【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10月11日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

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

（５）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2022年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

「分配金受取コース」および「分配金再投資コース」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10月12日から2023年4月11日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

※販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（９）【払込期日】

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

（１０）【払込取扱場所】

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

※払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（１１）【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

○振替受益権について

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

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

（参考）

◆投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

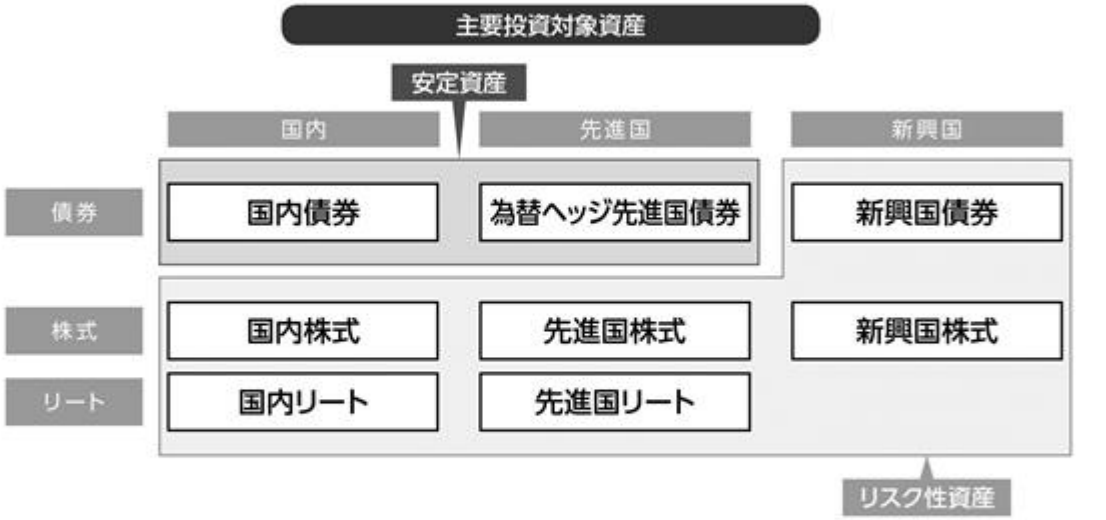
②当ファンドの信託金限度額は、5,000億円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

＜ファンドの特色＞

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

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

*マザーファンドについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご覧ください。



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

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

*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、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。

2 信託期間を3つの期間（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に分け、それぞれの期間に応じて、基準価額の目標変動リスク*を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。

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

	期間	目標変動リスク
資産育成期	設定日以降2045年の決算日まで	6%程度
資産形成期	2045年の決算日翌日以降 2065年の決算日まで	6%程度から2%程度へ月次で逓減
資産安定期	2065年の決算日翌日以降	2%程度

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

運用プロセス

■資産育成期および資産形成期においては、**「基本配分戦略」**に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、その時点のファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド、および為替ヘッジ比率を決定します。

・基本配分戦略は月次で行います。

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

■資産安定期においては、**「基本配分戦略」**に加え、**「機動的配分戦略」**に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

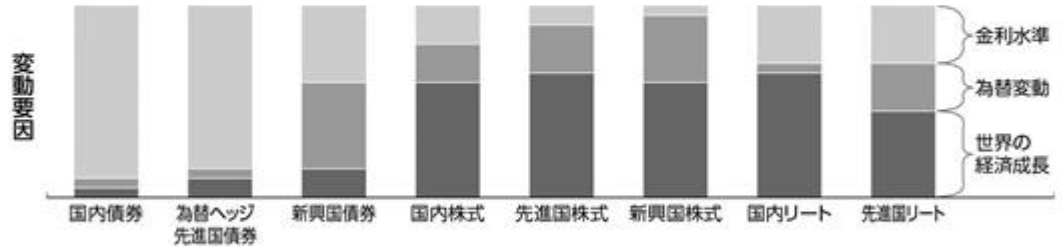
・機動的配分戦略は日次で行います。

基本配分戦略
(月次戦略)

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

基本配分比率決定のイメージ

変動要因と値動きへの影響度合い(例)



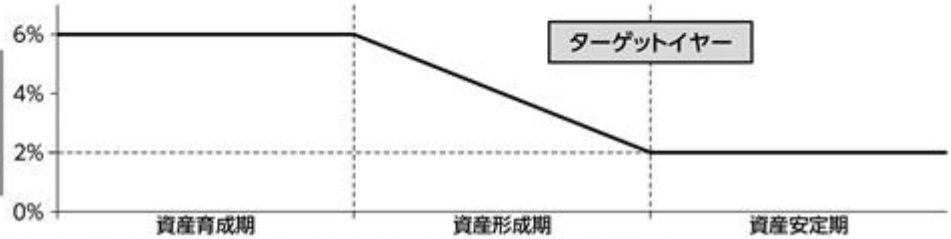
変動要因からファンドが受ける影響を均等に配分

着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

上記の配分から目標変動リスクになるように最適と判断される資産配分比率および通貨配分比率を決定

資産配分のイメージ
(基本配分比率)

目標変動リスク
(年率)の推移



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

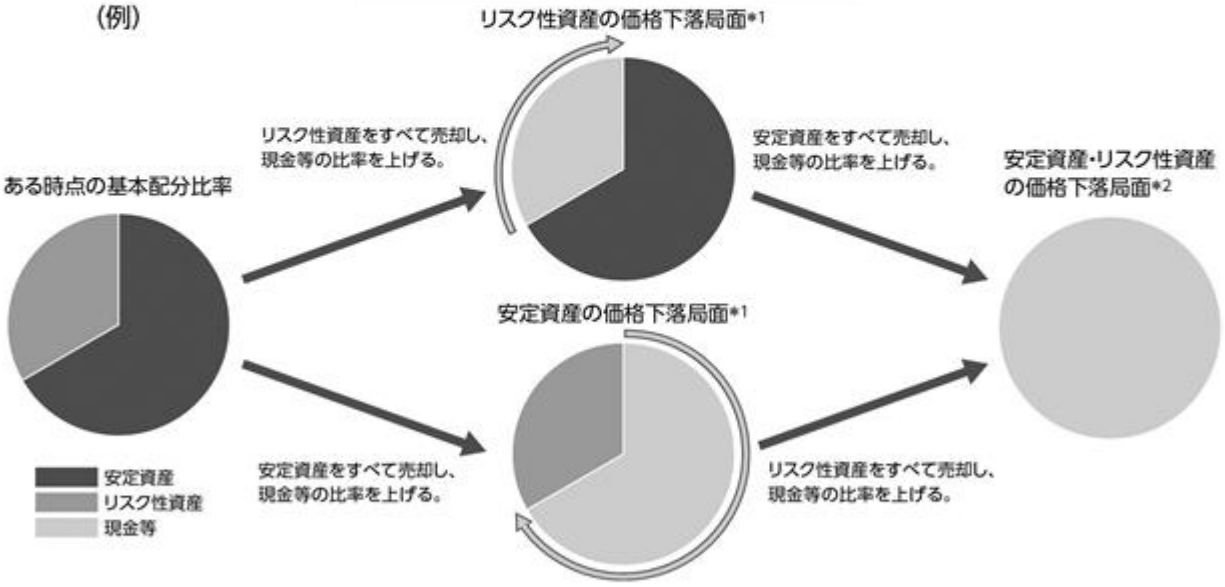
機動的配分戦略
（日次戦略）

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

資産安定期において、リスク性資産と安定資産のそれぞれに対して相場環境を日々判定し、下落の危険性が高まったと判定した場合は、安定資産、リスク性資産、現金等の比率を調整することで基準価額の下落の抑制をめざします。

