.00	32,760,000	
松風	6,700	1,996.00	13,373,200	
タカラスタンダード	30,000	1,536.00	46,080,000	
コクヨ	69,500	1,800.00	125,100,000	
ナカバヤシ	14,800	578.00	8,554,400	
ニフコ	53,200	3,570.00	189,924,000	
立川ブラインド工業	6,400	1,267.00	8,108,800	
グローブライト	14,000	3,980.00	55,720,000	
オカムラ	49,700	1,514.00	75,245,800	
バルカー	11,800	2,115.00	24,957,000	
M U T O Hホールディングス	1,300	1,623.00	2,109,900	
伊藤忠商事	998,600	3,288.00	3,283,396,800	
丸紅	1,407,600	956.10	1,345,806,360	
スクロール	21,200	884.00	18,740,800	
高島	1,800	1,900.00	3,420,000	
ヨンドシーホールディングス	13,100	1,732.00	22,689,200	
三陽商会	7,300	921.00	6,723,300	
長瀬産業	78,600	1,897.00	149,104,200	
ナイガイ	4,300	330.00	1,419,000	
蝶理	9,200	1,822.00	16,762,400	
豊田通商	143,400	4,895.00	701,943,000	
オンワードホールディングス	84,800	323.00	27,390,400	
三共生興	21,900	554.00	12,132,600	
兼松	57,000	1,365.00	77,805,000	
美津濃	14,300	2,575.00	36,822,500	
ツカモトコーポレーション	1,900	1,366.00	2,595,400	
ルックホールディングス	4,400	1,366.00	6,010,400	
三井物産	1,108,200	2,597.00	2,877,995,400	
日本紙パルプ商事	7,600	3,770.00	28,652,000	
東京エレクトロン	84,900	46,530.00	3,950,397,000	
カメイ	18,600	1,200.00	22,320,000	

東都水産	1,500	5,400.00	8,100,000
OUGホールディングス	2,300	2,751.00	6,327,300
スターゼン	10,600	2,134.00	22,620,400
セイコーホールディングス	20,500	2,281.00	46,760,500
山善	55,800	1,053.00	58,757,400
椿本興業	2,200	3,820.00	8,404,000
住友商事	901,300	1,625.00	1,464,612,500
日本ユニシス	49,200	2,983.00	146,763,600
内田洋行	6,000	4,975.00	29,850,000
三菱商事	869,200	3,703.00	3,218,647,600
第一実業	6,400	5,050.00	32,320,000
キャノンマーケティングジャパン	35,500	2,492.00	88,466,000
西華産業	7,600	1,632.00	12,403,200
佐藤商事	11,900	1,220.00	14,518,000
菱洋エレクトロ	10,900	2,309.00	25,168,100
東京産業	12,200	690.00	8,418,000
ユアサ商事	14,600	2,999.00	43,785,400
神鋼商事	3,100	3,445.00	10,679,500
トルク	6,300	227.00	1,430,100
阪和興業	28,500	3,290.00	93,765,000
正栄食品工業	9,300	4,070.00	37,851,000
カナデン	12,000	1,004.00	12,048,000
菱電商事	10,400	1,704.00	17,721,600
ニプロ	108,100	1,139.00	123,125,900
岩谷産業	34,200	6,730.00	230,166,000
ナイス	5,600	1,640.00	9,184,000
ニチモウ	2,100	1,995.00	4,189,500
極東貿易	4,500	2,500.00	11,250,000
アステナホールディングス	19,700	607.00	11,957,900
兼松エレクトロニクス	7,900	3,720.00	29,388,000
三愛石油	35,100	1,438.00	50,473,800
稲畑産業	34,300	1,696.00	58,172,800
G S Iクレオス	6,800	1,003.00	6,820,400
明和産業	12,900	778.00	10,036,200
クワザワホールディングス	4,800	659.00	3,163,200
キムラタン	76,100	23.00	1,750,300
ゴールドウイン	23,500	6,750.00	158,625,000
ユニ・チャーム	279,500	4,636.00	1,295,762,000
デサント	24,200	3,875.00	93,775,000
キング	7,700	542.00	4,173,400
ワキタ	28,100	1,016.00	28,549,600
ヤマトインターナショナル	12,800	322.00	4,121,600
東邦ホールディングス	45,900	1,795.00	82,390,500
サンゲツ	38,100	1,557.00	59,321,700
ミツウロコグループホールディングス	21,000	1,366.00	28,686,000
シナネンホールディングス	5,200	3,545.00	18,434,000
伊藤忠エネクス	31,600	1,045.00	33,022,000
サンリオ	40,100	2,486.00	99,688,600
サンワテクノス	9,300	1,483.00	13,791,900
リョーサン	15,800	2,186.00	34,538,800

新光商事	19,600	843.00	16,522,800
トーホー	6,600	1,577.00	10,408,200
三信電気	7,700	1,620.00	12,474,000
東陽テクニカ	13,800	1,107.00	15,276,600
モスフードサービス	20,200	3,185.00	64,337,000
加賀電子	12,900	2,863.00	36,932,700
三益半導体工業	11,300	2,270.00	25,651,000
都築電気	6,300	1,686.00	10,621,800
ソーダニッカ	13,500	625.00	8,437,500
立花エレテック	11,100	1,486.00	16,494,600
木曽路	18,600	2,153.00	40,045,800
S R S ホールディングス	19,300	762.00	14,706,600
千趣会	25,700	389.00	9,997,300
タカキュー	11,100	130.00	1,443,000
リテールパートナーズ	17,300	1,171.00	20,258,300
ケーヨー	26,300	807.00	21,224,100
上新電機	16,400	2,412.00	39,556,800
日本瓦斯	69,200	1,456.00	100,755,200
ロイヤルホールディングス	24,500	2,100.00	51,450,000
東天紅	700	1,128.00	789,600
いなげや	16,000	1,343.00	21,488,000
チヨダ	14,200	770.00	10,934,000
ライフコーポレーション	13,300	3,920.00	52,136,000
リンガーハット	17,600	2,316.00	40,761,600
MrMaxHD	19,600	638.00	12,504,800
テンアライド	14,100	313.00	4,413,300
AOKIホールディングス	27,400	701.00	19,207,400
オークワ	22,400	1,123.00	25,155,200
コメリ	22,100	2,641.00	58,366,100
青山商事	31,500	788.00	24,822,000
しまむら	16,600	9,400.00	156,040,000
はせがわ	5,800	261.00	1,513,800
高島屋	103,700	1,198.00	124,232,600
松屋	31,000	997.00	30,907,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	67,400	901.00	60,727,400
近鉄百貨店	5,500	2,545.00	13,997,500
丸井グループ	120,600	2,150.00	259,290,000
クレディセゾン	83,300	1,505.00	125,366,500
アクシアル リテイリング	11,900	3,620.00	43,078,000
井筒屋	7,100	302.00	2,144,200
イオン	549,400	2,625.50	1,442,449,700
イズミ	29,000	3,460.00	100,340,000
フォーバル	5,100	1,108.00	5,650,800
平和堂	26,400	1,999.00	52,773,600
フジ	17,200	2,023.00	34,795,600
ヤオコー	16,200	6,480.00	104,976,000
ゼビオホールディングス	17,000	1,064.00	18,088,000
ケーズホールディングス	121,300	1,192.00	144,589,600
PALTAC	22,900	5,070.00	116,103,000
三谷産業	18,700	374.00	6,993,800

Olympicグループ	7,500	751.00	5,632,500
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	1,897.00	220,810,800
あおぞら銀行	85,100	2,759.00	234,790,900
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,779,300	661.00	6,464,117,300
りそなホールディングス	1,591,300	455.90	725,473,670
三井住友トラスト・ホールディングス	270,300	3,904.00	1,055,251,200
三井住友フィナンシャルグループ	989,400	3,940.00	3,898,236,000
千葉銀行	477,100	751.00	358,302,100
群馬銀行	294,000	372.00	109,368,000
武蔵野銀行	21,300	1,828.00	38,936,400
千葉興業銀行	35,800	279.00	9,988,200
筑波銀行	58,600	177.00	10,372,200
七十七銀行	44,900	1,272.00	57,112,800
青森銀行	11,200	2,136.00	23,923,200
秋田銀行	8,700	1,460.00	12,702,000
山形銀行	16,100	836.00	13,459,600
岩手銀行	9,600	1,686.00	16,185,600
東邦銀行	128,800	212.00	27,305,600
東北銀行	6,800	1,008.00	6,854,400
みちのく銀行	9,300	882.00	8,202,600
ふくおかフィナンシャルグループ	129,000	2,144.00	276,576,000
静岡銀行	348,200	945.00	329,049,000
スルガ銀行	124,800	435.00	54,288,000
八十二銀行	322,200	404.00	130,168,800
山梨中央銀行	16,800	855.00	14,364,000
大垣共立銀行	28,400	1,963.00	55,749,200
福井銀行	12,400	1,456.00	18,054,400
清水銀行	6,000	1,599.00	9,594,000
富山銀行	2,100	2,129.00	4,470,900
滋賀銀行	28,800	1,967.00	56,649,600
南都銀行	20,900	2,032.00	42,468,800
百五銀行	129,700	333.00	43,190,100
京都銀行	51,200	5,160.00	264,192,000
紀陽銀行	50,700	1,545.00	78,331,500
ほくほくフィナンシャルグループ	95,300	858.00	81,767,400
山陰合同銀行	90,200	567.00	51,143,400
中国銀行	123,400	852.00	105,136,800
鳥取銀行	4,400	1,110.00	4,884,000
伊予銀行	190,000	582.00	110,580,000
百十四銀行	15,300	1,538.00	23,531,400
四国銀行	20,500	747.00	15,313,500
阿波銀行	22,100	2,136.00	47,205,600
大分銀行	8,300	1,895.00	15,728,500
宮崎銀行	9,000	2,110.00	18,990,000
佐賀銀行	8,100	1,485.00	12,028,500
琉球銀行	31,000	773.00	23,963,000
セブン銀行	477,200	248.00	118,345,600
みずほフィナンシャルグループ	1,942,900	1,587.00	3,083,382,300
高知銀行	4,600	797.00	3,666,200

山口フィナンシャルグループ	178,900	668.00	119,505,200	
芙蓉総合リース	15,000	7,710.00	115,650,000	
みずほリース	22,100	3,585.00	79,228,500	
東京センチュリー	33,300	6,250.00	208,125,000	
SBIホールディングス	176,200	2,950.00	519,790,000	
日本証券金融	60,100	846.00	50,844,600	
アイフル	238,900	382.00	91,259,800	
日本アジア投資	11,300	239.00	2,700,700	
長野銀行	4,600	1,127.00	5,184,200	
名古屋銀行	11,500	2,595.00	29,842,500	
北洋銀行	215,500	247.00	53,228,500	
愛知銀行	4,700	3,640.00	17,108,000	
中京銀行	5,400	1,390.00	7,506,000	
大光銀行	3,900	1,371.00	5,346,900	
愛媛銀行	20,400	791.00	16,136,400	
トマト銀行	5,700	1,060.00	6,042,000	
京葉銀行	61,500	443.00	27,244,500	
栃木銀行	68,300	181.00	12,362,300	
北日本銀行	4,400	1,576.00	6,934,400	
東和銀行	25,200	531.00	13,381,200	
福島銀行	15,600	253.00	3,946,800	
大東銀行	6,600	695.00	4,587,000	
リコーリース	11,300	3,735.00	42,205,500	
イオンフィナンシャルサービス	87,400	1,531.00	133,809,400	
アコム	282,300	410.00	115,743,000	
ジャックス	15,600	3,045.00	47,502,000	
オリエン트コーポレーション	385,500	165.00	63,607,500	
オリックス	867,900	2,153.00	1,868,588,700	
三菱HCキャピタル	494,900	590.00	291,991,000	
ジャフコグループ	18,100	6,980.00	126,338,000	
九州リースサービス	7,300	612.00	4,467,600	
トモニホールディングス	110,600	328.00	36,276,800	
大和証券グループ本社	1,071,000	670.80	718,426,800	
野村ホールディングス	2,182,700	555.30	1,212,053,310	
岡三証券グループ	122,300	392.00	47,941,600	
丸三証券	42,200	621.00	26,206,200	
東洋証券	45,400	169.00	7,672,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	152,200	407.00	61,945,400	
光世証券	3,300	594.00	1,960,200	
水戸証券	37,700	299.00	11,272,300	
いちよし証券	28,200	666.00	18,781,200	
松井証券	70,400	824.00	58,009,600	
SOMPOホールディングス	252,000	5,013.00	1,263,276,000	
日本取引所グループ	386,200	2,776.50	1,072,284,300	
マネックスグループ	127,600	648.00	82,684,800	
極東証券	19,100	802.00	15,318,200	
岩井コスモホールディングス	14,400	1,397.00	20,116,800	
アイザワ証券グループ	25,500	1,017.00	25,933,500	
フィデアホールディングス	13,500	1,225.00	16,537,500	

池田泉州ホールディングス	162,700	168.00	27,333,600	
アニコムホールディングス	40,000	903.00	36,120,000	
MS&ADインシュアランスグループ ホールディングス	347,300	3,771.00	1,309,668,300	
マネーパートナーズグループ	14,300	218.00	3,117,400	
スパークス・グループ	65,500	272.00	17,816,000	
小林洋行	3,300	266.00	877,800	
第一生命ホールディングス	703,500	2,493.00	1,753,825,500	
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	1,034.00	7,031,200	
イー・ギャランティ	16,700	2,379.00	39,729,300	
アサックス	7,900	702.00	5,545,800	
NECキャピタルソリューション	5,800	2,074.00	12,029,200	
T&Dホールディングス	427,000	1,564.00	667,828,000	
アドバンスクリエイト	6,700	1,057.00	7,081,900	
三井不動産	651,500	2,568.50	1,673,377,750	
三菱地所	939,500	1,706.50	1,603,256,750	
平和不動産	24,500	3,560.00	87,220,000	
東京建物	141,000	1,657.00	233,637,000	
ダイビル	36,200	1,521.00	55,060,200	
京阪神ビルディング	24,600	1,395.00	34,317,000	
住友不動産	321,500	4,043.00	1,299,824,500	
太平洋興発	5,700	691.00	3,938,700	
テーオーシー	26,300	645.00	16,963,500	
東京楽天地	2,200	4,010.00	8,822,000	
レオパレス21	118,100	250.00	29,525,000	
スターツコーポレーション	17,000	2,660.00	45,220,000	
フジ住宅	16,700	693.00	11,573,100	
空港施設	14,500	568.00	8,236,000	
明和地所	6,700	613.00	4,107,100	
ゴールドクレスト	12,900	1,651.00	21,297,900	
リログループ	75,700	2,306.00	174,564,200	
エスリード	5,500	1,640.00	9,020,000	
日神グループホールディングス	21,200	516.00	10,939,200	
日本エスコン	26,600	807.00	21,466,200	
タカラレーベン	59,700	319.00	19,044,300	
A V A N T I A	7,400	871.00	6,445,400	
イオンモール	71,800	1,667.00	119,690,600	
毎日コムネット	3,900	788.00	3,073,200	
ファースト住建	5,500	1,316.00	7,238,000	
ランド	764,100	12.00	9,169,200	
カチタス	35,400	3,995.00	141,423,000	
東祥	8,600	1,857.00	15,970,200	
トーセイ	19,700	1,175.00	23,147,500	
穴吹興産	3,100	2,019.00	6,258,900	
サンフロンティア不動産	17,200	1,073.00	18,455,600	
FJネクストホールディングス	14,000	1,018.00	14,252,000	
インテリックス	2,900	734.00	2,128,600	
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	1,000.00	4,700,000	

グランディハウス	9,100	486.00	4,422,600
東武鉄道	151,100	2,820.00	426,102,000
相鉄ホールディングス	49,800	2,138.00	106,472,400
東急	365,600	1,585.00	579,476,000
京浜急行電鉄	186,100	1,280.00	238,208,000
小田急電鉄	232,200	2,403.00	557,976,600
京王電鉄	81,000	5,580.00	451,980,000
京成電鉄	108,600	3,530.00	383,358,000
富士急行	19,800	4,445.00	88,011,000
新京成電鉄	3,800	2,065.00	7,847,000
東日本旅客鉄道	255,100	7,354.00	1,876,005,400
西日本旅客鉄道	161,700	5,487.00	887,247,900
東海旅客鉄道	120,500	17,115.00	2,062,357,500
西武ホールディングス	174,400	1,292.00	225,324,800
鴻池運輸	23,300	1,225.00	28,542,500
西日本鉄道	40,300	2,708.00	109,132,400
ハマキョウレックス	11,300	3,235.00	36,555,500
サカイ引越センター	6,800	4,710.00	32,028,000
近鉄グループホールディングス	137,400	3,605.00	495,327,000
阪急阪神ホールディングス	183,200	3,400.00	622,880,000
南海電気鉄道	65,100	2,276.00	148,167,600
京阪ホールディングス	61,200	2,948.00	180,417,600
神戸電鉄	3,500	3,400.00	11,900,000
名古屋鉄道	112,900	1,920.00	216,768,000
山陽電気鉄道	10,000	1,955.00	19,550,000
アルプス物流	9,700	1,017.00	9,864,900
トランコム	4,200	8,520.00	35,784,000
日本通運	47,600	7,500.00	357,000,000
ヤマトホールディングス	192,400	2,778.00	534,487,200
山九	35,300	5,080.00	179,324,000
日新	11,100	1,609.00	17,859,900
丸運	8,500	268.00	2,278,000
丸全昭和運輸	11,200	3,385.00	37,912,000
センコーグループホールディングス	75,900	1,000.00	75,900,000
トナミホールディングス	2,900	4,690.00	13,601,000
ニッコンホールディングス	46,400	2,204.00	102,265,600
日本石油輸送	1,000	2,691.00	2,691,000
福山通運	17,600	4,675.00	82,280,000
セイノーホールディングス	103,000	1,337.00	137,711,000
エスライン	3,300	917.00	3,026,100
神奈川中央交通	3,700	3,415.00	12,635,500
日立物流	28,300	4,730.00	133,859,000
丸和運輸機関	29,000	1,537.00	44,573,000
C & F ロジホールディングス	13,900	1,607.00	22,337,300
日本郵船	114,700	7,670.00	879,749,000
商船三井	81,300	6,960.00	565,848,000
川崎汽船	42,200	5,250.00	221,550,000
NSユナイテッド海運	6,300	3,870.00	24,381,000
明治海運	14,300	795.00	11,368,500
飯野海運	63,100	548.00	34,578,800

共栄タンカー	2,500	1,019.00	2,547,500	
九州旅客鉄道	105,900	2,620.00	277,458,000	
S Gホールディングス	259,400	2,908.00	754,335,200	
日本航空	334,200	2,548.00	851,541,600	
A N Aホールディングス	370,300	2,764.00	1,023,509,200	
パスコ	2,500	1,521.00	3,802,500	
T R Eホールディングス	19,792	1,537.00	30,420,304	
人・夢・技術グループ	6,200	2,002.00	12,412,400	
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,200	3,595.00	11,504,000	
シルバーライフ	2,800	1,515.00	4,242,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	2,054.00	2,464,800	
Genky Drug Stores	6,200	5,170.00	32,054,000	
コア商事ホールディングス	10,600	719.00	7,621,400	
国際紙パルプ商事	29,700	367.00	10,899,900	
ナルミヤ・インターナショナル	2,600	1,037.00	2,696,200	
ブックオフグループホールディングス	8,400	971.00	8,156,400	
ギフト	3,500	2,917.00	10,209,500	
三菱倉庫	47,600	3,170.00	150,892,000	
三井倉庫ホールディングス	14,500	2,320.00	33,640,000	
住友倉庫	48,600	1,818.00	88,354,800	
澁澤倉庫	7,700	2,129.00	16,393,300	
ヤマタネ	6,300	1,578.00	9,941,400	
東陽倉庫	23,600	328.00	7,740,800	
乾汽船	9,300	2,309.00	21,473,700	
日本トランスシティ	30,300	590.00	17,877,000	
ケイヒン	1,900	1,433.00	2,722,700	
中央倉庫	8,900	981.00	8,730,900	
川西倉庫	2,600	1,155.00	3,003,000	
安田倉庫	12,000	971.00	11,652,000	
ファイズホールディングス	2,200	710.00	1,562,000	
東洋埠頭	3,300	1,454.00	4,798,200	
宇徳	10,100	525.00	5,302,500	
上組	75,600	2,271.00	171,687,600	
サンリツ	2,600	809.00	2,103,400	
キムラユニティー	3,900	1,441.00	5,619,900	
キューソー流通システム	3,600	1,833.00	6,598,800	
近鉄エクスプレス	25,900	2,705.00	70,059,500	
東海運	8,800	335.00	2,948,000	
エーアイティー	8,600	1,154.00	9,924,400	
内外トランスライン	5,100	2,083.00	10,623,300	
ショーエイコーポレーション	2,900	806.00	2,337,400	
日本コンセプト	4,300	1,800.00	7,740,000	
T B Sホールディングス	94,300	1,727.00	162,856,100	
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	721.00	10,526,600	
テレビ朝日ホールディングス	43,800	1,780.00	77,964,000	
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	2,195.00	22,608,500	
日本B S放送	4,800	1,112.00	5,337,600	

ビジョン	24,000	1,419.00	34,056,000
スマートバリュー	3,400	652.00	2,216,800
USEN-NEXT HOLDINGS	13,400	3,425.00	45,895,000
ワイヤレスゲート	5,400	396.00	2,138,400
コネクシオ	8,200	1,574.00	12,906,800
日本通信	124,600	202.00	25,169,200
クロップス	2,600	983.00	2,555,800
日本電信電話	1,663,700	3,098.00	5,154,142,600
KDDI	1,140,700	3,671.00	4,187,509,700
ソフトバンク	1,292,500	1,517.00	1,960,722,500
光通信	16,700	17,750.00	296,425,000
エムティーアイ	13,300	744.00	9,895,200
GMOインターネット	50,200	2,846.00	142,869,200
ファイバーゲート	4,400	1,415.00	6,226,000
アйдママーケティングコミュニケーション	3,200	376.00	1,203,200
KADOKAWA	36,800	6,050.00	222,640,000
学研ホールディングス	19,900	1,120.00	22,288,000
ゼンリン	25,800	1,009.00	26,032,200
昭文社ホールディングス	4,800	498.00	2,390,400
インプレスホールディングス	16,700	267.00	4,458,900
東京電力ホールディングス	1,228,500	360.00	442,260,000
中部電力	443,700	1,301.00	577,253,700
関西電力	549,200	1,084.00	595,332,800
中国電力	209,200	994.00	207,944,800
北陸電力	132,500	594.00	78,705,000
東北電力	339,500	788.00	267,526,000
四国電力	120,600	759.00	91,535,400
九州電力	320,100	841.00	269,204,100
北海道電力	135,200	522.00	70,574,400
沖縄電力	28,400	1,436.00	40,782,400
電源開発	115,200	1,608.00	185,241,600
エフオン	10,800	850.00	9,180,000
イーレックス	21,200	2,493.00	52,851,600
レノバ	24,700	4,340.00	107,198,000
東京瓦斯	277,900	1,935.50	537,875,450
大阪瓦斯	262,600	1,956.00	513,645,600
東邦瓦斯	71,200	3,970.00	282,664,000
北海道瓦斯	8,000	1,513.00	12,104,000
広島ガス	30,900	373.00	11,525,700
西部ガスホールディングス	16,400	2,320.00	38,048,000
静岡ガス	37,400	1,278.00	47,797,200
メタウォーター	16,400	1,828.00	29,979,200
アイネット	7,000	1,261.00	8,827,000
松竹	9,400	12,130.00	114,022,000
東宝	83,900	5,120.00	429,568,000
エイチ・アイ・エス	30,600	2,654.00	81,212,400
東映	4,600	21,590.00	99,314,000
ラックランド	3,900	2,837.00	11,064,300

エヌ・ティ・ティ・データ	378,300	2,142.00	810,318,600
共立メンテナンス	22,900	4,230.00	96,867,000
イチネンホールディングス	14,500	1,298.00	18,821,000
建設技術研究所	8,200	2,565.00	21,033,000
スペース	10,200	926.00	9,445,200
アインホールディングス	20,800	6,310.00	131,248,000
燦ホールディングス	5,900	1,457.00	8,596,300
ピー・シー・エー	7,600	1,828.00	13,892,800
スバル興業	800	8,100.00	6,480,000
東京テアトル	5,600	1,243.00	6,960,800
タナベ経営	5,000	739.00	3,695,000
ビジネスブレイン太田昭和	6,600	1,801.00	11,886,600
ナガワ	4,400	12,510.00	55,044,000
東京都競馬	10,300	4,380.00	45,114,000
常磐興産	5,700	1,431.00	8,156,700
カナモト	24,500	2,552.00	62,524,000
D T S	29,200	2,488.00	72,649,600
スクウェア・エニックス・ホールディングス	60,700	5,990.00	363,593,000
シーイーシー	14,800	1,296.00	19,180,800
カブコン	121,800	2,997.00	365,034,600
西尾レントオール	12,800	2,794.00	35,763,200
アイ・エス・ビー	9,800	1,232.00	12,073,600
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	5,590.00	277,823,000
トランス・コスモス	13,100	3,550.00	46,505,000
乃村工藝社	59,300	1,038.00	61,553,400
ジャステック	8,100	1,257.00	10,181,700
S C S K	98,300	2,283.00	224,418,900
藤田観光	5,900	2,492.00	14,702,800
K N T - C Tホールディングス	7,300	1,728.00	12,614,400
日本管財	14,700	2,700.00	39,690,000
トーカイ	13,400	2,174.00	29,131,600
白洋舎	1,100	2,008.00	2,208,800
セコム	136,600	8,098.00	1,106,186,800
日本システムウエア	4,400	2,380.00	10,472,000
セントラル警備保障	6,700	2,845.00	19,061,500
アイネス	13,500	1,561.00	21,073,500
丹青社	25,900	925.00	23,957,500
メイテック	16,700	6,240.00	104,208,000
T K C	23,900	3,305.00	78,989,500
富士ソフト	15,100	5,650.00	85,315,000
応用地質	15,500	1,559.00	24,164,500
船井総研ホールディングス	28,300	2,950.00	83,485,000
N S D	45,300	1,926.00	87,247,800
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	817.00	7,924,900
コナミホールディングス	51,600	6,270.00	323,532,000

いであ	3,600	1,992.00	7,171,200
学究社	3,900	1,391.00	5,424,900
ベネッセホールディングス	50,800	2,494.00	126,695,200
イオンディライト	17,000	3,470.00	58,990,000
ナック	7,200	970.00	6,984,000
福井コンピュータホールディングス	7,100	4,050.00	28,755,000
ダイセキ	27,700	5,120.00	141,824,000
ステップ	5,000	1,878.00	9,390,000
日鉄物産	10,300	5,090.00	52,427,000
泉州電業	3,900	4,495.00	17,530,500
元気寿司	3,900	2,758.00	10,756,200
トラスコ中山	29,700	2,730.00	81,081,000
ヤマダホールディングス	478,400	461.00	220,542,400
オートバックスセブン	51,500	1,520.00	78,280,000
モリト	10,400	669.00	6,957,600
アークランドサカモト	22,300	1,686.00	37,597,800
ニトリホールディングス	56,600	20,345.00	1,151,527,000
グルメ杵屋	10,700	979.00	10,475,300
愛眼	8,500	220.00	1,870,000
ケーユーホールディングス	7,500	1,074.00	8,055,000
吉野家ホールディングス	46,900	2,119.00	99,381,100
加藤産業	20,800	3,315.00	68,952,000
北恵	3,600	1,039.00	3,740,400
イノテック	8,000	1,316.00	10,528,000
イエローハット	26,800	1,914.00	51,295,200
松屋フーズホールディングス	7,000	3,660.00	25,620,000
JBCホールディングス	9,300	1,560.00	14,508,000
JKホールディングス	13,100	806.00	10,558,600
サガミホールディングス	21,900	1,002.00	21,943,800
日伝	11,900	2,236.00	26,608,400
関西スーパーマーケット	10,600	1,915.00	20,299,000
ミロク情報サービス	13,900	1,692.00	23,518,800
北沢産業	8,100	250.00	2,025,000
杉本商事	7,200	2,430.00	17,496,000
因幡電機産業	38,200	2,666.00	101,841,200
王将フードサービス	9,500	5,990.00	56,905,000
プレナス	16,000	2,093.00	33,488,000
ミニストップ	10,800	1,388.00	14,990,400
アークス	27,300	2,211.00	60,360,300
バローホールディングス	29,200	2,401.00	70,109,200
東テク	4,400	2,581.00	11,356,400
ミスミグループ本社	179,100	4,535.00	812,218,500
藤久	3,300	771.00	2,544,300
アルテック	9,800	315.00	3,087,000
ベルク	7,100	5,580.00	39,618,000
大庄	7,800	1,013.00	7,901,400
タキヒヨー	4,700	1,796.00	8,441,200
ファーストリテイリング	19,000	71,110.00	1,351,090,000
ソフトバンクグループ	1,128,500	6,261.00	7,065,538,500
蔵王産業	2,100	1,740.00	3,654,000

スズケン	60,500	3,220.00	194,810,000	
サンドラッグ	53,700	3,445.00	184,996,500	
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	875.00	9,187,500	
ヤマザワ	2,900	1,711.00	4,961,900	
やまや	3,000	2,411.00	7,233,000	
グローセル	16,000	407.00	6,512,000	
ベルーナ	30,500	833.00	25,406,500	
合計	159,150,973		393,970,303,892	

(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。

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12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,446,334,619
国債証券	450,227,111,300
地方債証券	27,490,261,772
特殊債証券	28,690,180,664
社債証券	20,890,974,030
未収利息	503,224,742
前払費用	99,697,268
流動資産合計	529,347,784,395
資産合計	
529,347,784,395	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	422,230,000
流動負債合計	422,230,000
負債合計	
422,230,000	
純資産の部	
元本等	
元本	405,313,486,765
剰余金	
剰余金又は欠損金()	123,612,067,630
元本等合計	528,925,554,395
純資産合計	
528,925,554,395	
負債純資産合計	
529,347,784,395	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	175,050,543,528円
同期中追加設定元本額	440,243,776,542円
同期中一部解約元本額	209,980,833,305円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,256,396,765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)	34,908,005円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	662,864,983円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	141,629,800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	15,088,745,287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)	761,665,734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)	1,110,570,713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)	1,098,941,107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)	290,034,094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)	20,373,101円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	15,470,543円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	10,800,079円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	69,185,703円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,383,504円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	678,061円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,370,296,372円
Oneグローバルバランス	1,400,145円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,701,257,421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	1,121,151,787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)	4,290,470円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	11,988,498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>	2,009,071,880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>	201,890,939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)	17,817,109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)	34,135,086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)	3,826,358,880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)	4,601,170,236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)	191,279,019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)	2,364,486,025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)	575,107,381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)	46,606,329,080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	405,313,486,765円
2. 受益権の総数	405,313,486,765口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 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12日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
	国債証券
地方債証券	100,074,300
特殊債券	92,699,486
社債券	91,850,590
合計	1,776,696,526

(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12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3050円 (13,050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12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	400,924,000	
	419回 利付国庫債券(2年)	1,400,000,000	1,403,570,000	
	420回 利付国庫債券(2年)	3,200,000,000	3,208,768,000	
	421回 利付国庫債券(2年)	1,040,000,000	1,043,047,200	
	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	3,005,700,000	
	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	2,004,240,000	
	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	3,049,576,000	
	136回 利付国庫債券(5年)	3,250,000,000	3,262,057,500	
	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	3,770,100,000	
	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	3,230,319,300	

142回 利付国庫債券(5年)	4,830,000,000	4,862,409,300	
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	4,130,299,000	
145回 利付国庫債券(5年)	4,350,000,000	4,383,495,000	
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	157,873,100	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	876,733,200	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	754,439,400	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	1,010,700,000	
5回 利付国庫債券(40年)	1,040,000,000	1,407,432,000	
6回 利付国庫債券(40年)	1,060,000,000	1,413,202,600	
7回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,295,799,700	
8回 利付国庫債券(40年)	1,210,000,000	1,453,246,300	
9回 利付国庫債券(40年)	1,930,000,000	1,738,003,600	
10回 利付国庫債券(40年)	1,720,000,000	1,809,956,000	
11回 利付国庫債券(40年)	1,280,000,000	1,305,779,200	
12回 利付国庫債券(40年)	1,500,000,000	1,380,300,000	
13回 利付国庫債券(40年)	1,730,000,000	1,586,756,000	
14回 利付国庫債券(40年)	600,000,000	587,292,000	
326回 利付国庫債券(10年)	1,120,000,000	1,130,841,600	
327回 利付国庫債券(10年)	1,970,000,000	1,991,394,200	
328回 利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,566,690,000	
329回 利付国庫債券(10年)	3,850,000,000	3,909,444,000	
330回 利付国庫債券(10年)	3,460,000,000	3,521,449,600	
331回 利付国庫債券(10年)	1,450,000,000	1,470,126,000	
332回 利付国庫債券(10年)	6,480,000,000	6,581,541,600	
333回 利付国庫債券(10年)	4,230,000,000	4,303,771,200	
334回 利付国庫債券(10年)	4,640,000,000	4,729,320,000	

335回 利付国庫債券(10年)	4,100,000,000	4,174,292,000	
336回 利付国庫債券(10年)	1,900,000,000	1,937,050,000	
337回 利付国庫債券(10年)	2,810,000,000	2,846,811,000	
338回 利付国庫債券(10年)	4,730,000,000	4,812,254,700	
339回 利付国庫債券(10年)	4,410,000,000	4,491,540,900	
340回 利付国庫債券(10年)	4,610,000,000	4,701,093,600	
341回 利付国庫債券(10年)	6,020,000,000	6,119,932,000	
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	4,380,709,200	
353回 利付国庫債券(10年)	4,510,000,000	4,552,213,600	
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	4,447,264,500	
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	4,381,102,500	
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	134,338,600	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	119,954,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	251,772,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	246,260,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	236,706,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	294,497,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	282,428,500	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	182,881,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	432,313,400	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	334,807,200	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	310,197,600	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	346,534,200	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	509,548,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	357,845,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	432,032,700	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	398,430,600	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	381,692,200	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	462,203,000	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	357,474,600	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	428,349,900	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	815,653,400	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	829,349,200	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	1,035,288,100	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,147,386,200	

30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,163,852,800	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	943,214,400	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,291,933,300	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,513,680,400	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,586,604,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,882,626,200	
36回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	2,419,162,900	
37回 利付国庫債券(30年)	2,160,000,000	2,761,905,600	
38回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,830,842,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,439,424,000	
40回 利付国庫債券(30年)	1,040,000,000	1,317,690,400	
41回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,473,076,600	
42回 利付国庫債券(30年)	1,070,000,000	1,337,072,000	
43回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,713,664,500	
44回 利付国庫債券(30年)	1,080,000,000	1,352,235,600	
45回 利付国庫債券(30年)	1,170,000,000	1,416,027,600	
46回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,901,301,400	
47回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,555,155,000	
48回 利付国庫債券(30年)	1,640,000,000	1,951,370,400	
49回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,737,896,400	
50回 利付国庫債券(30年)	1,260,000,000	1,327,838,400	
51回 利付国庫債券(30年)	1,450,000,000	1,360,854,000	
52回 利付国庫債券(30年)	1,310,000,000	1,287,166,700	
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	1,289,544,300	
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	1,568,430,000	
59回 利付国庫債券(30年)	1,120,000,000	1,143,128,000	
60回 利付国庫債券(30年)	1,030,000,000	1,100,369,600	
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	1,102,426,800	
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	1,520,224,500	
68回 利付国庫債券(30年)	1,580,000,000	1,549,427,000	
69回 利付国庫債券(30年)	1,370,000,000	1,376,671,900	
70回 利付国庫債券(30年)	1,520,000,000	1,525,578,400	
71回 利付国庫債券(30年)	1,300,000,000	1,303,198,000	
59回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,215,600	
64回 利付国庫債券(20年)	30,000,000	31,173,300	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	62,643,000	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,451,500	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,386,500	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,493,600	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	489,950,600	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	405,570,200	

74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,819,600	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	193,640,400	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	74,822,300	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,893,200	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	268,442,500	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	53,873,500	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	97,304,400	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	433,112,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	152,143,600	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	76,441,400	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	184,929,400	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	647,359,800	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,734,400	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	132,200,400	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	656,032,800	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	11,072,100	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	523,110,000	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	122,975,600	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,291,358,400	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	411,654,600	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	749,080,100	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	624,041,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	134,785,200	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	748,644,600	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	180,537,600	

99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	850,057,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	950,208,900	
101回 利付国庫債券(20年)	130,000,000	150,506,200	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	581,770,000	
103回 利付国債(20年)	160,000,000	185,094,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	125,778,400	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	735,014,400	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	577,705,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	692,034,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	785,903,100	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	400,022,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	509,436,400	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	538,181,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	860,079,800	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,365,003,900	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	960,179,000	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	424,486,800	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	627,530,600	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,257,892,000	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	649,705,200	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	542,060,400	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	761,113,300	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	920,847,700	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	659,336,100	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,246,255,500	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	706,662,000	

125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	720,096,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	602,519,100	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	632,896,200	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,610,393,900	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	886,053,600	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,063,780,900	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	915,712,700	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	964,393,600	
133回 利付国庫債券(20年)	1,130,000,000	1,324,371,300	
134回 利付国庫債券(20年)	1,100,000,000	1,292,412,000	
135回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	745,344,000	
136回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	761,824,800	
137回 利付国庫債券(20年)	800,000,000	933,840,000	
138回 利付国庫債券(20年)	1,140,000,000	1,306,645,200	
139回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,064,200,800	
140回 利付国庫債券(20年)	2,090,000,000	2,446,470,400	
141回 利付国庫債券(20年)	1,450,000,000	1,700,995,000	
142回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,065,717,000	
143回 利付国庫債券(20年)	1,380,000,000	1,606,720,200	
144回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,049,257,300	
145回 利付国庫債券(20年)	2,350,000,000	2,768,276,500	
146回 利付国庫債券(20年)	2,580,000,000	3,045,380,400	
147回 利付国庫債券(20年)	2,180,000,000	2,552,169,600	
148回 利付国庫債券(20年)	2,490,000,000	2,891,437,800	
149回 利付国庫債券(20年)	2,500,000,000	2,907,450,000	

150回 利付国庫債券(20年)	2,610,000,000	3,006,850,500	
151回 利付国庫債券(20年)	2,440,000,000	2,751,710,000	
152回 利付国庫債券(20年)	2,150,000,000	2,426,468,500	
153回 利付国庫債券(20年)	2,220,000,000	2,538,503,400	
154回 利付国庫債券(20年)	2,590,000,000	2,929,238,200	
155回 利付国庫債券(20年)	2,160,000,000	2,385,201,600	
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	2,489,123,000	
160回 利付国庫債券(20年)	1,710,000,000	1,812,223,800	
161回 利付国庫債券(20年)	1,790,000,000	1,869,028,500	
162回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,794,372,800	
163回 利付国庫債券(20年)	1,720,000,000	1,792,721,600	
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	1,648,060,400	
166回 利付国庫債券(20年)	1,830,000,000	1,930,851,300	
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	1,583,871,000	
169回 利付国庫債券(20年)	1,650,000,000	1,622,742,000	
170回 利付国庫債券(20年)	1,990,000,000	1,953,423,800	
171回 利付国庫債券(20年)	1,840,000,000	1,802,684,800	
172回 利付国庫債券(20年)	1,460,000,000	1,453,751,200	
173回 利付国庫債券(20年)	1,920,000,000	1,908,384,000	
174回 利付国庫債券(20年)	2,250,000,000	2,232,315,000	

	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	450,227,111,300	
地方債証券	719回 東京都公募公債	200,000,000	202,454,000	
	720回 東京都公募公債	300,000,000	304,380,000	
	726回 東京都公募公債	400,000,000	406,348,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	100,197,000	
	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	400,500,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	245,350,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	129,942,000	
	1回 東京都公募公債 20年	100,000,000	102,591,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	107,228,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	108,482,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	222,812,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	334,410,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	115,770,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	116,833,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	100,292,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	402,996,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	99,815,000	
	29回1号 宮城県公募公債 10年	100,000,000	101,375,000	
	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	302,808,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	304,404,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,816,000	
	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	133,335,000	
	11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	115,260,000	
	16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	353,781,000	
	19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	116,625,000	
	368回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	101,067,000	
	374回 大阪府公募公債	300,000,000	304,986,000	

413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,954,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,778,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	198,386,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	200,074,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	232,224,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	111,800,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	102,410,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	355,250,000	
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	201,188,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	203,070,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	100,282,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	132,859,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	215,866,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	308,880,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	324,402,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	107,069,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	103,671,000	
令和2年度10回 静岡県公募公債	100,000,000	100,088,000	
令和2年度14回 静岡県公募公債	200,000,000	199,720,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	107,739,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	108,378,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	212,216,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	108,562,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	346,275,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	130,827,000	
25年度4回 愛知県公募公債	300,000,000	304,164,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	181,770,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,922,000	
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	101,135,000	

27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	101,715,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	99,460,000	
25年度 8回 埼玉県公募公債	100,000,000	101,537,000	
26年度 5回 埼玉県公募公債	400,000,000	406,772,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	213,984,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	117,356,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	115,536,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	346,959,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,257,000	
25年度 11回 福岡県公募公債	200,000,000	203,274,000	
28年度 8回 福岡県公募公債	100,000,000	101,125,000	
30年度 6回 福岡県公募公債	200,000,000	201,714,000	
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	107,719,000	
20回 2号 福岡県公募公債	100,000,000	114,079,000	
21年度 2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	117,522,000	
24年度 2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	345,894,000	
24年度 7回 千葉県公募公債	300,000,000	302,640,000	
25年度 5回 千葉県公募公債	200,000,000	203,122,000	
25年度 6回 千葉県公募公債	100,000,000	101,553,000	
27年度 9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,400,000	
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	110,945,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	100,839,000	
25年度 2回 新潟県公募公債	100,000,000	101,583,000	
令和3年度 1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	200,844,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	115,573,000	
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	505,445,000	
121回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,330,000	
127回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,375,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,161,000	