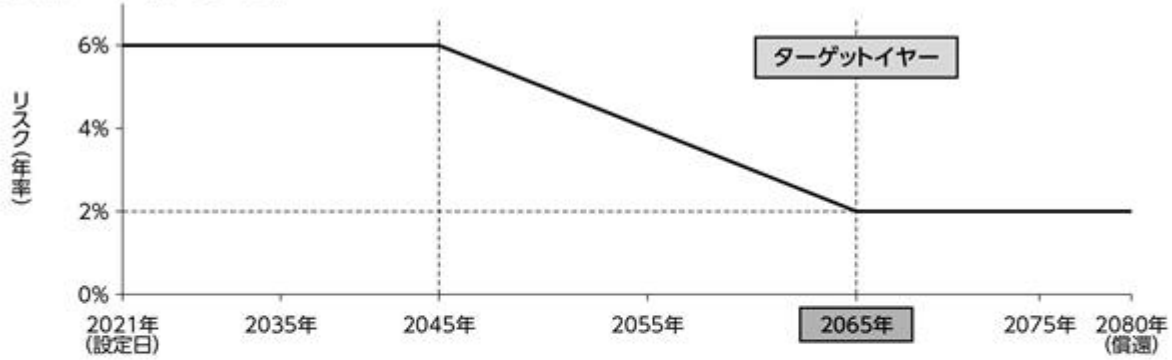
＊ 現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
※基準価額の下落を完全に抑制できるものではありません。

価格下落局面における配分比率変更のイメージ



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

運用期間中のポートフォリオ変化のイメージ
目標変動リスク(年率)の推移



	設定日～2045年決算日	2045年決算日翌日～2065年決算日	2065年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ(基本配分比率)			

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

■分配方針

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

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

＜商品分類＞

・商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

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

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

（注2）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数の資産（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。

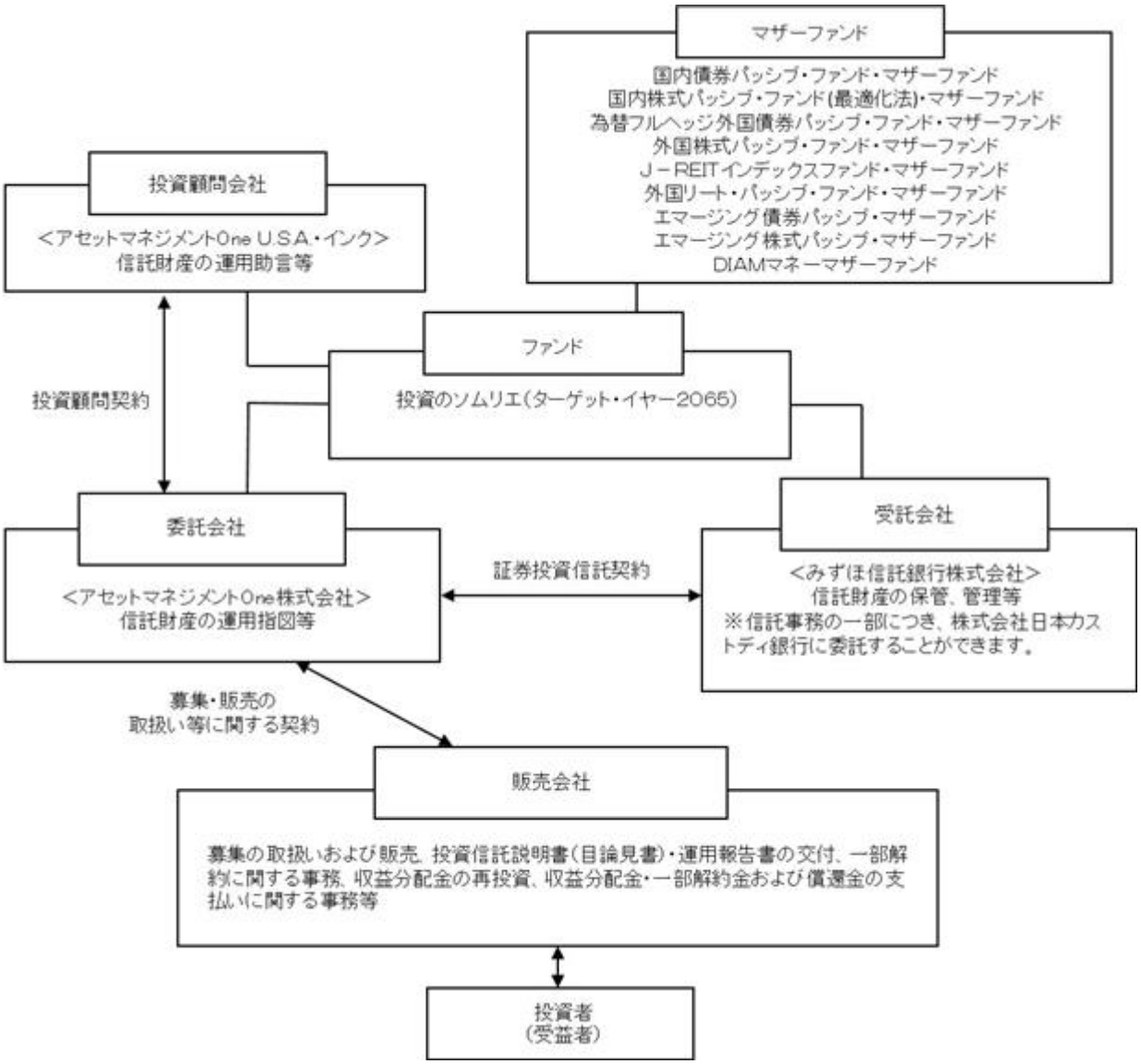
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。

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

（２）【ファンドの沿革】

2021年6月30日　　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

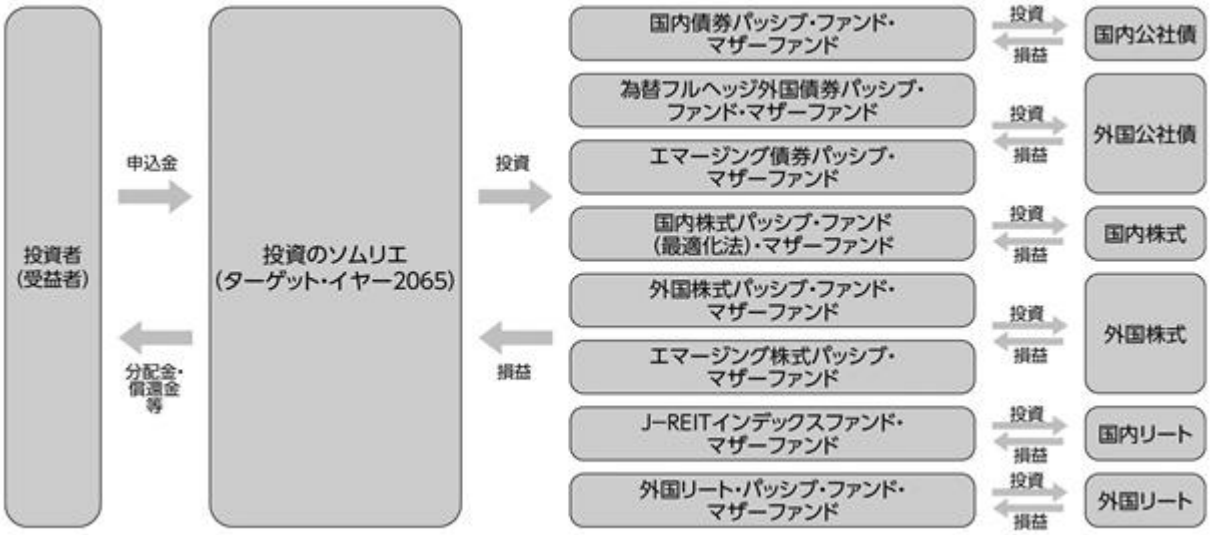
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

●ファミリーファンド方式とは●

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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

※投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額

20億円（2022年7月29日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日	**会社設立**
1998年3月31日	**「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得**
1998年12月1日	**証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可**

1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社」に商号変更
2016年10月1日	ＤＩＡＭアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

大株主の状況

（2022年7月29日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

①投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

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

・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
・Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
（上記マザーファンドおよびＤＩＡＭマネーマザーファンドを以下「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

・外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジ＊を行い、一部または全部の為替リスクの軽減をめざします。
＊一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断される通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。為替ヘッジにより、外貨建資産の為替リスクの軽減をめざします。
・上記のほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、「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へ直接投資する場合もあります。
・投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

②信託期間中、次に掲げる各期（資産育成期、資産形成期、資産安定期）に応じて、基準価額の目標変動リスク＊を変更しつつ、安定的な基準価額の上昇をめざします。
＊価格変動リスクの大きさを表し、この値が小さいほど、価格の変動が小さいことを意味します。

	期間	目標変動リスク
資産育成期	設定日以降 2045年の決算日まで	6%程度
資産形成期	2045年の決算日翌日以降 2065年の決算日まで	6%程度から 2%程度へ月次で逓減
資産安定期	2065年の決算日翌日以降	2%程度

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

③資産育成期および資産形成期においては、基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。
・基本配分戦略では、統計的手法を用い、ファンドに含まれる複数のリスク要因を抽出し、ファンドの目標変動リスクを考慮したうえで、これらの各リスク要因からファンドが受ける影響が均等になるように資産配分比率、および通貨配分比率を決定し、各マザーファンド受益証券、および為替ヘッジ比率を決定します。
・基本配分戦略は月次で行います。

④資産安定期においては、基本配分戦略に加え、機動的配分戦略に基づき、急な投資環境の変化に対応することをめざします。

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

・機動的配分戦略は日次で行います。

⑤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】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10.コマーシャル・ペーパー

11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、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、次の15.で定めるものを除きます。）

15.投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

16.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

17.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

18.預託証券または預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

23.外国の者に対する権利で上記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。

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1．預金

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

3．コール・ローン

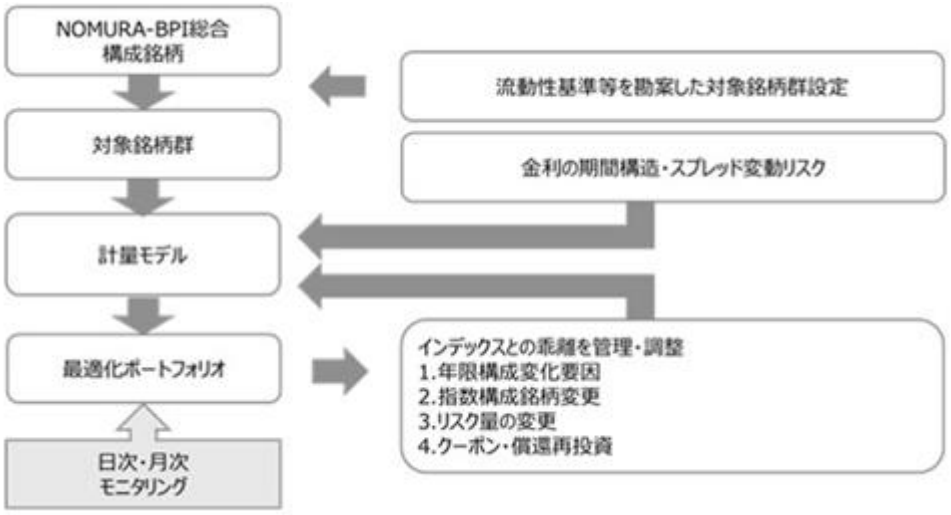
4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で上記5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

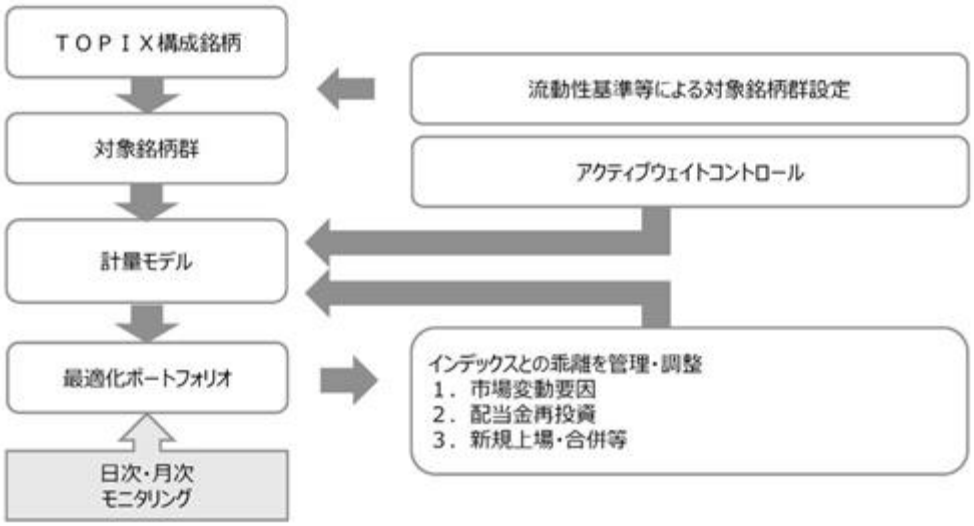
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 ※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

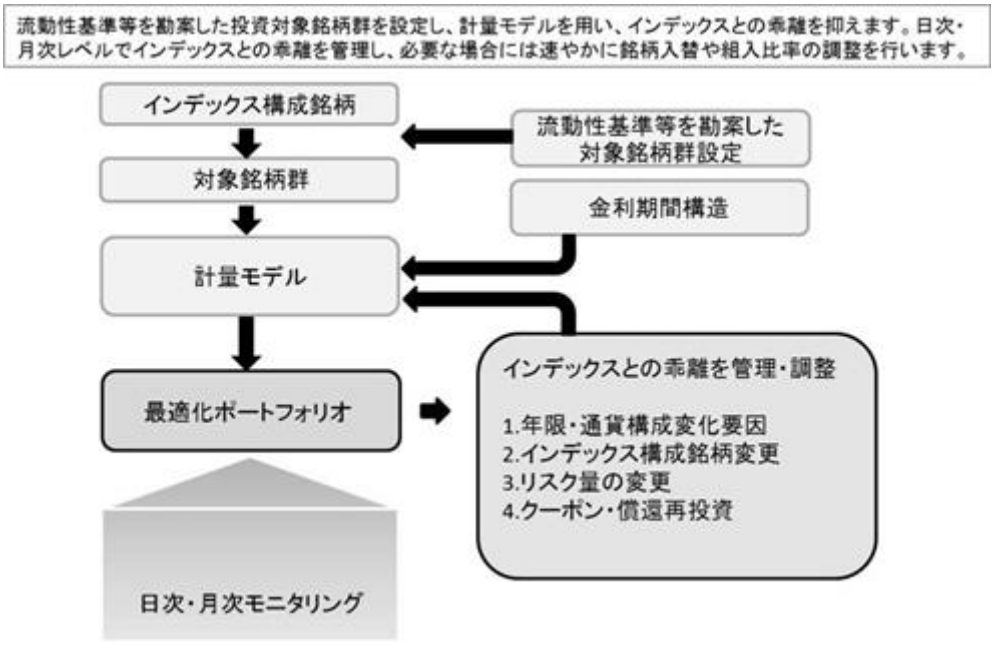
運用プロセス	**1.流動性基準等による対象銘柄群設定** **ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。** **2.最適化法によるポートフォリオの構築** **1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因** **2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因** **1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。** **3.インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。** **インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。** **・年限構成変化要因　・指数構成銘柄変更** **・リスク量の変更　・クーポン、償還再投資** 

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

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	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	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。 ※①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。 ②ＪＰＸ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。 ③ＪＰＸ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。 ④ＪＰＸ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。 ⑤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。 ⑥ＪＰＸ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。 ⑦ＪＰＸ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。 ⑧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。

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

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

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

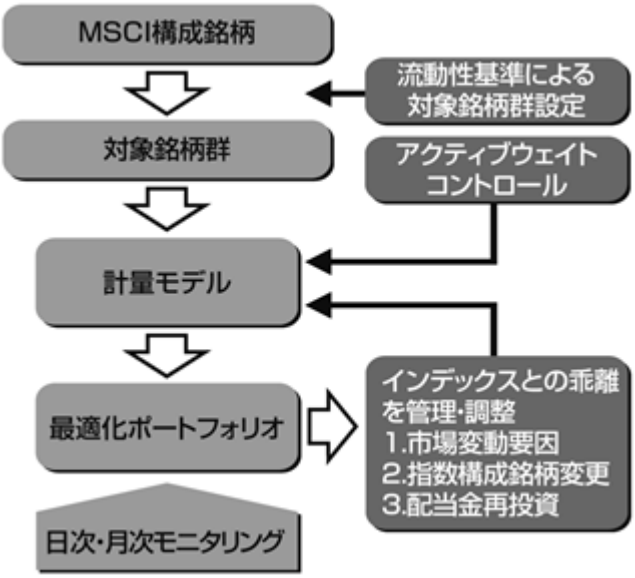
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