132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,604,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,585,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,416,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	611,874,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	510,365,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,949,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,406,800	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,610,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,955,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,593,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,001,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,390,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,928,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,834,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	100,749,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	101,628,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	107,498,840	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	200,000,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	101,591,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	101,083,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	201,244,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	230,526,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	457,843,500	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	115,440,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	111,819,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	112,360,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	236,632,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	232,794,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	101,662,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	303,393,000	
25年度2回 横浜市公募公債	400,000,000	406,196,000	

2回	横浜市公募公債 30年	100,000,000	128,699,000	
17回	横浜市公募公債 20年	100,000,000	114,262,000	
29回	横浜市公募公債 20年	100,000,000	115,492,000	
23年度7回	札幌市公募公債 30年	100,000,000	129,426,000	
25年度4回	札幌市公募公債	200,000,000	202,684,000	
26年度4回	札幌市公募公債 10年	100,000,000	101,438,000	
29年度5回	札幌市公募公債 20年	300,000,000	308,850,000	
第91回	川崎市公募公債	200,000,000	201,310,000	
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	113,895,000	
17回	北九州市公募公債 20年	100,000,000	115,444,000	
22年度8回	福岡市公募公債	100,000,000	131,947,000	
30年度7回	福岡市公募公債	200,000,000	208,760,000	
2019年度5回	福岡市公募公債 20年	100,000,000	96,904,000	
26年度3回	広島市公募公債	100,000,000	101,430,000	
29年度2回	広島市公募公債	200,000,000	206,592,000	
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	104,824,000	
26年度1回	相模原市公募公債	100,000,000	101,540,000	
26年度1回	三重県公募公債	100,000,000	101,444,000	
地方債証券 合計		26,145,330,000	27,490,261,772	
特殊債券	9回	新関西国際空港社債	200,000,000	215,680,000
	12回	新関西国際空港社債	200,000,000	214,220,000
	78回	日本政策投資銀行債券	300,000,000	302,547,000
	127回	日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,078,000
	131回	日本政策投資銀行債券	100,000,000	98,367,000
	19回	政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,971,000
	19回	高速道路機構債	150,000,000	220,197,000
	26回	高速道路機構債	200,000,000	269,014,000
	75回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	117,205,000
	101回	日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	201,834,000
	116回	高速道路機構債	100,000,000	101,380,000
	124回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,113,000
	139回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,410,000

155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,703,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	120,134,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	127,148,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	111,265,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	197,302,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	103,571,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,383,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	123,504,000	
121回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	575,475,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,468,000	
177回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,930,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,346,000	
189回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	504,285,000	
193回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,690,000	
195回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	437,168,100	
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,483,650	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,547,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,711,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,434,000	
239回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	333,834,000	
241回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,620,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,178,000	
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,667,000	
260回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	234,190,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,609,000	
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	207,606,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,080,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	191,570,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	194,672,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	651,045,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	228,280,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	349,557,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	350,502,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	118,116,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	322,098,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	232,804,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,334,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	231,622,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	213,332,000	
44回 政保地方公共団体金融機構債券	400,000,000	404,324,000	
44回 地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,010,000	
50回 政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	508,115,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	551,067,660	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	115,512,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,677,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,346,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	225,540,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	348,588,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	401,268,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,309,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	103,936,000	

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	101,084,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	231,332,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,045,320	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	108,658,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	107,554,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	213,264,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	197,156,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	111,301,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,507,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	231,930,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,571,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	412,531,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,734,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	116,795,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,335,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	317,897,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,273,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,973,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,316,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,460,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	303,411,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,202,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	499,750,000	
6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,852,000	31,118,869	
8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	21,606,000	21,950,399	
9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,709,000	33,232,998	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	34,833,000	35,662,373	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,132,000	53,878,943	

4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,625,000	11,919,693	
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	34,408,650	
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,325,000	56,252,247	
4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,423,000	11,670,079	
2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,323,000	20,487,017	
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	117,190,000	125,216,343	
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	181,184,000	191,332,115	
3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,305,000	26,669,192	
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,156,000	23,318,968	
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	27,188,000	28,559,906	
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,225,000	30,731,548	
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,405,000	39,331,357	
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,936,000	86,788,377	
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,075,000	37,763,670	
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,614,000	44,284,468	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,006,000	44,730,540	
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	50,691,296	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,606,000	55,684,468	
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	65,426,152	
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	80,089,647	
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	248,477,701	
128回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	246,276,000	248,667,339	
130回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	166,570,000	168,209,048	
131回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	250,221,000	252,290,327	
132回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	250,212,000	252,368,827	
137回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	432,950,000	438,747,200	
139回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	86,005,000	87,093,823	
142回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	88,624,000	88,904,938	
154回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	281,064,000	281,429,383	
156回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	374,720,000	376,559,875	
160回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	287,562,000	289,419,650	
168回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	294,990,000	297,733,407	
170回貸付債権担保住宅金融 支援機構債券	892,404,000	897,579,943	
21回 沖縄振興開発金融公庫 債券	100,000,000	102,214,000	
い第828号 利付商工債	100,000,000	100,261,000	
い第843号 利付商工債	100,000,000	100,231,000	
い第851号 利付商工債	300,000,000	300,135,000	
い第854号 利付商工債	300,000,000	300,000,000	
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	400,384,000	
7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債券	100,000,000	101,410,000	
15回 国際協力機構債	100,000,000	115,880,000	
18回 国際協力機構債券	100,000,000	101,447,000	
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	300,300,000	
55回 鉄道建設運輸施設債	500,000,000	505,970,000	
71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,577,000	
78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	105,587,000	
90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	200,188,000	

特殊債券 合計		27,175,523,000	28,690,180,664	
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	301,719,000	
	26回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2018)	100,000,000	100,349,000	
	2回 BPCE SA円貨社債(ソーシャルボンド)	100,000,000	100,111,000	
	6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,342,000	
	11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	99,786,000	
	25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,970,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	400,248,000	
	344回 東京交通債券	100,000,000	102,173,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	101,595,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	97,424,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	100,303,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,736,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	200,046,000	
	56回 中日本高速道路社債	100,000,000	101,594,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	200,046,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	203,082,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	102,030,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	302,856,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	202,606,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	199,992,000	
	10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,651,000	
	9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	102,106,000	
	12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,399,000	
	14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,402,000	
	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	199,812,000	
	49回 住友化学社債	100,000,000	102,088,000	
	19回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	100,436,000	
	23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	207,888,000	
	40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,996,000	
	6回 JXホールディングス社債	100,000,000	101,829,000	
	14回 プリヂストン社債	300,000,000	302,343,000	
	17回 パナソニック社債	100,000,000	101,393,000	

19回	パナソニック社債	100,000,000	100,582,000	
23回	パナソニック社債	200,000,000	200,822,000	
29回	三菱重工業社債	100,000,000	101,518,000	
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	100,685,000	
14回	トヨタ自動車社債	200,000,000	202,692,000	
16回	トヨタ自動車社債	200,000,000	203,040,000	
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	103,601,000	
47回	住友商事社債	100,000,000	101,521,000	
48回	クレディセゾン社債	100,000,000	101,888,000	
13回	新生銀行社債	200,000,000	199,820,000	
88回	三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	111,746,000	
12回	りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,817,000	
10回	三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,862,000	
10回	セブン銀行社債	100,000,000	101,025,000	
17回	NTTファイナンス社債	300,000,000	301,293,000	
18回	NTTファイナンス社債	400,000,000	403,348,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,416,000	
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	202,312,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	301,365,000	
29回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,382,000	
31回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	200,790,000	
56回	三菱UFJリース社債	300,000,000	303,900,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	106,380,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,911,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	201,540,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	107,039,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	100,641,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	321,375,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	215,636,000	
65回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	115,568,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,703,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	233,514,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	113,978,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,347,000	
127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	102,636,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,376,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,373,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	200,208,000	

171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	197,962,000	
10回 西日本旅客鉄道社債	300,000,000	311,598,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	115,003,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,817,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,570,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,953,000	
11回 東海旅客鉄道社債	300,000,000	303,939,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	208,478,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	105,122,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	112,467,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	132,664,800	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	95,575,000	
30回 光通信社債	200,000,000	203,490,000	
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	103,542,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	103,162,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	303,849,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	199,456,000	
377回 中国電力社債	400,000,000	407,844,000	
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	101,579,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	104,224,000	
311回 北陸電力社債	100,000,000	103,774,000	
471回 東北電力社債	400,000,000	409,568,000	
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	203,184,000	
424回 九州電力社債	200,000,000	204,874,000	
426回 九州電力社債	400,000,000	409,248,000	
428回 九州電力社債	100,000,000	102,334,000	
466回 九州電力社債	100,000,000	101,674,000	
492回 九州電力社債	100,000,000	99,482,000	
493回 九州電力社債	200,000,000	199,450,000	
321回 北海道電力社債	261,000,000	267,376,230	
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	203,090,000	
13回 電源開発社債	200,000,000	213,962,000	
38回 電源開発社債	300,000,000	305,904,000	
54回 電源開発社債	100,000,000	100,845,000	
23回 東京瓦斯社債	300,000,000	304,668,000	
41回 東京瓦斯社債	200,000,000	202,968,000	
52回 東京瓦斯社債	100,000,000	98,900,000	
55回 東京瓦斯社債	100,000,000	95,202,000	
18回 大阪ガス社債	100,000,000	101,669,000	
30回 大阪瓦斯社債	100,000,000	100,813,000	
27回 NTTデータ社債	200,000,000	202,746,000	
5回 ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,078,000	
7回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	202,104,000	

	8回 ファーストリテイリング社債	200,000,000	206,946,000	
社債券 合計		20,481,000,000	20,890,974,030	
合計			527,298,527,766	

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。

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12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,823,298,429
コール・ローン	862,442,708
株式	582,208,622,266
投資信託受益証券	1,045,640,296
投資証券	12,292,688,774
派生商品評価勘定	19,075,218
未収入金	26,244,751
未収配当金	448,000,571
差入委託証拠金	4,244,384,186
流動資産合計	604,970,397,199
資産合計	604,970,397,199
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	144,313,331
未払解約金	92,775,000
流動負債合計	237,088,331
負債合計	237,088,331
純資産の部	
元本等	
元本	108,379,642,938
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	496,353,665,930
元本等合計	604,733,308,868
純資産合計	604,733,308,868
負債純資産合計	604,970,397,199

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	95,596,418,253円
同期中追加設定元本額	69,030,127,565円
同期中一部解約元本額	56,246,902,880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)	18,625,079円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,659,441円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,856,924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	25,802,031,699円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	352,390,887円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,655,664,795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)	395,537,066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)	286,450,628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)	444,364,452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)	763,072円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	11,985,466円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,017,595円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	8,730,973円
たわらノーロード 全世界株式	143,215,740円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	49,019,488,274円
One DC 先進国株式インデックスファンド	1,451,938,340円
Oneグローバルバランス	483,009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	261,396,177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)	180,009,585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)	299,843,655円
投資のソムリエ	4,785,343,163円
クルーズコントロール	132,055,751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>	184,454,612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)	1,012,527円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	2,823,156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)	742,920,541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>	161,051,821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)	1,194,023,047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)	1,426,809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)	3,483,288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)	227,907,847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)	1,097,039,884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)	15,170,684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)	140,842,115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)	68,529,217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	108,379,642,938円
2. 受益権の総数	108,379,642,938口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	34,446,797,805	
投資信託受益証券	66,142,518	
投資証券	1,125,785,840	
合計	35,638,726,163	

(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12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	711,988,912	-	717,817,536	5,828,624	
イギリス・ポンド	536,563,920	-	541,162,358	4,598,438	
オーストラリア・ドル	31,433,436	-	31,610,688	177,252	
カナダ・ドル	19,350,550	-	19,577,686	227,136	
ユーロ	20,314,774	-	20,438,717	123,943	
ユーロ	104,326,232	-	105,028,087	701,855	
合計	711,988,912	-	717,817,536	5,828,624	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2021年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	9,271,602,532	-	9,140,535,795	131,066,737
合計	9,271,602,532	-	9,140,535,795	131,066,737

(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12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	5.5798円 (55,798円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	43,740	3,246.300	141,993,162.000	
	ABBOTT LABORATORIES	171,442	116.880	20,038,140.960	
	AES CORP	65,452	24.000	1,570,848.000	
	ABIOMED INC	4,985	332.150	1,655,767.750	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	86,594	142.430	12,333,583.420	
	ADVANCED MICRO DEVICES	116,586	104.680	12,204,222.480	
	ADOBE INC	46,067	573.070	26,399,615.690	
	CHUBB LTD	43,301	182.760	7,913,690.760	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21,196	268.730	5,696,001.080	
	ALLEGHANY CORP	1,454	644.000	936,376.000	
	ALLSTATE CORP	28,568	127.960	3,655,561.280	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,117	215.290	14,449,618.930	
	AMGEN INC	55,430	206.700	11,457,381.000	
	HESS CORP	27,192	89.850	2,443,201.200	
	AMERICAN EXPRESS CO	65,715	173.460	11,398,923.900	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	47,413	82.510	3,912,046.630	

AFLAC INC	66,003	54.480	3,595,843.440	
AMERICAN INTL GROUP	81,476	57.890	4,716,645.640	
AMERCO	929	690.920	641,864.680	
ANALOG DEVICES	51,668	167.900	8,675,057.200	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	67,905	68.790	4,671,184.950	
VALERO ENERGY CORP	38,208	77.800	2,972,582.400	
ANSYS INC	8,119	344.110	2,793,829.090	
APPLE INC	1,608,716	142.810	229,740,731.960	
APPLIED MATERIALS INC	88,147	127.500	11,238,742.500	
ALBEMARLE CORP	11,129	214.160	2,383,386.640	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	51,945	63.970	3,322,921.650	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	11,236	67.510	758,542.360	
AMEREN CORP	25,054	81.270	2,036,138.580	
ARROW ELECTRONICS INC	8,279	117.130	969,719.270	
AUTOLIV INC	7,570	92.560	700,679.200	
AUTODESK INC	20,970	276.540	5,799,043.800	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,013	203.750	8,356,398.750	
AUTOZONE INC	2,017	1,674.080	3,376,619.360	
AVERY DENNISON CORP	7,898	206.010	1,627,066.980	
BALL CORP	30,793	90.940	2,800,315.420	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	128,224	280.930	36,021,968.320	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	78,981	55.520	4,385,025.120	
BAXTER INTERNATIONAL INC	47,667	78.920	3,761,879.640	
BECTON DICKINSON & CO	27,892	235.830	6,577,770.360	
AMETEK INC	21,194	124.460	2,637,805.240	
VERIZON COMM INC	403,112	52.180	21,034,384.160	
WR BERKLEY CORP	16,304	76.560	1,248,234.240	
BEST BUY CO INC	21,362	108.880	2,325,894.560	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	1,975	718.500	1,419,037.500	
YUM! BRANDS INC	30,538	122.000	3,725,636.000	
FIRSTENERGY CORP	53,250	35.770	1,904,752.500	
BOEING CO	53,362	226.450	12,083,824.900	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	108.030	1,214,041.140	
BORGWARNER INC	21,938	46.920	1,029,330.960	
BOSTON BEER COMPANY INC- CL A	860	536.360	461,269.600	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	135,649	42.140	5,716,248.860	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	15,040	91.260	1,372,550.400	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	10,805	170.720	1,844,629.600	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,180	1,361.430	2,967,917.400	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	215,715	57.420	12,386,355.300	
ONEOK INC	43,019	61.900	2,662,876.100	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	135.120	1,005,833.280	
UNITED RENTALS INC	7,145	342.910	2,450,091.950	
SEMPRA ENERGY	30,010	123.130	3,695,131.300	
FEDEX CORP	24,133	219.820	5,304,916.060	
VERISIGN INC	10,001	204.830	2,048,504.830	
AMPHENOL CORP	61,252	75.070	4,598,187.640	
BROWN-FORMAN CORP	33,368	68.220	2,276,364.960	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	5.960	578,930.560	
CSX CORP	218,399	32.500	7,097,967.500	
COTERRA ENERGY INC	71,747	21.520	1,543,995.440	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	41.870	851,384.580	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,101	219.700	3,537,389.700	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	48.720	1,413,123.600	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	73,922	23.880	1,765,257.360	
CATERPILLAR INC	52,543	192.890	10,135,019.270	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,347	118.910	1,468,181.770	
CITRIX SYSTEMS INC	11,589	94.680	1,097,246.520	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	12.180	1,122,849.840	
CERNER CORP	29,663	70.590	2,093,911.170	
JPMORGAN CHASE & CO	292,453	166.640	48,734,367.920	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,345	83.000	2,020,635.000	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,567	118.760	1,729,976.920	
CINTAS CORP	8,902	402.370	3,581,897.740	
CISCO SYSTEMS INC	408,114	54.930	22,417,702.020	
CLOROX COMPANY	13,010	162.190	2,110,091.900	
COCA-COLA CO/THE	396,146	54.230	21,482,997.580	
COPART INC	19,653	138.760	2,727,050.280	
COGNEX CORP	16,685	79.450	1,325,623.250	
COLGATE-PALMOLIVE CO	77,391	75.800	5,866,237.800	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	25,389	156.820	3,981,502.980	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,363	279.130	1,776,104.190	
NRG ENERGY, INC.	27,425	40.880	1,121,134.000	
COMCAST CORP-CL A	440,010	52.220	22,977,322.200	
CONAGRA BRANDS INC	48,557	33.550	1,629,087.350	
CONSOLIDATED EDISON INC	31,468	73.920	2,326,114.560	
CMS ENERGY CORP	28,837	59.350	1,711,475.950	
COOPER COS INC	5,116	404.000	2,066,864.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	22,156	45.850	1,015,852.600	
CORNING INC	83,765	36.920	3,092,603.800	
SEALED AIR CORP	13,870	57.150	792,670.500	

HEICO CORP-CL A	7,477	119.240	891,557.480	
CUMMINS INC	13,461	232.440	3,128,874.840	
DR HORTON INC	31,517	83.290	2,625,050.930	
DANAHER CORP	61,893	298.740	18,489,914.820	
MOODY'S CORP	16,101	360.050	5,797,165.050	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	50,383	75.390	3,798,374.370	
TARGET CORP	47,531	228.720	10,871,290.320	
DEERE & CO	28,548	332.590	9,494,779.320	
MORGAN STANLEY	134,588	97.290	13,094,066.520	
REPUBLIC SERVICES INC	23,343	126.140	2,944,486.020	
COSTAR GROUP INC	37,089	86.530	3,209,311.170	
THE WALT DISNEY CO	174,439	173.520	30,268,655.280	
DOLLAR TREE INC	21,953	98.450	2,161,272.850	
DOVER CORP	12,789	156.670	2,003,652.630	
OMNICOM GROUP	21,323	75.270	1,604,982.210	
DTE ENERGY CO	18,647	112.150	2,091,261.050	
DUKE ENERGY CORP	74,513	99.710	7,429,691.230	
DARDEN RESTAURANTS INC	12,936	153.000	1,979,208.000	
EBAY INC	64,670	74.500	4,817,915.000	
BANK OF AMERICA CORP	744,285	43.780	32,584,797.300	
CITIGROUP INC	199,423	71.680	14,294,640.640	
EASTMAN CHEMICAL CO	11,862	104.660	1,241,476.920	
EATON CORP PLC	38,152	152.560	5,820,469.120	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,235	149.520	3,922,657.200	
DISH NETWORK CORP	21,420	43.240	926,200.800	
ECOLAB INC	24,739	212.170	5,248,873.630	
PERKINELMER INC	11,099	168.520	1,870,403.480	
ELECTRONIC ARTS INC	27,348	139.470	3,814,225.560	
SALESFORCE.COM INC	93,566	273.750	25,613,692.500	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	192.400	431,553.200	
EMERSON ELECTRIC CO	57,052	94.180	5,373,157.360	
ATMOS ENERGY CORP	10,719	89.110	955,170.090	
ENTERGY CORP	19,079	102.680	1,959,031.720	
EOG RESOURCES INC	54,857	90.160	4,945,907.120	
EQUIFAX INC	11,380	257.610	2,931,601.800	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	22,262	309.960	6,900,329.520	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	14,810	115.420	1,709,370.200	
EXXON MOBIL CORP	408,773	61.560	25,164,065.880	
FMC CORP	14,467	88.250	1,276,712.750	
NEXTERA ENERGY INC	189,952	77.830	14,783,964.160	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,844	405.150	1,557,396.600	
FAIR ISAAC CORP	2,810	394.540	1,108,657.400	
ASSURANT INC	5,523	161.250	890,583.750	
FASTENAL CO	58,642	52.230	3,062,871.660	
FIFTH THIRD BANCORP	65,494	43.490	2,848,334.060	
M&T BANK CORP	11,387	151.480	1,724,902.760	
FISERV INC	57,108	103.770	5,926,097.160	

FORD MOTOR CO	373,690	15.090	5,638,982.100	
FRANKLIN RESOURCES INC	26,714	29.940	799,817.160	
FREEPORT-MCMORAN INC	137,810	35.230	4,855,046.300	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20,793	156.920	3,262,837.560	
DENTSPLY SIRONA INC	24,507	57.170	1,401,065.190	
GENERAL DYNAMICS CORP	22,967	202.880	4,659,544.960	
GENERAL MILLS INC	56,563	61.690	3,489,371.470	
GENUINE PARTS CO	14,520	126.180	1,832,133.600	
GILEAD SCIENCES INC	120,589	68.080	8,209,699.120	
GARTNER INC	7,941	301.480	2,394,052.680	
MCKESSON CORP	16,362	201.780	3,301,524.360	
NVIDIA CORP	239,952	206.950	49,658,066.400	
GENERAL ELECTRIC CO	105,142	104.080	10,943,179.360	
VW GRAINGER INC	3,895	413.880	1,612,062.600	
HALLIBURTON CO	84,523	24.680	2,086,027.640	
MONSTER BEVERAGE CORP	37,156	88.050	3,271,585.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	32,683	385.240	12,590,798.920	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,177	235.370	4,513,690.490	
HASBRO INC	14,615	88.540	1,294,012.100	
HENRY SCHEIN INC	14,358	79.320	1,138,876.560	
HEICO CORP	3,623	134.940	488,887.620	
HERSHEY FOODS CORP	14,916	178.210	2,658,180.360	
HP INC	118,505	27.680	3,280,218.400	
F5 NETWORKS INC	5,548	202.300	1,122,360.400	
CROWN HOLDINGS INC NPR	13,523	102.670	1,388,406.410	
JUNIPER NETWORKS INC	34,151	28.640	978,084.640	
HOLOGIC INC	24,690	69.950	1,727,065.500	
HOME DEPOT INC	102,444	336.970	34,520,554.680	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	18,271	77.900	1,423,310.900	
HORMEL FOODS CORP	24,812	41.920	1,040,119.040	
CENTERPOINT ENERGY INC	60,210	25.540	1,537,763.400	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	295.360	1,010,426.560	
HUMANA INC	12,223	414.870	5,070,956.010	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,576	169.250	1,451,488.000	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	153,872	15.810	2,432,716.320	
BIOGEN INC	14,303	285.590	4,084,793.770	
IDEX CORP	7,369	207.160	1,526,562.040	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,381	213.870	6,497,584.470	
INTUIT INC	26,342	525.410	13,840,350.220	
IDEXX LABORATORIES INC	8,072	612.770	4,946,279.440	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	22,595	170.000	3,841,150.000	
INTEL CORP	389,611	53.440	20,820,811.840	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	23,358	140.000	3,270,120.000	
INTERNATIONAL PAPER CO	35,544	55.750	1,981,578.000	

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	32,532	37.380	1,216,046.160	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,946	133.990	1,734,634.540	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	6,620	164.820	1,091,108.400	
INCYTE CORP	18,028	64.810	1,168,394.680	
JOHNSON & JOHNSON	254,706	160.250	40,816,636.500	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34,801	72.610	2,526,900.610	
KLA CORPORATION	14,521	325.200	4,722,229.200	
DEVON ENERGY CORP	62,146	39.450	2,451,659.700	
KELLOGG CO	25,753	62.760	1,616,258.280	
KEYCORP	101,297	22.850	2,314,636.450	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,079	132.550	4,252,071.450	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,724	839.730	12,364,184.520	
KROGER CO	74,030	39.580	2,930,107.400	
LAM RESEARCH CORP	13,662	552.440	7,547,435.280	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,190	422.440	1,770,023.600	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,881	138.090	1,226,377.290	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,625	102.200	1,596,875.000	
PLUG POWER INC	54,206	27.650	1,498,795.900	
LENNAR CORP	25,435	93.500	2,378,172.500	
ELI LILLY & CO	78,478	233.670	18,337,954.260	
BATH & BODY WORKS INC	24,546	62.520	1,534,615.920	
LINCOLN NATIONAL CORP	18,090	72.810	1,317,132.900	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	69,686	181.740	12,664,733.640	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	28,832	150.020	4,325,376.640	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,161	357.080	8,627,409.880	
LOEWS CORP	22,394	56.790	1,271,755.260	
LOWE'S COS INC	67,847	208.850	14,169,845.950	
DOMINION ENERGY INC	77,064	72.120	5,557,855.680	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	41,345	44.420	1,836,544.900	
MCCORMICK & CO INC	24,703	78.420	1,937,209.260	
MCDONALD'S CORPORATION	71,870	246.580	17,721,704.600	
S&P GLOBAL INC	23,202	428.490	9,941,824.980	
EVEREST RE GROUP LTD	4,101	265.440	1,088,569.440	
MARKEL CORPORATION	1,367	1,239.700	1,694,669.900	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	59,184	108.490	6,420,872.160	
MARSH & MCLENNAN COS	49,081	156.820	7,696,882.420	
MASCO CORP	21,780	56.750	1,236,015.000	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	5,739	350.490	2,011,462.110	
METLIFE INC	71,197	65.120	4,636,348.640	

MEDTRONIC PLC	130,784	123.540	16,157,055.360	
ACTIVISION BLIZZARD INC	74,432	76.320	5,680,650.240	
CVS HEALTH CORP	126,594	84.280	10,669,342.320	
MERCK & CO. INC.	245,355	79.930	19,611,225.150	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	40,848	43.350	1,770,760.800	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,426	274.220	2,584,797.720	
MICROSOFT CORP	689,859	294.230	202,977,213.570	
MICRON TECH INC	107,101	69.220	7,413,531.220	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25,997	143.910	3,741,228.270	
3M CO	55,881	176.280	9,850,702.680	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	179.410	1,069,821.830	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,187	407.760	2,115,051.120	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,137	235.660	3,802,845.420	
KANSAS CITY SOUTHERN	8,697	283.000	2,461,251.000	
ILLUMINA INC	13,951	404.360	5,641,226.360	
XCEL ENERGY INC	50,377	62.440	3,145,539.880	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	103.820	1,008,403.660	
NETAPP INC	21,903	91.690	2,008,286.070	
NEWELL BRANDS INC	33,317	22.140	737,638.380	
NEWMONT CORP	76,661	54.200	4,155,026.200	
NOVAVAX INC	7,606	165.390	1,257,956.340	
NVR INC	352	4,840.860	1,703,982.720	
NIKE INC-CL B	122,767	150.280	18,449,424.760	
NORDSON CORP	5,870	237.930	1,396,649.100	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,009	264.440	6,348,939.960	
EVERSOURCE ENERGY	31,781	84.330	2,680,091.730	
NISOURCE INC	40,775	24.340	992,463.500	
NORTHERN TRUST CORP	17,989	115.780	2,082,766.420	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,627	393.160	5,750,751.320	
WELLS FARGO & CO	398,015	47.280	18,818,149.200	
NUCOR CORP	27,949	98.620	2,756,330.380	
CHENIERE ENERGY INC	24,614	101.630	2,501,520.820	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,964	166.180	7,139,757.520	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	97,764	33.390	3,264,339.960	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10,195	286.950	2,925,455.250	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,508	605.220	3,938,771.760	
ORACLE CORP	180,771	95.290	17,225,668.590	
PACCAR INC	32,111	83.800	2,690,901.800	
PTC INC	11,092	117.940	1,308,190.480	
EXELON CORP	100,657	47.570	4,788,253.490	
PARKER HANNIFIN CORP	12,039	287.430	3,460,369.770	
PAYCHEX INC	33,684	117.340	3,952,480.560	

ALIGN TECHNOLOGY INC	7,148	631.850	4,516,463.800	
PPL CORPORATION	75,032	28.190	2,115,152.080	
PEPSICO INC	133,710	156.240	20,890,850.400	
PENTAIR PLC	16,339	70.020	1,144,056.780	
PFIZER INC	539,863	42.060	22,706,637.780	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24,458	46.260	1,131,427.080	
CONOCOPHILLIPS	129,475	73.970	9,577,265.750	
PG&E CORP	140,021	10.150	1,421,213.150	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	21,771	193.060	4,203,109.260	
ALTRIA GROUP INC	178,220	46.710	8,324,656.200	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,219	201.050	8,287,079.950	
BROWN & BROWN INC	24,295	60.250	1,463,773.750	
GARMIN LTD	14,761	153.560	2,266,699.160	
PPG INDUSTRIES INC	22,360	151.860	3,395,589.600	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	158.000	529,774.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	42,679	449.700	19,192,746.300	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,330	194.870	4,156,577.100	
QUEST DIAGNOSTICS	12,499	140.360	1,754,359.640	
PROCTER & GAMBLE CO	236,726	142.320	33,690,844.320	
PROGRESSIVE CORP	56,047	91.200	5,111,486.400	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,270	59.280	2,920,725.600	
PULTE GROUP INC	25,385	47.250	1,199,441.250	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,012	151.460	4,242,697.520	
QUALCOMM INC	108,867	124.940	13,601,842.980	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	18,189	96.520	1,755,602.280	
EXACT SCIENCES CORP	17,983	93.450	1,680,511.350	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,638	145.290	673,855.020	
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,932	546.260	5,425,454.320	
RESMED INC	13,775	251.620	3,466,065.500	
US BANCORP	136,776	61.850	8,459,595.600	
SEAGEN INC	12,330	162.150	1,999,309.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,809	40.170	1,558,957.530	
ROSS STORES INC	33,423	105.540	3,527,463.420	
ROLLINS INC	25,899	36.110	935,212.890	
ROPER TECHNOLOGIES INC	9,987	452.240	4,516,520.880	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,912	298.690	3,259,305.280	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,882	87.320	1,998,056.240	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	79.780	1,028,922.660	
ACCENTURE PLC-CL A	61,565	326.500	20,100,972.500	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	135,239	59.420	8,035,901.380	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,411	242.660	3,011,653.260	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	26,020	156.230	4,065,104.600	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	59,365	115.870	6,878,622.550	
BOOKING HOLDINGS INC	3,914	2,467.410	9,657,442.740	
SCHLUMBERGER LTD	131,610	32.460	4,272,060.600	
SCHWAB (CHARLES) CORP	138,727	76.610	10,627,875.470	
POOL CORP	3,925	445.520	1,748,666.000	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19,561	143.790	2,812,676.190	
BUNGE LTD	13,581	84.940	1,153,570.140	
SEI INVESTMENTS CO	14,469	59.130	855,551.970	
ANTHEM INC	23,467	380.910	8,938,814.970	
AMERISOURCEBERGEN CORP	13,734	122.400	1,681,041.600	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,249	68.120	1,651,841.880	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,294	288.290	7,003,717.260	
CENTENE CORP	54,694	63.100	3,451,191.400	
SVB FINANCIAL GROUP	5,236	666.510	3,489,846.360	
SMITH (A.O.) CORP	14,015	64.160	899,202.400	
SNAP-ON INC	5,408	213.670	1,155,527.360	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	37,136	110.080	4,087,930.880	
ADVANCE AUTO PARTS	6,226	212.120	1,320,659.120	
EDISON INTERNATIONAL	34,912	56.090	1,958,214.080	
SOUTHERN CO	102,494	61.920	6,346,428.480	
TRUIST FINANCIAL CORP	129,210	60.230	7,782,318.300	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	51.670	683,077.400	
AT&T INC	690,815	26.030	17,981,914.450	
CHEVRON CORP	187,025	107.130	20,035,988.250	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15,076	174.790	2,635,134.040	
STATE STREET CORP	36,094	90.970	3,283,471.180	
STARBUCKS CORP	112,686	110.940	12,501,384.840	
STEEL DYNAMICS INC	20,423	60.720	1,240,084.560	
STRYKER CORP	32,758	258.740	8,475,804.920	
NETFLIX INC	42,608	627.040	26,716,920.320	
NORTONLIFELOCK INC	55,388	25.590	1,417,378.920	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	47.420	753,361.540	
SYNOPSIS INC	14,414	288.740	4,161,898.360	
SYSCO CORP	48,685	82.860	4,034,039.100	
INTUITIVE SURGICAL INC	34,527	324.180	11,192,962.860	
TELEFLEX INC	4,634	354.140	1,641,084.760	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	10.190	1,077,663.830	
TERADYNE INC	17,775	108.020	1,920,055.500	
TEXAS INSTRUMENTS INC	89,450	193.370	17,296,946.500	
TEXTRON INC	22,278	71.150	1,585,079.700	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,836	578.660	21,894,179.760	
GLOBE LIFE INC	10,611	93.550	992,659.050	
DAVITA INC	6,497	111.540	724,675.380	
TRACTOR SUPPLY CO	11,488	193.530	2,223,272.640	
BIO-TECHNE CORP	3,504	478.210	1,675,647.840	
TRIMBLE INC	24,682	80.380	1,983,939.160	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,014	475.810	1,909,901.340	
TYSON FOODS INC	28,083	78.340	2,200,022.220	
UGI CORP	19,377	44.050	853,556.850	
UNION PACIFIC CORP	64,419	214.910	13,844,287.290	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	145,549	89.890	13,083,399.610	
UNITEDHEALTH GROUP INC	90,985	404.990	36,848,015.150	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	130.100	1,006,583.700	
VF CORP	35,294	69.370	2,448,344.780	
VIACOMCBS INC	62,590	39.370	2,464,168.300	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,197	179.580	4,345,297.260	
VULCAN MATERIALS CO	12,739	171.880	2,189,579.320	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	69,370	47.420	3,289,525.400	
WALMART INC	149,575	139.530	20,870,199.750	
WASTE MANAGEMENT INC	40,322	154.080	6,212,813.760	
WATERS CORP	5,920	341.380	2,020,969.600	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,810	403.570	2,748,311.700	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	9,125	121.560	1,109,235.000	
VAIL RESORTS INC	3,547	339.240	1,203,284.280	
WESTERN DIGITAL CORP	29,830	56.170	1,675,551.100	
WABTEC CORP	18,377	89.300	1,641,066.100	
WHIRLPOOL CORP	7,030	198.440	1,395,033.200	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,892	159.460	2,534,138.320	
WYNN RESORTS LTD	9,809	88.980	872,804.820	
NASDAQ INC	11,126	197.680	2,199,387.680	
CME GROUP INC	34,435	201.320	6,932,454.200	
WILLIAMS COS INC	126,594	28.630	3,624,386.220	
LKQ CORP	28,725	52.300	1,502,317.500	
ALLIANT ENERGY CORP	20,873	54.660	1,140,918.180	
WEC ENERGY GROUP INC	28,977	87.330	2,530,561.410	
CARMAX INC	16,043	129.280	2,074,039.040	
XILINX INC	23,225	155.200	3,604,520.000	
TJX COMPANIES INC	115,092	63.020	7,253,097.840	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,003	493.130	2,467,129.390	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	4.920	534,804.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	20,600	53.760	1,107,456.000	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,581	204.530	2,368,661.930	
CBRE GROUP INC	34,563	97.690	3,376,459.470	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	29.360	428,567.920	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,214	21.850	2,124,125.900	
DOMINO'S PIZZA INC	3,715	479.480	1,781,268.200	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,275	460.830	1,970,048.250	
T-MOBILE US INC	59,927	117.190	7,022,845.130	
LAS VEGAS SANDS CORP	33,060	39.090	1,292,315.400	
MOSAIC CO/THE	32,592	41.920	1,366,256.640	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,162	402.960	1,677,119.520	
CELANESE CORP	11,626	159.820	1,858,067.320	
DEXCOM INC	9,155	528.780	4,840,980.900	
DISCOVERY INC-A	20,231	25.170	509,214.270	
EXPEDIA GROUP INC	12,886	168.510	2,171,419.860	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22,094	62.140	1,372,921.160	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11,840	277.230	3,282,403.200	
LIBERTY GLOBAL PLC- SERIES C	34,023	29.510	1,004,018.730	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	54,133	127.570	6,905,746.810	
LIVE NATION	15,697	98.040	1,538,933.880	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,646	1,783.860	4,720,093.560	
TRANSDIGM GROUP INC	5,382	637.140	3,429,087.480	
MASTERCARD INC	85,300	347.150	29,611,895.000	
WESTERN UNION CO	48,040	20.600	989,624.000	
OWENS CORNING	9,740	88.250	859,555.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,866	97.690	1,256,879.540	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	11.100	192,585.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	10,532	168.330	1,772,851.560	
DELTA AIR LINES INC	14,723	43.190	635,886.370	
INSULET CORP	6,387	293.230	1,872,860.010	
DISCOVER FINANCIAL	28,700	125.720	3,608,164.000	
TE CONNECTIVITY LTD	31,400	145.630	4,572,782.000	
MASIMO CORP	5,365	270.220	1,449,730.300	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,749	386.040	4,535,583.960	
VMWARE INC	7,464	147.590	1,101,611.760	
MERCADOLIBRE INC	4,278	1,459.320	6,242,970.960	
ULTA BEAUTY INC	5,259	380.870	2,002,995.330	
INVESCO LTD	39,794	24.800	986,891.200	
MSCI INC	7,829	597.210	4,675,557.090	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	150,641	95.120	14,328,971.920	
VISA INC	163,269	225.110	36,753,484.590	

KEURIG DR PEPPER INC	64,023	35.130	2,249,127.990	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,228	168.860	3,077,980.080	
DISCOVERY INC-C	30,388	24.260	737,212.880	
MARATHON PETROLEUM CORP	61,620	64.560	3,978,187.200	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	13,486	93.040	1,254,737.440	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	192,243	17.740	3,410,390.820	
XYLEM INC	16,073	118.790	1,909,311.670	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	24,698	97.410	2,405,832.180	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,818	210.820	1,015,730.760	
SPLUNK INC	15,213	151.200	2,300,205.600	
EPAM SYSTEMS INC	5,248	576.490	3,025,419.520	
ZILLOW GROUP INC	7,658	89.790	687,611.820	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	17,728	65.420	1,159,765.760	
HCA HEALTHCARE INC	25,845	237.520	6,138,704.400	
VERISK ANALYTICS INC	15,704	206.530	3,243,347.120	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	136.680	840,855.360	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,466	254.970	2,158,576.020	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,569	201.930	3,345,778.170	
NXP SEMICONDUCTOR NV	26,371	185.940	4,903,423.740	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	80.320	1,099,339.840	
LEAR CORP	5,733	167.760	961,768.080	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	125.150	1,317,454.050	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	23,036	70.680	1,628,184.480	
DOLLAR GENERAL CORP	22,273	209.790	4,672,652.670	
FORTINET INC	13,143	306.800	4,032,272.400	
HORIZON PHARMA PLC	20,678	113.220	2,341,163.160	
TESLA INC	78,889	791.940	62,475,354.660	
GENERAC HOLDINGS INC	6,138	409.570	2,513,940.660	
ENPHASE ENERGY INC	13,117	161.260	2,115,247.420	
GENERAL MOTORS CO	125,535	58.090	7,292,328.150	
ALLY FINANCIAL INC	39,108	52.440	2,050,823.520	
VOYA FINANCIAL INC	8,842	65.550	579,593.100	
APTIV PLC	25,603	160.150	4,100,320.450	
PHILLIPS 66	40,510	82.040	3,323,440.400	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	6,826	118.490	808,812.740	
FACEBOOK INC	230,966	325.450	75,167,884.700	
IQVIA HOLDINGS INC	18,203	240.280	4,373,816.840	
SERVICENOW INC	18,949	615.850	11,669,741.650	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,207	499.810	4,601,750.670	

WORKDAY INC	18,032	253.670	4,574,177.440	
ABBVIE INC	170,332	110.340	18,794,432.880	
ZOETIS INC	45,709	197.650	9,034,383.850	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	23.970	919,776.840	
CDW CORP	12,970	174.570	2,264,172.900	
HOWMET AEROSPACE INC	43,243	31.420	1,358,695.060	
TWILIO INC	15,432	320.720	4,949,351.040	
COUPA SOFTWARE INC	6,855	221.620	1,519,205.100	
SNAP INC	91,202	73.530	6,706,083.060	
TRADE DESK INC A	40,522	70.720	2,865,715.840	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	18,557	53.290	988,902.530	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	48.500	403,714.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	15,995	48.520	776,077.400	
OKTA INC	11,653	225.860	2,631,946.580	
BLACK KNIGHT INC	16,004	69.840	1,117,719.360	
BAKER HUGHES CO	69,453	25.450	1,767,578.850	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13,181	55.200	727,591.200	
ALTICE USA INC-A	21,506	18.120	389,688.720	
BROADCOM INC	39,475	492.340	19,435,121.500	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,277	222.780	1,843,950.060	
MONGODB INC	5,198	454.200	2,360,931.600	
BURLINGTON STORES INC	6,573	265.680	1,746,314.640	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	32.890	1,330,367.610	
VEEVA SYSTEMS INC	12,976	284.200	3,687,779.200	
TWITTER INC	76,364	62.100	4,742,204.400	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	56.680	906,029.800	
EVERGY INC	22,104	61.960	1,369,563.840	
ALLEGION PLC	8,924	129.100	1,152,088.400	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	116.980	1,562,852.800	
STERIS PLC	9,081	221.540	2,011,804.740	
DOCUSIGN INC	18,424	261.500	4,817,876.000	
WIX.COM LTD	5,567	181.930	1,012,804.310	
DROPBOX INC	28,170	28.480	802,281.600	
KKR & CO INC	48,489	65.430	3,172,635.270	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	87.170	414,754.860	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	20,278	253.970	5,150,003.660	
MODERNA INC	32,778	305.100	10,000,567.800	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	25,200	142.850	3,599,820.000	
ARAMARK	20,857	36.770	766,911.890	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	53,186	37.250	1,981,178.500	
CIGNA CORP	32,511	203.930	6,629,968.230	
DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	105.200	2,922,771.600	
DOW INC	70,936	58.230	4,130,603.280	
AMCOR PLC	153,824	11.620	1,787,434.880	

PINTEREST INC	52,639	50.930	2,680,904.270	
PELOTON INTERACTIVE INC	24,387	84.870	2,069,724.690	
FOX CORP-A	26,689	42.100	1,123,606.900	
FOX CORP-B	15,080	38.900	586,612.000	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	31,617	20.660	653,207.220	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	17,953	244.360	4,386,995.080	
CHEWY INC	9,068	61.460	557,319.280	
AVANTOR INC	49,938	40.480	2,021,490.240	
LYFT INC	23,625	52.800	1,247,400.000	
DYNATRACE INC	20,409	71.530	1,459,855.770	
CLOUDFLARE INC	22,227	144.270	3,206,689.290	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	82.600	816,583.600	
CARRIER GLOBAL CORP	78,248	51.250	4,010,210.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,822	81.620	3,413,511.640	
UBER TECHNOLOGIES INC	116,273	46.290	5,382,277.170	
CORTEVA INC	69,358	42.460	2,944,940.680	
MATCH GROUP INC	24,556	155.640	3,821,895.840	
BLACKSTONE INC	65,505	114.540	7,502,942.700	
CARLYLE GROUP INC	16,487	48.900	806,214.300	
10X GENOMICS INC	7,667	156.020	1,196,205.340	
DATADOG INC	19,036	141.960	2,702,350.560	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	19,472	81.630	1,589,499.360	
INGERSOLL RAND INC	41,830	50.070	2,094,428.100	
PAYCOM SOFTWARE INC	4,898	501.700	2,457,326.600	
PPD INC	10,828	46.900	507,833.200	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	135.700	728,301.900	
AON PLC	21,662	295.160	6,393,755.920	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	56.520	904,433.040	
IAC/INTERACTIVECORP	7,064	139.250	983,662.000	
AIRBNB INC	12,671	166.670	2,111,875.570	
ZENDESK INC	11,915	110.280	1,313,986.200	
ROYALTY PHARMA PLC	16,861	36.130	609,187.930	
VIATRIS INC	114,640	13.610	1,560,250.400	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,765	114.770	2,497,969.050	
DRAFTKINGS INC	33,459	48.880	1,635,475.920	
SNOWFLAKE INC	18,451	309.790	5,715,935.290	
DOORDASH INC	7,641	195.300	1,492,287.300	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	36.180	330,829.920	
ARISTA NETWORKS INC	5,602	377.590	2,115,259.180	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	146,368	23.530	3,444,039.040	
IHS MARKIT LTD	36,000	118.300	4,258,800.000	
FNF GROUP	30,955	46.750	1,447,146.250	
MARVELL TECHNOLOGY INC	77,931	63.440	4,943,942.640	
CATALENT INC	15,634	128.530	2,009,438.020	
SYNCHRONY FINANCIAL	53,826	49.060	2,640,703.560	

CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	42,845	48.330	2,070,698.850	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	163.900	566,602.300	
WAYFAIR INC	7,829	234.220	1,833,708.380	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,187	161.680	2,778,794.160	
HUBSPOT INC	4,156	682.720	2,837,384.320	
QORVO INC	11,107	163.680	1,817,993.760	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	163.410	396,269.250	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	13,265	166.510	2,208,755.150	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	5,031	276.820	1,392,681.420	
GODADDY INC	16,574	68.380	1,133,330.120	
ETSY INC	13,199	202.340	2,670,685.660	
TRANSUNION	18,741	111.580	2,091,120.780	
SQUARE INC	37,530	232.330	8,719,344.900	
DUPONT DE NEMOURS INC	50,529	69.760	3,524,903.040	
CARVANA CO	7,521	282.740	2,126,487.540	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,941	53.400	1,225,049.400	
TELADOC HEALTH INC	14,744	129.610	1,910,969.840	
WESTROCK CO	26,297	51.200	1,346,406.400	
KRAFT HEINZ CO	64,743	36.780	2,381,247.540	
NOVOCURE LTD	9,772	111.490	1,089,480.280	
FORTIVE CORP	29,332	70.470	2,067,026.040	
WASTE CONNECTIONS INC	24,251	127.970	3,103,400.470	
ALPHABET INC-CL A	28,951	2,778.280	80,433,984.280	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	119,706	14.860	1,778,831.160	
PAYPAL HOLDINGS INC	107,503	255.050	27,418,640.150	
SEA LTD ADR	7,078	316.070	2,237,143.460	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,417	31.580	1,276,368.860	
SUNRUN INC	16,213	45.060	730,557.780	
ZILLOW GROUP INC-C	15,665	89.990	1,409,693.350	
ALPHABET INC-CL C	28,126	2,776.950	78,104,495.700	
ZSCALER INC	8,506	267.700	2,277,056.200	
CABLE ONE INC	542	1,756.980	952,283.160	
LINDE PLC	50,154	294.840	14,787,405.360	
ATHENE HOLDING LTD	13,416	73.460	985,539.360	
ROKU INC	11,730	319.600	3,748,908.000	
AVALARA INC	8,515	161.310	1,373,554.650	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,584	695.230	8,748,774.320	
VISTRA CORP	38,032	17.570	668,222.240	
アメリカ・ドル 小計	30,359,762		3,731,525,802.200 (423,528,178,549)	

イギリス・ボンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	14.205	500,882.500	
	ASHTED GROUP	41,819	55.440	2,318,445.360	
	SEVERN TRENT PLC	18,929	26.130	494,614.770	
	BHP GROUP PLC	201,852	19.744	3,985,365.880	
	BARCLAYS PLC	1,587,377	1.976	3,136,656.950	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	97,947	6.382	625,097.750	
	BT GROUP PLC	864,218	1.465	1,266,079.370	
	BUNZL PLC	34,184	23.970	819,390.480	
	AVIVA PLC	353,095	4.054	1,431,447.130	
	CRODA INTERNATIONAL	15,033	82.660	1,242,627.780	
	DIAGEO PLC	225,216	35.525	8,000,798.400	
	SCHRODERS PLC	11,354	34.810	395,232.740	
	DCC PLC	7,898	60.280	476,091.440	
	NATIONAL GRID PLC	336,378	8.869	2,983,336.480	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.259	689,148.140	
	BAE SYSTEMS PLC	307,253	5.858	1,799,888.070	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	209,139	25.405	5,313,176.290	
	HALMA PLC	38,776	27.640	1,071,768.640	
	NEXT PLC	13,140	76.220	1,001,530.800	
	IMPERIAL BRANDS PLC	91,865	15.270	1,402,778.550	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	26.480	505,953.360	
	ANGLO AMERICAN PLC	121,934	28.310	3,451,951.540	
	COMPASS GROUP PLC	164,861	15.050	2,481,158.050	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,964,872	4.308	8,464,668.570	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	544,587	2.842	1,547,716.250	
	UNILEVER PLC	252,667	38.650	9,765,579.550	
	MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	230,212	2.854	657,025.040	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	9.826	665,357.760	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29,411	17.830	524,398.130	
	PEARSON PLC	87,535	7.446	651,785.610	
	PERSIMMON PLC	29,453	25.570	753,113.210	
	PRUDENTIAL PLC	249,443	14.880	3,711,711.840	
	RIO TINTO PLC	107,463	51.010	5,481,687.630	
	VODAFONE GROUP PLC	2,645,129	1.117	2,954,609.090	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	67,622	54.520	3,686,751.440	
	RELX PLC	184,767	21.550	3,981,728.850	
	RENTOKIL INITIAL PLC	199,293	5.858	1,167,458.390	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	781,282	1.454	1,135,984.020	
	NATWEST GROUP PLC	572,346	2.310	1,322,119.260	
	ST JAMES'S PLACE PLC	57,843	14.410	833,517.630	
SSE PLC	99,950	15.545	1,553,722.750		
BP PLC	1,941,000	3.603	6,993,423.000		

SAGE GROUP PLC(THE)	110,105	7.080	779,543.400	
SMITHS GROUP PLC	35,235	14.350	505,622.250	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,856	144.450	1,134,799.200	
STANDARD CHARTERED PLC	267,266	4.917	1,314,146.920	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,725,520	0.479	3,221,524.080	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.498	519,497.410	
TESCO PLC	794,842	2.703	2,148,457.920	
3I GROUP PLC	83,387	12.710	1,059,848.770	
SMITH & NEPHEW PLC	84,627	12.575	1,064,184.520	
GLAXOSMITHKLINE PLC	485,549	13.928	6,762,726.470	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	33,898	76.240	2,584,383.520	
WPP PLC	124,119	9.830	1,220,089.770	
ASTRAZENECA PLC	149,128	90.030	13,425,993.840	
WHITBREAD PLC	18,594	32.520	604,676.880	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	49.730	802,592.470	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	18.215	706,086.260	
INTERCONTINENTAL HOTELS	19,802	49.480	979,802.960	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.937	537,065.690	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	30.380	610,243.060	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	41.850	441,894.150	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	396,961	17.368	6,894,418.640	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	354,015	17.400	6,159,861.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	23.210	418,569.140	
AVEVA GROUP PLC	10,408	34.560	359,700.480	
ABRDN PLC	206,313	2.528	521,559.260	
EXPERIAN PLC	87,216	31.150	2,716,778.400	
MONDI PLC	47,464	17.680	839,163.520	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	14.610	515,908.320	
OCADO GROUP PLC	54,445	15.655	852,336.470	
INFORMA PLC	151,566	5.758	872,717.020	
GLENCORE PLC	938,148	3.670	3,443,003.160	
ENTAIN PLC	58,126	21.080	1,225,296.080	
EVRAZ PLC	48,765	5.898	287,615.970	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	112,694	2.812	316,895.520	
COCA-COLA HBC AG	20,233	23.780	481,140.740	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	39,279	6.494	255,077.820	
FERGUSON PLC	22,957	102.900	2,362,275.300	
M&G PLC	259,117	2.005	519,529.580	
JD SPORTS FASHION PLC	47,098	10.260	483,225.480	
AUTO TRADER GROUP PLC	77,282	5.790	447,462.780	
MELROSE INDUSTRIES PLC	498,786	1.651	823,495.680	

イギリス・ボンド 小計		28,160,037		172,464,988.390 (26,594,101,210)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	102,359	29.370	3,006,283.830	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	27.800	3,993,331.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,760	461.800	812,768.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	102,134	17.600	1,797,558.400	
	ICL GROUP LTD	68,048	26.480	1,801,911.040	
	NICE LTD	6,862	855.900	5,873,185.800	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,444	108.100	1,128,996.400	
	AZRIELI GROUP	4,414	298.000	1,315,372.000	
イスラエル・シュケル 小計		439,666		19,729,406.470 (693,784,579)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	16,854	66.750	1,125,004.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	270,980	28.090	7,611,828.200	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	349,412	26.060	9,105,676.720	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	179,715	15.000	2,695,725.000	
	TELSTRA CORP LTD	479,279	3.850	1,845,224.150	
	ASX LTD	19,940	79.740	1,590,015.600	
	BHP GROUP LTD	282,043	38.080	10,740,197.440	
	AMPOL LTD	20,946	30.000	628,380.000	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	18.060	931,968.240	
	CSL LIMITED	43,540	287.500	12,517,750.000	
	REA GROUP LTD	5,828	158.050	921,115.400	
	TRANSURBAN GROUP	251,267	13.790	3,464,971.930	
	COCHLEAR LTD	6,917	214.090	1,480,860.530	
	ORIGIN ENERGY LTD	196,680	5.070	997,167.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	170,975	104.690	17,899,372.750	
	RIO TINTO LIMITED	38,299	102.260	3,916,455.740	
	APA GROUP	118,205	8.740	1,033,111.700	
	ARISTOCRAT LEISU	50,270	44.470	2,235,506.900	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	216,220	5.350	1,156,777.000	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	41,434	48.130	1,994,218.420	
	ORICA LTD	41,311	14.220	587,442.420	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	11.040	685,760.640	
	BLUESCOPE STEEL LTD	46,777	20.820	973,897.140	
	SYDNEY AIRPORT	116,130	8.250	958,072.500	
MACQUARIE GROUP LTD	32,165	181.520	5,838,590.800		
SUNCORP GROUP LTD	105,244	12.770	1,343,965.880		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	312,992	28.400	8,888,972.800		
NEWCREST MINING LTD	70,671	23.900	1,689,036.900		

	OIL SEARCH LTD	211,926	4.600	974,859.600	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.530	594,380.990	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	143,822	11.940	1,717,234.680	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	130,073	9.350	1,216,182.550	
	REECE LTD	30,319	17.730	537,555.870	
	SANTOS LTD	194,614	7.490	1,457,658.860	
	SONIC HEALTHCARE	46,547	39.280	1,828,366.160	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	35.730	882,924.030	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.010	1,075,130.970	
	WESFARMERS LTD	106,369	54.440	5,790,728.360	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	83,871	25.460	2,135,355.660	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	117,924	40.200	4,740,544.800	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	33.410	519,625.730	
	SEEK LTD	36,770	31.660	1,164,138.200	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	143.280	872,002.080	
	AUSNET SERVICES	165,066	2.490	411,014.340	
	AGL ENERGY LTD	49,076	6.160	302,308.160	
	BRAMBLES LTD	150,237	10.210	1,533,919.770	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	8.910	292,791.510	
	EVOLUTION MINING LTD	140,964	3.700	521,566.800	
	AURIZON HOLDINGS LTD	153,654	3.880	596,177.520	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	12.180	924,498.540	
	XERO LTD	12,462	133.780	1,667,166.360	
	AFTERPAY LTD	22,748	117.870	2,681,306.760	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.950	831,039.300	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.520	996,702.080	
	SOUTH32 LTD(AUD)	497,070	3.650	1,814,305.500	
	COLES GROUP LTD	127,363	17.040	2,170,265.520	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	50.820	691,355.280	
	オーストラリア・ドル 小計	6,912,215		145,798,172.880 (12,146,445,783)	
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 (21,175,572,943)		
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	204,600	3.910	799,986.000	

	DBS GROUP HOLDINGS LTD	174,700	30.250	5,284,675.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	7.250	263,900.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	68,900	9.470	652,483.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.760	550,392.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.270	710,923.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	321,553	11.610	3,733,230.330	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.480	2,004,886.560	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.520	872,436.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	114,200	26.320	3,005,744.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.090	287,145.000	
	VENTURE CORP LTD	21,000	17.760	372,960.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.320	783,648.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	203,215	3.350	680,770.250	
	シンガポール・ドル 小計	3,192,040		20,003,179.140 (1,674,266,094)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	232,651	9.666	2,248,804.560	
	LOGITECH INTL-REG	18,464	81.400	1,502,969.600	
	NESTLE SA-REGISTERED	278,181	112.120	31,189,653.720	
	CIE FINANC RICHEMONT	49,443	101.150	5,001,159.450	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	67,280	362.600	24,395,728.000	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	249.000	1,026,378.000	
	SIKA INHABER	14,436	300.000	4,330,800.000	
	SGS SA-REG	646	2,703.000	1,746,138.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	215,524	76.700	16,530,690.800	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	142.600	607,333.400	
	BARRY CALLEBAUT AG	401	2,116.000	848,516.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	17.415	347,934.280	
	SWISSCOM AG-REG	2,489	538.400	1,340,077.600	
	ABB LTD	164,213	30.520	5,011,780.760	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,053	48.240	581,436.720	
	GEBERIT AG	3,295	686.200	2,261,029.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,019	695.000	4,878,205.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	83	10,780.000	894,740.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	11	111,200.000	1,223,200.000	
	GIVAUDAN-REG	945	4,287.000	4,051,215.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,455	386.900	5,592,639.500	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	393.600	1,418,534.400	
	HOLCIM LTD	47,857	44.330	2,121,500.810	
	TEMENOS GROUP	6,753	129.950	877,552.350	
	SONOVA HOLDING AG	5,191	345.000	1,790,895.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	4,894	295.400	1,445,687.600	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,032	1,679.000	1,732,728.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	245.100	733,094.100	

	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	48.400	222,252.800	
	SCHINDLER NAMEN	1,671	241.000	402,711.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,090	474.600	1,466,514.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	2,500	70.100	175,250.000	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	123.850	650,955.600	
	EMS-CHEMIE HOLDING	563	889.500	500,788.500	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	92.050	740,082.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,105	1,438.000	3,026,990.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,176	63.060	1,461,478.560	
	SWISS RE LTD	27,674	80.360	2,223,882.640	
	ALCON INC	47,022	73.240	3,443,891.280	
	UBS GROUP AG	347,797	15.625	5,434,328.120	
スイス・フラン	小計	1,655,757		145,479,546.150 (17,795,058,085)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	65,891	531.800	35,040,833.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	34,819	448.100	15,602,393.900	
	ERICSSON LM-B SHS	276,371	104.740	28,947,098.540	
	LUNDBERGS B	7,382	477.600	3,525,643.200	
	SKF AB-B SHS	35,049	215.200	7,542,544.800	
	SANDVIK AB	117,110	207.700	24,323,747.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	162,441	126.000	20,467,566.000	
	SKANSKA AB-B SHS	31,653	216.300	6,846,543.900	
	SWEDBANK AB	89,378	182.900	16,347,236.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	48,398	138.100	6,683,763.800	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	139,230	102.650	14,291,959.500	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	199.100	4,716,878.100	
	VOLVO AB-B SHS	127,767	195.500	24,978,448.500	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	76.000	12,033,004.000	
	TELE2 AB-B SHS	47,055	124.950	5,879,522.250	
	INDUSTRIVARDEN A	12,131	274.800	3,333,598.800	
	INDUSTRIVARDEN C	18,886	268.700	5,074,668.200	
	ELECTROLUX AB-SER B	15,395	183.920	2,831,448.400	
	SECURITAS AB-B SHS	35,948	139.000	4,996,772.000	
	INVESTOR AB-B SHS	185,463	187.240	34,726,092.120	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	70,896	163.860	11,617,018.560	
	ASSA ABLOY AB-B	92,064	249.000	22,923,936.000	
	TELIA CO AB	269,954	36.005	9,719,693.770	
	LUNDIN ENERGY AB	20,762	339.600	7,050,775.200	
	BOLIDEN AB	28,603	299.500	8,566,598.500	
	ALFA LAVAL AB	29,835	320.700	9,568,084.500	
	KINNEVIK AB-B	21,722	300.800	6,533,977.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	8,967	534.600	4,793,758.200	
	ICA GRUPPEN AB	9,009	401.900	3,620,717.100	
	HUSQVARNA AB-B SHS	33,442	104.000	3,477,968.000	

	NIBE INDUSTRIER AB	137,747	104.250	14,360,124.750	
	HEXAGON AB-B SHS	180,841	128.400	23,219,984.400	
	EPIROC AB-A	70,906	185.800	13,174,334.800	
	EPIROC AB-B	38,943	159.650	6,217,249.950	
	ESSITY AB-B	53,059	264.700	14,044,717.300	
	EQT AB	31,042	355.800	11,044,743.600	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	77.040	3,785,899.680	
	ELECTROLUX AB	15,395	16.976	261,345.520	
	EVOLUTION AB	17,548	1,238.800	21,738,462.400	
	NORDEA BANK ABP	309,007	105.360	32,556,977.520	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	267.200	3,993,304.000	
	SINCH AB	56,299	150.850	8,492,704.150	
スウェーデン・クローナ 小計		3,192,515		518,952,138.510 (6,710,051,151)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,585	1,062.000	11,241,270.000	
	A P MOLLER A/S	568	17,135.000	9,732,680.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	16,230.000	5,534,430.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	106.550	7,322,648.750	
	GENMAB A/S	5,911	2,729.000	16,131,119.000	
	NOVOZYMES-B SHS	20,271	429.300	8,702,340.300	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,605.000	2,117,865.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	161,686	635.000	102,670,610.000	
	GN STORE NORD A/S	13,407	414.100	5,551,838.700	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	94,335	224.100	21,140,473.500	
	COLOPLAST-B	10,577	1,000.500	10,582,288.500	
	DSV A/S	18,937	1,461.000	27,666,957.000	
	DEMANT A/S	10,739	292.700	3,143,305.300	
	TRYG A/S	35,784	147.550	5,279,929.200	
	PANDORA A/S	9,639	821.200	7,915,546.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,263	506.000	6,205,078.000	
AMBU A/S B	14,156	167.250	2,367,591.000		
ORSTED A/S	18,161	834.000	15,146,274.000		
デンマーク・クローネ 小計		506,898		268,452,245.050 (4,730,128,558)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.790	858,660.540	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	14.550	719,482.950	
	A2 MILK CO LTD	62,165	6.250	388,531.250	
	FISHER & PAYKEL	57,388	29.750	1,707,293.000	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	159,623	4.660	743,843.180	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.280	387,689.520	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.980	618,326.760	
ニュージーランド・ドル 小計		624,747		5,423,827.200 (426,638,248)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	224.000	9,677,248.000	

	NORSK HYDRO ASA	129,036	67.520	8,712,510.720	
	TELENOR ASA	67,591	138.650	9,371,492.150	
	SCHIBSTED ASA	7,537	421.400	3,176,091.800	
	ORKLA ASA	60,009	78.400	4,704,705.600	
	EQUINOR ASA	94,630	227.300	21,509,399.000	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	432.700	6,574,011.100	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	193.700	3,231,497.100	
	ADEVINTA ASA	22,265	146.450	3,260,709.250	
	DNB BANK ASA	91,214	206.400	18,826,569.600	
	SCHIBSTED ASA	7,445	374.800	2,790,386.000	
	ノルウェー・クローネ 小計	554,805		91,834,620.320 (1,214,053,681)	
ユーロ	CRH PLC	80,795	40.100	3,239,879.500	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	15,136	166.600	2,521,657.600	
	KERRY GROUP PLC-A	15,455	116.000	1,792,780.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	16,773	87.040	1,459,921.920	
	UMICORE	21,964	51.280	1,126,313.920	
	AIR LIQUIDE	45,651	138.360	6,316,272.360	
	AIRBUS SE	56,165	113.820	6,392,700.300	
	AXA SA	185,618	24.225	4,496,596.050	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	59,416	26.440	1,570,959.040	
	ADIDAS AG	18,120	261.250	4,733,850.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	115,980	18.895	2,191,442.100	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	94.150	277,742.500	
	DANONE	61,596	56.630	3,488,181.480	
	SAFRAN SA	32,279	115.740	3,735,971.460	
	INTESA SANPAOLO	1,547,296	2.503	3,872,881.880	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	35,037	86.570	3,033,153.090	
	ACCOR SA	17,380	31.470	546,948.600	
	BOUYGUES	21,417	34.870	746,810.790	
	BNP PARIBAS	107,999	57.330	6,191,582.670	
	THALES SA	10,448	85.000	888,080.000	
	CAPGEMINI SA	15,126	175.150	2,649,318.900	
	UNICREDIT SPA	217,091	11.904	2,584,251.260	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,356	173.350	2,835,312.600	
	COMMERZBANK AG	106,215	6.361	675,633.610	
	EIFFAGE	8,477	87.180	739,024.860	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	39,680	41.010	1,627,276.800	
	UNITED INTERNET	9,882	31.990	316,125.180	
	FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	38.800	215,184.800	
	PUBLICIS GROUPE	19,379	57.100	1,106,540.900	
	FAURECIA	10,774	43.650	470,285.100	
	IBERDROLA SA	567,470	9.276	5,263,851.720	
	ENI SPA	237,532	12.006	2,851,809.190	
	JERONIMO MARTINS	34,337	18.265	627,165.300	
	KESKO OYJ-B	30,812	28.900	890,466.800	

KBC GROUPE	23,789	79.960	1,902,168.440	
HANNOVER RUECK SE	5,923	153.250	907,699.750	
WARTSILA OYJ	48,612	10.575	514,071.900	
L'OREAL	24,400	355.750	8,680,300.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	26,708	631.700	16,871,443.600	
GEA GROUP AG	13,061	39.520	516,170.720	
BOLLORE	110,900	5.110	566,699.000	
MEDIOBANCA SPA	57,442	9.894	568,331.140	
MICHELIN(CGDE) -B	15,740	130.950	2,061,153.000	
CONTINENTAL AG	9,904	98.350	974,058.400	
DEUTSCHE POST AG-REG	94,619	52.190	4,938,165.610	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	19.805	419,984.830	
OMV AG	12,817	53.220	682,120.740	
VERBUND AG	6,916	89.100	616,215.600	
PERNOD-RICARD	19,790	197.800	3,914,462.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	15,524	84.460	1,311,157.040	
RENAULT SA	19,019	32.510	618,307.690	
REPSOL SA	152,723	11.458	1,749,900.130	
REMY COINTREAU	1,860	171.600	319,176.000	
MERCK KGAA	12,629	183.700	2,319,947.300	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	47,480	60.020	2,849,749.600	
RWE AG	63,738	30.140	1,921,063.320	
SEB SA	2,439	118.000	287,802.000	
SOCIETE GENERALE-A	74,556	28.340	2,112,917.040	
VINCI S.A.	50,480	90.730	4,580,050.400	
SODEXO	9,325	77.380	721,568.500	
SOFINA	1,382	355.600	491,439.200	
SOLVAY SA	7,183	105.500	757,806.500	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	51,786	138.720	7,183,753.920	
VIVENDI SE	73,788	11.050	815,357.400	
SAP SE	100,811	117.140	11,809,000.540	
TELEFONICA S.A	527,117	3.990	2,103,196.830	
TOTALENERGIES SE	240,839	44.220	10,649,900.580	
VALEO	19,653	26.380	518,446.140	
E.ON SE	226,220	10.350	2,341,377.000	
VOEST-ALPINE AG	9,875	31.780	313,827.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	72.650	753,089.900	
SIEMENS AG-REG	73,572	136.380	10,033,749.360	
UPM-KYMMENE OYJ	54,222	31.060	1,684,135.320	
ING GROEP NV-CVA	372,531	12.772	4,757,965.930	
PUMA AG	10,448	96.960	1,013,038.080	
BAYER AG	93,727	48.615	4,556,538.100	
STORA ENSO OYJ-R SHS	65,747	14.470	951,359.090	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	16,941	78.680	1,332,917.880	

DAIMLER AG	82,325	83.000	6,832,975.000	
BASF SE	87,434	64.190	5,612,388.460	
BEIERSDORF AG	10,342	93.040	962,219.680	
HEIDELBERGCEMENT AG	15,297	63.240	967,382.280	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	19,754	61.000	1,204,994.000	
ASM INTERNATIONAL NV	4,578	319.700	1,463,586.600	
ORANGE	186,186	9.448	1,759,085.320	
SAMPO OYJ-A SHS	44,704	45.180	2,019,726.720	
RANDSTAD NV	11,017	61.800	680,850.600	
ALLIANZ SE	39,827	198.940	7,923,183.380	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.505	1,210,205.180	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	97,517	28.875	2,815,803.370	
HERMES INTL	3,027	1,226.000	3,711,102.000	
ENDESA S.A.	27,736	18.105	502,160.280	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	75,751	5.946	450,415.440	
ERSTE GROUP BANK AG	25,385	39.900	1,012,861.500	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	13,095	242.000	3,168,990.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	66,045	26.235	1,732,690.570	
DASSAULT SYSTEMES SA	68,574	43.675	2,994,969.450	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	22.520	515,190.040	
HEINEKEN NV	24,889	90.080	2,242,001.120	
AKZO NOBEL	18,548	93.380	1,732,012.240	
ASML HOLDING NV	40,392	630.300	25,459,077.600	
AEGON NV	189,323	4.577	866,531.370	
VOLKSWAGEN AG	2,753	268.400	738,905.200	
VOLKSWAGEN AG PFD	18,625	190.820	3,554,022.500	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	627,420	5.914	3,710,561.880	
KERING	7,153	634.400	4,537,863.200	
CNP ASSURANCES	13,987	14.300	200,014.100	
FORTUM OYJ	39,409	26.520	1,045,126.680	
AGEAS	17,055	41.570	708,976.350	
UCB SA	12,778	98.320	1,256,332.960	
NEMETSCHEK SE	5,095	82.300	419,318.500	
CARREFOUR SA	61,189	15.565	952,406.780	
NATURGY ENERGY GROUP SA	34,156	21.650	739,477.400	
ATOS SE	8,972	45.080	404,457.760	
NOKIA OYJ	509,241	5.085	2,589,490.480	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	86,552	37.850	3,275,993.200	
WOLTERS KLUWER-CVA	24,545	89.320	2,192,359.400	
SANOFI	109,582	84.700	9,281,595.400	
STMICROELECTRONICS NV	71,332	35.945	2,564,028.740	
ELISA OYJ	13,642	54.280	740,487.760	
BANCO SANTANDER SA	1,643,883	3.349	5,505,364.160	

RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	47,453	17.635	836,833.650	
QIAGEN N.V.	21,144	44.430	939,427.920	
DEUTSCHE BANK AG-REG	197,931	11.516	2,279,373.390	
BMW VORZUG	4,471	69.450	310,510.950	
ENEL SPA	779,544	6.748	5,260,362.910	
COLRUYT NV	4,673	42.880	200,378.240	
VOPAK (KON.)	5,364	35.200	188,812.800	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	321,587	16.716	5,375,648.290	
SARTORIUS AG	2,391	495.900	1,185,696.900	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,686	47.500	365,085.000	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	124,000	35.785	4,437,340.000	
RATIONAL AG	479	732.400	350,819.600	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,771	159.400	601,097.400	
BECHTLE AG	7,533	53.360	401,960.880	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.697	920,882.550	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,226	105.200	1,391,375.200	
TELEPERFORMANCE	5,344	336.200	1,796,652.800	
DEUTSCHE BOERSE AG	17,819	146.250	2,606,028.750	
EURAZEO	3,008	82.850	249,212.800	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	12,395	96.100	1,191,159.500	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,883	75.300	819,489.900	
INDITEX	102,245	30.810	3,150,168.450	
ESSILORLUXOTTICA	27,129	159.960	4,339,554.840	
SNAM SPA	198,963	4.728	940,697.060	
CREDIT AGRICOLE SA	127,883	12.812	1,638,436.990	
ORPEA	4,932	89.700	442,400.400	
ENAGAS	23,477	19.355	454,397.330	
WENDEL	2,220	118.400	262,848.000	
TENARIS SA	52,985	9.814	519,994.790	
TELECOM ITALIA SPA	1,123,551	0.336	377,513.130	
TELECOM ITALIA-RNC	497,596	0.347	172,665.810	
ATLANTIA SPA	45,299	16.085	728,634.410	
PROXIMUS	13,739	17.460	239,882.940	
TERNA SPA	108,374	6.142	665,633.100	
BIOMERIEUX	3,248	97.920	318,044.160	
GRIFOLS SA	30,687	19.800	607,602.600	
FERROVIAL SA	46,794	26.190	1,225,534.860	
LANXESS AG	7,194	57.000	410,058.000	
NESTE OYJ	39,808	47.390	1,886,501.120	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	17,911	24.140	432,371.540	
RECORDATI SPA	10,303	49.410	509,071.230	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	12.395	685,493.080	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	4,809	196.650	945,689.850	
KONE OYJ	35,976	59.440	2,138,413.440	
ELIA GROUP	2,862	103.200	295,358.400	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,771	431.700	1,196,240.700	
ENGIE	178,037	11.570	2,059,888.090	
ALSTOM	30,600	30.750	940,950.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	54,778	12.080	661,718.240	
IPSEN SA	3,646	86.900	316,837.400	
DEUTSCHE WOHNEN	30,724	52.900	1,625,299.600	
ARKEMA SA	6,393	110.500	706,426.500	
LEGRAND SA	24,356	89.680	2,184,246.080	
AMPLIFON SPA	11,372	40.600	461,703.200	
ADP	2,313	113.750	263,103.750	
ORION OYJ	8,051	35.680	287,259.680	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	40,088	10.060	403,285.280	
SYMRISE AG	12,698	112.100	1,423,445.800	
SCOR SE	15,667	23.880	374,127.960	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	44.530	1,078,872.840	
PRYSMIAN SPA	28,236	29.550	834,373.800	
DIASORIN SPA	2,223	169.350	376,465.050	
CAIXABANK	496,448	2.707	1,343,884.730	
BUREAU VERITAS SA	29,810	26.560	791,753.600	
GETLINK	50,458	13.555	683,958.190	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	20.300	567,831.600	
SUEZ SA	34,245	19.715	675,140.170	
AMADEUS IT GROUP SA	42,083	59.300	2,495,521.900	
BRENTAG SE	13,072	80.540	1,052,818.880	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	27.610	644,417.400	
EDENRED	24,865	46.880	1,165,671.200	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.351	231,303.130	
LEG IMMOBILIEN SE	8,287	124.750	1,033,803.250	
KION GROUP AG	7,508	80.280	602,742.240	
VONOVIA SE	51,295	51.840	2,659,132.800	
KNORR-BREMSE AG	6,860	91.480	627,552.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	26,679	55.440	1,479,083.760	
FERRARI NV	12,037	187.000	2,250,919.000	
CNH INDUSTRIAL NV	101,681	14.115	1,435,227.310	
AROUNDTOWN SA	106,018	5.996	635,683.920	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	43.470	351,759.240	
MONCLER SPA	21,870	57.020	1,247,027.400	
NEXI SPA	43,586	16.135	703,260.110	
TEAMVIEWER AG	13,668	14.165	193,607.220	
PROSUS NV	88,845	71.490	6,351,529.050	
JDE PEET'S BV	7,308	24.960	182,407.680	
SIEMENS ENERGY AG	46,176	22.540	1,040,807.040	
INPOST SA	20,395	12.998	265,094.210	
WORLDLINE SA	23,570	66.470	1,566,697.900	
NN GROUP NV	28,556	45.530	1,300,154.680	
FINECOBANK SPA	51,807	15.665	811,556.650	

	ARGENX SE	4,403	256.000	1,127,168.000	
	DEUTSCHE LUFTHANSA AG-RTS	27,990	2.150	60,178.500	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	73,788	24.825	1,831,787.100	
	ZALANDO SE	20,080	75.280	1,511,622.400	
	STELLANTIS NV	194,081	16.826	3,265,606.900	
	AENA SME SA	7,240	144.600	1,046,904.000	
	CELLNEX TELECOM SAU	47,032	50.980	2,397,691.360	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,807	63.830	1,072,790.810	
	ABN AMRO BANK NV	34,251	12.306	421,492.800	
	EXOR NV	9,966	72.980	727,318.680	
	SCOUT24 AG	9,670	57.740	558,345.800	
	COVESTRO AG	19,158	58.680	1,124,191.440	
	HELLOFRESH SE	15,029	75.960	1,141,602.840	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	72,646	47.345	3,439,424.870	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	12.160	677,907.840	
	AMUNDI SA	5,924	73.550	435,710.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	39,494	9.356	369,505.860	
	ADYEN NV	1,886	2,410.000	4,545,260.000	
	UNIPER SE	10,427	36.490	380,481.230	
	DELIVERY HERO SE	16,642	107.650	1,791,511.300	
	ユーロ 小計	18,623,386		461,330,947.870 (60,489,713,885)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	17.640	2,892,960.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	74.750	12,109,500.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	45,000	42.900	1,930,500.000	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	114,740	471.200	54,065,488.000	
	MTR CORP	179,500	41.900	7,521,050.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	143.600	10,884,880.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	123,450	31.950	3,944,227.500	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	45.050	6,577,300.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,041,456	11.620	12,101,718.720	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	224,000	40.350	9,038,400.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	431,500	24.600	10,614,900.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	33.700	5,495,324.200	
	SINO LAND CO	273,400	10.780	2,947,252.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	116,000	101.100	11,727,600.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	49.350	2,442,825.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	142,000	147.900	21,001,800.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	20.550	3,411,300.000	

SJM HOLDINGS LTD	156,000	5.410	843,960.000	
WYNN MACAU LTD	124,400	6.400	796,160.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	16.200	3,518,640.000	
AIA GROUP LTD	1,160,627	88.650	102,889,583.550	
HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.520	4,681,400.000	
SANDS CHINA LTD	252,000	16.060	4,047,120.000	
SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	23.750	3,158,750.000	
SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	20.250	2,110,050.000	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	149,750	41.450	6,207,137.500	
ESR CAYMAN LTD	203,800	22.850	4,656,830.000	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.590	1,745,700.000	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	20.100	3,027,060.000	
WH GROUP LTD	897,000	5.280	4,736,160.000	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	254,332	52.950	13,466,879.400	
CK ASSET HOLDINGS LTD	224,832	45.400	10,207,372.800	
香港・ドル 小計	8,320,153		344,799,828.670 (5,030,629,500)	
合計	106,473,159		582,208,622,266 (582,208,622,266)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	118,215.000	1,232,982.450	
		GOODMAN GROUP	151,155.000	3,157,627.950	
		GPT GROUP	207,292.000	1,021,949.560	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,176,115.000	
		SCENTRE GROUP	485,250.000	1,441,192.500	
		STOCKLAND	243,481.000	1,068,881.590	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	626,333.030	
	オーストラリア・ドル 小計		1,991,229.000	9,725,082.080 (810,196,589)	
シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	241,306.000	716,678.820	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	556,577.000	1,168,811.700	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	398,061.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	270,100.000	529,396.000	
	シンガポール・ドル 小計		1,260,283.000	2,812,947.520 (235,443,707)	

投資信託受益証券 合計			3,251,512	1,045,640,296 (1,045,640,296)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,214.000	714,940.380	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,037.000	2,693,138.820	
		AMERICAN TOWER CORP	43,878.000	11,478,484.800	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	129,689.000	1,098,465.830	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,168.000	2,947,130.080	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,549.000	1,668,479.320	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	8,581.000	1,296,331.670	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	41,582.000	7,017,378.320	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	26,819.000	3,747,418.870	
		DUKE REALTY TRUST	35,962.000	1,820,396.440	
		EQUINIX INC	8,562.000	6,421,585.620	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19,134.000	1,565,735.220	
		EQUITY RESIDENTIAL	33,311.000	2,756,152.140	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,408.000	2,090,802.240	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	12,714.000	2,191,639.320	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	53,001.000	1,789,843.770	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	64,637.000	1,067,803.240	
		INVITATION HOMES INC	50,968.000	1,968,384.160	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,214,672.400	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	49,268.000	982,403.920	
		MID AMERICA	11,430.000	2,183,815.800	
		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	19,995.000	588,452.850	
		PROLOGIS INC	71,279.000	9,190,714.260	
		PUBLIC STORAGE	15,087.000	4,557,782.700	
		REALTY INCOME CORP	34,406.000	2,331,350.560	
		REGENCY CENTERS CORP	14,499.000	1,011,015.270	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,323.000	3,404,731.860	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	31,326.000	4,154,454.120	
		SUN COMMUNITIES INC	10,801.000	2,037,716.660	
		UDR INC	25,993.000	1,374,769.770	
		VENTAS INC	40,460.000	2,210,329.800	
		VEREIT INC	25,604.000	1,211,325.240	
VICI PROPERTIES INC	59,521.000	1,743,370.090			
VORNADO REALTY TRUST	17,313.000	765,061.470			
WELLTOWER INC	39,658.000	3,285,268.720			
WEYERHAEUSER CO	71,903.000	2,679,105.780			
WP CAREY INC	15,064.000	1,122,569.280			
アメリカ・ドル 小計		1,213,584.000	100,383,020.790 (11,393,472,860)		

イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	111,148.000	543,180.270	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	511,385.420	
	SEGRO PLC	116,375.000	1,396,500.000	
イギリス・ポンド 小計		301,551.000	2,451,065.690 (377,954,329)	
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 (70,915,100)	
ユーロ	COVIVIO	4,663.000	337,974.240	
	GECINA SA	4,763.000	562,272.150	
	KLEPIERRE	17,099.000	330,096.190	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	818,611.200	
ユーロ 小計		39,445.000	2,048,953.780 (268,658,820)	
香港・ドル	LINK REIT	186,700.000	12,452,890.000	
香港・ドル 小計		186,700.000	12,452,890.000 (181,687,665)	
投資証券 合計		1,762,967	12,292,688,774 (12,292,688,774)	
合計			13,338,329,070 (13,338,329,070)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 598銘柄	70.04	-	-	73.03
	投資証券 37銘柄	-	-	1.88	
イギリス・ポンド	株式 83銘柄	4.40	-	-	4.53
	投資証券 3銘柄	-	-	0.06	
イスラエル・シケル	株式 8銘柄	0.11	-	-	0.12
オーストラリア・ドル	株式 57銘柄	2.01	-	-	2.18
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.13	-	
カナダ・ドル	株式 89銘柄	3.50	-	-	3.57
	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	2.94	-	-	2.99
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	-	-	0.79

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	10.00	-	-	10.20
	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。

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12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	469,419,609
コール・ローン	1,743,607,148
国債証券	149,122,809,907
派生商品評価勘定	14,073,949
未収利息	885,436,294
前払費用	64,511,103
流動資産合計	152,299,858,010
資産合計	152,299,858,010
負債の部	
流動負債	
未払金	1,668,082,260
未払解約金	59,396,000
流動負債合計	1,727,478,260
負債合計	1,727,478,260
純資産の部	
元本等	
元本	73,151,994,654
剰余金	
剰余金又は欠損金()	77,420,385,096
元本等合計	150,572,379,750
純資産合計	150,572,379,750
負債純資産合計	152,299,858,010