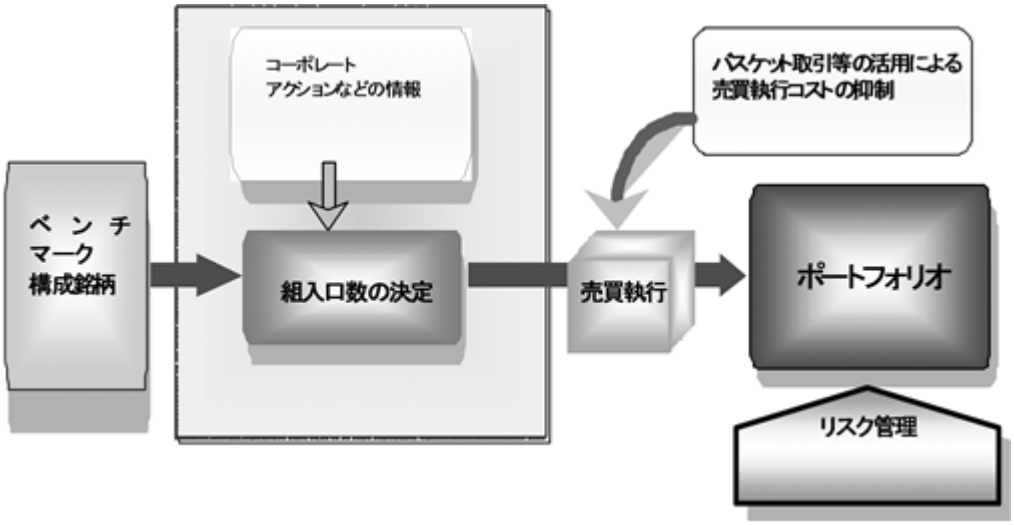
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかな

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

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

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

投資態度	**1.東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。** **※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数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。** **②ＪＰＸ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。** **③ＪＰＸ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。** **④ＪＰＸ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。** **⑤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。** **⑥ＪＰＸ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。** **⑦ＪＰＸ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。** **⑧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。**

運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額の割合が30%を超えている場合、当該同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、原則として当該同一銘柄の不動産投資信託証券の時価総額が東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める割合の範囲で投資することができるものとします。 ③株式への投資は行いません。 ④外貨建資産への投資は行いません。 ⑤デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

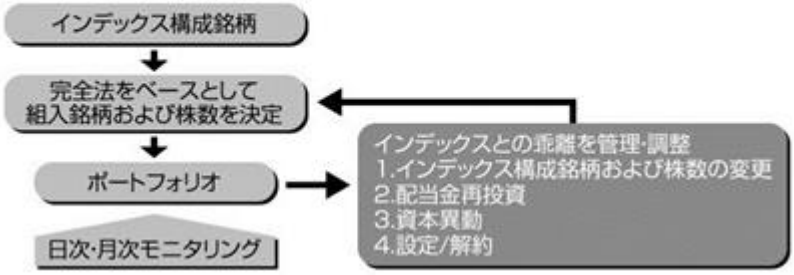
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

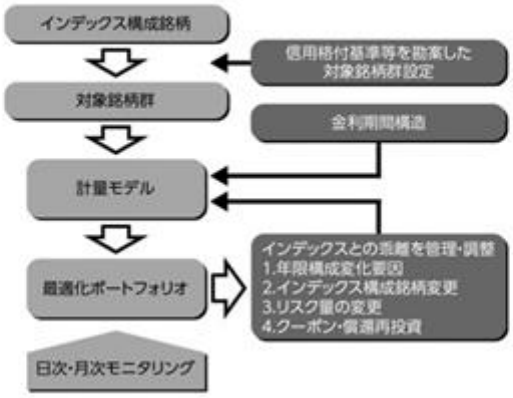
主な投資対象	**日本を除く世界各国の不動産投資信託証券※を主要投資対象とします。** **※海外の証券取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券とします。**
投資態度	**1.主に日本を除く世界各国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資割合は、原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行い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

※ＳＡＰ 先進国 ＲＥＩＴインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが委託会社に付与されています。

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

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

	先進国 ＲＥＩＴインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。
運用プロセス	ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス（除く日本）」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する連動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。 
主な投資制限	1.投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2.外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3.株式への直接投資は行いません。 4.同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をＳ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 5.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主として新興国の債券に投資し、ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。 3.組入債券は、当初組入時において、Ｓ＆ＰもしくはＭｏｏｄｙ’ｓの外貨建て長期格付がＢＢ－格もしくはＢａ３格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。 4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。 ※ＪＰモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はＪ．Ｐ．モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。
運用プロセス	信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 

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

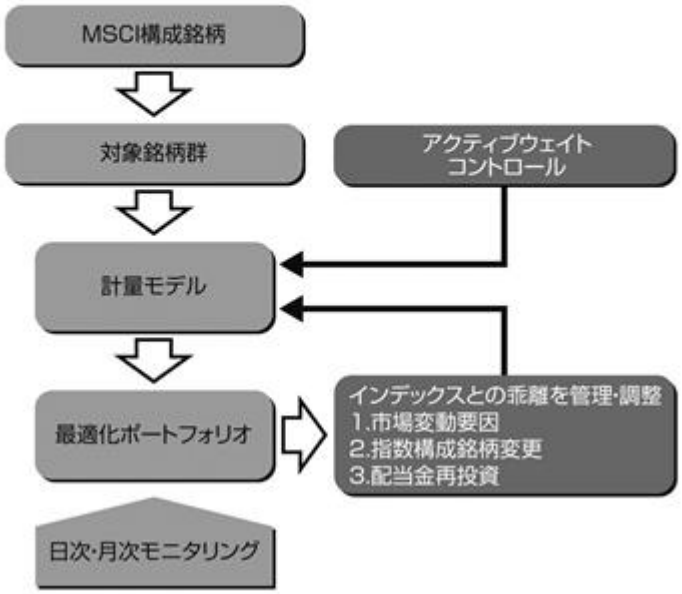
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

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

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

	る者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。
運用プロセス	現地口座の開設可否、預託証券の利用可否を基準に投資対象銘柄群を設定し、インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用いて、インデックスとの乖離を抑えます。 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 
主な投資制限	1.株式への投資割合には、制限を設けません。 2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。 3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