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	65,397,237,567円
同期中追加設定元本額	27,390,404,345円
同期中一部解約元本額	19,635,647,258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）	34,051,815円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	57,781,381円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	36,718,887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	12,181,617,494円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	217,534,320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）	382,705,284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）	161,833円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,632,649円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	21,415,668円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,426,202円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,599,917円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,160,295,538円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	559,664,491円

Oneグローバルバランス	927,283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	2,287,869,190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	1,077,110,006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)	4,131,039円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	11,523,702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	1,215,237,902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)	21,820,272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)	2,141,707,250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)	2,943,414,393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)	451,107,481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)	377,798,340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)	367,917,328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	73,151,994,654円
2. 受益権の総数	73,151,994,654口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	3,168,187,568	
合計	3,168,187,568	

(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12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	1,450,000,000	-	1,464,073,949	14,073,949
イギリス・ポンド	780,294,000	-	788,695,241	8,401,241
ユーロ	86,247,000	-	86,829,642	582,642
ユーロ	583,459,000	-	588,549,066	5,090,066
合計	1,450,000,000	-	1,464,073,949	14,073,949

(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12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.0583円 (20,583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12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	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	2,993,789.070	
		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	2,000,390.600	
		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	1,972,734.380	
		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	2,008,164.000	
US T N/B 0.5 03/31/25	1,300,000.000	1,289,437.500	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,000,000.000	1,924,375.000	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,500,000.000	1,444,335.930	
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	1,747,089.840	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,220,000.000	4,830,844.920	
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	2,330,047.270	
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	1,097,722.650	
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	3,030,053.880	
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	1,926,377.200	
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	615,361,563.870	

		(67,600,600,000)	(69,843,537,498)	
イギリス・ボンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	900,000.000	876,420.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	1,500,000.000	1,494,225.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,781,522.640	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,000,000.000	953,592.800	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	800,000.000	731,443.200	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,200,000.000	1,175,093.280	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,020,000.000	955,852.200	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	770,000.000	555,879.320	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	750,000.000	749,710.200	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,100,000.000	994,282.520	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	860,000.000	681,484.640	
	UK TREASURY 0.75 07/22/23	1,560,000.000	1,568,190.000	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	450,000.000	388,831.500	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	910,000.000	900,308.500	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,470,000.000	1,486,419.900	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	290,000.000	274,015.200	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	700,000.000	717,255.000	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	390,000.000	364,065.000	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,340,000.000	1,281,001.390	
	UK TREASURY 1.5 07/22/26	900,000.000	933,025.140	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,030,000.000	1,024,190.800		
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	975,439.800		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	1,070,000.000	1,105,267.200		
UK TREASURY 1.625 10/22/71	500,000.000	554,880.000		
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	536,400.860		
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,210,000.000	1,307,743.800		

	UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,440,000.000	1,503,676.800	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	790,000.000	831,024.700	
	UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,180,000.000	1,219,699.440	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	980,000.000	1,331,261.400	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	509,967.740	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,310,000.000	1,738,763.000	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,280,000.000	1,777,253.880	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	960,000.000	1,657,948.800	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	740,000.000	1,148,761.200	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	770,000.000	1,352,813.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,140,000.000	1,569,832.440	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,010,000.000	1,316,946.270	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,020,000.000	1,471,001.560	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	780,000.000	939,224.670	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	960,000.000	1,404,762.620	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,060,000.000	1,661,963.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	850,000.000	1,383,970.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,020,000.000	1,777,452.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	860,000.000	1,185,317.360	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,180,000.000	1,823,914.670	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	870,000.000	1,147,179.210	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	880,000.000	1,327,307.860	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,410,000.000	1,617,058.500	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	760,000.000	1,026,665.910	
	イギリス・ボンド 小計	48,690,000.000 (7,507,998,000)	57,090,306.320 (8,803,325,235)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	1,350,000.000	1,323,567.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	1,000,000.000	1,013,574.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,000,000.000	936,152.000	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,030,000.000	2,125,933.740	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,610,000.000	2,779,937.100	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,255,791.640	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,600,000.000	2,823,373.800	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,390,000.000	1,743,147.570	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	2,320,000.000	2,460,703.360	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,500,000.000	2,329,792.500	
イスラエル・シュケル 小計		16,960,000.000 (596,398,400)	18,791,972.710 (660,819,720)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,440,000.000	1,427,978.660	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,417,843.610	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	210,000.000	205,084.480	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,600,000.000	1,494,032.800	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,560,000.000	1,475,372.350	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	990,000.000	942,102.560	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,640,000.000	1,614,868.430	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	930,000.000	770,877.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	900,000.000	897,284.220	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	980,000.000	1,039,976.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,050,000.000	2,206,476.080	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,980,000.000	2,112,261.820	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	740,000.000	783,308.940	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	530,000.000	579,780.460	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,630,000.000	1,779,145.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	1,160,000.000	1,270,749.490	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,560,000.000	1,708,512.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	870,000.000	950,268.710	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	190,000.000	207,176.030	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,640,000.000	1,856,676.960	
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	708,264.560		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	760,000.000	924,805.010		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	2,010,000.000	2,310,057.220		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	880,000.000	1,130,567.590		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	2,120,000.000	2,294,586.240		
オーストラリア・ドル 小計		30,440,000.000 (2,535,956,400)	32,108,056.220 (2,674,922,164)	
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	1,515,900.000	
	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 (2,806,047,600)	32,091,467.090 (2,915,188,870)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	200,000.000	196,300.000
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	200,000.000	197,861.860
	SINGAPORE 1.75 02/01/23	200,000.000	203,460.000
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	440,000.000	415,580.000
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	200,000.000	206,432.000
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	420,000.000	439,599.300
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	480,000.000	490,809.600
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	340,000.000	358,530.000
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	180,000.000	187,290.000
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	380,000.000	407,550.000
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	420,000.000	466,200.000
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	380,000.000	419,088.700
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	727,510.000
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	470,000.000	513,240.000
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	370,000.000	405,705.000
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	550,000.000	585,585.000
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	480,000.000	552,240.000
SINGAPORE 3.5 03/01/27	730,000.000	814,315.000	
シンガポール・ドル 小計	7,140,000.000 (597,618,000)	7,587,296.460 (635,056,714)	

スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,500,000.000	2,433,526.340	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	1,540,000.000	1,597,725.510	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,170,000.000	3,285,546.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,250,000.000	4,461,777.500	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	4,700,000.000	4,877,349.800	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	2,700,000.000	3,202,429.500	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,980,000.000	8,738,597.950	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,270,000.000	4,758,974.880	
スウェーデン・クローナ 小計		30,110,000.000 (389,322,300)	33,355,927.980 (431,292,149)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/31	1,700,000.000	1,675,244.510	
	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	7,441,687.950	
	DENMARK 0.5 11/15/29	4,370,000.000	4,563,918.750	
	DENMARK 1.5 11/15/23	3,500,000.000	3,655,795.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,320,000.000	5,796,907.670	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,680,000.000	13,291,176.960	
デンマーク・クローネ 小計		35,530,000.000 (626,038,600)	42,120,203.340 (742,157,983)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	1,800,000.000	1,724,310.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,633,598.150	
	NORWAY 1.5 02/19/26	3,770,000.000	3,773,928.340	
	NORWAY 1.75 02/17/27	1,200,000.000	1,212,325.200	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,800,000.000	3,849,305.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	1,850,000.000	1,860,082.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	2,123,302.500	
	NORWAY 2.0 05/24/23	1,800,000.000	1,832,508.720	
	NORWAY 3.0 03/14/24	6,200,000.000	6,466,910.000	
ノルウェー・クローネ 小計		26,220,000.000 (346,628,400)	26,476,270.410 (350,016,295)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,400,000.000	1,280,552.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	180,000.000	173,505.700	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,050,000.000	3,673,005.020	
	POLAND 2.25 10/25/24	1,000,000.000	1,016,200.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	2,850,000.000	2,901,062.020	
	POLAND 2.5 04/25/24	2,290,000.000	2,340,344.040	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,180,000.000	2,230,147.840	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,250,000.000	2,291,062.500	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,510,000.000	3,623,373.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	210,000.000	216,258.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,380,000.000	2,495,073.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	4,240,000.000	4,457,808.800	
POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,790,136.000		
ポーランド・ズロチ 小計		27,980,000.000	28,488,527.920	

		(799,103,204)	(813,626,660)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 3.48 03/15/23	1,220,000.000	1,243,979.100	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	2,017,943.600	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,700,000.000	1,644,577.060	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,210,000.000	1,193,825.100	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	800,000.000	822,121.200	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,821,176.000	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,430,000.000	2,539,357.040	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,070,000.000	3,250,166.320	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,800,000.000	1,915,928.100	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,200,000.000	1,270,699.680	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,600,000.000	2,794,081.420	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	2,000,000.000	2,155,194.800	
マレーシア・リングgit 小計		22,730,000.000 (617,660,474)	23,669,049.420 (643,178,015)	
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	9,741,023.060	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	22,596,000.000	24,685,865.620	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	19,143,000.000	18,191,836.390	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,071,000.000	18,290,201.230	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	12,000,000.000	12,207,960.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,643,000.000	13,460,577.530	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	7,000,000.000	7,077,735.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	20,000,000.000	20,684,000.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	11,654,000.000	11,714,615.950	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	14,000,000.000	14,442,562.400	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	17,109,000.000	18,205,842.590	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	11,125,000.000	11,818,435.710	
	メキシコ・ペソ 小計		182,426,000.000 (991,740,706)	188,602,815.480 (1,025,320,346)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	690,000.000	689,695.710	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	830,000.000	822,717.730	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	200,000.000	202,209.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	220,000.000	197,494.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	140,000.000	135,636.200	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	820,000.000	857,137.800	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	650,000.000	680,959.500	

AUSTRIA 0.75 02/20/28	675,000.000	718,108.200	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	390,000.000	393,168.750	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	680,000.000	720,106.400	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	250,000.000	212,498.250	
AUSTRIA 07/15/23	650,000.000	658,346.000	
AUSTRIA 07/15/24	800,000.000	814,476.000	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	640,000.000	685,664.000	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	530,000.000	636,805.600	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	150,000.000	183,705.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	700,000.000	749,053.200	
AUSTRIA 1.75 10/20/23	780,000.000	819,497.640	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	350,000.000	541,739.950	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	680,000.000	860,930.320	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	470,000.000	734,384.160	
AUSTRIA 3.4 11/22/22	740,000.000	773,892.740	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	210,000.000	425,216.820	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	890,000.000	1,399,169.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	740,000.000	918,880.940	
AUSTRIA 6.25 07/15/27	670,000.000	927,789.200	
BELGIUM 0.0 10/22/27	610,000.000	620,855.560	
BELGIUM 0.0 10/22/31	570,000.000	559,624.860	
BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	804,880.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	660,000.000	672,210.000	
BELGIUM 0.4 06/22/40	430,000.000	408,358.100	
BELGIUM 0.5 10/22/24	530,000.000	548,284.470	
BELGIUM 0.65 06/22/71	330,000.000	268,191.330	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,140,000.000	1,197,939.360	
BELGIUM 0.8 06/22/27	840,000.000	894,994.800	
BELGIUM 0.8 06/22/28	930,000.000	993,798.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	680,000.000	732,396.040	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,460,000.000	1,559,748.660	
BELGIUM 1.0 06/22/31	930,000.000	1,010,352.000	
BELGIUM 1.25 04/22/33	710,000.000	791,968.790	
BELGIUM 1.45 06/22/37	340,000.000	387,158.000	
BELGIUM 1.6 06/22/47	570,000.000	663,154.410	
BELGIUM 1.7 06/22/50	670,000.000	797,204.190	
BELGIUM 1.9 06/22/38	550,000.000	666,279.900	
BELGIUM 2.15 06/22/66	420,000.000	576,744.000	
BELGIUM 2.25 06/22/23	830,000.000	871,829.510	
BELGIUM 2.25 06/22/57	350,000.000	478,931.950	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,220,000.000	1,328,090.030	
BELGIUM 3.0 06/22/34	590,000.000	785,150.760	
BELGIUM 3.75 06/22/45	740,000.000	1,211,690.800	
BELGIUM 4.0 03/28/32	730,000.000	1,022,261.340	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,110,000.000	1,834,916.580	
BELGIUM 4.5 03/28/26	430,000.000	527,580.330	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,090,000.000	1,755,970.380	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,340,000.000	1,849,313.900	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,430,000.000	1,466,293.400	

BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,250,000.000	1,278,006.250	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	600,000.000	615,348.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,400,000.000	1,433,922.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	670,000.000	687,734.900	
BUNDESOBL 04/05/24	1,540,000.000	1,567,173.300	
BUNDESOBL 04/14/23	1,030,000.000	1,041,217.730	
BUNDESOBL 10/07/22	1,000,000.000	1,007,091.000	
BUNDESOBL 10/13/23	1,280,000.000	1,298,739.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,130,000.000	1,153,143.530	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,690,000.000	1,726,166.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,660,000.000	1,686,062.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,700,000.000	1,682,847.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	700,000.000	687,029.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,000,000.000	2,038,200.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	500,000.000	512,190.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	506,095.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,720,000.000	1,554,223.980	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	400,000.000	366,104.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	600,000.000	533,280.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,200,000.000	1,230,900.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	500,000.000	512,072.950	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	1,960,000.000	2,038,576.400	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	1,890,000.000	1,972,611.900	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,440,000.000	1,502,121.600	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	2,060,000.000	2,140,813.800	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	1,810,000.000	1,895,631.100	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	3,140,000.000	3,324,223.800	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	2,500,000.000	2,640,997.500	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,680,000.000	1,724,173.920	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,610,000.000	1,646,983.310	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,340,000.000	1,405,188.320	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,770,000.000	1,881,403.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,020,000.000	2,508,559.220	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	1,420,000.000	1,462,690.880	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	1,650,000.000	1,708,693.800	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,410,000.000	1,491,506.460	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	2,750,000.000	2,911,521.250	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,930,000.000	3,079,681.980	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,760,000.000	2,658,832.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,890,000.000	2,915,844.160	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,100,000.000	1,791,768.000	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,730,000.000	2,773,124.260	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,140,000.000	1,972,906.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	1,100,000.000	1,488,960.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,420,000.000	2,298,781.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,140,000.000	2,119,909.800	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,240,000.000	1,908,149.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,160,000.000	1,606,716.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	840,000.000	971,880.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	710,000.000	1,099,747.400	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	710,000.000	998,423.300	
FINLAND 0.0 09/15/24	180,000.000	183,281.400	
FINLAND 0.0 09/15/30	170,000.000	169,959.540	
FINLAND 0.125 04/15/36	240,000.000	231,880.800	
FINLAND 0.125 04/15/52	210,000.000	180,125.400	
FINLAND 0.125 09/15/31	140,000.000	140,461.300	
FINLAND 0.25 09/15/40	300,000.000	287,314.800	
FINLAND 0.5 04/15/26	580,000.000	606,052.440	
FINLAND 0.5 09/15/27	500,000.000	524,709.000	
FINLAND 0.5 09/15/28	240,000.000	251,838.720	
FINLAND 0.5 09/15/29	370,000.000	387,619.400	
FINLAND 0.75 04/15/31	250,000.000	267,199.000	
FINLAND 0.875 09/15/25	390,000.000	411,838.050	
FINLAND 09/15/23	260,000.000	263,404.380	
FINLAND 1.125 04/15/34	290,000.000	321,780.230	
FINLAND 1.375 04/15/47	280,000.000	335,823.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	470,000.000	485,698.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	280,000.000	299,031.320	
FINLAND 2.625 07/04/42	350,000.000	499,613.450	
FINLAND 2.75 07/04/28	420,000.000	506,255.400	
FINLAND 4.0 07/04/25	430,000.000	504,584.790	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,030,000.000	1,175,974.690	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	1,100,000.000	1,110,175.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	500,000.000	507,307.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,300,000.000	2,343,927.700	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	900,000.000	914,688.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,550,000.000	2,549,905.650	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	2,700,000.000	2,672,460.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	1,930,000.000	1,889,010.660	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,550,000.000	2,630,687.100	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,090,000.000	3,206,486.820	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	2,570,000.000	2,680,165.620	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	2,620,000.000	2,732,052.160	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,100,000.000	1,066,425.800	

FRANCE OAT 0.5 05/25/72	600,000.000	453,594.600	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	740,000.000	699,419.880	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,170,000.000	3,368,086.960	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,930,000.000	1,815,442.920	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	250,000.000	232,868.000	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,240,000.000	3,443,763.600	
FRANCE OAT 03/25/23	2,200,000.000	2,222,148.280	
FRANCE OAT 03/25/24	2,520,000.000	2,558,581.200	
FRANCE OAT 03/25/25	2,970,000.000	3,025,547.910	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,350,000.000	2,523,500.500	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,220,000.000	2,356,676.520	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,540,000.000	2,811,137.380	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,190,000.000	2,422,578.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,090,000.000	3,492,398.340	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,000,000.000	2,292,016.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	3,130,000.000	3,253,291.630	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	820,000.000	1,013,316.640	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,990,000.000	2,387,164.200	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,980,000.000	3,198,872.060	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,690,000.000	2,148,074.500	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,980,000.000	2,129,800.860	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	2,030,000.000	2,092,134.640	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,240,000.000	3,932,990.640	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,450,000.000	4,087,387.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	1,600,000.000	2,461,856.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	2,820,000.000	3,327,177.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,360,000.000	2,533,680.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,090,000.000	2,120,357.380	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,520,000.000	2,378,953.520	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,130,000.000	3,446,248.940	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,310,000.000	3,947,443.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,050,000.000	3,238,885.200	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,540,000.000	3,617,902.340	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,100,000.000	3,371,995.200	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	1,800,000.000	2,278,414.800	
IRISH 0.0 10/18/31	360,000.000	351,272.520	
IRISH 0.2 05/15/27	530,000.000	545,091.750	
IRISH 0.2 10/18/30	450,000.000	452,697.750	
IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	386,241.570	
IRISH 0.55 04/22/41	280,000.000	271,129.880	
IRISH 0.9 05/15/28	680,000.000	728,962.040	
IRISH 1.0 05/15/26	640,000.000	682,550.400	
IRISH 1.1 05/15/29	520,000.000	565,223.360	
IRISH 1.3 05/15/33	340,000.000	377,834.520	
IRISH 1.35 03/18/31	270,000.000	301,091.310	
IRISH 1.5 05/15/50	420,000.000	476,593.320	
IRISH 1.7 05/15/37	390,000.000	457,461.420	
IRISH 10/18/22	20,000.000	20,130.180	
IRISH 2.0 02/18/45	570,000.000	718,583.040	

IRISH 2.4 05/15/30	630,000.000	758,582.370	
IRISH 3.4 03/18/24	640,000.000	703,614.250	
IRISH 3.9 03/20/23	570,000.000	607,476.930	
IRISH 5.4 03/13/25	800,000.000	964,204.000	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	1,007,100.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	985,545.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,000,000.000	1,006,600.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	400,000.000	397,000.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	580,000.000	573,040.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,000,000.000	1,013,300.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,080,000.000	1,097,404.200	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,400,000.000	1,426,572.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	500,000.000	500,000.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	500,000.000	509,090.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,210,000.000	1,175,498.350	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	980,000.000	1,000,756.400	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,300,000.000	1,341,600.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,200,000.000	2,206,551.600	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	920,000.000	937,917.460	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	900,000.000	848,970.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	1,070,000.000	1,091,218.100	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,170,000.000	1,186,263.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,200,000.000	1,243,080.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	600,000.000	599,470.200	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,350,000.000	1,422,986.400	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,510,000.000	1,586,833.330	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,020,000.000	1,041,930.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,340,000.000	1,414,409.790	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,092,216.320	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	530,000.000	509,701.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	790,000.000	835,516.640	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,100,000.000	1,178,540.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,840,000.000	1,963,916.640	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,480,000.000	1,587,282.240	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	700,000.000	673,263.640	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,264,867.200	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	600,000.000	621,180.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	810,000.000	854,793.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	900,000.000	963,540.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,620,000.000	1,781,585.280	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	970,000.000	1,050,166.810	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,040,000.000	1,143,700.580	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,580,000.000	1,728,069.700	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	500,000.000	484,300.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,120,000.000	1,240,512.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	1,020,000.000	1,148,724.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,140,000.000	1,307,737.660	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	970,000.000	1,099,010.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	982,550.580	

ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,250,000.000	1,378,226.250	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,170,000.000	1,268,068.340	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,220,000.000	1,451,556.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	590,000.000	685,698.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	1,000,000.000	1,159,415.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	940,000.000	1,153,662.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,330,000.000	1,571,115.700	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	790,000.000	987,902.900	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	990,000.000	1,288,011.780	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,010,000.000	1,272,434.360	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,020,000.000	1,374,390.840	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,540,000.000	1,891,705.350	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,410,000.000	1,571,705.850	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	740,000.000	1,067,734.160	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,660,000.000	2,261,086.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	2,390,000.000	2,664,519.940	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,630,000.000	1,948,339.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	1,400,000.000	1,508,575.600	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	1,900,000.000	2,079,037.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,890,000.000	2,433,447.380	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	970,000.000	1,533,622.380	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,790,000.000	2,101,547.710	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,610,000.000	2,339,008.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,330,000.000	2,062,963.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,490,000.000	2,334,830.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,650,000.000	3,616,190.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	1,960,000.000	2,083,468.240	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,280,000.000	1,923,840.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,470,000.000	2,170,308.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,790,000.000	2,447,646.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	1,080,000.000	1,466,100.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,190,000.000	1,418,718.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	920,000.000	939,692.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	400,000.000	381,040.800	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	510,000.000	445,209.090	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	950,000.000	957,046.150	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	540,000.000	540,131.760	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,420,000.000	1,464,659.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	790,000.000	816,070.000	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	630,000.000	654,994.230	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,250,000.000	1,308,937.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	820,000.000	873,987.160	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	980,000.000	1,049,241.900	
NETHERLANDS 01/15/24	1,930,000.000	1,960,250.820	

NETHERLANDS 1.75 07/15/23	450,000.000	469,749.040	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	880,000.000	945,312.720	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	980,000.000	1,248,622.900	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,110,000.000	1,754,454.900	
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	350,000.000	369,857.950	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,280,000.000	2,149,436.160	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,160,000.000	1,820,388.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	850,000.000	1,164,330.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,419,880.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	800,000.000	809,522.400	
SPAIN 0.0 01/31/28	580,000.000	579,130.000	
SPAIN 0.0 04/30/23	990,000.000	999,256.500	
SPAIN 0.0 05/31/24	860,000.000	870,535.510	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,190,000.000	1,152,455.500	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,240,000.000	1,265,443.560	
SPAIN 0.35 07/30/23	1,620,000.000	1,646,938.640	
SPAIN 0.45 10/31/22	840,000.000	849,363.050	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,850,000.000	1,883,490.550	
SPAIN 0.5 10/31/31	800,000.000	799,444.800	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,180,000.000	1,216,221.280	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,200,000.000	1,261,920.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	600,000.000	590,248.800	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,170,000.000	1,066,733.460	
SPAIN 1.2 10/31/40	1,280,000.000	1,303,872.000	
SPAIN 1.25 10/31/30	1,370,000.000	1,477,819.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,850,000.000	1,992,699.750	
SPAIN 1.4 04/30/28	1,440,000.000	1,569,038.400	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,649,071.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	1,170,000.000	1,284,207.210	
SPAIN 1.45 10/31/27	1,500,000.000	1,636,531.500	
SPAIN 1.45 10/31/71	300,000.000	263,844.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,240,000.000	1,353,150.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	1,450,000.000	1,554,970.570	
SPAIN 1.85 07/30/35	1,490,000.000	1,696,570.620	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,270,000.000	1,398,877.060	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,460,000.000	1,668,485.080	
SPAIN 2.15 10/31/25	1,380,000.000	1,521,244.380	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,240,000.000	1,478,700.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	860,000.000	1,136,244.900	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,693,122.200	
SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,604,389.360	
SPAIN 3.45 07/30/66	920,000.000	1,402,802.200	
SPAIN 3.8 04/30/24	1,670,000.000	1,854,200.160	
SPAIN 4.2 01/31/37	1,350,000.000	2,006,968.050	
SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,223,570.760	

	SPAIN 4.65 07/30/25	1,370,000.000	1,635,081.300	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,390,000.000	2,300,255.400	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,130,000.000	1,269,442.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,170,000.000	1,957,410.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	1,540,000.000	2,092,244.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	910,000.000	1,649,476.920	
	SPAIN 5.4 01/31/23	1,460,000.000	1,573,748.600	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,220,000.000	1,893,477.820	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,670,000.000	2,166,000.020	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,580,000.000	2,261,939.060	
	ユーロ 小計	393,515,000.000 (51,597,686,800)	454,426,237.480 (59,584,368,258)	
国債証券 合計		137,012,798,884.400 (137,012,798,884)	149,122,809,907 (149,122,809,907)	
合計			149,122,809,907 (149,122,809,907)	

(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	46.39	46.84
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	5.85	5.90
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	1.78	1.79
カナダ・ドル	国債証券 32銘柄	1.94	1.95
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.42	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	0.49	0.50
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.23	0.23
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.54	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	0.68	0.69
ユーロ	国債証券 337銘柄	39.57	39.96

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2021年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,760,959,695
コール・ローン	2,188,985,829
国債証券	523,995,450,864
未収入金	407,240,675
未収利息	2,532,650,779
前払費用	556,847,441
流動資産合計	531,442,135,283
資産合計	531,442,135,283
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,792,961,260
未払金	404,971,806
未払解約金	89,694,000
流動負債合計	9,287,627,066
負債合計	9,287,627,066
純資産の部	
元本等	
元本	366,229,927,093
剰余金	
剰余金又は欠損金()	155,924,581,124
元本等合計	522,154,508,217
純資産合計	522,154,508,217
負債純資産合計	531,442,135,283

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	310,787,069,975円
同期中追加設定元本額	543,032,405,836円
同期中一部解約元本額	487,589,548,718円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	7,170,339,862円
たわらノーロード バランス(堅実型)	646,666,384円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,584,683,722円
たわらノーロード バランス(積極型)	730,327,785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)	37,574,013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)	1,144,705,565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)	1,334,090,718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)	403,873,411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)	185,496,303円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,052,789円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	12,977,189円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	99,261,252円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	10,956,644円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,831,498円
投資のソムリエ	200,763,866,960円
投資のソムリエ<DC年金>	10,313,568,414円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,978,825,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	56,184,349,243円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,760,696,920円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	8,484,604,746円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	159,249,468円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	83,434,040円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	58,549,734円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	503,916,717円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	20,746,176,259円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,622,306,393円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	128,332,337円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	61,071,314円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	49,667,916円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	467,056円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,920,375,189円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	6,543,792,597円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	5,492,734,325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)	60,984,617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)	537,606,272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)	48,715,190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)	329,613,697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)	654,566,440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)	1,030,937,249円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	2,049,047,614円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,222,164,083円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,940,401,092円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	118,069,032円
計	366,229,927,093円
2. 受益権の総数	366,229,927,093口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	5,720,709,635	
合計	5,720,709,635	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年6月23日から2021年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	522,890,353,728	-	531,683,314,988	8,792,961,260
アメリカ・ドル	243,741,382,549	-	247,957,077,650	4,215,695,101
イギリス・ポンド	30,924,265,578	-	31,696,082,633	771,817,055
イスラエル・シェケル	2,420,747,417	-	2,461,598,833	40,851,416
オーストラリア・ドル	9,478,483,947	-	9,796,715,935	318,231,988

カナダ・ドル	10,198,029,360	-	10,518,637,899	320,608,539
シンガポール・ドル	2,266,143,044	-	2,307,914,923	41,771,879
スウェーデン・クローナ	1,582,605,115	-	1,604,519,904	21,914,789
デンマーク・クローネ	2,687,015,251	-	2,722,897,935	35,882,684
ノルウェー・クローネ	1,319,411,801	-	1,364,491,033	45,079,232
ポーランド・ズロチ	2,886,659,107	-	2,933,739,785	47,080,678
マレーシア・リンギット	2,446,655,960	-	2,488,640,811	41,984,851
メキシコ・ペソ	3,732,279,625	-	3,737,873,900	5,594,275
ユーロ	209,206,674,974	-	212,093,123,747	2,886,448,773
合計	522,890,353,728	-	531,683,314,988	8,792,961,260

(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12日現在
1口当たり純資産額	1.4258円
(1万口当たり純資産額)	(14,258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12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	13,000,000.000	12,919,765.560	
		US T N/B 0.125 01/31/23	11,630,000.000	11,622,731.250	
		US T N/B 0.125 02/15/24	16,350,000.000	16,242,064.330	
		US T N/B 0.125 02/28/23	19,820,000.000	19,802,192.900	
		US T N/B 0.125 03/31/23	15,000,000.000	14,981,835.900	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,612,133.220	
		US T N/B 0.125 05/31/23	9,480,000.000	9,460,743.750	
		US T N/B 0.125 06/30/23	13,000,000.000	12,970,039.030	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,977,148.370	

US T N/B 0.125 07/31/23	1,850,000.000	1,844,941.390	
US T N/B 0.125 08/15/23	8,310,000.000	8,285,978.860	
US T N/B 0.125 09/15/23	11,120,000.000	11,080,471.840	
US T N/B 0.125 10/31/22	7,910,000.000	7,911,699.380	
US T N/B 0.125 11/30/22	8,450,000.000	8,450,000.000	
US T N/B 0.125 12/15/23	10,000,000.000	9,947,265.600	
US T N/B 0.125 12/31/22	10,000,000.000	9,995,703.100	
US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,131,587.780	
US T N/B 0.25 05/15/24	8,960,000.000	8,904,000.000	
US T N/B 0.25 05/31/25	8,970,000.000	8,804,965.990	
US T N/B 0.25 06/15/24	8,500,000.000	8,440,234.370	
US T N/B 0.25 06/30/25	8,990,000.000	8,816,521.040	
US T N/B 0.25 07/31/25	8,980,000.000	8,796,541.380	
US T N/B 0.25 08/31/25	9,920,000.000	9,702,224.940	
US T N/B 0.25 09/30/25	9,480,000.000	9,261,885.860	
US T N/B 0.25 10/31/25	13,510,000.000	13,179,638.210	
US T N/B 0.25 11/15/23	12,280,000.000	12,256,015.550	
US T N/B 0.375 01/31/26	14,420,000.000	14,082,594.480	
US T N/B 0.375 04/15/24	2,740,000.000	2,733,364.040	
US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,776,342.590	
US T N/B 0.375 07/15/24	9,000,000.000	8,960,976.540	
US T N/B 0.375 07/31/27	11,250,000.000	10,728,808.530	
US T N/B 0.375 08/15/24	12,240,000.000	12,178,321.780	
US T N/B 0.375 09/30/27	6,470,000.000	6,152,060.120	
US T N/B 0.375 11/30/25	10,540,000.000	10,319,730.440	
US T N/B 0.375 12/31/25	10,960,000.000	10,718,537.500	
US T N/B 0.5 02/28/26	5,820,000.000	5,709,738.230	
US T N/B 0.5 03/15/23	7,000,000.000	7,028,574.000	
US T N/B 0.5 03/31/25	11,090,000.000	10,999,893.750	
US T N/B 0.5 04/30/27	4,590,000.000	4,416,440.620	
US T N/B 0.5 05/31/27	9,610,000.000	9,253,378.850	
US T N/B 0.5 06/30/27	10,800,000.000	10,388,250.000	
US T N/B 0.5 08/31/27	10,590,000.000	10,158,126.550	
US T N/B 0.5 10/31/27	10,000,000.000	9,564,453.100	
US T N/B 0.625 03/31/27	6,260,000.000	6,075,990.240	
US T N/B 0.625 05/15/30	20,990,000.000	19,425,179.120	
US T N/B 0.625 07/31/26	11,960,000.000	11,736,684.310	
US T N/B 0.625 08/15/30	15,270,000.000	14,111,030.810	
US T N/B 0.625 11/30/27	8,510,000.000	8,189,212.820	
US T N/B 0.625 12/31/27	14,160,000.000	13,577,559.410	
US T N/B 0.75 01/31/28	15,270,000.000	14,771,935.490	
US T N/B 0.75 03/31/26	14,790,000.000	14,653,654.680	
US T N/B 0.75 04/30/26	15,000,000.000	14,850,000.000	
US T N/B 0.75 05/31/26	8,100,000.000	8,011,406.250	
US T N/B 0.875 06/30/26	4,300,000.000	4,273,460.910	
US T N/B 0.875 11/15/30	20,530,000.000	19,347,920.980	
US T N/B 1.0 07/31/28	9,000,000.000	8,787,656.250	
US T N/B 1.125 02/15/31	24,380,000.000	23,440,988.940	
US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	7,908,980.010	

US T N/B 1.125 02/28/27	3,840,000.000	3,832,050.000	
US T N/B 1.125 02/29/28	14,380,000.000	14,233,391.290	
US T N/B 1.125 05/15/40	12,110,000.000	10,317,152.270	
US T N/B 1.125 08/15/40	10,540,000.000	8,942,531.250	
US T N/B 1.25 03/31/28	14,120,000.000	14,061,534.300	
US T N/B 1.25 04/30/28	11,000,000.000	10,948,867.160	
US T N/B 1.25 05/15/50	12,230,000.000	9,803,587.070	
US T N/B 1.25 05/31/28	10,850,000.000	10,788,121.030	
US T N/B 1.25 06/30/28	12,000,000.000	11,924,062.440	
US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,547,000.000	
US T N/B 1.25 08/15/31	6,880,000.000	6,658,281.190	
US T N/B 1.25 08/31/24	8,400,000.000	8,565,703.100	
US T N/B 1.375 01/31/25	7,340,000.000	7,510,024.190	
US T N/B 1.375 02/15/23	7,680,000.000	7,803,899.980	
US T N/B 1.375 06/30/23	8,960,000.000	9,133,949.970	
US T N/B 1.375 08/15/50	19,250,000.000	15,942,910.050	
US T N/B 1.375 08/31/23	7,880,000.000	8,039,446.830	
US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,828,300.750	
US T N/B 1.375 09/30/23	9,820,000.000	10,026,373.370	
US T N/B 1.375 10/15/22	5,500,000.000	5,570,468.750	
US T N/B 1.375 11/15/40	11,560,000.000	10,244,146.810	
US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,134,374.960	
US T N/B 1.5 01/31/27	6,020,000.000	6,143,457.010	
US T N/B 1.5 02/15/30	16,730,000.000	16,739,802.600	
US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,758,707.770	
US T N/B 1.5 03/31/23	7,740,000.000	7,886,636.690	
US T N/B 1.5 08/15/26	12,540,000.000	12,821,660.060	
US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,667,460.930	
US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,218,124.960	
US T N/B 1.5 11/30/24	9,140,000.000	9,389,564.760	
US T N/B 1.625 02/15/26	12,800,000.000	13,176,000.000	
US T N/B 1.625 04/30/23	8,000,000.000	8,172,187.440	
US T N/B 1.625 05/15/26	13,210,000.000	13,588,239.400	
US T N/B 1.625 05/15/31	32,300,000.000	32,423,648.270	
US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,584,342.920	
US T N/B 1.625 08/15/29	11,760,000.000	11,910,675.000	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,928,780.450	
US T N/B 1.625 10/31/23	9,650,000.000	9,904,820.310	
US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,243,835.910	
US T N/B 1.625 11/15/22	8,330,000.000	8,464,386.300	
US T N/B 1.625 11/15/50	17,120,000.000	15,098,368.700	
US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,457,476.910	
US T N/B 1.625 12/15/22	4,170,000.000	4,242,486.310	
US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,347,753.880	
US T N/B 1.75 05/15/23	10,000,000.000	10,241,406.200	
US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,986,037.500	
US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,272,812.480	
US T N/B 1.75 08/15/41	7,130,000.000	6,720,860.490	
US T N/B 1.75 09/30/22	3,650,000.000	3,708,385.720	

US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	7,048,781.250	
US T N/B 1.75 12/31/24	8,300,000.000	8,594,390.620	
US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,159,582.000	
US T N/B 1.875 02/15/41	12,360,000.000	11,926,434.290	
US T N/B 1.875 02/15/51	18,240,000.000	17,088,600.000	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	5,118,145.270	
US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,203,320.300	
US T N/B 1.875 08/31/24	7,030,000.000	7,295,821.870	
US T N/B 1.875 09/30/22	3,270,000.000	3,326,330.850	
US T N/B 1.875 10/31/22	4,000,000.000	4,074,453.120	
US T N/B 2.0 02/15/23	14,780,000.000	15,141,994.410	
US T N/B 2.0 02/15/25	11,220,000.000	11,714,381.240	
US T N/B 2.0 02/15/50	13,510,000.000	13,042,954.970	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	7,126,360.890	
US T N/B 2.0 05/31/24	8,440,000.000	8,773,313.990	
US T N/B 2.0 06/30/24	6,710,000.000	6,979,186.270	
US T N/B 2.0 08/15/25	14,040,000.000	14,672,896.780	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,000,000.000	5,788,828.080	
US T N/B 2.0 10/31/22	2,720,000.000	2,774,187.480	
US T N/B 2.0 11/15/26	12,150,000.000	12,716,208.950	
US T N/B 2.0 11/30/22	12,020,000.000	12,277,772.620	
US T N/B 2.125 02/29/24	8,810,000.000	9,167,217.910	
US T N/B 2.125 03/31/24	13,170,000.000	13,710,175.700	
US T N/B 2.125 05/15/25	10,360,000.000	10,862,217.150	
US T N/B 2.125 05/31/26	7,070,000.000	7,436,203.860	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	6,444,034.740	
US T N/B 2.125 09/30/24	6,400,000.000	6,691,499.960	
US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,301,874.960	
US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	6,981,874.580	
US T N/B 2.125 12/31/22	10,620,000.000	10,874,714.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	8,160,000.000	8,505,524.990	
US T N/B 2.25 02/15/27	8,150,000.000	8,627,857.400	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,630,000.000	8,062,764.050	
US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,361,250.000	
US T N/B 2.25 05/15/41	13,360,000.000	13,703,393.680	
US T N/B 2.25 08/15/27	21,540,000.000	22,819,778.830	
US T N/B 2.25 08/15/46	6,330,000.000	6,432,120.670	
US T N/B 2.25 08/15/49	12,260,000.000	12,495,142.850	
US T N/B 2.25 10/31/24	6,560,000.000	6,888,768.700	
US T N/B 2.25 11/15/24	14,440,000.000	15,169,896.800	
US T N/B 2.25 11/15/25	15,100,000.000	15,935,218.740	
US T N/B 2.25 11/15/27	12,650,000.000	13,400,105.390	
US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,329,374.960	
US T N/B 2.25 12/31/24	7,210,000.000	7,580,075.740	
US T N/B 2.375 01/31/23	5,560,000.000	5,719,415.590	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	6,067,570.290	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,547,834.350	
US T N/B 2.375 05/15/27	9,230,000.000	9,839,324.170	
US T N/B 2.375 05/15/29	9,450,000.000	10,095,257.800	

US T N/B 2.375 05/15/51	19,220,000.000	20,157,725.730	
US T N/B 2.375 08/15/24	15,210,000.000	15,999,612.840	
US T N/B 2.375 11/15/49	6,950,000.000	7,270,894.480	
US T N/B 2.5 01/31/24	10,820,000.000	11,339,444.500	
US T N/B 2.5 01/31/25	5,160,000.000	5,472,220.290	
US T N/B 2.5 02/15/45	7,670,000.000	8,162,557.800	
US T N/B 2.5 02/15/46	6,270,000.000	6,680,244.080	
US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,891,737.500	
US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,945,224.960	
US T N/B 2.5 05/15/24	15,300,000.000	16,096,078.120	
US T N/B 2.5 05/15/46	6,280,000.000	6,683,783.890	
US T N/B 2.5 08/15/23	10,000,000.000	10,406,250.000	
US T N/B 2.625 01/31/26	7,280,000.000	7,805,524.990	
US T N/B 2.625 02/15/29	14,530,000.000	15,766,185.070	
US T N/B 2.625 02/28/23	5,370,000.000	5,551,027.690	
US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,723,141.380	
US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,135,315.610	
US T N/B 2.625 12/31/23	7,320,000.000	7,684,284.330	
US T N/B 2.625 12/31/25	6,300,000.000	6,751,335.890	
US T N/B 2.75 02/15/28	15,000,000.000	16,351,171.790	
US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,727,597.240	
US T N/B 2.75 04/30/23	7,660,000.000	7,958,620.270	
US T N/B 2.75 05/31/23	7,220,000.000	7,515,004.650	
US T N/B 2.75 06/30/25	5,150,000.000	5,522,369.090	
US T N/B 2.75 07/31/23	8,860,000.000	9,251,778.120	
US T N/B 2.75 08/15/42	4,500,000.000	4,993,945.270	
US T N/B 2.75 08/15/47	7,630,000.000	8,525,630.820	
US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,352,116.770	
US T N/B 2.75 08/31/25	6,430,000.000	6,905,468.330	
US T N/B 2.75 11/15/42	4,920,000.000	5,456,971.850	
US T N/B 2.75 11/15/47	6,310,000.000	7,054,136.270	
US T N/B 2.875 04/30/25	6,920,000.000	7,439,810.870	
US T N/B 2.875 05/15/28	17,170,000.000	18,868,890.950	
US T N/B 2.875 05/15/43	4,370,000.000	4,946,805.820	
US T N/B 2.875 05/15/49	11,490,000.000	13,229,657.800	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,895,693.340	
US T N/B 2.875 07/31/25	5,270,000.000	5,679,042.530	
US T N/B 2.875 08/15/28	12,860,000.000	14,143,488.170	
US T N/B 2.875 08/15/45	3,690,000.000	4,192,618.330	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,200,500.000	
US T N/B 2.875 10/31/23	9,430,000.000	9,919,917.920	
US T N/B 2.875 11/15/46	4,030,000.000	4,595,144.500	
US T N/B 2.875 11/30/23	8,670,000.000	9,131,609.690	
US T N/B 2.875 11/30/25	6,140,000.000	6,638,395.270	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,770,000.000	6,730,614.810	
US T N/B 3.0 02/15/48	6,700,000.000	7,840,308.570	
US T N/B 3.0 02/15/49	9,670,000.000	11,378,870.310	
US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,774,550.740	
US T N/B 3.0 05/15/45	4,120,000.000	4,778,395.270	

US T N/B 3.0 05/15/47	3,350,000.000	3,912,826.150	
US T N/B 3.0 08/15/48	11,340,000.000	13,301,465.620	
US T N/B 3.0 09/30/25	6,360,000.000	6,898,115.590	
US T N/B 3.0 10/31/25	5,620,000.000	6,101,432.010	
US T N/B 3.0 11/15/44	7,070,000.000	8,186,010.510	
US T N/B 3.0 11/15/45	3,370,000.000	3,913,412.500	
US T N/B 3.125 02/15/42	4,040,000.000	4,756,468.740	
US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	5,595,231.230	
US T N/B 3.125 05/15/48	9,900,000.000	11,859,503.830	
US T N/B 3.125 08/15/44	7,650,000.000	9,025,505.790	
US T N/B 3.125 11/15/28	15,380,000.000	17,200,967.850	
US T N/B 3.125 11/15/41	3,780,000.000	4,442,681.250	
US T N/B 3.375 05/15/44	6,000,000.000	7,352,812.480	
US T N/B 3.375 11/15/48	10,850,000.000	13,607,425.710	
US T N/B 3.5 02/15/39	2,390,000.000	2,943,621.080	
US T N/B 3.625 02/15/44	5,280,000.000	6,703,331.230	
US T N/B 3.625 08/15/43	5,050,000.000	6,394,562.500	
US T N/B 3.75 08/15/41	3,000,000.000	3,839,296.860	
US T N/B 3.75 11/15/43	4,300,000.000	5,550,527.320	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	3,340,293.750	
US T N/B 4.25 05/15/39	3,000,000.000	4,038,515.610	
US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	4,505,603.100	
US T N/B 4.375 02/15/38	1,890,000.000	2,555,486.690	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,770,000.000	3,807,235.130	
US T N/B 4.375 05/15/41	3,500,000.000	4,841,484.370	
US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	3,696,257.790	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,910,000.000	2,582,976.560	
US T N/B 4.5 05/15/38	2,140,000.000	2,937,400.760	
US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,483,213.240	
US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	3,940,221.070	
US T N/B 4.75 02/15/41	3,470,000.000	5,008,185.930	
US T N/B 5.0 05/15/37	1,450,000.000	2,076,445.310	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,149,437.500	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	3,061,264.830	
US T N/B 5.5 08/15/28	1,600,000.000	2,036,749.980	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	2,202,119.500	
US T N/B 6.125 11/15/27	4,000,000.000	5,154,687.480	
US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,772,031.200	
US T N/B 6.25 08/15/23	2,390,000.000	2,652,993.350	
アメリカ・ドル 小計	2,093,900,000.000 (237,657,650,000)	2,157,527,625.690 (244,879,385,515)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	1,680,000.000	1,635,984.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/23	7,390,000.000	7,361,548.500
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	8,120,000.000	8,036,646.570
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	2,970,000.000	2,832,170.600

UK TREASURY 0.25 07/31/31	5,950,000.000	5,440,108.800	
UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,900,000.000	1,860,564.360	
UK TREASURY 0.375 10/22/30	4,180,000.000	3,917,119.800	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,960,000.000	2,136,886.750	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	3,610,000.000	3,608,605.090	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	5,920,000.000	5,351,047.740	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,430,000.000	1,133,166.320	
UK TREASURY 0.75 07/22/23	4,000,000.000	4,021,000.000	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	2,240,000.000	1,935,516.800	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,840,000.000	3,799,104.000	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	2,420,000.000	2,447,031.400	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,220,000.000	1,152,753.600	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,760,000.000	3,852,684.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	460,000.000	429,410.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	5,440,000.000	5,200,483.320	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,170,000.000	3,286,321.860	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,430,000.000	3,410,654.800	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,940,000.000	2,034,788.400	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	3,460,000.000	3,574,041.600	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,620,000.000	2,907,571.200	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,790,000.000	2,934,428.240	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	3,720,000.000	4,020,501.600	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	4,560,000.000	4,761,643.200	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,750,000.000	2,892,807.500	
UK TREASURY 2.25 09/07/23	4,130,000.000	4,268,948.060	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,480,000.000	4,727,336.400	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	2,560,000.000	2,719,827.960	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	2,880,000.000	3,822,624.000	

	UK TREASURY 3.5 01/22/45	4,750,000.000	6,595,278.080	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	2,890,000.000	4,991,116.700	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	3,150,000.000	4,889,997.000	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	2,990,000.000	5,253,131.000	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	4,190,000.000	5,769,822.740	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,650,000.000	4,759,261.280	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,720,000.000	3,922,670.840	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	3,280,000.000	3,949,560.150	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,190,000.000	4,667,909.110	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	3,860,000.000	6,052,055.400	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,110,000.000	5,063,702.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	3,950,000.000	6,883,270.000	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	1,390,000.000	1,915,803.640	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	4,010,000.000	6,198,218.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	4,100,000.000	5,406,246.870	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,560,000.000	5,369,563.660	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	3,650,000.000	4,186,002.500	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,958,770.470	
	イギリス・ボンド 小計	170,870,000.000 (26,348,154,000)	199,345,706.410 (30,739,107,928)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.15 07/31/23	5,060,000.000	5,059,402.920	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	660,000.000	661,059.960	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	6,460,000.000	6,333,513.200	
	ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	3,230,000.000	3,273,844.020	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,610,000.000	1,507,204.720	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	4,730,000.000	4,863,494.790	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	4,500,000.000	4,712,661.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	4,340,000.000	4,622,577.400	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,620,000.000	5,001,514.980	

	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	5,070,000.000	5,505,578.910	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	6,420,000.000	8,051,084.460	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	4,570,000.000	4,847,161.360	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	4,900,000.000	7,610,655.500	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	4,450,000.000	5,684,834.950	
イスラエル・シケル 小計		60,620,000.000 (2,131,702,300)	67,734,588.170 (2,381,886,793)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	6,850,000.000	6,792,815.160	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	5,270,000.000	5,146,644.050	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	5,540,000.000	5,173,088.560	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	6,710,000.000	6,345,992.610	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	2,960,000.000	2,816,791.550	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	5,150,000.000	5,071,080.780	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	3,430,000.000	2,843,127.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,610,000.000	3,599,106.740	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	4,220,000.000	4,478,264.000	
	AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	2,270,000.000	2,325,465.180	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	7,540,000.000	8,115,526.680	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,190,000.000	3,403,088.480	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	2,540,000.000	2,688,655.020	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,740,000.000	1,903,430.190	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	3,860,000.000	4,213,190.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,750,000.000	4,108,026.370	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,760,000.000	6,308,352.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,590,000.000	2,828,960.910	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	5,320,000.000	5,800,929.050	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	5,000,000.000	5,660,600.480	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,940,000.000	2,216,182.660	
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	2,970,000.000	3,614,040.630		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,440,000.000	6,252,095.150		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	2,890,000.000	3,712,886.720		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	3,800,000.000	4,549,706.180		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	4,010,000.000	4,340,231.520		
オーストラリア・ドル 小計		108,350,000.000 (9,026,638,500)	114,308,277.670 (9,523,022,613)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	3,650,000.000	3,639,688.750	
	CANADA 0.25 03/01/26	5,260,000.000	5,061,492.860	
	CANADA 0.25 04/01/24	8,430,000.000	8,325,619.740	
	CANADA 0.25 05/01/23	7,040,000.000	7,010,551.680	
	CANADA 0.25 08/01/23	6,270,000.000	6,230,549.160	
	CANADA 0.25 11/01/22	1,950,000.000	1,946,944.350	
	CANADA 0.5 09/01/25	6,690,000.000	6,542,820.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	8,960,000.000	8,142,516.480	

	CANADA 1.0 06/01/27	2,850,000.000	2,810,949.300	
	CANADA 1.0 09/01/26	100,000.000	99,032.400	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,200,000.000	2,223,086.800	
	CANADA 1.25 06/01/30	7,990,000.000	7,816,800.770	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,110,000.000	3,159,529.860	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,400,000.000	1,422,911.000	
	CANADA 1.5 06/01/31	2,300,000.000	2,274,690.800	
	CANADA 1.5 09/01/24	50,000.000	50,936.350	
	CANADA 1.75 03/01/23	4,490,000.000	4,568,233.760	
	CANADA 2.0 06/01/28	2,370,000.000	2,467,790.940	
	CANADA 2.0 09/01/23	6,220,000.000	6,378,460.720	
	CANADA 2.0 12/01/51	9,110,000.000	8,942,448.880	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,660,000.000	3,792,799.440	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	2,024,748.980	
	CANADA 2.5 06/01/24	20,000.000	20,901.180	
	CANADA 2.75 12/01/48	3,080,000.000	3,520,261.360	
	CANADA 2.75 12/01/64	2,190,000.000	2,531,904.990	
	CANADA 3.5 12/01/45	2,570,000.000	3,285,701.310	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,960,000.000	2,611,149.240	
	CANADA 5.0 06/01/37	1,480,000.000	2,110,807.080	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,440,000.000	1,888,319.520	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,240,000.000	3,180,999.360	
カナダ・ドル 小計		110,990,000.000 (10,082,331,600)	114,082,647.060 (10,363,267,659)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	1,700,000.000	1,668,550.000	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	940,000.000	887,830.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,050,000.000	1,098,998.250	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	2,210,000.000	2,259,769.200	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,230,000.000	1,297,035.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	780,000.000	811,590.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	1,250,000.000	1,340,625.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,780,000.000	1,975,800.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	1,080,000.000	1,191,094.200	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	2,780,000.000	2,889,254.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,530,000.000	1,670,760.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	2,200,000.000	2,412,300.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	2,620,000.000	2,789,514.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,540,000.000	1,771,770.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	2,090,000.000	2,331,395.000		
シンガポール・ドル 小計		24,780,000.000 (2,074,086,000)	26,396,284.650 (2,209,369,025)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	6,990,000.000	6,804,139.660	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	13,480,000.000	13,985,285.630	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	16,560,000.000	17,163,612.000	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	18,140,000.000	19,043,916.200	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	24,200,000.000	25,113,162.800	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	7,180,000.000	8,516,090.300	

	SWEDEN 2.5 05/12/25	12,140,000.000	13,294,057.530	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	11,120,000.000	16,183,425.280	
スウェーデン・クローナ 小計		109,810,000.000 (1,419,843,300)	120,103,689.400 (1,552,940,704)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	1,300,000.000	1,320,956.000	
	DENMARK 0.0 11/15/31	7,060,000.000	6,957,191.900	
	DENMARK 0.25 11/15/52	5,500,000.000	5,107,850.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	20,550,000.000	21,448,343.250	
	DENMARK 0.5 11/15/29	22,820,000.000	23,832,637.500	
	DENMARK 1.5 11/15/23	22,100,000.000	23,083,737.300	
	DENMARK 1.75 11/15/25	16,950,000.000	18,469,470.880	
	DENMARK 4.5 11/15/39	29,560,000.000	51,157,186.320	
デンマーク・クローネ 小計		125,840,000.000 (2,217,300,800)	151,377,373.150 (2,667,269,315)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	9,100,000.000	8,717,345.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	9,760,000.000	9,507,752.800	
	NORWAY 1.5 02/19/26	10,870,000.000	10,881,326.540	
	NORWAY 1.75 02/17/27	9,840,000.000	9,941,066.640	
	NORWAY 1.75 03/13/25	12,270,000.000	12,429,203.250	
	NORWAY 1.75 09/06/29	6,410,000.000	6,444,934.500	
	NORWAY 2.0 04/26/28	10,760,000.000	11,037,070.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	15,260,000.000	15,535,601.700	
	NORWAY 3.0 03/14/24	14,640,000.000	15,270,252.000	
ノルウェー・クローネ 小計		98,910,000.000 (1,307,590,200)	99,764,552.430 (1,318,887,383)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	100,000.000	91,468.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	7,980,000.000	7,692,086.380	
	POLAND 04/25/23	7,310,000.000	7,156,124.500	
	POLAND 1.25 10/25/30	12,000,000.000	10,882,977.950	
	POLAND 2.25 10/25/24	10,870,000.000	11,046,094.000	
	POLAND 2.5 01/25/23	660,000.000	671,824.890	
	POLAND 2.5 04/25/24	9,750,000.000	9,964,346.920	
	POLAND 2.5 07/25/26	10,300,000.000	10,536,937.060	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,190,000.000	2,229,967.500	
	POLAND 2.75 04/25/28	17,310,000.000	17,869,113.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	4,489,928.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	9,190,000.000	9,634,336.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	5,440,000.000	5,719,452.800	
ポーランド・ズロチ 小計		97,460,000.000 (2,783,438,108)	97,984,657.500 (2,798,422,221)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,490,000.000	2,284,120.820	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	3,330,000.000	3,410,553.690	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	2,110,000.000	2,151,472.050	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	3,590,000.000	3,622,208.750	
	MALAYSIA 3.757 04/20/23	3,160,000.000	3,244,573.920	

	MALAYSIA 3.757 05/22/40	2,550,000.000	2,359,886.250	
	MALAYSIA 3.795 09/30/22	2,600,000.000	2,645,087.640	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	3,070,000.000	3,167,856.860	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,150,000.000	1,112,508.030	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	3,720,000.000	3,670,272.250	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	4,200,000.000	4,359,670.980	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	5,910,000.000	6,036,107.580	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,407,882.550	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	4,240,000.000	4,348,389.660	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	4,140,000.000	4,277,070.010	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	4,810,000.000	4,954,229.280	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,840,000.000	1,922,579.200	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	2,600,000.000	2,708,278.020	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	6,120,000.000	5,725,953.570	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,480,000.000	2,591,607.190	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	3,000,000.000	3,132,224.700	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	2,200,000.000	2,216,688.100	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,030,000.000	3,207,818.880	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	3,050,000.000	3,246,433.720	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,400,000.000	2,530,161.360	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	2,000,000.000	2,096,444.200	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,730,000.000	3,949,758.170	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,430,000.000	1,534,049.370	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	3,400,000.000	3,653,798.780	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,970,000.000	2,122,866.870	
	マレーシア・リングット 小計	91,690,000.000 (2,491,565,722)	93,690,552.450 (2,545,928,334)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/09/23	29,830,000.000	30,136,354.100	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,223,000.000	21,955,555.130	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,893,000.000	64,339,913.440	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	28,524,000.000	27,106,720.020	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	69,445,000.000	70,287,367.850	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	63,590,000.000	64,692,014.700	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	33,918,000.000	33,464,477.660	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,011,000.000	16,188,802.130	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	74,910,000.000	77,471,922.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	52,126,000.000	52,397,122.950	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	80,133,000.000	82,666,132.330	

	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	67,501,000.000	71,828,428.320	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	52,783,000.000	56,073,032.990	
メキシコ・ペソ	小計	645,887,000.000 (3,511,300,087)	668,607,843.620 (3,634,819,681)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	3,820,000.000	3,818,315.380	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,960,000.000	1,942,803.330	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	2,800,000.000	2,830,926.000	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	570,000.000	511,689.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	790,000.000	825,779.100	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,630,000.000	2,755,266.900	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	3,340,000.000	3,553,305.760	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	1,230,000.000	1,239,993.750	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	3,830,000.000	4,055,893.400	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	890,000.000	756,493.770	
	AUSTRIA 07/15/23	3,130,000.000	3,170,189.200	
	AUSTRIA 07/15/24	900,000.000	916,285.500	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	4,740,000.000	5,078,199.000	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	2,220,000.000	2,667,374.400	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	450,000.000	551,115.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	2,520,000.000	2,696,591.520	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	3,720,000.000	3,908,373.360	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,420,000.000	2,197,916.460	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,960,000.000	2,481,505.040	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	380,000.000	593,757.410	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	1,380,000.000	2,794,281.960	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,260,000.000	5,125,046.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	3,580,000.000	4,445,396.980	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	60,000.000	83,085.600	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	1,990,000.000	2,025,414.040	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	2,190,000.000	2,150,137.620	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	3,100,000.000	3,118,910.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	1,060,000.000	1,006,650.200	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	2,820,000.000	2,917,287.180	
	BELGIUM 0.65 06/22/71	1,670,000.000	1,357,210.750	
	BELGIUM 0.8 06/22/25	4,720,000.000	4,959,889.280	
	BELGIUM 0.8 06/22/27	3,060,000.000	3,260,338.200	
	BELGIUM 0.8 06/22/28	3,870,000.000	4,135,482.000	
	BELGIUM 0.9 06/22/29	2,370,000.000	2,552,615.610	
	BELGIUM 1.0 06/22/26	4,340,000.000	4,636,513.140	
	BELGIUM 1.0 06/22/31	3,110,000.000	3,378,704.000	
	BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,677,077.600	
	BELGIUM 1.45 06/22/37	930,000.000	1,058,991.000	
	BELGIUM 1.6 06/22/47	1,960,000.000	2,280,320.440	
	BELGIUM 1.7 06/22/50	2,800,000.000	3,331,599.600	
	BELGIUM 1.9 06/22/38	2,380,000.000	2,883,174.840	
	BELGIUM 2.15 06/22/66	1,340,000.000	1,840,088.000	
	BELGIUM 2.25 06/22/23	3,140,000.000	3,298,246.580	

BELGIUM 2.25 06/22/57	610,000.000	834,709.970	
BELGIUM 2.6 06/22/24	3,780,000.000	4,114,901.950	
BELGIUM 3.0 06/22/34	2,140,000.000	2,847,834.960	
BELGIUM 3.75 06/22/45	2,230,000.000	3,651,446.600	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,950,000.000	2,730,698.100	
BELGIUM 4.25 03/28/41	4,270,000.000	7,058,643.060	
BELGIUM 4.5 03/28/26	2,590,000.000	3,177,751.290	
BELGIUM 5.0 03/28/35	4,430,000.000	7,136,650.260	
BELGIUM 5.5 03/28/28	4,660,000.000	6,431,196.100	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	5,100,000.000	5,229,438.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	4,910,000.000	5,020,008.550	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,500,000.000	1,538,370.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	6,960,000.000	7,128,640.800	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,000,000.000	1,026,470.000	
BUNDESOBL 04/05/24	6,080,000.000	6,187,281.600	
BUNDESOBL 04/14/23	5,060,000.000	5,115,108.460	
BUNDESOBL 10/07/22	3,790,000.000	3,816,874.890	
BUNDESOBL 10/13/23	3,940,000.000	3,997,681.600	
BUNDESOBL 10/18/24	5,540,000.000	5,653,464.740	
BUNDESSCHAT 0.0 03/10/23	3,570,000.000	3,605,626.810	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/22	3,000,000.000	3,025,369.500	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	6,690,000.000	6,833,166.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	4,670,000.000	4,743,319.000	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	5,640,000.000	5,583,092.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,980,000.000	2,924,780.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	7,110,000.000	7,245,801.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,320,000.000	2,376,561.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,610,000.000	2,641,815.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	6,810,000.000	6,153,642.660	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	300,000.000	274,578.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,990,000.000	2,041,242.500	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,000,000.000	2,048,291.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,650,000.000	7,956,688.500	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	6,540,000.000	6,825,863.400	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	6,430,000.000	6,707,390.200	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	7,100,000.000	7,378,533.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,490,000.000	6,797,041.900	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	9,550,000.000	10,110,298.500	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	8,260,000.000	8,725,855.740	
DEUTSCHLAND 08/15/26	5,680,000.000	5,829,349.920	
DEUTSCHLAND 08/15/29	7,680,000.000	7,856,417.280	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	3,400,000.000	3,565,403.200	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,350,000.000	6,749,669.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	7,430,000.000	9,227,027.230	
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	5,050,000.000	5,201,823.200	

DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	7,790,000.000	8,067,105.880	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	4,390,000.000	4,643,768.340	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	6,070,000.000	6,426,521.450	
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	6,230,000.000	6,548,265.780	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	6,650,000.000	10,046,155.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	6,180,000.000	9,534,347.630	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	5,020,000.000	8,176,977.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	5,760,000.000	9,233,061.120	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	3,990,000.000	6,905,173.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,380,000.000	3,221,568.000	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,840,000.000	9,454,142.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,980,000.000	9,260,658.600	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	5,340,000.000	8,217,352.200	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	890,000.000	1,232,739.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,365,260.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,168,516.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,348,404.100	
FINLAND 0.0 09/15/24	2,230,000.000	2,270,652.900	
FINLAND 0.0 09/15/30	1,280,000.000	1,279,695.360	
FINLAND 0.125 04/15/36	1,370,000.000	1,323,652.900	
FINLAND 0.125 04/15/52	1,740,000.000	1,492,467.600	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	180,593.100	
FINLAND 0.25 09/15/40	580,000.000	555,475.280	
FINLAND 0.5 04/15/26	2,170,000.000	2,267,472.060	
FINLAND 0.5 09/15/27	1,620,000.000	1,700,057.160	
FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	94,439.520	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,560,000.000	1,634,287.200	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	1,047,420.080	
FINLAND 0.875 09/15/25	160,000.000	168,959.200	
FINLAND 09/15/23	2,050,000.000	2,076,842.280	
FINLAND 1.125 04/15/34	540,000.000	599,176.980	
FINLAND 1.375 04/15/47	880,000.000	1,055,445.600	
FINLAND 1.5 04/15/23	900,000.000	930,060.000	
FINLAND 2.0 04/15/24	1,220,000.000	1,302,922.180	
FINLAND 2.625 07/04/42	580,000.000	827,930.860	
FINLAND 2.75 07/04/28	1,470,000.000	1,771,893.900	
FINLAND 4.0 07/04/25	1,500,000.000	1,760,179.500	
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	1,480,000.000	1,689,750.040	
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	4,660,000.000	4,703,105.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	5,490,000.000	5,570,236.350	

FRANCE OAT 0.0 02/25/26	5,050,000.000	5,146,449.950	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,000,000.000	4,065,280.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	15,760,000.000	15,759,416.880	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	11,680,000.000	11,560,864.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	5,570,000.000	5,451,704.340	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	8,000,000.000	8,253,136.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	11,200,000.000	11,622,217.600	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,220,000.000	9,615,224.520	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	11,050,000.000	11,522,586.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	4,460,000.000	4,323,871.880	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	2,000,000.000	1,511,982.000	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,360,000.000	1,285,420.320	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	11,660,000.000	12,388,610.080	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	6,860,000.000	6,452,817.840	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,100,000.000	1,024,619.200	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	8,980,000.000	9,544,752.200	
FRANCE OAT 03/25/23	10,160,000.000	10,262,284.770	
FRANCE OAT 03/25/24	9,810,000.000	9,960,191.100	
FRANCE OAT 03/25/25	11,000,000.000	11,205,733.000	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,780,000.000	9,428,227.400	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	9,000,000.000	9,554,094.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	7,020,000.000	7,769,363.940	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	10,080,000.000	11,150,496.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,910,000.000	14,591,217.660	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	7,730,000.000	8,858,641.840	
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	9,640,000.000	10,019,722.480	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	3,310,000.000	4,090,339.120	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	6,940,000.000	8,325,085.200	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	9,090,000.000	9,757,633.230	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	6,760,000.000	8,592,298.000	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	13,080,000.000	14,069,593.560	
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	8,150,000.000	8,399,456.820	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	11,550,000.000	14,020,383.300	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,550,000.000	5,390,612.500	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,450,000.000	9,924,357.000	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	10,550,000.000	12,447,417.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,030,000.000	7,507,890.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,520,000.000	6,847,392.640	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	4,750,000.000	7,434,229.750	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	11,620,000.000	12,794,061.560	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	8,630,000.000	14,747,375.500	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	6,130,000.000	9,685,056.720	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	3,720,000.000	5,298,660.120	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,090,000.000	12,990,210.080	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,810,044.920	
IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	907,454.010	
IRISH 0.2 05/15/27	140,000.000	143,986.500	
IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,669,951.700	
IRISH 0.4 05/15/35	300,000.000	297,108.900	

IRISH 0.55 04/22/41	990,000.000	958,637.790	
IRISH 0.9 05/15/28	2,700,000.000	2,894,408.100	
IRISH 1.0 05/15/26	4,340,000.000	4,628,544.900	
IRISH 1.1 05/15/29	2,280,000.000	2,478,287.040	
IRISH 1.3 05/15/33	1,740,000.000	1,933,623.720	
IRISH 1.35 03/18/31	1,420,000.000	1,583,517.260	
IRISH 1.5 05/15/50	680,000.000	771,627.280	
IRISH 1.7 05/15/37	3,000,000.000	3,518,934.000	
IRISH 2.0 02/18/45	2,060,000.000	2,596,984.320	
IRISH 2.4 05/15/30	2,610,000.000	3,142,698.390	
IRISH 3.4 03/18/24	1,930,000.000	2,121,836.780	
IRISH 3.9 03/20/23	2,320,000.000	2,472,537.680	
IRISH 5.4 03/13/25	930,000.000	1,120,887.150	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	4,750,000.000	4,783,725.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	4,700,000.000	4,731,020.000	
ITALY BTPS 0.05 01/15/23	4,100,000.000	4,127,345.350	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,610,000.000	1,590,680.000	
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	3,710,000.000	3,759,343.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	5,200,000.000	5,283,798.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	4,100,000.000	4,177,818.000	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	2,000,000.000	2,000,000.000	
ITALY BTPS 0.6 06/15/23	4,500,000.000	4,581,810.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	4,920,000.000	4,779,712.350	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,840,000.000	3,921,331.200	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	4,800,000.000	4,953,600.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	5,770,000.000	5,787,183.060	
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	4,070,000.000	4,149,265.280	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,450,000.000	3,254,385.000	
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	2,210,000.000	2,253,824.300	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	4,750,000.000	4,816,025.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	5,100,000.000	5,283,090.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	2,750,000.000	2,747,571.750	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	6,030,000.000	6,356,005.920	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,930,000.000	6,231,736.190	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	4,100,000.000	4,188,150.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	6,120,000.000	6,459,841.760	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,690,000.000	4,925,475.520	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	2,130,000.000	2,048,421.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,010,000.000	4,241,040.160	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	5,790,000.000	6,203,406.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	6,410,000.000	6,841,687.860	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	5,570,000.000	5,973,758.160	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	2,000,000.000	1,923,610.400	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,630,000.000	4,880,279.280	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	3,510,000.000	3,633,903.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	4,600,000.000	4,854,380.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,670,000.000	4,999,702.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	5,660,000.000	6,224,551.040	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	3,110,000.000	3,367,029.680	

ITALY BTPS 2.05 08/01/27	5,500,000.000	6,048,416.540	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	4,540,000.000	4,965,466.100	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	1,336,668.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,000,000.000	1,107,600.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	4,130,000.000	4,651,206.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	5,850,000.000	6,710,759.050	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	3,480,000.000	3,942,840.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	3,580,000.000	3,782,291.480	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,550,000.000	3,914,162.550	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	5,790,000.000	6,275,312.580	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	4,030,000.000	4,794,894.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	2,400,000.000	2,789,280.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	5,660,000.000	6,562,288.900	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	4,330,000.000	5,314,209.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,790,000.000	5,658,379.100	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	3,500,000.000	4,376,785.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	3,980,000.000	5,178,067.560	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	4,170,000.000	5,253,516.120	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	4,000,000.000	5,389,768.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,860,000.000	7,198,307.370	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	5,300,000.000	5,907,830.500	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	2,660,000.000	3,838,071.440	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	5,720,000.000	7,791,212.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	5,190,000.000	5,786,133.250	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,500,000.000	7,769,450.000	
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	5,480,000.000	5,904,995.920	
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,830,000.000	6,379,360.900	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	5,660,000.000	7,287,466.770	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	3,450,000.000	5,454,636.300	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,820,000.000	4,484,867.180	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,950,000.000	5,738,560.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,220,000.000	6,545,642.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,670,000.000	5,750,890.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	6,940,000.000	9,470,324.000	
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	5,560,000.000	5,910,246.640	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,690,000.000	5,546,070.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,348,520.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,649,160.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	2,150,000.000	2,918,625.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,700,000.000	2,026,740.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	4,060,000.000	4,146,904.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	970,000.000	924,023.940	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	2,540,000.000	2,217,315.860	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	2,640,000.000	2,659,580.880	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	2,480,000.000	2,480,605.120	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	380,000.000	391,951.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	2,920,000.000	3,016,360.000	

NETHERLANDS 0.5 01/15/40	2,970,000.000	3,087,829.970	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	6,450,000.000	6,754,117.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	5,480,000.000	5,840,792.240	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	3,660,000.000	3,918,597.300	
NETHERLANDS 01/15/24	8,630,000.000	8,765,266.620	
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	4,240,000.000	4,426,080.010	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	2,350,000.000	2,524,414.650	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,620,000.000	4,612,260.100	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	3,920,000.000	6,195,912.800	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	3,320,000.000	5,575,100.040	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	4,220,000.000	6,622,446.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	680,000.000	931,464.000	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	90,000.000	99,351.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	4,920,000.000	4,989,864.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	2,690,000.000	2,722,019.070	
SPAIN 0.0 04/30/23	3,430,000.000	3,462,070.500	
SPAIN 0.0 05/31/24	3,200,000.000	3,239,201.910	
SPAIN 0.1 04/30/31	4,890,000.000	4,735,720.500	
SPAIN 0.25 07/30/24	2,470,000.000	2,520,681.930	
SPAIN 0.35 07/30/23	6,240,000.000	6,343,763.710	
SPAIN 0.45 10/31/22	4,320,000.000	4,368,152.880	
SPAIN 0.5 04/30/30	6,040,000.000	6,149,342.120	
SPAIN 0.5 10/31/31	3,000,000.000	2,997,918.000	
SPAIN 0.6 10/31/29	7,030,000.000	7,245,792.880	
SPAIN 0.8 07/30/27	5,720,000.000	6,015,152.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,300,000.000	1,278,872.400	
SPAIN 1.0 10/31/50	3,340,000.000	3,045,204.920	
SPAIN 1.2 10/31/40	4,110,000.000	4,186,651.500	
SPAIN 1.25 10/31/30	6,970,000.000	7,518,539.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	6,490,000.000	6,990,606.150	
SPAIN 1.4 04/30/28	5,310,000.000	5,785,829.100	
SPAIN 1.4 07/30/28	6,200,000.000	6,771,020.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	10,430,000.000	11,448,103.590	
SPAIN 1.45 10/31/27	5,390,000.000	5,880,603.190	
SPAIN 1.45 10/31/71	1,460,000.000	1,284,040.800	
SPAIN 1.5 04/30/27	4,340,000.000	4,736,025.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	5,130,000.000	5,501,378.650	
SPAIN 1.85 07/30/35	4,900,000.000	5,579,326.200	
SPAIN 1.95 04/30/26	5,170,000.000	5,694,641.260	
SPAIN 1.95 07/30/30	5,660,000.000	6,468,236.680	
SPAIN 2.15 10/31/25	5,460,000.000	6,018,836.460	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,290,000.000	1,538,325.000	
SPAIN 2.7 10/31/48	3,020,000.000	3,990,069.300	
SPAIN 2.75 10/31/24	5,850,000.000	6,431,665.500	

	SPAIN 2.9 10/31/46	4,000,000.000	5,438,608.000	
	SPAIN 3.45 07/30/66	3,450,000.000	5,260,508.250	
	SPAIN 3.8 04/30/24	4,470,000.000	4,963,038.760	
	SPAIN 4.2 01/31/37	5,260,000.000	7,819,742.180	
	SPAIN 4.4 10/31/23	4,600,000.000	5,070,653.600	
	SPAIN 4.65 07/30/25	5,310,000.000	6,337,431.900	
	SPAIN 4.7 07/30/41	4,510,000.000	7,463,418.600	
	SPAIN 4.8 01/31/24	3,840,000.000	4,313,856.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	4,720,000.000	7,896,560.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	700,000.000	951,020.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	3,530,000.000	6,398,520.360	
	SPAIN 5.4 01/31/23	5,480,000.000	5,906,946.800	
	SPAIN 5.75 07/30/32	5,510,000.000	8,551,690.810	
	SPAIN 5.9 07/30/26	5,590,000.000	7,250,263.540	
	SPAIN 6.0 01/31/29	820,000.000	1,173,917.740	
	ユーロ 小計	1,395,590,000.000 (182,989,760,800)	1,596,866,562.640 (209,381,143,693)	
国債証券 合計		484,041,361,416.800 (484,041,361,417)	523,995,450,864 (523,995,450,864)	
合計			523,995,450,864 (523,995,450,864)	

(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 244銘柄	46.90	46.73
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	5.89	5.87
イスラエル・シケル	国債証券 14銘柄	0.46	0.45
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.82	1.82
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	1.98	1.98
シンガポール・ドル	国債証券 15銘柄	0.42	0.42
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.30	0.30
デンマーク・クローネ	国債証券 8銘柄	0.51	0.51
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.25	0.25
ポーランド・ズロチ	国債証券 13銘柄	0.54	0.53
マレーシア・リングギット	国債証券 30銘柄	0.49	0.49
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.70	0.69
ユーロ	国債証券 332銘柄	40.10	39.96

(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12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,083,250,513
コール・ローン	313,538,838
株式	55,905,415,511
投資信託受益証券	360,701,664
投資証券	51,837,994
派生商品評価勘定	34,660,639
未収入金	27,035,012
未収配当金	74,683,074
差入委託証拠金	2,841,490,613
流動資産合計	63,692,613,858
資産合計	
63,692,613,858	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	166,352,929
未払金	192,066
未払解約金	11,035,000
流動負債合計	177,579,995
負債合計	
177,579,995	
純資産の部	
元本等	
元本	43,320,766,854
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	20,194,267,009
元本等合計	63,515,033,863
純資産合計	
63,515,033,863	
負債純資産合計	
63,692,613,858	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,475,042,418円
同期中追加設定元本額	59,514,775,309円
同期中一部解約元本額	59,669,050,873円

元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金>	7,745,605,153円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし>(ファン ドラップ)	340,036,428円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,331,193円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	9,322,518円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	17,842,965円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,789,251円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,353,476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	8,209,018,464円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,589,347,439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)	242,432,368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)	259,558,134円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	400,879円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,630,464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)	4,940,628円
たわらノーロード 全世界株式	79,390,540円
O n e D C 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
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	329,145,943円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	440,413,913円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	867,743,249円
投資のソムリエ	8,904,846,709円
クルーズコントロール	509,400,750円
投資のソムリエ< D C 年金>	381,656,777円
D I A M 8資産バランスファンドN< D C 年金>	354,164,633円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	9,795,675円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	27,184,380円
投資のソムリエ< D C 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(D C)	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< D C 年金>	312,569,995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V A(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)	2,264,542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)	270,900,825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)	131,656,873円
計	43,320,766,854円
2. 受益権の総数	43,320,766,854口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
株式	2,413,808,012	
投資信託受益証券	24,698,085	
投資証券	3,012,737	
合計	2,441,518,834	

(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12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,595,644	-	1,612,620	16,976
ブラジル・リアル	1,595,644	-	1,612,620	16,976
買建	204,166,804	-	206,370,983	2,204,179
アメリカ・ドル	204,166,804	-	206,370,983	2,204,179
合計	205,762,448	-	207,983,603	2,187,203

(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12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	7,363,988,392	-	7,230,108,899	133,879,493
合計	7,363,988,392	-	7,230,108,899	133,879,493

(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12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4662円 (14,662円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2021年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	31,008	31.650	981,403.200	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,584	7.610	141,424.240	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.590	135,333.900	
	CREDICORP LTD	4,299	128.790	553,668.210	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR	35,762	9.530	340,811.860	
	NETEASE INC-ADR	24,534	96.000	2,355,264.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,706	58.980	336,539.880	
	YPF SA ADR	4,248	4.770	20,262.960	
	LUKOIL SPON ADR	26,074	101.200	2,638,688.800	
	GAZPROM PAO ADR	373,371	10.280	3,838,253.880	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	128,421	2.800	359,578.800	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.920	88,676.960	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	53,984	5.125	276,668.000	
51JOB INC ADR	2,101	69.190	145,368.190		

X5 RETAIL GROUP NV GDR	9,970	33.750	336,487.500	
NOVATEK PJSC GDR	5,665	266.700	1,510,855.500	
BAIDU INC -SPON ADR	17,099	162.160	2,772,773.840	
NOVOLIPETSK STEEL GDR	10,730	30.960	332,200.800	
MMC NORILSK NICKEL ADR	39,954	31.550	1,260,548.700	
ROSNEFT OIL CO GDR	82,771	8.954	741,131.530	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	92,139	2.240	206,391.360	
SEVERSTAL GDR	15,471	22.340	345,622.140	
TATNEFT ADR	14,663	47.300	693,559.900	
VTB BANK OJSC GDR	112,000	1.538	172,256.000	
MAGNIT PJSC GDR	24,369	17.735	432,184.210	
VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,455	11.180	340,486.900	
21VIANET GROUP INC ADR	8,615	16.860	145,248.900	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	4.870	119,938.360	
MAIL.RU GROUP LTD GDR	9,858	20.380	200,906.040	
YANDEX NV	18,811	77.900	1,465,376.900	
NOAH HOLDINGS LTD ADR	1,716	36.390	62,445.240	
SBERBANK ADR	171,838	21.560	3,704,827.280	
PHOSAGRO PJSC GDR	11,773	24.300	286,083.900	
ADECOAGRO SA	5,000	8.860	44,300.000	
HUAZHU GROUP LTD ADR	10,564	50.350	531,897.400	
JOYY INC-ADR	3,647	56.700	206,784.900	
DAQO NEW ENERGY CORP ADR	3,303	61.410	202,837.230	
GDS HOLDINGS LTD ADR	5,777	57.770	333,737.290	
ZAI LAB LTD ADR	5,172	101.700	525,992.400	
TCS GROUP HOLDING PLC GDR	7,429	100.150	744,014.350	
HUYA INC ADR	4,204	9.420	39,601.680	
360 DIGITECH INC ADR	5,813	21.390	124,340.070	
BILIBILI INC ADR	10,935	70.560	771,573.600	
NIO INC ADR	84,613	35.640	3,015,607.320	
TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	46,711	7.660	357,806.260	
AUTOHOME INC ADR	4,096	50.230	205,742.080	
UP FINTECH HOLDING LTD ADR	5,517	10.670	58,866.390	
GAOTU TECHEDU INC ADR	4,275	4.010	17,142.750	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNOLOGY CO LTD ADR	7,893	3.840	30,309.120	
I-MAB ADR	2,148	67.300	144,560.400	
WEIBO CORP ADR	4,386	48.110	211,010.460	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	28.190	82,061.090	
BURNING ROCK BIOTECH LTD ADR	2,868	16.380	46,977.840	
RLX TECHNOLOGY INC ADR	36,000	4.870	175,320.000	

	DIDI GLOBAL INC ADR	18,000	8.380	150,840.000	
	KE HOLDINGS INC ADR	24,318	20.520	499,005.360	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	9.160	58,037.760	
	DADA NEXUS LTD ADR	4,179	20.130	84,123.270	
	JD.COM INC ADR	53,917	78.000	4,205,526.000	
	AGORA INC ADR	3,131	27.710	86,760.010	
	LI AUTO INC ADR	33,077	28.220	933,432.940	
	XPENG INC ADR	23,630	37.420	884,234.600	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	2,945	48.200	141,949.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	11,272	7.420	83,638.240	
	GLOBANT SA	2,499	267.950	669,607.050	
	HELLO GROUP INC ADR	12,641	11.940	150,933.540	
	BAOZUN INC-SPN ADR	4,490	18.980	85,220.200	
	PINDUODUO INC ADR	27,210	94.830	2,580,324.300	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	25,809	59.190	1,527,634.710	
	IQIYI INC ADR	15,440	9.000	138,960.000	
	POLYUS PJSC GDR	5,259	85.300	448,592.700	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	6,136	32.630	200,217.680	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	26,464	31.330	829,117.120	
	BEIGENE LTD ADR	2,832	363.530	1,029,516.960	
アメリカ・ドル	小計	2,104,062		49,999,421.950 (5,674,934,391)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	5.610	641,049.090	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	99,831	4.920	491,168.520	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	107,901	24.700	2,665,154.700	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	176,404	7.630	1,345,962.520	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	271,412	17.720	4,809,420.640	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	202,262	3.970	802,980.140	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	224,384	4.110	922,218.240	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	153,780	13.100	2,014,518.000	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	159,897	4.300	687,557.100	
アラブ首長国連邦・ディルハム	小計	1,510,140		14,380,028.950 (445,061,896)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	22,504	12.700	285,800.800	
イギリス・ポンド	小計	22,504		285,800.800 (44,070,483)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	177,831	2,652.650	471,723,402.150	