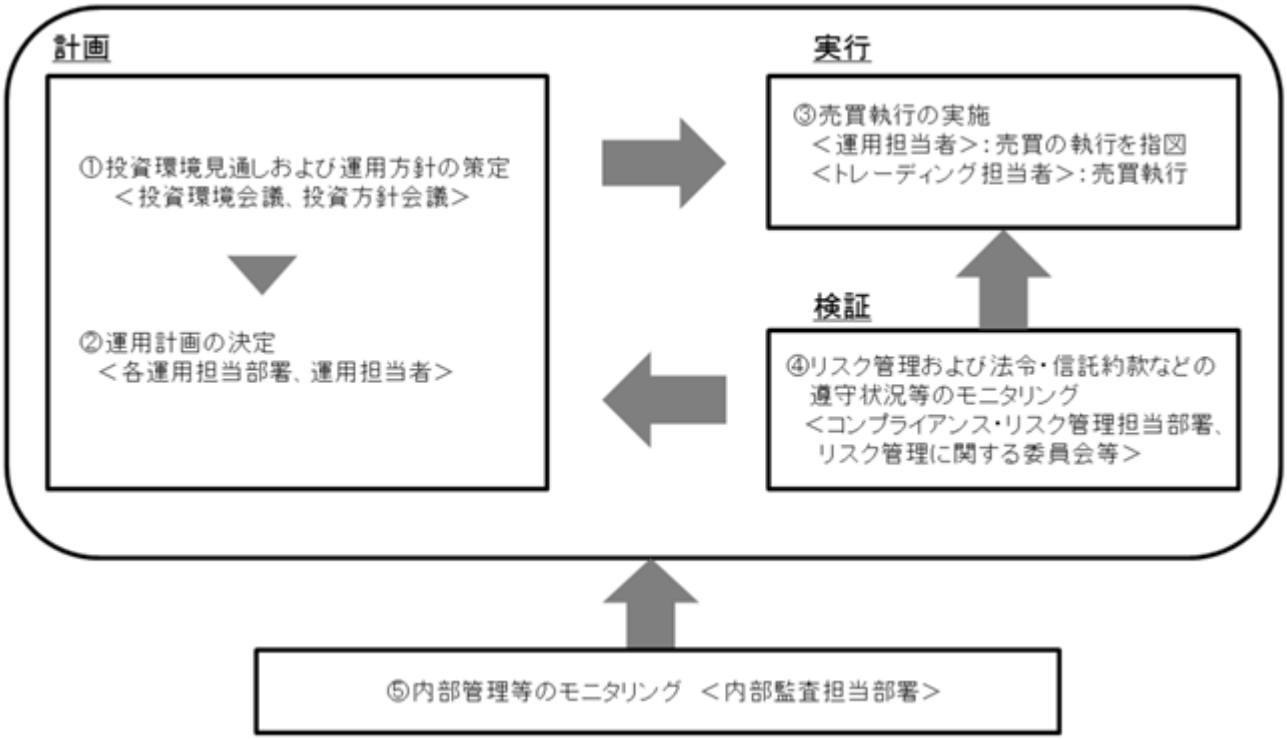
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

投資態度	①国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関（＊）の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がＡＡ-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のＣＤ、ＣＰを主要投資対象とします。 （＊）主要格付機関とは、Ｒ＆Ｉ、ＪＣＲ、Ｍｏｏｄｙ’ｓ、Ｓ＆Ｐとします。 ②国債および政府保証債を除き、原則として、ファンドの元本総額に対する1発行体当たりの有価証券の額面総額の割合は5%以内とします。 ③ポートフォリオ全体の修正デュレーションは1年未満を基本として運用します。
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	①株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。 ②同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③同一銘柄の新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④新株引受権証券及び新株予約権証券への投資割合は、取得時において、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑤投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ⑥外貨建て資産への投資は行いません。 ⑦デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動および金利変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ⑧一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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7月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

毎決算時（原則として毎年1月11日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

(1)分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益（マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）を含みます。）および売買益（評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額）等の全額とします。

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

(3)留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

②収益の分配方式

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

1)信託財産に属する配当等収益（配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）とマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額（以下「みなし配当等収益」といいます。）との合計額から、諸経費、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。

③収益分配金の支払い

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

①各マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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

③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）

④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）

⑤デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑥一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑧信用取引の指図範囲（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書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（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

⑨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③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、⑨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⑨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③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③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額（以下2.において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨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。

⑩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たときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第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たときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第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。

⑬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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑭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。

⑮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たときは、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。

⑯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。

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

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

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

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

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

5)委託会社は、外国為替の売買の予約取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めたときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

⑱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。

⑲同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

○資産配分リスク

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

当ファンドの実質資産配分において、収益率の悪い資産への配分比率が大きい場合、基準価額が下がる場合があります。
当ファンドは短期金融資産等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

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

為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があり、その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

○当ファンドは、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で、受益者毎に異なります。

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

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

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

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

○当ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、信託財産の純資産総額が30億円を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了（繰上償還）する場合があります。

○注意事項

・当ファンドは、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。

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

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

・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があり、これによる損失は購入者が負担することとなります。

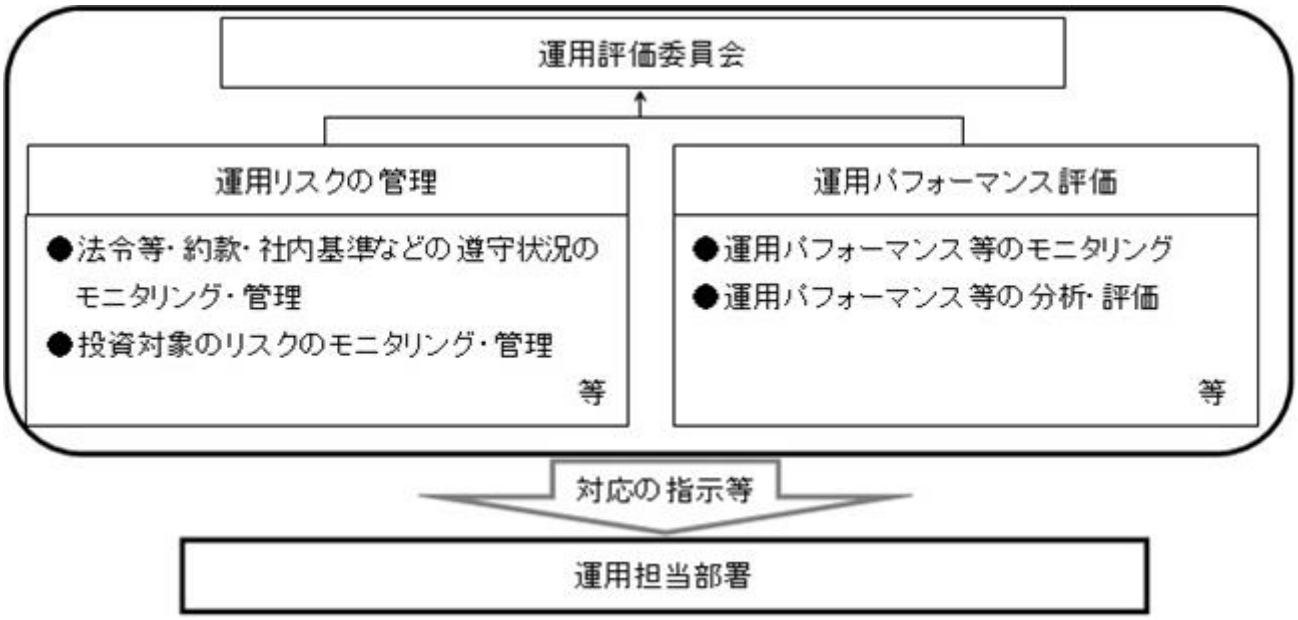
＜リスク管理体制＞

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

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

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

・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。



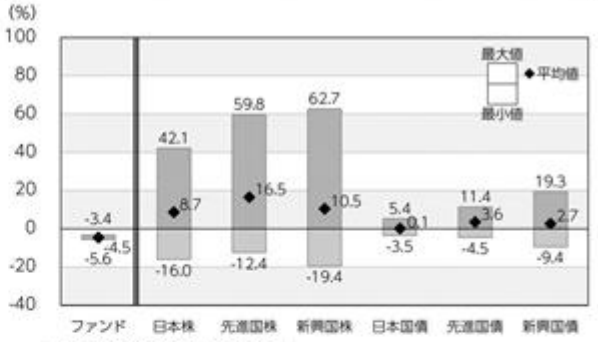
・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

※リスク管理体制は2022年7月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2022年6月～2022年7月
代表的な資産クラス:2017年8月～2022年7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。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村證券株式会社が国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表すために開発した投資収益指数です。同指数の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	「FTSE世界国債インデックス(除く日本)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2022年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.649%～年率0.913%（税抜0.59%～税抜0.83%）

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第24計算期まで 年率0.913% （税抜0.83%）	0.40%	0.40%	0.03%
第25計算期から第34計算期まで 年率0.825% （税抜0.75%）	0.36%	0.36%	0.03%
第35計算期から第44計算期まで 年率0.737% （税抜0.67%）	0.32%	0.32%	0.03%
第45計算期から第59計算期まで 年率0.649% （税抜0.59%）	0.28%	0.28%	0.03%

支払先	主な役務
委託会社	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	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	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

※委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク）に対する投資顧問報酬が含まれます。投資顧問報酬率は各計算期間における信託報酬率に応じて、以下の通りとします。