BHARAT PETROLEUM CORP LTD	50,649	454.400	23,014,905.600	
ASIAN PAINTS LTD	23,422	3,306.050	77,434,303.100	
EICHER MOTORS LTD	8,743	2,851.750	24,932,850.250	
GRASIM INDUSTRIES LTD	14,918	1,651.750	24,640,806.500	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	52,685	895.600	47,184,686.000	
SHREE CEMENT LTD	756	28,022.450	21,184,972.200	
ICICI BANK LTD	317,600	713.300	226,544,080.000	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	37,298	319.050	11,899,926.900	
STATE BANK OF INDIA LTD	108,404	469.250	50,868,577.000	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,888	687.600	12,987,388.800	
TATA STEEL LTD	42,591	1,313.200	55,930,501.200	
TATA MOTORS LTD	99,865	415.750	41,518,873.750	
JSW STEEL LTD	56,966	672.400	38,303,938.400	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	37,935	816.250	30,964,443.750	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	6,220	3,840.600	23,888,532.000	
NESTLE INDIA LTD	1,991	19,084.650	37,997,538.150	
GAIL INDIA LTD	119,463	158.750	18,964,751.250	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	34,219	1,975.400	67,596,212.600	
VEDANTA LTD	77,294	297.750	23,014,288.500	
AXIS BANK LTD	139,811	787.150	110,052,228.650	
TITAN COMPANY LTD	21,784	2,362.400	51,462,521.600	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	155,474	165.000	25,653,210.000	
COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	6,531	1,697.100	11,083,760.100	
BHARAT ELECTRONICS LTD	82,654	208.600	17,241,624.400	
LUPIN LTD	17,003	958.500	16,297,375.500	
ACC LTD	5,706	2,249.850	12,837,644.100	
BAJAJ FINANCE LTD	16,713	7,817.100	130,647,192.300	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	106,400	2,749.250	292,520,200.000	
INFOSYS LTD	211,991	1,690.950	358,466,181.450	
WIPRO LTD	83,147	652.800	54,278,361.600	
MRF LTD	160	84,932.900	13,589,264.000	
INDIAN OIL CORP LTD	125,755	131.550	16,543,070.250	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	50,910	2,645.100	134,662,041.000	
TRENT LTD	9,385	1,103.150	10,353,062.750	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	5,713	4,377.150	25,006,657.950	
HCL TECHNOLOGIES LTD	66,381	1,302.900	86,487,804.900	
DABUR INDIA LTD	39,316	608.650	23,929,683.400	
HERO MOTOCORP LTD	7,629	2,857.800	21,802,156.200	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,603.400	16,549,813.800	

DR REDDYS LABORATORIES LTD	6,974	4,894.350	34,133,196.900	
IPCA LABORATORIES LTD	5,552	2,357.650	13,089,672.800	
BHARTI AIRTEL LTD	153,370	690.850	105,955,664.500	
UNITED SPIRITS LTD	16,044	895.800	14,372,215.200	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	50,456	832.550	42,007,142.800	
DIVI'S LABORATORIES LTD	7,881	5,143.050	40,532,377.050	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,311	7,700.800	64,001,348.800	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,868	720.550	13,595,337.400	
HAVELLS INDIA LTD	14,378	1,382.150	19,872,552.700	
INDRAPRASTHA GAS LTD	22,037	514.450	11,336,934.650	
BIOCON LTD	21,168	360.100	7,622,596.800	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	88,501	240.600	21,293,340.600	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,071	1,334.900	18,783,377.900	
PETRONET LNG LTD	52,703	230.350	12,140,136.050	
CIPLA LTD/INDIA	30,575	913.750	27,937,906.250	
LARSEN & TOUBRO LTD	42,199	1,716.900	72,451,463.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	5,984	7,330.250	43,864,216.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	57,472	3,685.600	211,818,803.200	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,203	1,539.750	26,488,319.250	
NTPC LTD	292,756	144.800	42,391,068.800	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	5,805	2,754.350	15,989,001.750	
YES BANK LTD	714,850	13.050	9,328,792.500	
AMBUJA CEMENTS LTD	48,819	402.950	19,671,616.050	
BHARAT FORGE LTD	18,024	794.000	14,311,056.000	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	91,923	487.500	44,812,462.500	
ITC LTD	181,602	238.050	43,230,356.100	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8,676	2,462.750	21,366,819.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	31,183	742.450	23,151,818.350	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,929	3,167.200	12,443,928.800	
SIEMENS INDIA LTD	3,637	2,236.750	8,135,059.750	
INFO EDGE INDIA LTD	4,882	6,632.250	32,378,644.500	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	25,397	1,024.650	26,023,036.050	
TECH MAHINDRA LTD	37,689	1,400.200	52,772,137.800	
MARICO LTD	37,095	570.350	21,157,133.250	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	37,266.800	14,086,850.400	
DLF LTD	33,709	424.850	14,321,268.650	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	188,388	193.450	36,443,658.600	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	31,292	737.450	23,076,285.400	
REC LTD	45,037	159.200	7,169,890.400	
BAJAJ FINSERV LTD	2,291	17,713.950	40,582,659.450	

	BAJAJ AUTO LTD	4,914	3,852.100	18,929,219.400	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	5,592	4,064.150	22,726,726.800	
	MUTHOOT FINANCE LTD	8,810	1,533.750	13,512,337.500	
	COAL INDIA LTD	100,287	196.850	19,741,495.950	
	INDUS TOWERS LTD	37,374	303.700	11,350,483.800	
	PI INDUSTRIES LTD	6,020	3,254.550	19,592,391.000	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	3,823	5,879.150	22,475,990.450	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	23,447	1,162.100	27,247,758.700	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	55,353	717.300	39,704,706.900	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,012	2,914.200	11,691,770.400	
	BANDHAN BANK LTD	38,990	326.500	12,730,235.000	
	ADANI TOTAL GAS LTD	16,897	1,415.200	23,912,634.400	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,249	570.350	15,541,467.150	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	16,624	1,126.850	18,732,754.400	
	BHARTI AIRTEL LTD-RTS	11,863	204.200	2,422,424.600	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	12,556	824.000	10,346,144.000	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	16,803	1,696.700	28,509,650.100	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	9,719	4,719.450	45,868,334.550	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	16,026	1,536.600	24,625,551.600	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	27,604	661.500	18,260,046.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	4,893	2,048.200	10,021,842.600	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	26,396	1,206.100	31,836,215.600	
インド・ルピー	小計	5,362,919		4,533,979,159.000 (6,846,308,530)	
インドネシ ア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,420.000	1,383,514,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,470,900	925.000	1,360,582,500.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	133,301	26,350.000	3,512,481,350.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,625.000	2,337,962,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	480,500	4,830.000	2,320,815,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,306,700	5,775.000	7,546,192,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	2,985,200	3,810.000	11,373,612,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	392,800	6,300.000	2,474,640,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	33,850.000	1,096,740,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	67,800	10,025.000	679,695,000.000	

	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	8,675.000	1,655,190,000.000	
	BANK MANDIRI	1,183,100	6,900.000	8,163,390,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,140,500	4,180.000	17,307,290,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	572,200	6,400.000	3,662,080,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	959,700	1,360.000	1,305,192,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	149,800	7,875.000	1,179,675,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	678,100	36,275.000	24,598,077,500.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	1,915.000	1,788,801,500.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,850.000	1,460,250,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	2,870.000	1,530,571,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,235.000	2,122,100,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	825,100	3,090.000	2,549,559,000.000	
	インドネシア・ルピア 小計	19,844,201		101,408,411,350.000 (811,267,291)	
オフショア・ 人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	101.010	892,120.320	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	11.480	68,191.200	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	37.060	111,180.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	12.250	147,000.000	
	JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	5,200	158.000	821,600.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	7,540	24.810	187,067.400	
	WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	8.190	133,497.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.800	225,380.000	
	SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	23.370	93,480.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	165.780	198,936.000	
	JOYOUNG CO LTD	5,100	22.220	113,322.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	3,900	38.420	149,838.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	28.840	216,300.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	295.600	620,760.000	

ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	23.600	243,788.000	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LTD	6,600	16.670	110,022.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	45.900	243,270.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	14.900	87,910.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	21.030	401,673.000	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTICAL CO LTD	23,800	3.500	83,300.000	
SUOFEIYA HOME COLLECTION CO LTD	6,600	17.350	114,510.000	
GEM CO LTD	29,100	11.500	334,650.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	127.100	330,460.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	57.930	399,717.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	7.380	137,268.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	6,500	139.010	903,565.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	23.850	204,346.800	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	34.400	203,097.600	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	27.000	187,920.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	16.790	44,661.400	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	22.700	149,820.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	39.630	134,742.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	33.100	168,810.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	14.970	22,455.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	13.390	34,814.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	65.860	302,956.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	3,000	46.250	138,750.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	13.730	151,030.000	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	8,400	20.850	175,140.000	

MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	16,800	55.170	926,856.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	7,200	142.600	1,026,720.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	17.320	311,760.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	16.000	163,200.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	13.560	151,872.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	8.530	267,842.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.630	65,128.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	5.030	71,929.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	14.390	39,284.700	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	18.570	48,282.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	28.750	224,250.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	19.950	1,002,487.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	27.720	166,320.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	199.900	639,680.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	29.390	104,922.300	
JILIN AODONG PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	14,900	16.960	252,704.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.060	127,762.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	8.520	73,272.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	9.120	334,704.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	23,381	51.440	1,202,718.640	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	37.790	408,132.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	65.820	36,859.200	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	27.300	188,370.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.480	247,536.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	35.170	172,333.000	

GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.480	160,344.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	7.940	166,740.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	33.400	250,500.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	50.750	253,750.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	23.620	155,892.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	4,800	224.500	1,077,600.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	64.010	710,511.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.160	121,992.000	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.760	155,052.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	15,300	46.100	705,330.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	14.650	87,021.000	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,320	25.990	138,266.800	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	4.840	77,440.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	119.960	251,916.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	9.090	331,603.200	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.180	131,274.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	37.570	1,151,670.780	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.580	180,950.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	44,500	7.530	335,085.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	15.110	300,689.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	24.040	574,556.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.740	29,412.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	54.500	735,750.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.750	287,925.000	
GOERTEK INC	8,700	42.810	372,447.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.780	165,714.000	

BANK OF NINGBO CO LTD	19,100	37.600	718,160.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	14,600	21.130	308,498.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	6.470	306,678.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.710	218,193.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	7.370	277,112.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	17,360	17.750	308,140.000	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	8.270	187,729.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	8,200	27.550	225,910.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	97.020	368,676.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	45,508	34.410	1,565,930.280	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,600	180.500	1,371,800.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,900	227.800	3,622,020.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	6.870	142,896.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	5.120	121,344.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,600	5.220	655,632.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	18,800	12.830	241,204.000	
MIDEA GROUP CO LTD	14,100	71.080	1,002,228.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	17,000	12.230	207,910.000	
PING AN BANK CO LTD	83,400	19.400	1,617,960.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	9,280	15.150	140,592.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	70,200	5.370	376,974.000	
CHINA VANKE CO LTD	41,300	22.100	912,730.000	
ZTE CORP	24,300	34.600	840,780.000	
ZOONLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	8.210	233,985.000	
WEICHAI POWER CO LTD	17,000	17.240	293,080.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	38.810	163,002.000	
GF SECURITIES CO LTD	17,600	20.800	366,080.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	15.940	336,334.000	

BYD CO LTD	7,700	255.750	1,969,275.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	6.570	224,037.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	4,830	137.760	665,380.800	
LB GROUP CO LTD	11,000	30.120	331,320.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	24.620	440,698.000	
NANJI E-COMMERCE CO LTD	12,900	6.730	86,817.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	47.300	137,170.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	37.120	296,960.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	1,500	337.600	506,400.000	
JIANGXI ZHENGHANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	10.300	37,080.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	15.760	87,468.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	1,200	245.630	294,756.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	11.730	182,988.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	62.500	412,500.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	50.000	30,000.000	
NINESTAR CORP	5,700	37.200	212,040.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	18.320	128,606.400	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	4.150	140,270.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	10.870	130,440.000	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	70.520	473,894.400	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	97.510	156,016.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	500	412.000	206,000.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	2,300	250.400	575,920.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	7.890	119,139.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	16.770	88,881.000	
SF HOLDING CO LTD	15,000	68.580	1,028,700.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	138.510	249,318.000	

FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	7.150	168,740.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	125.030	312,575.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	7.520	479,700.800	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	11.980	466,022.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	147.800	339,940.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	29.860	406,096.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	166.540	489,627.600	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	16,400	26.330	431,812.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	128.720	399,032.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.480	280,800.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	45.770	71,401.200	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	31.490	163,748.000	
ZHEJIANG SATELLITE PETROCHEMICAL CO LTD	10,200	40.110	409,122.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	82.570	260,095.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,300	254.000	838,200.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	78.110	210,897.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	67.800	210,180.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	132.560	278,376.000	
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	23,600	6.490	153,164.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	104.000	449,280.000	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	16.260	154,470.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	35.600	106,800.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	18.300	142,740.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	94.820	79,648.800	
ZHEJIANG WOLWO BIO- PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	58.690	158,463.000	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH CO LTD	2,080	42.130	87,630.400	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	57.920	77,033.600	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	87.790	114,127.000	

WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	67.280	201,840.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	107.020	214,040.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	10.780	136,906.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	12.690	342,630.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	103.470	196,593.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	10.100	98,980.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	12.130	174,672.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,600	365.880	1,683,048.000	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY CO LTD	5,300	11.380	60,314.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.690	150,195.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	232.000	278,400.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	79.130	321,267.800	
SG MICRO CORP	900	333.800	300,420.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	8,600	521.000	4,480,600.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	147.350	503,347.600	
WUXI APPTTEC CO LTD	10,872	141.860	1,542,301.920	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,500	98.410	344,435.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,600	318.300	509,280.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	15.770	572,451.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	196.500	648,450.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.210	516,201.590	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	234.470	890,986.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	1,700	273.730	465,341.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.600	464,760.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	4.320	352,944.000	

AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	32.630	349,141.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	178.460	160,614.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	5.010	870,237.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.220	562,194.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	70.750	431,575.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,200	60.080	72,096.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	6,200	60.260	373,612.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	1,900	221.880	421,572.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	173.180	103,908.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	264.000	646,008.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	455	704.000	320,320.000	
PETROCHINA CO LTD	110,900	6.150	682,035.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	4.740	1,003,932.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	2.990	820,456.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.080	258,720.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	42,100	4.620	194,502.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	31.900	319,000.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	15,500	22.420	347,510.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	86,100	53.000	4,563,300.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	42,100	52.740	2,220,354.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	72,000	19.360	1,393,920.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	97,800	9.150	894,870.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	3.980	550,036.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	23,900	19.760	472,264.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	4,700	1,867.120	8,775,464.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.570	578,105.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	25.660	1,449,790.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	29.680	911,176.000	

SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	6.060	232,098.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	75,500	21.620	1,632,310.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	109,700	3.480	381,756.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	135,100	4.830	652,533.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	21,500	12.400	266,600.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	5.720	474,188.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	30,400	39.470	1,199,888.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.480	393,792.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	90,100	4.210	379,321.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	64,800	8.390	543,672.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	41.770	584,780.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	18.480	619,080.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	7.200	56,160.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	14,100	55.180	778,038.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	13.890	626,439.000	
CRRC CORP LTD	77,000	6.260	482,020.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	25,152	53.610	1,348,398.720	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	18,900	44.700	844,830.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	23,900	17.070	407,973.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	156,800	5.630	882,784.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	42.870	638,763.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	26.730	743,094.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	28,100	25.930	728,633.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	6.110	62,933.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	51.610	407,719.000	
GEMDALE CORP	10,600	11.000	116,600.000	
SANAN OPTOELECTRONICS CO LTD	22,100	33.990	751,179.000	

WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	13,500	106.200	1,433,700.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	11.040	1,023,408.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	8.270	566,495.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	10.910	344,756.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	30,120	32.880	990,345.600	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.060	150,788.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,300	263.500	1,923,550.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	235,900	3.020	712,418.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	600	83.300	49,980.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.880	97,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	31,500	7.430	234,045.000	
AIR CHINA LTD	28,400	8.120	230,608.000	
TBEA CO LTD	26,700	22.000	587,400.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	45,700	4.210	192,397.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	6.980	588,414.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	13,700	24.080	329,896.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	49.630	163,779.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	30.430	209,967.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	17,200	24.950	429,140.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.100	174,930.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	23.940	198,702.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	11.430	169,164.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	13.850	66,480.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	12.910	305,967.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	27,900	19.350	539,865.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	14,400	53.530	770,832.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	9.640	280,524.000	

JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	16.010	121,676.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	42,970	16.830	723,185.100	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	60,200	6.350	382,270.000	
ZHONGJIN GOLD CORP LTD	32,700	8.620	281,874.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	9.720	274,104.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	20.040	190,780.800	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	49.270	374,452.000	
BBMG CORP	54,200	2.900	157,180.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	4.100	120,540.000	
YANZHOU COAL MINING CO LTD	18,600	29.920	556,512.000	
YUTONG BUS CO LTD	12,500	11.600	145,000.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	5.060	195,316.000	
LIAONING CHENG DA CO LTD	1,600	25.720	41,152.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	15.320	230,091.080	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	14.720	113,344.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	7,896	56.750	448,098.000	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	34.200	555,750.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.240	204,048.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.470	204,730.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	1,800	45.850	82,530.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	8.700	164,430.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.490	166,144.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	59.000	271,400.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	9.500	159,600.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.780	227,732.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	9.800	192,080.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,800	394.910	710,838.000	

TONGHUA DONGBAO PHARMACEUTICAL CO LTD	9,000	10.980	98,820.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	5,180	317.600	1,645,168.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	18.750	22,500.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	31,560	5.100	160,956.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.450	261,250.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	3,100	49.460	153,326.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	14.400	325,440.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	4.320	113,184.000	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	31.880	172,152.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	9.760	122,976.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.680	200,400.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	32.700	137,340.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.760	109,370.800	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.860	139,948.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	22.380	100,710.000	
TONGWEI CO LTD	21,000	51.510	1,081,710.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	1,430	66.000	94,380.000	
JCET GROUP CO LTD	10,900	32.510	354,359.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	55.180	375,224.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	134.000	335,000.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	47.150	249,895.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	20.310	113,736.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	33.480	404,773.200	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	17.450	466,717.700	

JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	7,324	84.800	621,075.200	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	17.000	333,200.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	22.430	352,151.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	106.390	180,863.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	48.830	239,267.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,420	78.450	1,915,749.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	196.050	352,890.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	15.300	494,970.300	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	13,224	109.920	1,453,582.080	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	47.470	237,350.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	17.990	21,588.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	66.550	385,990.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	11.580	152,856.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	20,900	18.660	389,994.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	6.910	412,527.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	53.400	181,560.000	
HUAAN SECURITIES CO LTD	16,500	5.380	88,770.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	6.010	547,511.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	15.260	360,136.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	900	37.650	33,885.000	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	53.110	75,947.300	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	19.000	38,000.000	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	110.900	133,080.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	61.000	91,500.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.480	410,816.000	
SDIC CAPITAL CO LTD	10,016	9.000	90,144.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	298.390	238,712.000	

	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,700	122.100	573,870.000	
	TOLY BREAD CO LTD	5,040	28.750	144,900.000	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	54.340	155,412.400	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	72.890	214,296.600	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	14.780	286,732.000	
	SPRING AIRLINES CO LTD	4,200	58.400	245,280.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.830	253,280.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	69.790	418,740.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	30,660	4.710	144,408.600	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	36.500	390,550.000	
オフショア・人民元 小計		8,353,704		161,928,100.010 (2,845,449,152)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	287,448	19.500	5,605,236.000	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	107,776	6.131	660,774.650	
	OOREDOO QSC	43,816	7.201	315,519.010	
	QATAR FUEL QSC	28,478	17.890	509,471.420	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	24,605	17.000	418,285.000	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.665	493,185.620	
	INDUSTRIES QATAR QSC	90,288	15.370	1,387,726.560	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,819	18.220	1,381,422.180	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	138,961	3.101	430,918.060	
	MASRAF AL RAYAN	242,381	4.572	1,108,165.930	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.150	436,114.350	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	251,921	2.353	592,770.110	
カタール・リアル 小計		1,480,970		13,339,588.890 (414,461,027)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	296,394	0.810	240,079.140	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	126,248	0.600	75,748.800	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	445,843	0.939	418,646.570	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	89,203	0.969	86,437.700	
	MABANEE CO KPSC	19,432	0.761	14,787.750	

	BOUBAYAN BANK KSCP	48,757	0.761	37,104.070	
クウェート・ディナール 小計		1,025,877		872,804.030 (329,003,479)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	24,435	22,820.000	557,606,700.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,944.000	827,941,120.000	
	BANCOLOMBIA SA	12,950	33,330.000	431,623,500.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	33,300.000	1,169,795,700.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	8,537	21,970.000	187,557,890.000	
コロンビア・ペソ 小計		362,281		3,174,524,910.000 (95,642,086)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	15,478	74.500	1,153,111.000	
	JARIR MARKETING CO	4,004	203.000	812,812.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	88.000	365,640.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	28,728	30.400	873,331.200	
	SAUDI BRITISH BANK	56,694	33.200	1,882,240.800	
	AL RAJHI BANK	76,273	134.000	10,220,582.000	
	ARAB NATIONAL BANK	34,464	22.800	785,779.200	
	BANK ALBILAD	26,491	41.700	1,104,674.700	
	BANK AL-JAZIRA	17,287	18.740	323,958.380	
	BANQUE SAUDI FRANSI	34,261	41.650	1,426,970.650	
	RIYAD BANK	80,010	27.450	2,196,274.500	
	SAUDI TELECOM CO	37,253	119.000	4,433,107.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	12,524	174.000	2,179,176.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	55,968	128.400	7,186,291.200	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	60.900	394,449.300	
	SAUDI ELECTRICITY CO	57,882	27.200	1,574,390.400	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	10,245	38.600	395,457.000	
	SAVOLA GROUP	14,538	36.750	534,271.500	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	22.900	515,891.200	
	ALMARAI CO JSC	16,575	53.300	883,447.500	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	12.660	358,417.260	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	19,255	43.050	828,927.750	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	72.400	607,798.000	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	40,406	19.200	775,795.200		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	9.940	308,249.340		
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	10,717	26.950	288,823.150		

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	21,818	13.540	295,415.720	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,677	140.800	376,921.600	
	ALINMA BANK	61,501	24.360	1,498,164.360	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	112.200	394,495.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	27,062	82.900	2,243,439.800	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	46.400	395,142.400	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	174.600	589,624.200	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	142,503	37.000	5,272,611.000	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	2,712	167.000	452,904.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	136,420	62.900	8,580,818.000	
	サウジアラビア・リアル 小計	1,160,032		62,509,402.510 (1,894,659,990)	
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	45.750	1,564,650.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	43,200	123.000	5,313,600.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	509,355	4.300	2,190,226.500	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	12,400	179.000	2,219,600.000	
	SHIN CORP PCL	59,600	75.500	4,499,800.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	25.750	7,725,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	80,400	193.000	15,517,200.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	272,320	14.200	3,866,944.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	21,000	454.000	9,534,000.000	
	PTT PCL	598,600	40.000	23,944,000.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	147,100	20.600	3,030,260.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	67,700	56.250	3,808,125.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	722,300	8.050	5,814,515.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	52,450	398.000	20,875,100.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	259,800	64.250	16,692,150.000	

CENTRAL PATTANA PCL NVDR	145,500	54.500	7,929,750.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	659,800	22.300	14,713,540.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	140.000	5,572,000.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	173,610	33.250	5,772,532.500	
THAI OIL PCL NVDR	83,100	56.500	4,695,150.000	
CP ALL PCL NVDR	351,400	63.500	22,313,900.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	336,000	9.550	3,208,800.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	94,645	123.500	11,688,657.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	131,322	45.000	5,909,490.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	147,408	64.750	9,544,668.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	76,000	62.500	4,750,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	316,200	9.000	2,845,800.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	41.250	2,334,750.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	43.500	8,565,150.000	
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	4.580	1,619,488.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	91,933	34.750	3,194,671.750	
SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	61.250	5,537,000.000	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	30,300	63.750	1,931,625.000	
SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	36,600	31.000	1,134,600.000	
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	28.500	5,603,100.000	
CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	121.500	3,183,300.000	
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	61.750	3,772,925.000	
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	75.750	3,719,325.000	
タイ・パーツ 小計	7,266,443		273,765,713.250 (928,065,768)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	3,251	905.000	2,942,155.000
	CEZ	10,929	784.000	8,568,336.000
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	90.150	2,433,058.350

チェコ・コルナ 小計		41,169		13,943,549.350 (71,980,785)	
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 (224,440,776)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	5.320	1,270,612.840	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	15.820	710,286.360	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	17.560	1,689,026.160	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	161.400	753,415.200	
	KOC HOLDING AS	53,770	22.220	1,194,769.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	8.120	730,800.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	47,391	15.130	717,025.830	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	181,455	9.440	1,712,935.200	
	TURKIYE IS BANKASI	66,205	5.230	346,252.150	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,201	125.800	780,085.800	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	27,755	62.850	1,744,401.750	
トルコ・リラ 小計		857,366		11,649,610.690 (146,942,364)	
ハンガリー・ フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	8,393	8,650.000	72,599,450.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	26,296	2,708.000	71,209,568.000	
	OTP BANK NYRT	13,598	18,780.000	255,370,440.000	
ハンガリー・フォリント 小計		48,287		399,179,458.000 (145,529,254)	
パキスタン・ ルピー	LUCKY CEMENT LTD	7,000	650.690	4,554,830.000	
	MCB BANK LTD	12,400	149.620	1,855,288.000	

	HABIB BANK LTD	19,300	109.650	2,116,245.000	
パキスタン・ルビー 小計		38,700		8,526,363.000 (5,712,663)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	432,900	36.000	15,584,400.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	94,330	47.750	4,504,257.500	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	107,520	83.750	9,004,800.000	
	AYALA CORP	17,253	820.000	14,147,460.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,420	3,080.000	4,373,600.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	73,840	185.000	13,660,400.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	61.900	12,358,335.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	33,940	208.400	7,073,096.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,275	49.100	7,525,802.500	
	BDO UNIBANK INC	125,723	127.200	15,991,965.600	
	PLDT INC	5,260	1,660.000	8,731,600.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	689,175	35.150	24,224,501.250	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	54,840	135.000	7,403,400.000	
	SM INVESTMENTS CORP	12,583	1,005.000	12,645,915.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.730	3,364,087.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	292.000	5,171,320.000	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	536.500	3,541,436.500		
フィリピン・ペソ 小計		2,927,920		169,306,376.350 (378,365,890)	
ブラジル・リアル	BRF SA	47,292	26.550	1,255,602.600	
	VALE SA	244,121	81.620	19,925,156.020	
	CIA PARANAENSE DE ENERGIA	15,100	6.480	97,848.000	
	RAIA DROGASIL SA	70,100	22.120	1,550,612.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,750	39.040	810,080.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	39.090	770,073.000	
	BANCO DO BRASIL SA	52,000	30.720	1,597,440.000	
	ITAUSA SA	259,660	11.150	2,895,209.000	
	GERDAU SA	69,130	27.170	1,878,262.100	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	225,310	29.770	6,707,478.700	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	64,600	24.800	1,602,080.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	296,812	29.320	8,702,527.840	
	CCR SA	90,920	12.220	1,111,042.400	
	WEG SA	102,744	38.620	3,967,973.280	
	BANCO BRADESCO SA PREF	305,093	20.470	6,245,253.710	
BANCO BRADESCO SA	78,457	17.590	1,380,058.630		

CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	42,106	28.120	1,184,020.720	
BRADESPAR SA	17,958	54.730	982,841.340	
SUZANO SA	50,775	50.200	2,548,905.000	
CPFL ENERGIA SA	20,700	25.960	537,372.000	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	298,347	24.230	7,228,947.810	
AMERICANAS SA	28,371	33.790	958,656.090	
BRASKEM SA	12,300	56.510	695,073.000	
ENGIE BRASIL SA	16,587	37.980	629,974.260	
ALPARGATAS SA	8,500	47.160	400,860.000	
LOCALIZA RENT A CAR	41,489	54.660	2,267,788.740	
LOJAS RENNER SA	57,237	33.900	1,940,334.300	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	55,904	14.880	831,851.520	
COSAN SA	73,300	22.800	1,671,240.000	
TOTVS SA	35,600	34.080	1,213,248.000	
EQUATORIAL ENERGIA SA	62,400	24.500	1,528,800.000	
JBS SA	52,200	37.610	1,963,242.000	
CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	56,717	14.580	826,933.860	
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,098	37.980	1,029,182.040	
HYPERA SA	17,400	29.450	512,430.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	372,648	12.130	4,520,220.240	
MAGAZINE LUIZA SA	199,100	14.380	2,863,058.000	
TELEFONICA BRASIL SA	32,628	45.290	1,477,722.120	
VIA S/A	68,300	7.910	540,253.000	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	42,300	20.420	863,766.000	
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	29,900	72.050	2,154,295.000	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	79,800	12.890	1,028,622.000	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	17.980	537,602.000	
AMBEV SA	284,895	15.240	4,341,799.800	
NATURA &CO HOLDING SA	52,500	43.600	2,289,000.000	
TIM SA	72,100	12.110	873,131.000	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	22,700	64.720	1,469,144.000	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA-RTS	4,007	0.010	40.070	
XP INC	7,453	205.000	1,527,865.000	
RUMO SA	80,500	18.170	1,462,685.000	
ブラジル・リアル 小計	4,315,509		115,397,601.190 (2,364,416,070)	

ポーランド・ズロチ	KGHM POLSKA MIEDZ SA	7,664	164.800	1,263,027.200	
	BANK PEKAO SA	13,136	122.000	1,602,592.000	
	ORANGE POLSKA SA	30,783	8.075	248,572.720	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	18,695	87.440	1,634,690.800	
	LPP SA	67	12,910.000	864,970.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,756	351.000	616,356.000	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	195.200	904,361.600	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	52,035	47.880	2,491,435.800	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	129,398	6.550	847,556.900	
	CYFROWY POLSAT SA	20,000	36.140	722,800.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	9.950	519,310.400	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	37,670	39.700	1,495,499.000	
	DINO POLSKA SA	3,464	354.800	1,229,027.200	
	ALLEGRO.EU SA	21,992	58.250	1,281,034.000	
ポーランド・ズロチ 小計	393,485		15,721,233.620 (448,995,288)		
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	5.000	1,874,000.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	4.280	1,007,084.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	6.860	615,479.200	
	RHB BANK BHD	140,880	5.410	762,160.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.900	250,430.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	382,300	2.810	1,074,263.000	
	GENTING BHD	171,300	5.170	885,621.000	
	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	4.070	776,608.910	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	22,600	22.700	513,020.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	26.960	312,736.000	
	MALAYAN BANKING BHD	254,375	8.160	2,075,700.000	
	MISC BHD	100,880	6.940	700,107.200	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	134.500	551,450.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	18.500	855,810.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	19.400	432,620.000	
PETRONAS GAS BHD	55,400	16.900	936,260.000		
GENTING MALAYSIA BHD	219,800	3.150	692,370.000		

	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.680	337,960.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	139,650	9.710	1,356,001.500	
	QL RESOURCES BHD	28,450	5.280	150,216.000	
	DIALOG GROUP BHD	233,944	2.880	673,758.720	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	888,750	4.110	3,652,762.500	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	82,800	2.280	188,784.000	
	SUPERMAX CORP BHD	74,571	2.270	169,276.170	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.270	316,665.000	
	HARTEGA HOLDINGS BHD	107,200	5.720	613,184.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	4.000	680,400.000	
	MAXIS BHD	130,800	4.630	605,604.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	135,700	8.750	1,187,375.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	113,100	6.680	755,508.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	35,700	4.460	159,222.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	229,700	6.130	1,408,061.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	93,400	4.270	398,818.000	
	マレーシア・リンギット 小計	5,131,157		27,956,839.200 (759,693,557)	
メキシコ・ペ ソ	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,000	57.590	4,895,150.000	
	GRUMA SAB DE CV	10,905	221.640	2,416,984.200	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	142.360	2,542,549.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	74.940	2,615,406.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	158,500	136.120	21,575,020.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	78,425	53.460	4,192,600.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	7,865	267.760	2,105,932.400	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	86,300	32.600	2,813,380.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	12,040	400.900	4,826,836.000	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	186,952	87.440	16,347,082.880	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,142,778	18.110	38,805,709.580	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	172,000	20.050	3,448,600.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	23,100	126.880	2,930,928.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	322,900	71.590	23,116,411.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,410	256.880	6,270,440.800	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	18.170	1,404,541.000	
BECLÉ SAB DE CV	38,400	44.280	1,700,352.000		

メキシコ・ペソ 小計		3,479,635		142,007,923.960 (772,011,878)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	130,000	1.112	144,560.000	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,162	15.900	209,275.800	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.845	153,739.300	
	OPAP SA	15,554	13.400	208,423.600	
	JUMBO SA	9,601	14.030	134,702.030	
ユーロ 小計		353,387		850,700.730 (111,543,880)	
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 (6,692,517,802)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	14.020	939,340.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	7.800	702,000.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	180,000	4.690	844,200.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	101.830	651,712.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	73,500	42.900	3,153,150.000	
	BEIJING ENTERPRISES	20,000	30.600	612,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	342,000	3.840	1,313,280.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	236,000	11.400	2,690,400.000	
	YANZHOU COAL MINING CO LTD	70,000	14.220	995,400.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	46,900	27.700	1,299,130.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	43,500	43.450	1,890,075.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	3.650	518,300.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	537,600	9.220	4,956,672.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	260,620	17.860	4,654,673.200	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	196,888	31.300	6,162,594.400	
	CITIC LTD	351,000	8.030	2,818,530.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	96,000	4.850	465,600.000	
	LENOVO GROUP LTD	428,000	7.630	3,265,640.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,240,000	4.110	5,096,400.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	12.620	1,395,645.800	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,515,200	4.020	6,091,104.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	49,000	14.880	729,120.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	144,000	26.500	3,816,000.000	

ENN ENERGY HOLDINGS LTD	47,900	118.100	5,656,990.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	276,000	7.360	2,031,360.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	78,000	6.720	524,160.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	63,200	7.310	461,992.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	66,000	13.200	871,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	244,000	5.320	1,298,080.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	87,000	26.150	2,275,050.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	10.060	970,790.000	
CHINA EVERBRIGHT LTD	44,000	9.300	409,200.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	186,000	20.650	3,840,900.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	35.950	1,599,775.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	361,000	22.700	8,194,700.000	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	216,000	1.980	427,680.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	54,000	39.800	2,149,200.000	
BYD CO LTD	48,000	258.800	12,422,400.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	7.740	913,320.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,030,000	0.880	906,400.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	5.860	1,650,129.120	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	152,000	12.720	1,933,440.000	
MMG LTD	184,000	3.320	610,880.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	5.500	385,000.000	
CHINA YOUZAN LTD	1,000,000	1.110	1,110,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	397,788	7.360	2,927,719.680	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	4.930	665,550.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	115,200	18.980	2,186,496.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	196,000	30.500	5,978,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	501,000	13.800	6,913,800.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	381,000	10.300	3,924,300.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	156,000	13.960	2,177,760.000	
WEICHAH POWER CO LTD	127,440	15.560	1,982,966.400	

TINGYI HOLDING CORP	140,000	14.600	2,044,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	60.700	2,306,600.000	
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	57.750	5,043,480.750	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	68,000	6.430	437,240.000	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	71,000	14.620	1,038,020.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	619,250	6.010	3,721,692.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	192,000	47.300	9,081,600.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	358,300	496.000	177,716,800.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	391,500	59.850	23,431,275.000	
LI NING CO LTD	138,500	79.350	10,989,975.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	260,000	3.190	829,400.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	0.860	592,746.400	
CHINA POWER INTERNATIONAL	207,000	3.520	728,640.000	
AIR CHINA / HONG KONG	76,000	5.580	424,080.000	
ZTE CORP	44,288	25.850	1,144,844.800	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	214,500	18.140	3,891,030.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	203,250	11.160	2,268,270.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	574,205	4.710	2,704,505.550	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	8.000	882,000.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,000	32.150	1,318,150.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,017,530	5.470	32,915,889.100	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	51,000	155.600	7,935,600.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	206,000	7.190	1,481,140.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	6.640	650,720.000	
MINTH GROUP LTD	54,000	28.200	1,522,800.000	
SSY GROUP LTD	138,000	4.080	563,040.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	84,000	9.600	806,400.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	242,000	10.160	2,458,720.000	

BANK OF CHINA LTD	5,025,200	2.720	13,668,544.000	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	99,500	13.060	1,299,470.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	11.160	669,600.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	5.270	522,784.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	235,470	63.300	14,905,251.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,531,235	4.360	15,396,184.600	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	49,500	5.530	273,735.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	12.920	691,220.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	4.270	715,652.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	33,000	23.900	788,700.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	31,300	33.450	1,046,985.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	447,142	7.500	3,353,565.000	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	4.860	1,151,820.000	
CHINA CITIC BANK-H	602,800	3.510	2,115,828.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	65,000	6.950	451,750.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,400	201.600	8,749,440.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	66,400	125.500	8,333,200.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	22.950	459,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	9.160	1,548,296.480	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	276,000	2.520	695,520.000	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	85,000	3.490	296,650.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	162,000	5.560	900,720.000	
KINGSOFT CORP LTD	60,000	32.200	1,932,000.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	11.880	415,800.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	168,000	3.940	661,920.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	7.120	790,320.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	47,500	26.750	1,270,625.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	320,000	5.800	1,856,000.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	151,200	25.300	3,825,360.000	

CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	14.420	1,326,640.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	65,500	3.980	260,690.000	
SINOPHARM GROUP CO	86,000	21.000	1,806,000.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	120,000	7.400	888,000.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	178,527	7.310	1,305,032.370	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	9.380	1,411,690.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	5.550	599,400.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK	198,000	2.840	562,320.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	210,000	15.000	3,150,000.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	30,100	15.320	461,132.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	148,000	14.920	2,208,160.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	62,000	6.800	421,600.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	9.350	841,500.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	122,500	34.700	4,250,750.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	43,100	24.150	1,040,865.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	364,656	3.200	1,166,899.200	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	125,000	1.840	230,000.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	31,000	15.120	468,720.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	81,000	12.260	993,060.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.750	687,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,717,000	2.680	4,601,560.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	39,000	62.600	2,441,400.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	7.500	772,500.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	44,600	42.200	1,882,120.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	143,000	19.800	2,831,400.000	

SEAZEN GROUP LIMITED	108,000	6.110	659,880.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	194,000	7.160	1,389,040.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	461,000	2.480	1,143,280.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	34,500	37.450	1,292,025.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	226,000	4.890	1,105,140.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	216,500	4.470	967,755.000	
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	8.490	645,240.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	548,000	5.280	2,893,440.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	36,000	41.850	1,506,600.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	29.100	2,386,200.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	94,000	62.950	5,917,300.000	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	92,000	4.010	368,920.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	33,000	52.150	1,720,950.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	12.960	673,920.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.940	522,750.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	44,250	27.900	1,234,575.000	
CHINA TOWER CORP LTD	2,538,000	1.030	2,614,140.000	
XIAOMI CORP	890,000	21.650	19,268,500.000	
WUXI APPTec CO LTD	19,112	165.800	3,168,769.600	
WEIMOB INC	105,000	12.300	1,291,500.000	
MEITUAN	250,900	277.400	69,599,660.000	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	71,200	19.160	1,364,192.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	67,000	28.200	1,889,400.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	294,000	15.080	4,433,520.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	71,000	76.300	5,417,300.000	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	42,000	16.000	672,000.000	

CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.340	891,100.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	40,000	40.650	1,626,000.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	8.080	832,240.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	36.650	3,756,625.000	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT CO LTD	5,800	48.800	283,040.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	78,000	12.440	970,320.000	
CHINA EAST EDUCATION HOLDINGS LTD	27,000	8.130	219,510.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	216.000	1,339,200.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	116,000	8.600	997,600.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	86,000	20.700	1,780,200.000	
CHINA FEIHE LTD	249,000	13.180	3,281,820.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	946,068	167.800	158,750,210.400	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,700	163.700	1,260,490.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	109,000	34.650	3,776,850.000	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	42.800	663,400.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	21.550	1,077,500.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	16,200	88.000	1,425,600.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	131,600	27.150	3,572,940.000	
AKESO INC	20,000	42.950	859,000.000	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	42,000	17.020	714,840.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	27.850	696,250.000	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	41,000	16.100	660,100.000	
NONGFU SPRING CO LTD	34,000	38.100	1,295,400.000	
CHINA BOHAI BANK CO LTD	294,500	3.000	883,500.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	20,350	79.050	1,608,667.500	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	33,000	43.500	1,435,500.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	9,600	157.000	1,507,200.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	118,961	21.600	2,569,557.600	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	37,000	39.300	1,454,100.000	
CGN POWER CO LTD	450,000	2.220	999,000.000	

	GF SECURITIES CO LTD	68,200	13.220	901,604.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	40.400	1,923,040.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	92,400	12.000	1,108,800.000	
	3SBIO INC	90,500	7.310	661,555.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	94,000	3.860	362,840.000	
	CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	461,000	0.510	235,110.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	58.500	1,661,400.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	35.000	1,190,000.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.450	651,925.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	64,000	3.690	236,160.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	6.680	434,200.000	
	BOC AVIATION LTD	10,700	69.000	738,300.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	32.150	1,093,100.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	90,000	12.320	1,108,800.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	112,800	20.450	2,306,760.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	223,000	112.100	24,998,300.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	17,000	136.900	2,327,300.000	
	香港・ドル 小計	55,448,963		936,822,053.450 (13,668,233,763)	
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 (8,024,872,741)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	206.500	1,479,159.500	
	BIDVEST GROUP LTD	15,345	187.660	2,879,642.700	
	CLICKS GROUP LTD	16,368	273.520	4,476,975.360	
	DISCOVERY LTD	30,465	137.940	4,202,342.100	
	GOLD FIELDS LTD	52,261	133.800	6,992,521.800	
	REMGRO LTD	37,513	135.970	5,100,642.610	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	28,537	53.180	1,517,597.660	
	EXXARO RESOURCES LTD	14,115	182.880	2,581,351.200	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	4,828	1,671.000	8,067,588.000	
	MTN GROUP LTD	103,790	143.510	14,894,902.900	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	24,592	267.280	6,572,949.760	
	FIRSTRAND LTD	303,860	61.000	18,535,460.000	
	NASPERS LTD	13,492	2,568.720	34,657,170.240	
	NEDBANK GROUP LTD	26,060	168.890	4,401,273.400	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,800	1,517.080	5,764,904.000	
	SASOL LTD	38,173	291.270	11,118,649.710	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	31,242	180.250	5,631,370.500	
	MR PRICE GROUP LTD	17,459	200.620	3,502,624.580	
	STANDARD BANK GROUP LTD	75,693	138.410	10,476,668.130	
	SPAR GROUP LTD/THE	9,125	190.580	1,739,042.500	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,648	57.360	4,167,089.280	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	25,010	242.490	6,064,674.900	
	ABSA GROUP LTD	49,397	143.000	7,063,771.000	
	TIGER BRANDS LTD	12,981	186.000	2,414,466.000	
	SANLAM LTD	107,156	62.020	6,645,815.120	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	54,034	204.580	11,054,275.720	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,497	511.550	2,300,440.350	

RMI HOLDINGS	35,836	38.240	1,370,368.640	
VODACOM GROUP PTY LTD	38,342	138.800	5,321,869.600	
NEPI ROCKCASTLE PLC	22,770	103.000	2,345,310.000	
OLD MUTUAL LTD	304,247	16.470	5,010,948.090	
REINET INVESTMENTS SCA	7,743	282.910	2,190,572.130	
MULTICHOICE GROUP LTD	27,072	116.280	3,147,932.160	
SIBANYE STILLWATER LTD	169,143	54.160	9,160,784.880	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	22,064	225.180	4,968,371.520	
BID CORP LTD	19,281	331.270	6,387,216.870	
南アフリカ・ランド 小計	1,826,102		234,206,742.910 (1,761,234,707)	
合計	155,979,429		55,905,415,511 (55,905,415,511)	

(2) 株式以外の有価証券

2021年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
新株予約権証券	タイ・パーツ	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	1,684,590.000	
		BANCO INTER SA	23,700.000	1,064,130.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	21,100.000	757,490.000	
		ENERGISA SA	15,800.000	715,740.000	
		KLABIN SA	50,500.000	1,149,380.000	
	ブラジル・リアル 小計	181,000.000	5,371,330.000 (110,054,792)		
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	910,575.000	12,693,415.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,994,848.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	118,600.000	20,465,616.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	157,800.000	7,468,674.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	25,000.000	1,482,750.000	
メキシコ・ペソ 小計	1,247,175.000	46,105,303.500 (250,646,872)			
投資信託受益証券 合計			1,428,175	360,701,664 (360,701,664)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	4,943,400.000	
	メキシコ・ペソ 小計		235,400.000	4,943,400.000	

				(26,874,299)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	235,102.000	3,319,640.240	
	南アフリカ・ランド	小計	235,102.000	3,319,640.240	(24,963,695)
投資証券	合計		470,502	51,837,994	(51,837,994)
合計				412,539,658	(412,539,658)

(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	8.93	-	-	-	10.08
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	10.78	-	-	-	12.16
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	4.48	-	-	-	5.05
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.65	-	-	-	0.74
クウェート・ディナール	株式 6銘柄	0.52	-	-	-	0.58
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	2.98	-	-	-	3.36
タイ・バーツ	株式 42銘柄 新株予約権証 券 2銘柄	1.46 -	- 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	0.35	-	-	-	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	0.60	-	-	-	0.67
ブラジル・レアル	株式 50銘柄 投資信託受益 証券 5銘柄	3.72 -	- -	- 0.17	- -	4.39
ポーランド・ズロチ	株式 14銘柄	0.71	-	-	-	0.80
マレーシア・リンギット	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 -	- -	- 0.39	- -	1.86

	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	10.54	-	-	-	11.88
香港・ドル	株式	212銘柄	21.52	-	-	-	24.27
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.63	-	-	-	14.25
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	2.77	-	-	-	3.17
	投資証券	1銘柄	-	-	-	0.04	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,815,892,765
コール・ローン	651,601,241
国債証券	110,605,566,639
派生商品評価勘定	4,306,705
未収利息	825,829,335
前払費用	408,714,918
流動資産合計	114,311,911,603
資産合計	114,311,911,603
負債の部	
流動負債	
未払解約金	99,782,000
流動負債合計	99,782,000
負債合計	99,782,000
純資産の部	
元本等	
元本	52,254,579,544
剰余金	
剰余金又は欠損金()	61,957,550,059
元本等合計	114,212,129,603
純資産合計	114,212,129,603
負債純資産合計	114,311,911,603

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12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12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	68,793,586,315円
同期中追加設定元本額	117,175,292,766円
同期中一部解約元本額	133,714,299,537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）	194,426,610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）	920,163円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	2,199,605円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	17,621,348円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	1,900,990円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,445,055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	337,934,117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）	2,596,618円
D I A Mコア資産設計ファンド（積極型）	7,233,326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）	1,868,465,469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)	2,791,041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)	176,892,910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)	86,125,892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	52,254,579,544円
2. 受益権の総数	52,254,579,544口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

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

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	3,366,355,268	
合計	3,366,355,268	

(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12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2021年10月12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	-	404,306,705	4,306,705
	400,000,000	-	404,306,705	4,306,705
合計	400,000,000	-	404,306,705	4,306,705

(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取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取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取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12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1857円 (21,857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12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	7,000,000.000	7,148,750.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	12,000,000.000	11,586,000.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	8,168,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	12,800,000.000	13,438,272.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	13,000,000.000	11,407,500.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	10,800,000.000	10,000,800.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	7,100,000.000	7,162,125.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	9,600,000.000	9,504,000.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	7,800,000.000	8,945,625.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	5,300,000.000	6,349,691.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	4,200,000.000	5,525,520.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	4,800,000.000	5,888,640.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	6,634,285.000	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	10,000,000.000	9,417,500.000	
		COLOMBIA 3.875 02/15/61	5,000,000.000	4,137,600.000	
		COLOMBIA 4.0 02/26/24	6,100,000.000	6,384,107.500	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	4,384,150.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	9,000,000.000	9,673,695.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	7,000,000.000	7,419,370.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	14,000,000.000	13,860,700.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	7,015,400.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	8,000,000.000	8,464,000.000	
		COLOMBIA 6.125 01/18/41	10,000,000.000	11,118,750.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	8,400,000.000	8,987,890.800	
		CROATIA 6.0 01/26/24	10,400,000.000	11,583,312.000	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	8,358,000.000	8,899,272.430	
HUNGARY 5.375 03/25/24	9,380,000.000	10,388,819.000			
HUNGARY 5.75 11/22/23	11,000,000.000	12,141,360.000			

HUNGARY 7.625 03/29/41	5,000,000.000	8,199,500.000	
INDONESIA 1.85 03/12/31	5,000,000.000	4,710,875.000	
INDONESIA 2.85 02/14/30	4,000,000.000	4,086,380.000	
INDONESIA 3.05 03/12/51	6,000,000.000	5,488,110.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	3,000,000.000	3,187,380.000	
INDONESIA 3.5 01/11/28	5,200,000.000	5,583,552.000	
INDONESIA 3.7 10/30/49	3,000,000.000	2,938,785.000	
INDONESIA 3.85 10/15/30	5,000,000.000	5,503,325.000	
INDONESIA 4.1 04/24/28	6,000,000.000	6,661,620.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	8,800,000.000	9,582,496.000	
INDONESIA 4.2 10/15/50	6,000,000.000	6,424,170.000	
INDONESIA 4.35 01/08/27	5,000,000.000	5,594,725.000	
INDONESIA 4.35 01/11/48	6,000,000.000	6,430,020.000	
INDONESIA 4.45 04/15/70	4,000,000.000	4,384,437.400	
INDONESIA 4.75 01/08/26	7,800,000.000	8,797,581.000	
INDONESIA 4.75 02/11/29	6,000,000.000	6,917,310.000	
INDONESIA 5.125 01/15/45	6,400,000.000	7,490,112.000	
INDONESIA 5.25 01/17/42	7,300,000.000	8,575,675.000	
INDONESIA 5.35 02/11/49	3,000,000.000	3,703,708.860	
INDONESIA 5.875 01/15/24	7,200,000.000	7,995,600.000	
INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	4,200,704.000	
INDONESIA 6.75 01/15/44	6,500,000.000	9,105,330.000	
INDONESIA 7.75 01/17/38	6,500,000.000	9,398,610.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	9,000,000.000	8,381,340.000	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	8,155,200.000	
PANAMA 3.75 03/16/25	5,200,000.000	5,571,852.000	
PANAMA 3.875 03/17/28	6,100,000.000	6,602,365.500	
PANAMA 4.5 04/01/56	9,000,000.000	9,497,250.000	
PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	9,844,050.000	
PANAMA 6.7 01/26/36	6,900,000.000	9,037,620.000	
PANAMA 7.125 01/29/26	4,800,000.000	5,842,800.000	
PERU 1.862 12/01/32	7,000,000.000	6,387,500.000	
PERU 2.392 01/23/26	6,000,000.000	6,129,300.000	
PERU 2.78 12/01/60	9,000,000.000	7,655,490.000	
PERU 2.783 01/23/31	13,000,000.000	13,000,130.000	
PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	5,062,800.000	
PERU 3.3 03/11/41	5,000,000.000	4,893,800.000	
PERU 5.625 11/18/50	9,000,000.000	12,234,510.000	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	4,000,000.000	3,750,420.000	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	2,000,000.000	2,015,730.000	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	5,000,000.000	4,429,800.000	
PHILIPPINES 2.95 05/05/45	4,000,000.000	3,700,937.680	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	10,551,450.000	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	6,000,000.000	6,149,910.000	

PHILIPPINES 3.75 01/14/29	5,000,000.000	5,499,675.000	
PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,800,000.000	7,184,370.000	
PHILIPPINES 4.2 01/21/24	5,800,000.000	6,200,635.000	
PHILIPPINES 5.0 01/13/37	4,800,000.000	5,744,993.800	
PHILIPPINES 6.375 10/23/34	8,000,000.000	10,765,200.000	
PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	11,423,065.500	
PHILIPPINES 9.5 02/02/30	6,800,000.000	10,355,414.000	
ROMANIA 3.0 02/14/31	6,000,000.000	6,012,900.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	9,000,000.000	8,802,738.000	
ROMANIA 4.875 01/22/24	5,600,000.000	6,066,160.800	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	5,324,730.000	
ROMANIA 6.125 01/22/44	6,400,000.000	8,191,232.000	
RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	9,243,000.000	10,739,404.710	
RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	9,400,000.000	10,426,423.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	12,400,000.000	13,983,938.800	
RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	14,400,000.000	16,174,281.600	
RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	8,400,000.000	9,047,808.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	14,000,000.000	16,528,064.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	22,000,000.000	27,345,252.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	11,000,000.000	14,007,840.000	
RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	5,200,000.000	6,918,714.400	
SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	8,200,000.000	8,231,816.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	9,000,000.000	9,217,170.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	7,400,000.000	7,896,924.800	
SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	4,200,000.000	3,941,406.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	9,000,000.000	8,459,100.000	
SOUTH AFRICA 5.875 05/30/22	3,000,000.000	3,095,193.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	7,400,000.000	8,122,069.800	
SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	9,200,000.000	10,301,746.000	

	SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	3,000,000.000	3,041,520.000	
	UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	12,000,000.000	11,535,120.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	8,000,000.000	8,164,480.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	7,200,000.000	7,839,648.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	7,200,000.000	7,805,700.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	10,000,000.000	8,575,000.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	10,000,000.000	8,786,350.000	
	UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	5,000,000.000	5,495,000.000	
	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	7,100,800.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	11,000,000.000	12,315,105.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	8,000,000.000	8,260,080.000	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	7,400,000.000	7,607,607.000	
	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	7,637,070.000	
	UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	10,956,498.000	
	UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	8,900,000.000	10,891,464.000	
	アメリカ・ドル 小計	898,481,000.000 (101,977,593,500)	974,498,384.480 (110,605,566,639)	
国債証券	合計	101,977,593,500 (101,977,593,500)	110,605,566,639 (110,605,566,639)	
合計			110,605,566,639 (110,605,566,639)	

(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	119銘柄	96.84	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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,658,597,235
投資証券	188,997,171,820
未収配当金	2,062,195,205
前払金	223,050,980
差入委託証拠金	219,925,000
流動資産合計	194,160,940,240
資産合計	194,160,940,240
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	233,723,130
未払金	32,971,052
未払解約金	6,875,000
流動負債合計	273,569,182
負債合計	273,569,182
純資産の部	
元本等	
元本	79,688,101,403
剰余金	
剰余金又は欠損金()	114,199,269,655
元本等合計	193,887,371,058
純資産合計	193,887,371,058
負債純資産合計	194,160,940,240

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2021年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	22,623,974,077円
同期中追加設定元本額	116,553,347,985円
同期中一部解約元本額	59,489,220,659円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	238,654円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	956,081円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	1,803,624円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,143,815円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,373,126円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,161,040円
たわらノーロード 国内リート	4,565,959,187円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	702,349,284円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,176,460,841円
たわらノーロード バランス(堅実型)	22,961,955円
たわらノーロード バランス(標準型)	408,199,971円
たわらノーロード バランス(積極型)	432,018,283円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	111,408,516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)	283,285,780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)	181,416,971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)	238,303,461円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,702,564円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,061,487円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,704,054円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	9,382,465円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	11,755,986円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	393,070,746円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,214,817円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	127,599,856円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	150,529,987円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	302,269,783円
投資のソムリエ	5,565,200,898円
投資のソムリエ<DC年金>	282,212,857円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	123,589,297円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	222,613,209円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,089,879,267円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	14,091,542円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,407,063円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,182,168円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	38,420,991円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,908,131,316円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,416,406円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	11,225,977円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,421,003円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,410,595円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	39,913円
Jリートインデックスファンド(DC)	43,180,492円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	81,224,491円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	734,079,436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)	61,677,465円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	390,826,344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)	63,160,843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)	177,774,004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)	38,540,401円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	212,738,301円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	83,760,318円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	182,770,387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)	60,701,740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)	158,008,252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)	318,367,858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)	525,688,310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)	367,599,785円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	81,017,581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)	60,762,984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)	366,558,306円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	3,977,586,532円 156,804,711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)	629,222,131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)	103,651,968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)	1,735,123円
日米資産配分戦略ファンド(TIPS活用品)(為替ヘッジ比率調整型)(適格機関投資家限定)	60,899,092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)	1,320,686,565円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,611,049,643円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	39,410,196,399円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,760,819,529円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	109,401,415円
計	79,688,101,403円
2. 受益権の総数	79,688,101,403口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。リスク管理に関する委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2021年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の損益に含まれた評価差額(円)	
投資証券	8,538,300,407	
合計	8,538,300,407	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年6月8日から2021年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2021年10月12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	4,961,855,980	-		4,728,387,500
合計	4,961,855,980	-		4,728,387,500

(注)時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 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12日現在	
1口当たり純資産額	2.4331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12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	6,508	1,345,203,600	
	GLP投資法人	54,422	9,812,286,600	
	NTT都市開発リート投資法人	15,177	2,273,514,600	
	Oneリート投資法人	2,916	851,763,600	
	SOSILA物流リート投資法人	7,049	1,146,167,400	
	いちごオフィスリート投資法人	13,769	1,232,325,500	
	いちごホテルリート投資法人	2,784	253,622,400	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	8,956	4,146,628,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	16,801	5,930,753,000	
	イオンリート投資法人	19,761	2,993,791,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイ リート投資法人	37,374	849,511,020	
	インヴィンシブル投資法人	73,958	3,150,610,800	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,384	468,345,600	
	オリックス不動産投資法人	33,481	6,344,649,500	
	グローバル・ワン不動産投資法人	11,668	1,333,652,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人	5,198	3,820,530,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人	11,477	2,458,373,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	6,709	1,921,457,600	
	コンフォリア・レジデンシャル 投資法人	7,566	2,462,733,000	
	サムティ・レジデンシャル投資 法人	3,806	445,682,600	
	サンケイリアルエステート投資 法人	5,322	643,429,800	
	ザイマックス・リート投資法人	2,439	272,436,300	
	ジャパン・ホテル・リート投資 法人	51,478	3,412,991,400	
ジャパンエクセレント投資法人	15,592	2,094,005,600		
ジャパンリアルエステイト投資 法人	16,803	11,342,025,000		

スターアジア不動産投資法人	17,365	1,008,906,500	
スターツブロード投資法人	2,617	644,043,700	
タカラレーベン不動産投資法人	6,626	726,872,200	
トーセイ・リート投資法人	3,511	481,358,100	
ヒューリックリート投資法人	14,771	2,581,970,800	
フロンティア不動産投資法人	5,891	3,039,756,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,584	551,936,000	
マリモ地方創生リート投資法人	1,574	204,147,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	37,827	5,239,039,500	
ラサールロジポート投資法人	20,571	3,809,749,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	6,552	1,017,525,600	
阪急阪神リート投資法人	7,590	1,263,735,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,246	3,553,974,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,270	2,034,655,000	
産業ファンド投資法人	23,855	4,813,939,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	3,942	544,784,400	
森トラスト総合リート投資法人	12,009	1,750,912,200	
森ヒルズリート投資法人	19,759	2,969,777,700	
星野リゾート・リート投資法人	2,593	1,872,146,000	
積水ハウス・リート投資法人	49,423	4,512,319,900	
大江戸温泉リート投資法人	2,712	221,570,400	
大和ハウスリート投資法人	25,230	8,098,830,000	
大和証券オフィス投資法人	3,552	2,596,512,000	
大和証券リビング投資法人	22,705	2,533,878,000	
投資法人みらい	19,156	1,038,255,200	
東海道リート投資法人	1,287	137,451,600	
東急リアル・エステート投資法人	11,266	2,058,298,200	
日本アコモデーションファンド投資法人	5,802	3,597,240,000	
日本ビルファンド投資法人	19,044	13,540,284,000	
日本プライムリアルティ投資法人	11,043	4,433,764,500	
日本プロロジスリート投資法人	26,622	9,663,786,000	
日本リート投資法人	5,185	2,177,700,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	10,979	3,650,517,500	
日本都市ファンド投資法人	84,782	9,241,238,000	
福岡リート投資法人	8,690	1,453,837,000	
平和不動産リート投資法人	10,886	1,742,848,600	
野村不動産マスターファンド投資法人	54,338	9,183,122,000	
投資証券 合計	1,008,253	188,997,171,820	
合計		188,997,171,820	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	209,715,917
コール・ローン	124,025,349
投資信託受益証券	6,703,393,856
投資証券	57,292,684,724
未収入金	240,789
未収配当金	149,811,103
流動資産合計	64,479,871,738
資産合計	64,479,871,738
負債の部	
流動負債	
未払解約金	22,599,000
流動負債合計	22,599,000
負債合計	22,599,000
純資産の部	
元本等	
元本	40,756,471,365
剰余金	
剰余金又は欠損金()	23,700,801,373
元本等合計	64,457,272,738
純資産合計	64,457,272,738
負債純資産合計	64,479,871,738

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 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>
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 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12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	41,175,807,580円
同期中追加設定元本額	100,452,835,081円
同期中一部解約元本額	100,872,171,296円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	89,123,493円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	55,607,269円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,865,156円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	15,517,167円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	30,039,897円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	34,734,711円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,280,035円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	18,640,688円
たわらノーロード 先進国リート	9,805,454,751円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,540,656,751円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	351,059,870円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,835,800,945円
たわらノーロード バランス(堅実型)	18,072,886円
たわらノーロード バランス(標準型)	319,851,876円
たわらノーロード バランス(積極型)	624,990,072円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	55,947,112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)	143,293,437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)	273,786,709円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	7,042,892円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,191,762円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,260,959円
One DC 先進国リートインデックスファンド	780,742,890円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,050,217円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	591,801,177円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	49,505,985円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	205,280,393円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	256,897,674円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	480,395,998円
投資のソムリエ	8,913,383,298円
投資のソムリエ<DC年金>	455,117,592円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	196,233,945円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	269,860,333円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,530,422,706円
ワールドアセットバランス(基本コース)	557,530,093円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,746,085,151円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	22,261,506円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,697,217円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,640,529円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	60,694,182円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,358,645,407円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	172,062,970円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	17,734,174円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	8,564,383円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,967,245円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	65,820円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	369,129,500円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	172,707,186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)	137,425,208円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	255,258,945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)	140,818,021円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	125,559,493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)	85,970,749円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	66,936,067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)	135,862,362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)	507,928,231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)	135,449,629円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	247,648,214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)	230,892,784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)	2,696,840円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	107,039,562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)	249,341,212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)	1,915,564,074円
P-Oneマルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	340,995,307円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	554,411,768円
計	40,756,471,365円
2. 受益権の総数	40,756,471,365口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
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12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2021年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券	15,607,185	
投資証券	534,139,190	
合計	549,746,375	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2021年6月23日から2021年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2021年10月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5815円 (15,815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12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	295,400.000	230,412.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	514,800.000	370,656.000	
		PRIME US REIT	211,400.000	178,633.000	
	アメリカ・ドル	小計	1,094,300.000	779,701.000 (88,496,064)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	146,849.000	521,313.950	
		ARENA REIT	131,556.000	559,113.000	
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	156,209.000	504,555.070	
		BWP TRUST	172,929.000	705,550.320	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	227,531.000	741,751.060	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	205,446.000	739,605.600	
CENTURIA OFFICE REIT		154,639.000	375,772.770		
CHARTER HALL GROUP	174,807.000	2,928,017.250			
CHARTER HALL LONG WALE REIT	213,195.000	1,046,787.450			

	CHARTER HALL RETAIL REIT	199,391.000	803,545.730	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	116,700.000	420,120.000	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	497,602.000	405,545.630	
	DEXUS	402,856.000	4,201,788.080	
	DEXUS INDUSTRIA REIT	81,488.000	280,318.720	
	GDI PROPERTY GROUP	172,055.000	193,561.870	
	GOODMAN GROUP	627,729.000	13,113,258.810	
	GPT GROUP	718,072.000	3,540,094.960	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	103,182.000	423,046.200	
	HOME CONSORTIUM LTD	64,680.000	485,100.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	191,217.000	300,210.690	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,965.000	252,960.300	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	105,969.000	677,141.910	
	IRONGATE GROUP	181,433.000	274,870.990	
	MIRVAC GROUP	1,476,543.000	4,193,382.120	
	NATIONAL STORAGE REIT	387,416.000	898,805.120	
	RURAL FUNDS GROUP	133,303.000	359,918.100	
	SCENTRE GROUP	1,941,686.000	5,766,807.420	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	391,451.000	1,056,917.700	
	STOCKLAND	894,379.000	3,926,323.810	
	VICINITY CENTRES	1,450,005.000	2,443,258.420	
	WAYPOINT REIT LTD	303,188.000	830,735.120	
	オーストラリア・ドル 小計	12,097,471.000	52,970,178.170 (4,412,945,541)	
シンガポール・ ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	154,495.000	225,562.700	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	466,580.000	426,920.700	
	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,257,660.000	3,735,250.200	
	ASCOTT TRUST	707,016.000	703,480.920	
	CAPITALAND CHINA TRUST	365,880.000	457,350.000	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,869,209.000	3,925,338.900	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	263,100.000	313,089.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	127,400.000	100,646.000	
	ESR REIT	1,065,430.000	479,443.500	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	356,900.000	228,416.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	608,800.000	155,244.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	385,200.000	878,256.000	

		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,095,664.000	1,599,669.440	
		IREIT GLOBAL	186,300.000	119,232.000	
		KEPPEL DC REIT	456,600.000	1,068,444.000	
		KEPPEL REIT	703,000.000	759,240.000	
		LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	316,200.000	273,513.000	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	826,500.000	1,710,855.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	730,820.000	1,980,522.200	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,082,820.000	2,122,327.200	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	835,200.000	801,792.000	
		QUE COMMERCIAL REIT	958,855.000	431,484.750	
		PARKWAY LIFE REIT	148,900.000	670,050.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	170,300.000	142,200.500	
		SPH REIT	375,600.000	366,210.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	485,300.000	305,739.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	785,390.000	1,138,815.500	
		シンガポール・ドル 小計	16,785,119.000	25,119,092.510 (2,102,468,043)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	111,040.000	287,593.600	
	ユーロ 小計		111,040.000	287,593.600 (37,709,273)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,000.000	4,234,060.000	
	香港・ドル 小計		538,000.000	4,234,060.000 (61,774,935)	
投資信託受益証券 合計			30,625,930	6,703,393,856 (6,703,393,856)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	31,979.000	693,944.300	
		AGREE REALTY CORP	25,908.000	1,751,380.800	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	26,178.000	613,088.760	
		ALEXANDER'S INC.	736.000	198,793.600	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	51,768.000	9,932,208.480	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,917.000	90,866.160	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,051.000	742,989.000	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	52,143.000	2,628,007.200	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	41,588.000	349,339.200	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	102,482.000	3,925,060.600	
		AMERICOLD REALTY TRUST	97,831.000	2,751,986.030	

APARTMENT INCOME REIT CORP	58,807.000	2,937,997.720	
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	53,669.000	385,343.420	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	77,513.000	1,265,012.160	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	21,480.000	289,120.800	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	9,350.000	132,209.000	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	52,119.000	11,664,753.390	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	8,663.000	109,673.580	
BOSTON PROPERTIES INC	53,113.000	6,090,998.840	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,777.000	120,416.220	
BRANDYWINE REALTY TRUST	61,776.000	861,775.200	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	111,339.000	2,549,663.100	
BROADSTONE NET LEASE INC	59,768.000	1,506,153.600	
BRT APARTMENTS CORP	6,375.000	122,081.250	
CAMDEN PROPERTY TRUST	37,593.000	5,679,174.510	
CARETRUST REIT INC	35,140.000	712,639.200	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,828.000	124,602.640	
CENTERSPACE	5,077.000	490,742.820	
CHATHAM LODGING TRUST	16,797.000	205,763.250	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,068.000	36,530.640	
CITY OFFICE REIT INC	15,360.000	281,088.000	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	42,824.120	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	41,501.000	793,499.120	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,337.000	376,248.810	
COREPOINT LODGING INC	13,767.000	212,975.490	
CORESITE REALTY CORP	16,581.000	2,293,815.540	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,957.000	1,145,157.720	
COUSINS PROPERTIES INC	55,807.000	2,177,589.140	
CTO REALTY GROUTH INC	2,965.000	158,597.850	
CUBESMART	75,520.000	3,707,276.800	
CYRUSONE INC	46,423.000	3,517,470.710	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	76,286.000	698,016.900	
DIGITAL REALTY TRUST INC	105,462.000	14,736,205.260	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	179,505.000	1,200,888.450	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	83,977.000	297,278.580	
DOUGLAS EMMETT INC	65,863.000	2,162,282.290	

DUKE REALTY TRUST	141,349.000	7,155,086.380	
EAST GROUP	15,147.000	2,635,426.530	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	30,319.000	637,305.380	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	51,085.000	535,881.650	
EPR PROPERTIES	27,332.000	1,426,730.400	
EQUINIX INC	33,481.000	25,111,084.810	
EQUITY COMMONWEALTH	44,473.000	1,180,758.150	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	63,900.000	5,228,937.000	
EQUITY RESIDENTIAL	127,221.000	10,526,265.540	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	43,153.000	1,215,188.480	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,291.000	7,925,667.480	
EXTRA SPACE STORAGE INC	49,974.000	8,614,518.120	
FARMLAND PARTNERS INC	11,176.000	124,277.120	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,212.000	3,195,767.040	
FIRST INDUSTRIAL RT	48,411.000	2,600,638.920	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	27,490.000	762,022.800	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	32,561.000	169,642.810	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	83,289.000	3,967,887.960	
GEO GROUP INC	43,368.000	369,929.040	
GETTY REALTY CORP	13,990.000	426,275.300	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	12,908.000	274,682.240	
GLADSTONE LAND CORP	11,352.000	258,485.040	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	24,700.000	375,440.000	
GLOBAL NET LEASE INC	36,406.000	575,578.860	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	54,716.000	1,713,157.960	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	82,065.000	2,668,753.800	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	201,367.000	6,800,163.590	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	16,618.000	147,069.300	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	39,167.000	1,795,415.280	
HOST HOTELS & RESORTS INC	267,052.000	4,411,699.040	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	56,739.000	1,518,335.640	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	37,950.000	783,667.500	
INDUS REALTY TRUST INC	2,009.000	131,388.600	

INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	23,562.000	632,168.460	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,983.000	2,075,701.810	
INVITATION HOMES INC	215,306.000	8,315,117.720	
IRON MOUNTAIN INC	108,244.000	4,623,101.240	
JBG SMITH PROPERTIES	42,392.000	1,265,401.200	
KILROY REALTY CORP	39,286.000	2,675,769.460	
KIMCO REALTY	229,396.000	5,005,420.720	
KITE REALTY GROUP TRUST	30,547.000	672,644.940	
LEXINGTON REALTY TRUST	101,412.000	1,446,135.120	
LIFE STORAGE INC	29,323.000	3,470,377.050	
LTC PROPERTIES INC	14,200.000	467,038.000	
MACK CALI	28,607.000	509,204.600	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	222,810.000	4,442,831.400	
MID AMERICA	43,332.000	8,279,011.920	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	35,545.000	679,264.950	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,592.000	877,219.040	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	65,788.000	2,951,249.680	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	30,676.000	1,680,431.280	
NETSTREIT CORP	14,114.000	337,606.880	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,096.000	511,829.120	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,401.000	460,430.460	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	89,532.000	2,634,926.760	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,446.000	170,024.120	
PARAMOUNT GROUP INC	59,073.000	545,243.790	
PARK HOTELS & RESORTS INC	88,902.000	1,706,918.400	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	47,886.000	1,104,251.160	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	51,462.750	
PHYSICIANS REALTY TRUST	79,474.000	1,448,016.280	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	44,827.000	821,678.910	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,046.000	309,190.200	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,941.000	112,344.310	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	20,349.000	246,833.370	
PROLOGIS INC	275,741.000	35,554,044.540	
PS BUSINESS PARKS	7,333.000	1,219,257.910	
PUBLIC STORAGE	56,888.000	17,185,864.800	

REALTY INCOME CORP	145,395.000	9,851,965.200	
REGENCY CENTERS CORP	57,207.000	3,989,044.110	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	43,832.000	791,605.920	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	78,223.000	1,074,001.790	
RETAIL VALUE INC	7,197.000	200,868.270	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	51,602.000	2,993,948.040	
RLJ LODGING TRUST	60,302.000	893,675.640	
RPT REALTY	29,043.000	392,661.360	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,696.000	1,780,683.840	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	80,571.000	1,192,450.800	
SAFEHOLD INC	5,420.000	392,787.400	
SAUL CENTERS INC	4,477.000	206,210.620	
SERITAGE GROWTH PROPERTIES	12,543.000	183,002.370	
SERVICE PROPERTIES TRUST	59,624.000	679,713.600	
SIMON PROPERTY GROUP INC	122,629.000	16,263,057.980	
SITE CENTERS CORP	67,743.000	1,122,501.510	
SL GREEN	25,234.000	1,893,307.020	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	44,703.000	2,107,746.450	
STAG INDUSTRIAL INC	60,767.000	2,480,508.940	
STORE CAPITAL CORP	91,597.000	3,008,961.450	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,077.000	380,389.230	
SUN COMMUNITIES INC	43,290.000	8,167,091.400	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	79,340.000	986,989.600	
TANGER FACTORY OUTLET	37,559.000	614,089.650	
TERRENO REALTY CORP	26,515.000	1,735,141.600	
THE MACERICH COMPANY	77,817.000	1,358,684.820	
UDR INC	104,301.000	5,516,479.890	
UMH PROPERTIES INC	15,784.000	354,666.480	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,854.000	272,357.940	
URBAN EDGE PROPERTIES	42,764.000	780,443.000	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	10,398.000	201,513.240	
VENTAS INC	146,958.000	8,028,315.540	
VEREIT INC	85,742.000	4,056,454.020	
VICI PROPERTIES INC	229,394.000	6,718,950.260	
VORNADO REALTY TRUST	59,605.000	2,633,944.950	
WASHINGTON REIT	30,535.000	775,894.350	
WELLTOWER INC	157,721.000	13,065,607.640	
WHITESTONE REIT	17,850.000	178,678.500	

	WP CAREY INC	68,894.000	5,133,980.880	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	44,399.000	788,526.240	
アメリカ・ドル	小計	8,312,228.000	425,761,571.900 (48,323,938,408)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	50,845.000	52,573.730	
	ASSURA PLC	973,642.000	700,048.590	
	BIG YELLOW GROUP PLC	65,178.000	898,152.840	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	284,282.000	271,205.020	
	BRITISH LAND CO PLC	351,852.000	1,719,500.720	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	308,010.000	495,588.090	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	220,567.000	197,628.030	
	CUSTODIAN REIT PLC	177,203.000	167,811.240	
	DERWENT LONDON PLC	42,127.000	1,417,994.820	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	211,024.000	184,857.020	
	GCP STUDENT LIVING PLC	163,036.000	345,636.320	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	92,323.000	686,883.120	
	HAMMERSON PLC	1,513,235.000	491,801.370	
	HOME REIT PLC	100,813.000	108,878.040	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	119,601.000	136,105.930	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	281,621.000	1,945,437.860	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	342,121.000	822,458.880	
	LXI REIT PLC	273,458.000	388,857.270	
	NEWRIVER REIT PLC	139,604.000	110,426.760	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	192,372.000	185,446.600	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	484,126.000	734,419.140	
	PRS REIT PLC/THE	161,754.000	163,371.540	
	REGIONAL REIT LTD	148,338.000	129,647.410	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	79,592.000	865,960.960	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	255,156.000	126,557.370	
	SEGRO PLC	448,386.000	5,380,632.000	
	SHAFTESBURY PLC	104,662.000	630,588.550	
	STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	179,591.000	129,305.520	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	315,426.000	367,471.290	

	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	127,588.000	124,525.880	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	646,516.000	1,357,683.600	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	305,229.000	226,479.910	
	UNITE GROUP PLC	149,706.000	1,574,907.120	
	WORKSPACE GROUP PLC	49,590.000	419,531.400	
イギリス・ボンド 小計		9,589,614.000	23,558,373.940 (3,632,701,262)	
イスラエル・シュケル	REIT 1 LTD	66,161.000	1,253,089.340	
イスラエル・シュケル 小計		66,161.000	1,253,089.340 (44,064,887)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	22,575.000	918,351.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,898.000	255,549.660	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,672.000	73,962.880	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,193.000	453,306.830	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,000.000	28,140.000	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	31,841.000	1,865,882.600	
	CHOICE PROPERTIES REIT	57,893.000	851,606.030	
	COMINAR REAL ESTATE INV TR	33,464.000	336,313.200	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	16,561.000	294,951.410	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,601.000	354,543.210	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	36,891.000	609,439.320	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	8,435.000	200,331.250	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,576.000	90,122.880	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,471.000	749,380.970	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,197.000	1,121,148.240	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51,016.000	824,928.720	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	44,201.360	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,864.000	436,325.680	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,045.000	412,324.250	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,025.000	182,247.750	

	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	8,583.000	146,597.640	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,759.000	100,944.590	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,672.000	532,803.200	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	93,780.050	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	58,775.000	1,304,805.000	
	SLATE GROCERY REIT	10,657.000	138,327.860	
	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	59,798.760	
	SMARTCENTRES REIT	27,015.000	817,473.900	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	29,543.000	645,809.980	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	13,365.000	97,698.150	
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,414.000	389,754.560	
	カナダ・ドル 小計	697,889.000	14,430,850.930 (1,310,898,498)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	298,582.000	471,759.560	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	398,365.000	975,994.250	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	561,801.000	637,644.130	
	PRECINCT PROPERTIES	466,957.000	779,818.190	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	146,206.000	445,197.270	
	ニュージーランド・ドル 小計	1,871,911.000	3,310,413.400 (260,397,118)	
ユーロ	AEDIFICA	13,561.000	1,510,695.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	64,950.000	1,036,602.000	
	ALTAREA	1,404.000	255,247.200	
	BEFIMMO	8,766.000	308,124.900	
	CARE PROPERTY INVEST NV	9,500.000	249,375.000	
	CARMILA SA	17,349.000	231,782.640	
	COFINIMMO SA	10,220.000	1,369,480.000	
	COIMA RES SPA	5,171.000	35,731.610	
	COVIVIO	17,291.000	1,253,251.680	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	14,964.000	285,183.910	
	GECINA SA	20,361.000	2,403,616.050	
	HAMBORNER REIT AG	27,591.000	263,880.320	
	HIBERNIA REIT PLC	235,730.000	290,419.360	
	ICADE	11,647.000	795,490.100	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	26,547.000	105,657.060	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	96,500.000	805,775.000		

	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,227.000	202,384.200	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	164,689.000	251,974.170	
	KLEPIERRE	74,104.000	1,430,577.720	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	27,656.000	148,512.720	
	MERCIALYS	19,022.000	171,007.780	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	123,820.000	1,137,658.160	
	MONTEA SCA	3,932.000	467,121.600	
	NSI NV	6,166.000	204,094.600	
	RETAIL ESTATES	4,379.000	289,889.800	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	43,602.000	2,762,622.720	
	VASTNED RETAIL	7,225.000	173,761.250	
	WAREHOUSES DE PAUW	52,483.000	1,895,685.960	
	WERELDHAVE NV	14,260.000	177,822.200	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	6,748.000	338,749.600	
	ユーロ 小計	1,137,865.000	20,852,174.710 (2,734,137,148)	
韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	36,373.000	234,605,850.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,958.000	56,860,180.000	
	JR REIT XXVII	42,699.000	234,417,510.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,840.000	74,473,600.000	
	LOTTE REIT CO LTD	41,844.000	233,071,080.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	38,205.000	183,957,075.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	15,126.000	122,066,820.000	
	韓国・ウォン 小計	196,045.000	1,139,452,115.000 (107,906,115)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	673,070.000	2,732,664.200	
	LINK REIT	781,620.000	52,134,054.000	
	PROSPERITY REIT	506,000.000	1,553,420.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	346,000.000	1,553,540.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	611,000.000	2,248,480.000	
	香港・ドル 小計	2,917,690.000	60,222,158.200 (878,641,288)	
投資証券 合計		24,789,403	57,292,684,724 (57,292,684,724)	
合計			63,996,078,580 (63,996,078,580)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 4銘柄	0.14	-	75.65
	投資証券 154銘柄	-	74.97	
イギリス・ポンド	投資証券 35銘柄	-	5.64	5.68
イスラエル・シケル	投資証券 1銘柄	-	0.07	0.07
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	6.85	-	6.90
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	-	2.03	2.05
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 27銘柄	3.26	-	3.29
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-	0.40	0.41
	投資信託受益証券 1銘柄	0.06	-	
ユーロ	投資証券 30銘柄	-	4.24	4.33
	投資信託受益証券 1銘柄	0.06	-	
韓国・ウォン	投資証券 7銘柄	-	0.17	0.17
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.10	-	1.47
	投資証券 5銘柄	-	1.36	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間(2021年10月13日から2022年4月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【たわらノーロード 最適化バランス(保守型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	268,921	432,431
親投資信託受益証券	33,126,904	38,284,428
未収入金	-	11,000
流動資産合計	33,395,825	38,727,859
資産合計		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	133,320
未払受託者報酬	7,188	7,852
未払委託者報酬	83,332	90,767
その他未払費用	549	585
流動負債合計	91,069	232,524
負債合計		
負債合計		
91,069		
232,524		
純資産の部		
元本等		
元本	32,087,475	38,687,613
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	1,217,281	192,278
(分配準備積立金)	336,175	309,864
元本等合計	33,304,756	38,495,335
純資産合計		
純資産合計		
33,304,756		
38,495,335		
負債純資産合計		
負債純資産合計		
33,395,825		
38,727,859		

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	35,033	1,484,476
営業収益合計	35,033	1,484,476
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	5,393	7,852
委託者報酬	62,799	90,767
その他費用	390	585
営業費用合計	68,583	99,204
営業利益又は営業損失()	103,616	1,583,680
経常利益又は経常損失()	103,616	1,583,680
中間純利益又は中間純損失()	103,616	1,583,680
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	1,641	14,229
期首剰余金又は期首欠損金()	814,496	1,217,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	583,624	265,462
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	583,624	265,462
剰余金減少額又は欠損金増加額	228,008	105,570
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	228,008	105,570
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,068,137	192,278

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自 2021年10月13日	至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 期首元本額	20,448,102円	32,087,475円
期中追加設定元本額	24,844,256円	9,387,646円
期中一部解約元本額	13,204,883円	2,787,508円
2. 受益権の総数	32,087,475口	38,687,613口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は192,278円でありませ

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
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)」にて記載してありませ (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ありませ	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
----------------------------	---	----

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,0379円 (10,379円)	0.9950円 (9,950円)

【たわらノーロード 最適化バランス(安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	461,672	671,680
親投資信託受益証券	59,621,736	78,841,208
流動資産合計	60,083,408	79,512,888
資産合計	60,083,408	79,512,888
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,519	35,466
未払受託者報酬	10,041	16,184
未払委託者報酬	116,036	186,704
その他未払費用	813	1,377
流動負債合計	138,409	239,731
負債合計	138,409	239,731
純資産の部		
元本等		
元本	53,251,724	73,053,701
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	6,693,275	6,219,456
(分配準備積立金)	2,159,651	1,678,516
元本等合計	59,944,999	79,273,157
純資産合計	59,944,999	79,273,157
負債純資産合計	60,083,408	79,512,888

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	1,672,644	2,862,528
営業収益合計	1,672,644	2,862,527
営業費用		
支払利息	4	6
受託者報酬	7,939	16,184
委託者報酬	91,754	186,704
その他費用	577	1,377
営業費用合計	100,274	204,271
営業利益又は営業損失()	1,572,370	3,066,798
経常利益又は経常損失()	1,572,370	3,066,798
中間純利益又は中間純損失()	1,572,370	3,066,798
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	214,831	350,329
期首剰余金又は期首欠損金()	2,233,502	6,693,275
剰余金増加額又は欠損金減少額	933,283	4,476,428
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	933,283	4,476,428
剰余金減少額又は欠損金増加額	772,713	2,233,778
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	772,713	2,233,778
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	3,751,611	6,219,456