信託報酬率（年率）	投資顧問報酬率（年率）
0.913%（税抜0.83%）	0.180%
0.825%（税抜0.75%）	0.162%
0.737%（税抜0.67%）	0.144%
0.649%（税抜0.59%）	0.126%

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、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。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の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。

③有価証券の売買時の売買委託手数料および有価証券取引にかかる手数料・税金、先物・オプション取引に要する費用、当該手数料にかかる消費税等相当額および外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。

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

ＮＩＳＡおよびジュニアＮＩＳＡは、上場株式や公募株式投資信託などにかかる非課税制度です。毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

なお、同非課税口座内で少額上場株式等にかかる譲渡損失が生じた場合には、課税上譲渡損失はないものとみなされ、他の口座の上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得等の金額との損益通算を行うことはできませんので、ご留意ください。

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

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

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

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

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

②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」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。

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

＜収益分配金の課税について＞

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。
収益分配の際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		84,070,408	98.00
	内　日本	84,070,408	98.00
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,715,299	2.00
純資産総額		85,785,707	100.00

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

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		445,385,909,550	82.53
	内　日本	445,385,909,550	82.53
地方債証券		33,072,719,520	6.13
	内　日本	33,072,719,520	6.13
特殊債券		30,718,529,194	5.69
	内　日本	30,718,529,194	5.69
社債券		26,466,064,900	4.90
	内　日本	25,667,738,900	4.76
	内　フランス	798,326,000	0.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,045,570,027	0.75
純資産総額		539,688,793,191	100.00

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		446,198,914,370	97.15
	内　日本	446,198,914,370	97.15
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		13,111,513,928	2.85
純資産総額		459,310,428,298	100.00

その他資産の投資状況

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		13,155,625,000	2.86
	内　日本	13,155,625,000	2.86

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（%）

国債証券		378,400,144,373	97.02
	内　アメリカ	192,375,009,496	49.32
	内　フランス	33,535,086,057	8.60
	内　イタリア	29,586,555,655	7.59
	内　ドイツ	24,958,233,966	6.40
	内　スペイン	20,042,407,318	5.14
	内　イギリス	19,292,352,856	4.95
	内　中国	8,503,865,416	2.18
	内　カナダ	7,941,216,821	2.04
	内　ベルギー	7,504,563,690	1.92
	内　オランダ	6,616,129,653	1.70
	内　オーストラリア	5,889,986,323	1.51
	内　オーストリア	4,887,457,825	1.25
	内　メキシコ	2,890,294,715	0.74
	内　アイルランド	2,555,303,147	0.66
	内　フィンランド	2,057,280,437	0.53
	内　マレーシア	1,857,084,231	0.48
	内　シンガポール	1,657,673,159	0.43
	内　ポーランド	1,551,339,583	0.40
	内　イスラエル	1,495,285,311	0.38
	内　デンマーク	1,425,897,065	0.37
	内　スウェーデン	1,000,652,772	0.26
	内　ノルウェー	776,468,877	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		11,620,628,414	2.98
純資産総額		390,020,772,787	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7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		725,515,532,481	95.22
	内　アメリカ	515,624,280,789	67.67
	内　イギリス	31,748,850,150	4.17
	内　カナダ	28,168,019,121	3.70
	内　スイス	24,715,434,519	3.24
	内　フランス	22,103,909,703	2.90
	内　ドイツ	15,941,658,399	2.09
	内　オーストラリア	15,900,000,831	2.09
	内　オランダ	13,305,563,786	1.75
	内　アイルランド	13,052,035,009	1.71
	内　スウェーデン	7,054,329,032	0.93
	内　デンマーク	6,040,172,985	0.79
	内　スペイン	5,135,762,616	0.67
	内　香港	4,987,138,038	0.65
	内　イタリア	3,340,034,399	0.44
	内　ジャージィー	2,777,083,245	0.36
	内　フィンランド	2,597,135,784	0.34
	内　シンガポール	2,377,181,750	0.31
	内　ノルウェー	1,811,611,207	0.24

	内　ベルギー	1,695,576,760	0.22
	内　イスラエル	1,609,867,886	0.21
	内　ケイマン諸島	1,603,813,246	0.21
	内　バミューダ	979,356,787	0.13
	内　オランダ領キュラソー	765,738,042	0.10
	内　ニュージーランド	516,792,528	0.07
	内　ルクセンブルグ	510,493,445	0.07
	内　ポルトガル	405,576,922	0.05
	内　オーストリア	362,463,362	0.05
	内　リベリア	140,031,985	0.02
	内　パナマ	126,102,580	0.02
	内　マン島	119,517,575	0.02
投資信託受益証券		1,319,664,197	0.17
	内　オーストラリア	955,402,094	0.13
	内　シンガポール	364,262,103	0.05
投資証券		17,583,792,130	2.31
	内　アメリカ	16,463,057,890	2.16
	内　イギリス	427,322,111	0.06
	内　フランス	285,190,870	0.04
	内　香港	261,024,413	0.03
	内　カナダ	74,515,203	0.01
	内　ベルギー	72,681,643	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		17,524,983,249	2.30
純資産総額		761,943,972,057	100.00

その他資産の投資状況

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		17,857,568,666	2.34
	内　アメリカ	13,516,429,032	1.77
	内　ドイツ	2,462,709,690	0.32
	内　イギリス	812,955,340	0.11
	内　カナダ	665,654,479	0.09
	内　オーストラリア	399,820,125	0.05

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		199,983,017,400	97.64
	内　日本	199,983,017,400	97.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,825,278,711	2.36
純資産総額		204,808,296,111	100.00

その他資産の投資状況

2022年7月29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）	4,697,370,000	2.29

	内　日本	4,697,370,000	2.29

（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7月29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		7,492,097,572	9.95
	内　オーストラリア	4,753,641,058	6.31
	内　シンガポール	2,674,626,615	3.55
	内　香港	63,829,899	0.08
投資証券		67,519,268,405	89.66
	内　アメリカ	58,120,968,695	77.18
	内　イギリス	3,779,387,825	5.02
	内　カナダ	1,360,921,075	1.81
	内　フランス	1,163,256,107	1.54
	内　香港	1,043,373,624	1.39
	内　ベルギー	838,768,064	1.11
	内　スペイン	281,655,541	0.37
	内　ニュージーランド	263,151,272	0.35
	内　ガーンジィ	192,700,683	0.26
	内　韓国	163,838,366	0.22
	内　オランダ	130,512,305	0.17
	内　イスラエル	86,452,606	0.11
	内　ドイツ	42,617,421	0.06
	内　アイルランド	31,669,295	0.04
	内　イタリア	19,995,526	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		294,759,809	0.39
純資産総額		75,306,125,786	100.00

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		134,985,160,025	98.23
	内　メキシコ	12,729,122,044	9.26
	内　カタール	12,178,426,495	8.86
	内　サウジアラビア	12,159,948,496	8.85
	内　アラブ首長国連邦	11,021,456,640	8.02
	内　インドネシア	10,935,443,275	7.96
	内　ブラジル	9,906,590,828	7.21
	内　フィリピン	8,319,456,350	6.05
	内　チリ	8,218,091,604	5.98
	内　コロンビア	8,098,494,582	5.89
	内　パナマ	7,932,084,773	5.77
	内　南アフリカ	6,994,000,903	5.09
	内　ペルー	6,658,170,804	4.85
	内　ドミニカ共和国	6,008,148,861	4.37