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自	至
	2021年10月13日	2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 期首元本額	34,965,629円	53,251,724円
期中追加設定元本額	33,732,331円	37,586,926円
期中一部解約元本額	15,446,236円	17,784,949円
2. 受益権の総数	53,251,724口	73,053,701口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1257円 (11,257円)	1.0851円 (10,851円)

【たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,482,757	8,131,936
親投資信託受益証券	543,352,929	849,905,045
流動資産合計	547,835,686	858,036,981
資産合計	547,835,686	858,036,981
負債の部		
流動負債		
未払解約金	550,951	1,168,865
未払受託者報酬	67,873	155,584
未払委託者報酬	781,080	1,789,769
その他未払費用	5,948	13,765
流動負債合計	1,405,852	3,127,983
負債合計	1,405,852	3,127,983
純資産の部		
元本等		
元本	468,979,128	752,239,043
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	77,450,706	102,669,955
(分配準備積立金)	10,155,195	8,624,196
元本等合計	546,429,834	854,908,998
純資産合計	546,429,834	854,908,998
負債純資産合計	547,835,686	858,036,981

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日
営業収益		
受取利息	-	24
有価証券売買等損益	7,658,922	19,364,884
営業収益合計	7,658,922	19,364,860
営業費用		
支払利息	25	524
受託者報酬	22,076	155,584
委託者報酬	254,551	1,789,769
その他費用	1,871	13,765
営業費用合計	278,523	1,959,642
営業利益又は営業損失()	7,380,399	21,324,502
経常利益又は経常損失()	7,380,399	21,324,502
中間純利益又は中間純損失()	7,380,399	21,324,502
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	754,991	846,678
期首剰余金又は期首欠損金()	5,585,406	77,450,706
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,518,723	62,150,927
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,518,723	62,150,927
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,826,524	16,453,854
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,826,524	16,453,854
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	16,903,013	102,669,955

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自 2021年10月13日	至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 期首元本額	86,738,094円	468,979,128円
期中追加設定元本額	444,800,840円	381,093,698円
期中一部解約元本額	62,559,806円	97,833,783円
2. 受益権の総数	468,979,128口	752,239,043口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.1651円	1.1365円
(1万口当たり純資産額)	(11,651円)	(11,365円)

【たわらノーロード 最適化バランス(成長型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	859,698	704,004
親投資信託受益証券	82,197,914	90,322,797
未収入金	100,000	-
流動資産合計	83,157,612	91,026,801
資産合計	83,157,612	91,026,801
負債の部		
流動負債		
未払解約金	250,384	500
未払受託者報酬	15,145	18,653
未払委託者報酬	174,559	214,965
その他未払費用	1,254	1,596
流動負債合計	441,342	235,714
負債合計	441,342	235,714
純資産の部		
元本等		
元本	67,259,471	74,170,816
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	15,456,799	16,620,271
(分配準備積立金)	6,338,724	4,949,960
元本等合計	82,716,270	90,791,087
純資産合計	82,716,270	90,791,087
負債純資産合計	83,157,612	91,026,801

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	5,387,884	4,117
営業収益合計	5,387,884	4,117
営業費用		
支払利息	6	29
受託者報酬	9,788	18,653
委託者報酬	113,057	214,965
その他費用	804	1,596
営業費用合計	123,655	235,243
営業利益又は営業損失()	5,264,229	239,360
経常利益又は経常損失()	5,264,229	239,360
中間純利益又は中間純損失()	5,264,229	239,360
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	863,411	378,904
期首剰余金又は期首欠損金()	2,404,406	15,456,799
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,885,596	5,520,547
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,885,596	5,520,547
剰余金減少額又は欠損金増加額	989,363	3,738,811
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	989,363	3,738,811
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	7,701,457	16,620,271

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自 2021年10月13日	至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 期首元本額	38,133,188円	67,259,471円
期中追加設定元本額	51,733,528円	23,078,133円
期中一部解約元本額	22,607,245円	16,166,788円
2. 受益権の総数	67,259,471口	74,170,816口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
1口当たり純資産額	1,2298円	1,2241円
(1万口当たり純資産額)	(12,298円)	(12,241円)

【たわらノーロード 最適化バランス(積極型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,277,770	2,185,789
親投資信託受益証券	176,238,141	225,466,787
未収入金	-	515,000
流動資産合計	177,515,911	228,167,576
資産合計	177,515,911	228,167,576
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,596	872,600
未払受託者報酬	28,844	45,955
未払委託者報酬	332,135	528,880
その他未払費用	2,463	3,996
流動負債合計	371,038	1,451,431
負債合計	371,038	1,451,431
純資産の部		
元本等		
元本	137,707,368	173,702,498
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	39,437,505	53,013,647
(分配準備積立金)	15,899,987	12,114,873
元本等合計	177,144,873	226,716,145
純資産合計	177,144,873	226,716,145
負債純資産合計	177,515,911	228,167,576

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期中間計算期間 自 2020年10月13日 至 2021年4月12日	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日
営業収益		
受取利息	-	2
有価証券売買等損益	11,827,700	2,236,646
営業収益合計	11,827,700	2,236,648
営業費用		
支払利息	15	110
受託者報酬	16,588	45,955
委託者報酬	191,307	528,880
その他費用	1,377	3,996
営業費用合計	209,287	578,941
営業利益又は営業損失()	11,618,413	1,657,707
経常利益又は経常損失()	11,618,413	1,657,707
中間純利益又は中間純損失()	11,618,413	1,657,707
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	909,105	72,757
期首剰余金又は期首欠損金()	3,955,570	39,437,505
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,288,044	24,195,325
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,288,044	24,195,325
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,180,001	12,204,133
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,180,001	12,204,133
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	16,772,921	53,013,647

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第5期中間計算期間	
	自 2021年10月13日	至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 期首元本額	68,013,037円	137,707,368円
期中追加設定元本額	99,789,186円	77,621,221円
期中一部解約元本額	30,094,855円	41,626,091円
2. 受益権の総数	137,707,368口	173,702,498口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期	第5期中間計算期間末
	2021年10月12日現在	2022年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期中間計算期間末 2022年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2864円 (12,864円)	1.3052円 (13,052円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,084,444,982
株式	364,137,666,676
派生商品評価勘定	316,426,180
未収配当金	4,653,723,045
差入委託証拠金	701,505,000
流動資産合計	381,893,765,883
資産合計	381,893,765,883
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	427,778,080
前受金	146,040,000
未払解約金	107,387,000
流動負債合計	681,205,080
負債合計	681,205,080
純資産の部	
元本等	
元本	122,097,253,056
剰余金	
剰余金又は欠損金()	259,115,307,747
元本等合計	381,212,560,803
純資産合計	381,212,560,803
負債純資産合計	381,893,765,883

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	123,946,519,436円
同期中追加設定元本額	116,430,191,567円
同期中一部解約元本額	118,279,457,947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	2,689,106,129円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	6,976,967,534円
One DC 国内株式インデックスファンド	20,842,492,015円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,711,254,951円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	5,402,887円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	24,888,907円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	111,807,135円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,302,412円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,928,177円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,529,980円
たわらノーロード TOPIX	1,370,909,196円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,131,500,565円
たわらノーロード バランス(堅実型)	42,771,206円
たわらノーロード バランス(標準型)	279,562,885円
たわらノーロード バランス(積極型)	437,912,649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)	3,527,105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)	169,308,483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)	434,839,612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)	293,966,075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)	424,442,564円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	712,952円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,955,810円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	42,709,163円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,154,774円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	19,831,971円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,904,329,667円
Oneグローバルバランス	5,088,077円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,070,840,582円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,560,725,462円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,837,557,882円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	346,859,921円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,115,372,319円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,125,450,046円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	32,713,491円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,116,553,539円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	15,484,653円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	309,475,685円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	308,861,026円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	547,544,408円
投資のソムリエ	15,065,349,651円
クルーズコントロール	338,825,643円
投資のソムリエ<DC年金>	916,190,203円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	338,355,786円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	577,317,755円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	452,775,498円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,526,001,301円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	41,445,218円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	21,368,454円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,098,829円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	131,087,415円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	365,109,057円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	570,162,666円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	297,779,050円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	41,398,322円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	18,438,906円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,047,928円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	122,785,771円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,619,814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)	1,508,892円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	1,428,548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)	21,508,092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)	883,293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)	1,485,019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)	3,694,551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)	10,989,111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)	68,800,315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)	18,029,169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)	12,498,039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)	1,184,343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)	12,636,763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)2021-12(適格機関投資家限定)	18,207,688円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	383,274,045円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	33,643,088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)	38,131,400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)	2,500,226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)	13,420,156円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	35,982,151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)	51,431,272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)	98,330,470円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,774,616円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,193,546円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,466,304円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,230,648円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,918,016円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	29,466,211円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	524,198,593円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	610,290,206円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,762,575,611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)	28,281,497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)	27,048,868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)	282,182,492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)	69,675,855円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,380,977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)	330,901,081円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	19,995,091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)	71,142,183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)	164,263,418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)	221,384,323円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	35,331,281円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	17,086,483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>	14,951,285円
コア資産形成ファンド	10,039,766円
MHAMトピックスファンド	720,550,123円
MHAM TOPIXファンドVA（適格機関投資家専用）	64,951,581円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	2,065,811,220円
MHAM日本株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,849,210,805円
計	122,097,253,056円
2. 受益権の総数	122,097,253,056口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年4月12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				
先物取引				
買建	17,422,995,000	-	17,311,950,000	111,045,000
合計	17,422,995,000	-	17,311,950,000	111,045,000

（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ではありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年4月12日現在
1口当たり純資産額	3,122.22円
(1万口当たり純資産額)	(31,222.22円)

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)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,062,165,167
国債証券	455,042,479,300
地方債証券	31,008,934,967
特殊債券	28,293,491,912
社債券	27,904,879,060
未収利息	478,486,515
前払費用	90,470,164
流動資産合計	544,880,907,085
資産合計	544,880,907,085
負債の部	
流動負債	
未払金	51,477,367,000
未払解約金	511,763,000
流動負債合計	51,989,130,000
負債合計	51,989,130,000
純資産の部	
元本等	
元本	384,856,597,878
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	108,035,179,207
元本等合計	492,891,777,085
純資産合計	492,891,777,085
負債純資産合計	544,880,907,085

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	405,313,486,765円
同期中追加設定元本額	391,009,186,732円
同期中一部解約元本額	411,466,075,619円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	24,875,871,480円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	147,584,576円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	176,402,888円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	186,592,276円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	694,440,939円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	133,937,077円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	24,165,922円
たわらノーロード 国内債券	16,062,066,556円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,689,437,658円
たわらノーロード バランス(堅実型)	941,736,726円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,639,684,890円
たわらノーロード バランス(積極型)	210,720,470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)	77,017,986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)	1,360,403,290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)	1,299,423,598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)	351,952,938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)	24,456,920円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	18,017,977円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	14,081,204円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	104,898,244円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,102,892円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	414,272円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,311,094,376円
Oneグローバルバランス	11,893,078円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	9,060,467,385円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,591,625,188円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,242,580,684円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,210,797,748円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,334,451,587円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	385,782,207円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	100,647,011円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,434,833,812円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,441,521円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,318,007,035円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,598,736,163円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	335,747,530円
投資のソムリエ	55,836,225,717円
クルーズコントロール	837,877,625円
投資のソムリエ<DC年金>	3,395,245,812円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,701,247,585円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	794,873,899円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	3,974,303,164円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	22,184,350,526円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	23,801,278円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,057,020円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	27,210,471円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	207,839,119円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,402,383,298円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,925,813,472円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,382,051,831円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	28,229,721円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,367,417円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,071,040円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	377,430,982円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	913,729円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,925,572,990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)	1,972,924,761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)	1,522,987,910円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	1,204,874,172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)	1,903,971,380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)	4,909,368,609円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型・シグナルヘッジ付き)2021-06(適格機関投資家限定)	1,920,169,465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)	1,717,672,121円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,108,404,978円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,745,194,385円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,420,335,275円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	280,372,567円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,870,266,482円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,881,603,781円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	4,838,160,658円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	3,272,119,464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)	47,835,239円
AMOne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)	221,474,815円

しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	316,721,502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)	156,495,610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)	99,660,098円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	28,257,309円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	99,630,316円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	34,658,760円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,160,211円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,313,562円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	112,492,722円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,545,633,618円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,321,370,678円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,468,736,713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)	108,086,339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)	171,547,412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)	2,149,046,016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)	176,653,533円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,511,996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)	2,241,844,214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)	50,694,743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)	361,059,031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)	555,337,564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)	935,738,018円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	294,438,137円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	101,100,770円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	935,002,540円
動的パッケージファンド<DC年金>	345,510,906円
コア資産形成ファンド	227,623,515円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	40,656,167,261円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	47,913,964,167円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	13,869,926,842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]	1,646,644,903円
計	384,856,597,878円
2. 受益権の総数	384,856,597,878口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2807円 (12,807円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,759,759,547
コール・ローン	5,363,240,731
株式	711,829,729,331
投資信託受益証券	1,346,538,891
投資証券	16,866,705,256
派生商品評価勘定	154,324,720
未収入金	33,746,485
未収配当金	889,338,085
差入委託証拠金	4,745,051,239
流動資産合計	745,988,434,285
資産合計	
745,988,434,285	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	213,510,462
未払解約金	148,824,000
流動負債合計	362,334,462
負債合計	
362,334,462	
純資産の部	
元本等	
元本	121,204,530,333
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	624,421,569,490
元本等合計	745,626,099,823
純資産合計	745,626,099,823
負債純資産合計	745,988,434,285

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	108,379,642,938円
同期中追加設定元本額	58,843,158,628円
同期中一部解約元本額	46,018,271,233円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,274,995,970円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	4,425,622円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	15,897,546円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	87,626,291円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	20,739,797円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	12,071,571円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	11,348,005円
たわらノーロード 先進国株式	30,849,753,969円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	387,014,834円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,710,272,846円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	604,832,032円
たわらノーロード バランス(堅実型)	65,592,001円
たわらノーロード バランス(標準型)	554,218,035円
たわらノーロード バランス(積極型)	698,853,141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)	922,478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)	138,230,900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)	421,830,293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)	323,852,329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)	483,502,578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)	1,158,318円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	19,553,036円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,417,953円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,748,552円
たわらノーロード 全世界株式	262,036,585円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	51,972,005,842円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,353,658,897円
Oneグローバルバランス	2,630,985円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	154,485,867円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	779,333,475円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,001,077,525円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	94,918,018円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	260,944,399円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	243,821,529円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,816,057円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	606,914,833円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,370,292円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	168,619,253円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	168,723,784円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	306,043,035円
投資のソムリエ	6,000,870,379円
クルーズコントロール	86,797,562円
投資のソムリエ<DC年金>	364,969,273円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	189,274,749円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	150,045,351円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	242,751,652円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,354,950,594円
ワールドアセットバランス(基本コース)	183,505,989円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	217,571,884円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	23,622,741円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,038,274円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,661,103円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	34,701,801円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	99,116,235円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	298,356,006円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,156,281円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	21,076,069円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,486,353円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,005,864円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	31,935,086円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	924,244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)	1,080,114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)	1,203,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	10,092,199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)	719,029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)	1,054,128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)	126,341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)	36,823,913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)	961,920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)	954,472,732円
DIAM外国株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	63,301,290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)	1,190,732,214円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	204,273,849円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,081,745,212円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	152,686,053円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,541,099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)	1,911,209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)	5,188,072円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	19,406,215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)	26,921,019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)	51,469,533円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,499,178円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	20,569,218円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,429,943円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	429,241円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,621,072円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,109,494円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	182,864,194円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	279,503,926円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	922,614,593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)	74,110,161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)	42,452,786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)	295,691,920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)	12,140,461円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	3,250,238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)	115,421,592円

D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	10,466,439円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	37,237,613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)	57,311,480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)	115,881,575円
動的パッケージファンド<DC年金>	7,367,469円
コア資産形成ファンド	4,833,950円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,513,931,748円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,726,646円
MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	15,134,035円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,023,699,208円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,781,444,986円
計	121,204,530,333円
2. 受益権の総数	121,204,530,333口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建				
アメリカ・ドル	5,221,454,065	-	5,256,564,568	35,110,503
イギリス・ポンド	3,938,501,640	-	3,967,221,679	28,720,039
	141,930,102	-	142,894,400	964,298

オーストラリア・ドル	129,556,991	-	129,882,819	325,828
カナダ・ドル	275,298,254	-	276,131,758	833,504
ユーロ	736,167,078	-	740,433,912	4,266,834
合計	5,221,454,065	-	5,256,564,568	35,110,503

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	15,628,972,864	-	15,534,676,619	94,296,245
合計	15,628,972,864	-	15,534,676,619	94,296,245

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年4月12日現在	
1口当たり純資産額		6.1518円
(1万口当たり純資産額)		(61,518円)

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)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	515,006,706
コール・ローン	10,012,644,029
国債証券	178,069,547,635
派生商品評価勘定	64,468,106
未収利息	986,892,540
前払費用	164,050,645
流動資産合計	189,812,609,661
資産合計	189,812,609,661
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	335,390
未払金	9,458,640,753
未払解約金	58,064,000
流動負債合計	9,517,040,143
負債合計	9,517,040,143
純資産の部	
元本等	
元本	87,475,811,588
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,819,757,930
元本等合計	180,295,569,518
純資産合計	180,295,569,518
負債純資産合計	189,812,609,661

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	73,151,994,654円
同期中追加設定元本額	26,969,410,045円
同期中一部解約元本額	12,645,593,111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	7,734,968,634円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	11,836,308円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	41,924,699円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	174,183,104円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	55,432,582円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	31,884,189円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	22,638,637円
たわらノーロード 先進国債券	13,656,394,854円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	238,604,527円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,752,782,433円
たわらノーロード バランス（堅実型）	49,728,389円
たわらノーロード バランス（標準型）	247,224,455円
たわらノーロード バランス（積極型）	52,448,447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）	6,495,388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）	326,167,168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）	391,453,551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）	77,158,611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）	370,460円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,096,602円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	29,423,682円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,179,463円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,200,381円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,293,354,167円
O n e DC 先進国債券インデックスファンド	602,656,016円

Oneグローバルバランス	7,894,039円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	711,700,267円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,226,508,317円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,403,942,419円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	402,785,778円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	838,867,705円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	702,200,052円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,483,375円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	494,372,256円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,330,259円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	142,143,683円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	125,371,251円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	214,713,670円
クルーズコントロール	783,018,121円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	154,405,852円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	356,574,720円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	430,686,668円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	181,479,592円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	95,773,428円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,181,097,770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)	515,001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)	358,315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)	95,948,247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)	418,167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)	546,045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)	3,468,868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)	191,664,142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)	294,771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)	5,447,957,595円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,635,478,567円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,560,732,946円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,290,591,836円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	53,063,248円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	645,235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)	389,624,362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)	248,177,650円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	17,578,771円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	41,315,531円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,621,810円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	646,314円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	16,370,015円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	46,417,254円

D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,929,952,575円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,564,511,123円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,780,096,754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)	111,686,570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)	149,423,867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)	1,783,286,857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)	403,184,341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)	3,268,456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)	347,802,652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)	345,476,868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)	465,649,166円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	55,725,532円
動的パッケージファンド<DC年金>	77,125,423円
コア資産形成ファンド	50,935,086円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	2,632,900,396円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	233,018,450円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	10,619,227,357円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,560,506,260円
計	87,475,811,588円
2. 受益権の総数	87,475,811,588口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年4月12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	9,702,086,810	-	9,766,219,526	64,132,716	
アメリカ・ドル	4,787,951,000	-	4,823,950,919	35,999,919	
イギリス・ポンド	541,300,000	-	545,181,410	3,881,410	
オーストラリア・ドル	159,797,000	-	160,221,148	424,148	
オフショア・人民元	146,936,000	-	147,547,200	611,200	
カナダ・ドル	198,201,000	-	198,825,379	624,379	
デンマーク・クローネ	39,939,000	-	40,170,923	231,923	
ノルウェー・クローネ	41,375,000	-	41,079,257	295,743	
ポーランド・ズロチ	55,354,000	-	55,314,353	39,647	
マレーシア・リングgit	49,194,810	-	49,251,703	56,893	
メキシコ・ペソ	71,808,000	-	72,851,176	1,043,176	
ユーロ	3,610,231,000	-	3,631,826,058	21,595,058	
合計	9,702,086,810	-	9,766,219,526	64,132,716	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年4月12日現在	
1口当たり純資産額	2.0611円
(1万口当たり純資産額)	(20,611円)

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,909,491,035
国債証券	294,496,454,273
未収入金	1,420,885,354
未収利息	1,205,251,781
前払費用	721,389,714
流動資産合計	300,753,472,157
資産合計	
300,753,472,157	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,124,693,985
前受金	456,591,787
未払金	54,846,095
未払解約金	887,124,000
流動負債合計	8,523,255,867
負債合計	
8,523,255,867	
純資産の部	
元本等	
元本	221,295,334,501
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	70,934,881,789
元本等合計	292,230,216,290
純資産合計	
292,230,216,290	
負債純資産合計	
300,753,472,157	

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	366,229,927,093円
同期中追加設定元本額	559,006,737,825円
同期中一部解約元本額	703,941,330,417円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	7,694,152,594円
たわらノーロード バランス(堅実型)	842,389,979円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,193,725,675円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,052,644,819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)	45,737,640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)	1,414,448,554円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	1,730,895,536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)	553,779,350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)	280,370,220円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	7,516,387円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	19,143,759円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	174,561,412円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	12,781,174円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	19,699,393円
投資のソムリエ	97,180,399,598円
投資のソムリエ<DC年金>	5,909,726,672円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,608,382,952円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	31,300,280,462円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,422,612,386円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	2,642,917,728円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	366,357,654円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	185,723,084円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	38,394,483円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,422,645,973円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,568,708,498円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,117,489,890円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	387,906,524円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	159,802,294円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	122,661,858円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	14,129,501円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,899,525,100円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	7,235,990,271円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,471,780,210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)	84,083,666円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	446,653,257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)	534,092,788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)	48,430,283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)	344,927,280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)	663,188,608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)	893,932,256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)	1,980,063,066円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,187,671,809円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	2,899,010,363円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	115,999,495円
計	221,295,334,501円
2. 受益権の総数	221,295,334,501口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年4月12日現在			
	契約額等（円）	うち		評価損益（円）
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建				
アメリカ・ドル	297,408,480,210	-	304,533,174,195	7,124,693,985
イギリス・ポンド	143,521,576,100	-	148,463,452,701	4,941,876,601
イスラエル・シケル	16,092,258,129	-	16,464,218,756	371,960,627
イスラエル・シケル	1,336,015,912	-	1,369,686,671	33,670,759
オーストラリア・ドル	4,853,986,027	-	4,954,602,878	100,616,851
オフショア・人民元	4,415,790,754	-	4,538,878,781	123,088,027
カナダ・ドル	6,058,018,942	-	6,187,037,794	129,018,852
シンガポール・ドル	1,245,722,525	-	1,276,676,773	30,954,248
スウェーデン・クローナ	841,008,086	-	853,044,997	12,036,911
デンマーク・クローネ	1,233,350,070	-	1,246,789,044	13,438,974
ノルウェー・クローネ	788,019,622	-	807,075,492	19,055,870
ポーランド・ズロチ	1,348,234,910	-	1,356,759,305	8,524,395
マレーシア・リンギット	1,454,232,230	-	1,484,287,936	30,055,706
メキシコ・ペソ	2,225,856,909	-	2,306,118,190	80,261,281
ユーロ	111,994,409,994	-	113,224,544,877	1,230,134,883
合計	297,408,480,210	-	304,533,174,195	7,124,693,985

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年4月12日現在	
1口当たり純資産額		1.3205円
(1万口当たり純資産額)		(13,205円)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	19,982,761,340
コール・ローン	551,000,801
株式	52,411,197,528
投資信託受益証券	354,584,427
投資証券	47,031,402
派生商品評価勘定	422,532
未収入金	1,578,445,361
未収配当金	160,011,397
差入委託証拠金	2,581,180,034
流動資産合計	77,666,634,822
資産合計	
77,666,634,822	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	198,899,653
未払金	9,859
未払解約金	15,051,798,000
流動負債合計	15,250,707,512
負債合計	
15,250,707,512	
純資産の部	
元本等	
元本	43,324,130,286
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,091,797,024
元本等合計	62,415,927,310
純資産合計	
62,415,927,310	
負債純資産合計	
77,666,634,822	

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,320,766,854円
同期中追加設定元本額	39,098,514,346円
同期中一部解約元本額	39,095,150,914円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	8,158,149,055円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	316,460,911円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	5,065,871円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	18,938,511円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	105,968,279円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,026,610円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,611,780円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	14,356,432円
たわらノーロード 新興国株式	9,216,470,158円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,875,278,271円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,578,644,415円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,686,677円
たわらノーロード バランス(標準型)	88,594,794円
たわらノーロード バランス(積極型)	150,290,585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)	126,549,606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)	209,700,011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)	184,039,208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)	260,945,681円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	540,273円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	18,047,275円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	1,905,741円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,346,203円
たわらノーロード 全世界株式	149,095,588円
One DC 新興国株式インデックスファンド	395,587,658円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	385,912,567円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	345,994,625円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	463,152,779円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	940,074,201円
投資のソムリエ	8,414,976,041円
クルーズコントロール	371,495,340円
投資のソムリエ<DC年金>	512,003,596円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	377,344,929円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	512,932,398円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,856,021,516円
ワールドアセットバランス(基本コース)	755,160,967円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	832,729,130円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	17,362,940円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,593,766円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,509,820円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	60,654,292円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	512,298,207円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	334,081,535円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	14,127,616円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,563,166円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,875,009円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	682,711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)	12,616,953円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	213,862,757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)	7,398,029円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	40,668,920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)	248,271,540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)	123,372,252円
計	43,324,130,286円

2. 受益権の総数

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	17,907,384,700	-	17,944,990,176	37,605,476
アメリカ・ドル	14,666,115,018	-	14,703,754,494	37,639,476
インドネシア・ルピア	455,990,682	-	455,990,682	-
マレーシア・リングgit	296,079,000	-	296,045,000	34,000
韓国・ウォン	2,489,200,000	-	2,489,200,000	-
買建	3,241,269,682	-	3,234,405,538	6,864,144
アメリカ・ドル	3,241,269,682	-	3,234,405,538	6,864,144
合計	21,148,654,382	-	21,179,395,714	44,469,620

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年4月12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	9,727,297,055	-	9,573,289,554	154,007,501
合計	9,727,297,055	-	9,573,289,554	154,007,501

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年4月12日現在	
1口当たり純資産額	1.4407円
(1万口当たり純資産額)	(14,407円)

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,192,891,525
コール・ローン	583,882,063
国債証券	132,990,819,400
派生商品評価勘定	3,007,542
未収利息	461,421,454
前払費用	1,026,112,580
流動資産合計	141,258,134,564
資産合計	141,258,134,564
負債の部	
流動負債	
未払金	5,066,692,546
未払解約金	84,705,000
流動負債合計	5,151,397,546
負債合計	5,151,397,546
純資産の部	
元本等	
元本	68,789,504,118
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,317,232,900
元本等合計	136,106,737,018
純資産合計	136,106,737,018
負債純資産合計	141,258,134,564

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,254,579,544円
同期中追加設定元本額	104,081,688,716円
同期中一部解約元本額	87,546,764,142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）	193,172,059円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	1,805,489,673円
たわらノーロード バランス（堅実型）	136,598,446円
たわらノーロード バランス（標準型）	384,227,070円
たわらノーロード バランス（積極型）	162,945,301円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	1,154,848円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,149,906円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	29,603,165円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,217,012円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	2,211,511円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	59,256,549円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	236,077,296円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	324,643,114円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	668,999,117円
投資のソムリエ	21,826,975,940円
クルーズコントロール	269,846,036円
投資のソムリエ<DC年金>	1,327,285,815円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	243,760,761円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,135,044,315円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,330,686,040円
ワールドアセットバランス（基本コース）	536,425,776円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	600,825,759円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	33,112,488円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	16,727,971円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	7,764,190円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	124,678,896円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	798,577,422円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	222,519,382円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	36,355,348円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	14,482,845円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	11,120,595円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,277,092円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	21,510,968,507円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	555,387,723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)	2,435,421,495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)	589,689,490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)	18,708,675円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	92,241,468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)	9,327,182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)	174,695,974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)	86,817,990円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,769,033,876円
計	68,789,504,118円
2. 受益権の総数	68,789,504,118口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	400,000,000 400,000,000	- -	403,007,542 403,007,542	3,007,542 3,007,542
合計	400,000,000	-	403,007,542	3,007,542

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.9786円
(1万口当たり純資産額)	(19,786円)

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,731,279,452
投資証券	200,811,190,900
派生商品評価勘定	253,073,730
未収入金	36,409,591
未収配当金	1,891,546,740
差入委託証拠金	269,923,500
流動資産合計	205,993,423,913
資産合計	205,993,423,913
負債の部	
流動負債	
前受金	276,700,800
未払解約金	139,227,000
流動負債合計	415,927,800
負債合計	415,927,800
純資産の部	
元本等	
元本	85,862,164,258
剰余金	
剰余金又は欠損金()	119,715,331,855
元本等合計	205,577,496,113
純資産合計	205,577,496,113
負債純資産合計	205,993,423,913

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	79,688,101,403円
同期中追加設定元本額	62,620,765,372円
同期中一部解約元本額	56,446,702,517円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	484,095円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,737,788円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	9,581,835円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,267,895円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,319,493円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,240,742円
たわらノーロード 国内リート	4,803,123,173円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	782,750,060円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,507,295,525円
たわらノーロード バランス(堅実型)	28,493,060円
たわらノーロード バランス(標準型)	530,312,874円
たわらノーロード バランス(積極型)	578,978,579円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	36,161円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	75,837,580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)	376,303,599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)	219,873,304円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	285,720,981円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,314,290円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	32,341,734円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,631,601円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	13,336,920円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,588,888円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	429,635,940円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	127,599,856円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	168,835,185円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	343,149,449円
投資のソムリエ	11,541,486,066円
投資のソムリエ<DC年金>	701,742,412円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	138,640,897円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	623,121,316円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,475,056,976円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	20,447,156円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,567,040円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,265,637円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	65,069,135円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	567,419,498円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,233,102円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	21,419,054円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,104,504円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,150,636円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	805,963円
Jリートインデックスファンド(DC)	50,761,571円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	79,722,801円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201401(適格機関投資家限定)	720,962,940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)	760,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	217,707,759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)	708,067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)	26,730,366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)	551,421円
固定比率マルチアセット戦略ファンド(米ドル建日本政府保証債活用型)(適格機関投資家限定)	198,568,060円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	59,683,551円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	140,219,304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)	527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	2,869,206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)	187,198,977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)	307,835,393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)	215,378,929円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	60,842,765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)	588,327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)	214,708,814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)2021-12(適格機関投資家限定)	309,456,284円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	4,388,887,510円 293,518,001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)	452,008,277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)	1,014,158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)	10,050,168円
日米資産配分戦略ファンド(TIPS活用型)(為替ヘッジ比率調整型)(適格機関投資家限定)	98,736,940円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	49,516,636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)	2,383,087,395円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,636,848,115円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	37,406,891,684円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,592,054,693円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	104,177,453円
計	85,862,164,258円
2. 受益権の総数	85,862,164,258口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2022年4月12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 先物取引 買建	4,354,064,700	-	4,607,395,500	253,330,800
合計	4,354,064,700	-	4,607,395,500	253,330,800

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.3943円
(1万口当たり純資産額)	(23,943円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

（単位：円）

2022年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	136,628,959
コール・ローン	195,114,412
投資信託受益証券	9,240,434,667
投資証券	80,782,492,059
未収配当金	168,355,992
流動資産合計	90,523,026,089
資産合計	90,523,026,089
負債の部	
流動負債	
未払解約金	105,933,000
流動負債合計	105,933,000
負債合計	105,933,000
純資産の部	
元本等	
元本	47,951,723,107
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	42,465,369,982
元本等合計	90,417,093,089
純資産合計	90,417,093,089
負債純資産合計	90,523,026,089

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10月13日 至 2022年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 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>
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 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	2022年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	40,756,471,365円
同期中追加設定元本額	79,150,897,575円
同期中一部解約元本額	71,955,645,833円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	93,610,630円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	53,188,676円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	6,720,407円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	24,131,558円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	132,958,227円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	31,753,977円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	18,321,557円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	17,488,632円
たわらノーロード 先進国リート	11,642,017,285円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,356,409,150円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	340,149,042円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,066,666,863円
たわらノーロード バランス(堅実型)	18,123,672円
たわらノーロード バランス(標準型)	340,589,058円
たわらノーロード バランス(積極型)	695,444,309円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	5,559,853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)	85,340,901円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	201,634,644円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,648,978円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,096,560円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,081,035円
One DC 先進国リートインデックスファンド	971,356,431円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,531,806円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	496,277,548円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	182,510,607円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	234,225,799円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	470,363,750円
投資のソムリエ	14,987,486,787円
投資のソムリエ<DC年金>	911,504,640円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	192,723,624円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	807,842,243円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	4,508,381,549円
ワールドアセットバランス(基本コース)	409,733,897円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	489,203,159円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	24,298,659円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	12,434,044円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,527,945円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	85,476,963円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	992,708,286円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	169,393,776円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	24,710,427円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,580,162円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,237,668円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	940,083円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	300,737,842円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	232,492,990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)	983,915円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型)20-04(適格機関投資家限定)	91,764,215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)	656,048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)	39,117,042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)	459,027円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	50,771,390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)	583,400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)	826,526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)	692,408円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	381,230,516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)	1,380,735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)	12,763,280円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	64,473,129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)	80,884,938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)	191,815,259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)	2,859,200,727円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	436,644,185円
計	47,951,723,107円
2. 受益権の総数	47,951,723,107口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.8856円
(1万口当たり純資産額)	(18,856円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

2022年4月28日現在

資産総額	38,919,188円
負債総額	251,699円
純資産総額（ - ）	38,667,489円
発行済数量	38,799,813口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9966円

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

2022年4月28日現在

資産総額	79,877,604円
負債総額	19,875円
純資産総額（ - ）	79,857,729円
発行済数量	73,646,212口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0843円

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

2022年4月28日現在

資産総額	864,350,667円
負債総額	10,124,732円
純資産総額（ - ）	854,225,935円
発行済数量	753,250,877口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1341円

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

2022年4月28日現在

資産総額	91,559,664円
負債総額	136,201円
純資産総額（ - ）	91,423,463円
発行済数量	74,936,215口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2200円

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

2022年4月28日現在

資産総額	225,621,060円
負債総額	1,116,529円
純資産総額（ - ）	224,504,531円
発行済数量	172,757,006口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2995円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	394,784,172,381円
負債総額	34,763,159,590円
純資産総額（ - ）	360,021,012,791円
発行済数量	113,104,109,991口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1831円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	586,843,394,168円
負債総額	2,421,451,000円
純資産総額（ - ）	584,421,943,168円
発行済数量	455,438,758,440口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2832円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	724,842,441,667円
負債総額	1,767,385,733円
純資産総額（ - ）	723,075,055,934円
発行済数量	121,189,732,491口
1口当たり純資産額（ / ）	5.9665円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	182,143,322,274円
負債総額	2,000,632,000円
純資産総額（ - ）	180,142,690,274円
発行済数量	86,782,053,567口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0758円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	499,670,073,007円
負債総額	164,199,715,804円
純資産総額（ - ）	335,470,357,203円
発行済数量	254,907,028,442口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3160円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	61,258,251,986円
負債総額	1,243,817,872円
純資産総額（ - ）	60,014,434,114円
発行済数量	43,374,012,832口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3836円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	136,863,868,596円
負債総額	6,610,785,351円
純資産総額（ - ）	130,253,083,245円
発行済数量	65,578,571,980口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9862円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	205,902,063,936円
負債総額	13,684,864,410円
純資産総額(-)	192,217,199,526円
発行済数量	80,307,692,674口
1口当たり純資産額(/)	2.3935円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年4月28日現在

資産総額	91,377,075,999円
負債総額	3,132,412,511円
純資産総額(-)	88,244,663,488円
発行済数量	46,374,777,785口
1口当たり純資産額(/)	1.9029円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2022年4月28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（2022年4月28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。

2022年4月28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	1,471,714,623,702
追加型株式投資信託	810	14,822,397,858,988
単位型公社債投資信託	27	53,750,145,946
単位型株式投資信託	220	1,232,854,578,168
合計	1,083	17,580,717,206,804

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 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期事業年度の財務諸表及び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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第37期事業年度（自2021年4月1日至2022年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	36,734	31,421
金銭の信託	25,670	30,332
未収委託者報酬	16,804	17,567
未収運用受託報酬	5,814	4,348
未収投資助言報酬	317	309
未収収益	7	5
前払費用	724	1,167
その他	2,419	2,673
流動資産計	88,493	87,826
固定資産		
有形固定資産	1,119	1,268
建物	1 915	1 1,109
器具備品	1 202	1 158
建設仮勘定	0	-
無形固定資産	3,991	4,561
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	1,109	1,449
電話加入権	3	3
投資その他の資産	11,153	10,153
投資有価証券	261	241
関係会社株式	5,299	5,349
長期差入保証金	1,324	1,102
繰延税金資産	3,676	3,092
その他	591	367
固定資産計	16,264	15,983
資産合計	104,757	103,810

(単位:百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

（単位：百万円）

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）		第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		1	559
時効成立分配金・償還金	0		0	
為替差益	7		7	
金銭の信託運用益	1,229		-	
雑収入	13		19	
時効後支払損引当金戻入額	13		10	
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0		-	
金銭の信託運用損	-		743	
早期割増退職金	48		20	
雑損失	0		-	
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	-		0	
特別利益計		-		0
特別損失				
固定資産除却損	1		5	
投資有価証券売却損	-		6	
ゴルフ会員権売却損	-		3	
オフィス再編費用	-		2	509
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		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	17,871	49,674	71,227
当期変動額									
剰余金の配当							12,000	12,000	12,000
当期純利益							14,125	14,125	14,125
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	2,125	2,125
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353

	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	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		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	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	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	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

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 市場価格のない株式等以外のもの 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) 市場価格のない株式等 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。 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 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 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 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。 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。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 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. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、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

（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

当社は、当事業年度において、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、当事業年度において、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、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万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。

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。

（未適用の会計基準等）

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（会計基準適用指針第31号 2021年6月17日）

（1）概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

（2）適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業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

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
建物	407	415
器具備品	978	966

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
受取配当金	-	543

2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

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 (百万円)	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	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

決議	株式の 種類	配当の 原資	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	利益 剰余金	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

第37期(自2021年4月1日至2022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 (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
2022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 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種 類株式					

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期(2021年3月31日現在)

	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	25,670	25,670	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,672	25,672	-

第37期(2022年3月31日現在)

	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	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

(注1) 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。

(注2) 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36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	36,734	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	85,024	1	-	-

第37期(2022年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

3. 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
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

「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）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。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、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、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の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。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

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	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(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。

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

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	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額239百万円)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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
投資信託	0	-	0

（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。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	-	6

（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

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

(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

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	84	35
未認識過去勤務費用	102	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	7	3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万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36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	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100百万円、当事業年度97百万円であります。

(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36期	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額(一括償却資産)	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額(税法上)	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	3,676	3,092
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	3,676	3,092

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	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(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

(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。

(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

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

(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	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

(2) 損益計算書項目

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,823百万円	8,429百万円
経常利益	8,823百万円	8,429百万円
税引前当期純利益	8,823百万円	8,429百万円
当期純利益	7,288百万円	7,015百万円
1株当たり当期純利益	182,220円85銭	175,380円68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	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

（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。

（収益認識関係）

1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）	
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬（注）	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

（注）成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託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. 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）

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36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）及び第37期（自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	未払 手数料	1,457
	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	未払 手数料	2,524

第37期(自 2021年4月1日 至 2022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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						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	7,789	未払 手数料	1,592
	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	16,373	未払 手数料	2,651

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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36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36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
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当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
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	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

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

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

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「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	日本において銀行業務を営んでおります。
auカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	(1) 7,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東武証券株式会社(2)	420	「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。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
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。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注)資本金の額は2021年3月末日現在

(1) 2020年12月31日現在

(2) 「保守型」以外の取扱いはありません。

(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【その他】

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

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

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

2022年5月26日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の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2022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。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

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) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR 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 稲葉 宏和
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」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス（保守型）の2020年10月13日から2021年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス（保守型）の2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的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 稲葉 宏和
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」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス(安定型)の2020年10月13日から2021年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス(安定型)の2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年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 稲葉 宏和
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」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス（安定成長型）の2020年10月13日から2021年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス（安定成長型）の2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年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 稲葉 宏和
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」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス（成長型）の2020年10月13日から2021年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス（成長型）の2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年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 稲葉 宏和
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」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス(積極型)の2020年10月13日から2021年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス(積極型)の2021年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

（注2）XBRLデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年6月17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

稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス（保守型）の2021年10月13日から2022年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス（保守型）の2022年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年10月13日から2022年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年6月17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

稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード最適化バランス（安定型）の2021年10月13日から2022年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード最適化バランス（安定型）の2022年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年10月13日から2022年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年6月17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

稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）の2021年10月13日から2022年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）の2022年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年10月13日から2022年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

（注1）上記の中間監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）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

2022年6月17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

稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（成長型）の2021年10月13日から2022年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（成長型）の2022年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年10月13日から2022年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年6月17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

稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス(積極型)の2021年10月13日から2022年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス(積極型)の2022年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間(2021年10月13日から2022年4月12日まで)の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。