	内　ハンガリー	4,783,594,049	3.48
	内　ルーマニア	3,437,677,877	2.50
	内　ウルグアイ	3,234,067,252	2.35
	内　クロアチア	1,624,247,281	1.18
	内　中国	746,137,911	0.54
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,426,809,067	1.77
純資産総額		137,411,969,092	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7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		58,074,471,679	90.37
	内　ケイマン諸島	10,964,082,112	17.06
	内　台湾	8,299,498,525	12.92
	内　インド	8,006,458,551	12.46
	内　中国	7,286,233,624	11.34
	内　韓国	6,958,460,082	10.83
	内　ブラジル	2,870,174,166	4.47
	内　サウジアラビア	2,628,197,671	4.09
	内　南アフリカ	2,022,814,696	3.15
	内　インドネシア	1,105,660,346	1.72
	内　タイ	1,087,852,020	1.69
	内　メキシコ	981,871,551	1.53
	内　マレーシア	875,602,709	1.36
	内　アラブ首長国連邦	768,671,349	1.20
	内　香港	729,968,487	1.14
	内　カタール	639,819,789	1.00
	内　クエート	493,545,842	0.77
	内　フィリピン	431,989,275	0.67
	内　バミューダ	337,508,180	0.53
	内　ポーランド	332,736,320	0.52
	内　チリ	330,715,829	0.51
	内　アメリカ	215,651,121	0.34
	内　トルコ	152,563,516	0.24
	内　ギリシャ	150,066,156	0.23
	内　チェコ	94,427,968	0.15
	内　コロンビア	93,024,628	0.14
	内　ハンガリー	92,566,154	0.14
	内　ルクセンブルグ	61,936,026	0.10
	内　エジプト	33,890,624	0.05
	内　シンガポール	18,886,609	0.03
	内　ペルー	9,597,753	0.01
	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		327,109,225	0.51
	内　メキシコ	224,216,785	0.35

	内　ブラジル	102,892,440	0.16
投資証券		59,691,527	0.09
	内　メキシコ	32,116,002	0.05
	内　南アフリカ	27,575,525	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		5,799,160,539	9.02
純資産総額		64,260,432,970	100.00

その他資産の投資状況

2022年7月29日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引（買建）		5,847,264,561	9.10
	内　アメリカ	5,847,264,561	9.10

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

2022年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	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	32,495,908	1.3270 43,122,799	1.3045 42,390,911	－ －	49.41
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	4,248,576	3.1733 13,482,267	3.2592 13,846,958	－ －	16.14
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	7,282,050	1.2772 9,300,662	1.2777 9,304,275	－ －	10.85
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	3,357,475	1.9890 6,678,148	2.0351 6,832,797	－ －	7.96
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	1,576,620	2.3816 3,754,939	2.4713 3,896,301	－ －	4.54
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	576,727	5.8168 3,354,741	6.0392 3,482,969	－ －	4.06
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,224,569	1.7246 2,111,905	1.8045 2,209,734	－ －	2.58
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	1,506,554	1.3811 2,080,789	1.3982 2,106,463	－ －	2.46

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	98.00
合計	98.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	３３３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	7,130,000,000	101.17 7,213,784,000	101.16 7,212,779,300	0.6 2024/3/20	1.34
2	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,960,000,000	100.22 5,973,282,000	100.61 5,996,892,400	0.1 2028/3/20	1.11
3	３４１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,220,000,000	101.25 5,285,538,000	101.32 5,289,112,800	0.3 2025/12/20	0.98
4	３３９回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,080,000,000	101.37 5,149,693,000	101.43 5,152,694,800	0.4 2025/6/20	0.95
5	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	100.31 5,015,950,000	0.1 2023/12/20	0.93
6	３６１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	5,000,000,000	99.22 4,961,253,000	99.91 4,995,800,000	0.1 2030/12/20	0.93
7	３３２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,910,000,000	101.00 4,959,100,000	101.01 4,959,738,300	0.6 2023/12/20	0.92
8	３４２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,880,000,000	100.54 4,906,834,000	100.67 4,912,891,200	0.1 2026/3/20	0.91
9	３３７回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	100.91 4,844,084,000	100.94 4,845,312,000	0.3 2024/12/20	0.90
10	３６２回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,840,000,000	99.03 4,793,132,000	99.82 4,831,723,600	0.1 2031/3/20	0.90
11	３５１回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,800,000,000	100.21 4,810,274,000	100.58 4,828,224,000	0.1 2028/6/20	0.89
12	３４４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,730,000,000	100.39 4,748,788,200	100.70 4,763,346,500	0.1 2026/9/20	0.88

13	３５９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,700,000,000	99.29 4,666,827,000	100.07 4,703,666,000	0.1 2030/6/20	0.87
14	３４６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,670,000,000	100.43 4,690,342,100	100.69 4,702,503,200	0.1 2027/3/20	0.87
15	３３４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,620,000,000	101.40 4,685,038,400	101.32 4,681,030,200	0.6 2024/6/20	0.87
16	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,540,000,000	101.46 4,606,559,900	101.55 4,610,687,800	0.4 2025/9/20	0.85
17	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,530,000,000	100.30 4,543,793,000	100.61 4,558,040,700	0.1 2027/12/20	0.84
18	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,390,000,000	100.46 4,410,398,000	100.70 4,420,861,700	0.1 2026/12/20	0.82
19	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	101.30 4,386,549,800	0.4 2025/3/20	0.81
20	３４３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,350,000,000	100.48 4,371,192,000	100.70 4,380,493,500	0.1 2026/6/20	0.81
21	３４８回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,290,000,000	100.29 4,302,743,000	100.61 4,316,469,300	0.1 2027/9/20	0.80
22	４３１回　利付国庫債券 （２年） 日本	国債証券	4,300,000,000	100.13 4,305,633,000	100.18 4,308,041,000	0.005 2023/12/1	0.80
23	１４９回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,150,000,000	100.02 4,150,869,000	100.31 4,162,906,500	0.005 2026/9/20	0.77
24	３６６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	99.89 4,095,648,000	100.76 4,131,201,000	0.2 2032/3/20	0.77
25	１４７回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,080,000,000	100.07 4,082,964,000	100.32 4,093,341,600	0.005 2026/3/20	0.76
26	３６３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	98.94 4,056,939,000	99.73 4,089,176,000	0.1 2031/6/20	0.76
27	３６４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,100,000,000	98.86 4,053,271,000	99.68 4,087,044,000	0.1 2031/9/20	0.76
28	１３９回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	4,050,000,000	100.30 4,062,150,000	100.34 4,063,891,500	0.1 2024/3/20	0.75
29	３５３回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	4,040,000,000	100.11 4,044,786,000	100.54 4,061,896,800	0.1 2028/12/20	0.75

30	３５８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,050,000,000	99.37 4,024,614,000	100.18 4,057,654,500	0.1 2030/3/20	0.75

（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7月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	82.53
地方債証券	6.13
特殊債券	5.69
社債券	4.90
合計	99.25

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	8,195,200	2,196.52 18,000,970,434	2,137.00 17,513,142,400	－ －	3.81
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	1,126,200	12,220.07 13,762,250,783	11,695.00 13,170,909,000	－ －	2.87
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	162,800	54,582.93 8,886,102,308	52,430.00 8,535,604,000	－ －	1.86
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	10,378,600	748.76 7,771,093,731	745.40 7,736,208,440	－ －	1.68
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,977,200	3,620.37 7,158,207,975	3,807.00 7,527,200,400	－ －	1.64
6	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,230,500	5,151.21 6,338,574,014	4,953.00 6,094,666,500	－ －	1.33
7	任天堂 日本	株式 その他製品	101,500	58,867.75 5,975,077,155	59,710.00 6,060,565,000	－ －	1.32
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	1,057,900	5,323.80 5,632,053,341	5,605.00 5,929,529,500	－ －	1.29
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	864,700	6,184.68 5,347,893,976	6,704.00 5,796,948,800	－ －	1.26
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,412,900	3,589.88 5,072,142,033	3,925.00 5,545,632,500	－ －	1.21

11	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,286,000	4,051.70 5,210,493,172	4,292.00 5,519,512,000	－ －	1.20
12	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	114,000	54,466.09 6,209,135,392	46,010.00 5,245,140,000	－ －	1.14
13	信越化学工業 日本	株式 化学	279,000	18,156.79 5,065,745,423	16,960.00 4,731,840,000	－ －	1.03
14	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,150,500	4,207.43 4,840,649,779	4,107.00 4,725,103,500	－ －	1.03
15	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	347,000	14,223.11 4,935,420,542	13,270.00 4,604,690,000	－ －	1.00
16	第一三共 日本	株式 医薬品	1,303,900	2,746.78 3,581,534,551	3,523.00 4,593,639,700	－ －	1.00
17	三菱商事 日本	株式 卸売業	1,160,900	4,124.21 4,787,804,355	3,948.00 4,583,233,200	－ －	1.00
18	ダイキン工業 日本	株式 機械	196,300	22,068.09 4,331,966,143	23,250.00 4,563,975,000	－ －	0.99
19	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,314,300	3,363.69 4,420,909,589	3,388.00 4,452,848,400	－ －	0.97
20	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,671,900	1,475.99 3,943,716,427	1,538.50 4,110,718,150	－ －	0.89
21	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	1,061,500	3,780.08 4,012,563,526	3,866.00 4,103,759,000	－ －	0.89
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	493,300	7,364.16 3,632,744,289	7,764.00 3,829,981,200	－ －	0.83
23	村田製作所 日本	株式 電気機器	490,400	8,085.52 3,965,139,341	7,747.00 3,799,128,800	－ －	0.83
24	三井物産 日本	株式 卸売業	1,283,300	3,051.94 3,916,563,101	2,925.50 3,754,294,150	－ －	0.82
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	182,700	20,681.78 3,778,561,411	20,150.00 3,681,405,000	－ －	0.80
26	日本電産 日本	株式 電気機器	399,300	9,423.03 3,762,618,210	9,198.00 3,672,761,400	－ －	0.80
27	ファナック 日本	株式 電気機器	157,800	21,848.01 3,447,615,983	22,825.00 3,601,785,000	－ －	0.78
28	ＳＭＣ 日本	株式 機械	52,700	64,363.74 3,391,969,341	65,410.00 3,447,107,000	－ －	0.75
29	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	2,125,800	1,595.11 3,390,903,432	1,583.50 3,366,204,300	－ －	0.73
30	セブン＆アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	593,800	5,590.55 3,319,670,671	5,429.00 3,223,740,200	－ －	0.70

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.15
合計	97.15

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年7月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	17.18
情報・通信業		8.97
輸送用機器		7.63
化学		6.05
サービス業		5.40
卸売業		5.27
医薬品		5.19
機械		5.16
銀行業		5.16
小売業		4.25
食料品		3.27
陸運業		2.95
精密機器		2.71
その他製品		2.43
保険業		2.16
建設業		2.14
不動産業		1.95
電気・ガス業		1.26
その他金融業		1.14
鉄鋼		0.75
証券、商品先物取引業		0.71
ゴム製品		0.70
ガラス・土石製品		0.69
非鉄金属		0.69
海運業		0.67
金属製品		0.60
石油・石炭製品		0.52
繊維製品		0.44
空運業		0.40
鉱業		0.29
パルプ・紙		0.18
倉庫・運輸関連業		0.16
水産・農林業		0.10
合計		97.15

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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7月29日現在

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

1	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	2,112,030,900	83.84 1,770,790,067	88.74 1,874,427,423	1.25 2031/8/15	0.48
2	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	2,191,450,800	80.81 1,770,966,177	85.33 1,870,095,073	0.625 2030/8/15	0.48
3	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	2,129,530,200	82.82 1,763,884,850	86.93 1,851,360,317	0.875 2030/11/15	0.47
4	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	1,866,600,000	90.39 1,687,328,002	97.04 1,811,417,704	0.5 2029/5/25	0.46
5	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,927,615,200	87.06 1,678,229,983	91.96 1,772,803,604	1.625 2031/5/15	0.45
6	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,885,886,100	88.88 1,676,211,079	93.25 1,758,736,113	1.875 2032/2/15	0.45
7	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,962,613,800	84.41 1,656,721,397	89.36 1,753,932,744	1.375 2031/11/15	0.45
8	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,918,192,500	83.73 1,606,186,500	88.48 1,697,300,643	1.125 2031/2/15	0.44
9	US T N/B 0.25 11/15/23 アメリカ	国債証券	1,653,010,800	96.14 1,589,214,913	96.64 1,597,479,967	0.25 2023/11/15	0.41
10	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,480,710,000	97.14 1,438,486,621	100.63 1,490,080,110	2.875 2028/5/15	0.38
11	US T N/B 0.125 08/31/23 アメリカ	国債証券	1,486,094,400	96.60 1,435,706,511	97.01 1,441,685,707	0.125 2023/8/31	0.37
12	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	1,671,856,200	81.35 1,360,146,451	85.67 1,432,408,506	0.625 2030/5/15	0.37
13	US T N/B 2.0 08/15/51 アメリカ	国債証券	1,764,737,100	73.76 1,301,761,687	79.12 1,396,348,230	2 2051/8/15	0.36
14	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	1,564,168,200	80.57 1,260,377,210	86.43 1,352,027,887	2.375 2051/5/15	0.35
15	US T N/B 2.25 02/15/52 アメリカ	国債証券	1,587,051,900	78.58 1,247,261,595	84.33 1,338,393,099	2.25 2052/2/15	0.34
16	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	99.00 1,332,744,157	99.37 1,337,634,282	2.5 2024/1/31	0.34
17	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	96.59 1,300,248,468	98.10 1,320,650,296	2.125 2025/5/15	0.34
18	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	1,183,095,000	103.31 1,222,309,511	111.11 1,314,593,643	2.5 2030/5/25	0.34
19	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	95.89 1,290,888,860	97.59 1,313,709,468	2 2025/8/15	0.34
20	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	918,202,500	131.40 1,206,529,979	142.36 1,307,165,933	5.75 2032/10/25	0.34
21	US T N/B 0.125 10/15/23 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	96.15 1,294,359,281	96.73 1,302,141,421	0.125 2023/10/15	0.33
22	US T N/B 0.125 01/15/24 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	95.42 1,284,579,016	96.00 1,292,361,157	0.125 2024/1/15	0.33
23	US T N/B 0.25 03/15/24 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	95.08 1,279,899,219	95.76 1,289,153,656	0.25 2024/3/15	0.33
24	US T N/B 0.5 02/28/26 アメリカ	国債証券	1,393,213,500	89.92 1,252,912,539	92.18 1,284,368,695	0.5 2026/2/28	0.33
25	US T N/B 0.625 10/15/24 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	94.17 1,267,752,766	95.21 1,281,739,593	0.625 2024/10/15	0.33

26	US T N/B 0.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	94.08 1,266,543,376	95.04 1,279,425,984	0.375 2024/8/15	0.33
27	US T N/B 0.375 09/15/24 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	93.82 1,263,020,390	94.85 1,276,902,046	0.375 2024/9/15	0.33
28	US T N/B 1.25 11/30/26 アメリカ	国債証券	1,346,100,000	92.04 1,239,083,057	93.94 1,264,650,423	1.25 2026/11/30	0.32
29	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	1,313,793,600	94.51 1,241,740,232	95.74 1,257,854,725	1 2024/12/15	0.32
30	US T N/B 2.5 03/31/27 アメリカ	国債証券	1,265,334,000	96.08 1,215,808,029	99.03 1,253,125,500	2.5 2027/3/31	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7月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.02
合計	97.02

（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7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	APPLE INC アメリカ	株式 コンピュータ・周辺機器	1,837,323	22,264.80 40,907,635,743	21,180.88 38,916,124,414	－ －	5.11
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	802,234	39,206.00 31,452,386,668	37,207.55 29,849,161,746	－ －	3.92
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	1,031,831	20,198.11 20,841,038,548	16,460.11 16,984,052,586	－ －	2.23
4	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	99,007	115,082.20 11,393,943,809	113,435.84 11,230,942,903	－ －	1.47
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	677,697	17,836.00 12,087,408,372	15,375.15 10,419,695,875	－ －	1.37

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	638,911	17,854.93 11,407,712,387	15,424.95 9,855,176,554	－ －	1.29
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	106,087	64,619.18 6,855,255,755	72,889.96 7,732,678,130	－ －	1.01
8	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	295,991	22,574.07 6,681,724,123	23,449.06 6,940,711,310	－ －	0.91
9	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	282,153	31,539.16 8,898,871,169	24,208.26 6,830,433,860	－ －	0.90
10	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	477,994	10,934.16 5,226,466,293	12,470.27 5,960,714,429	－ －	0.78
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	145,492	42,396.39 6,168,336,449	39,561.87 5,755,936,899	－ －	0.76
12	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	260,198	28,543.34 7,426,922,013	21,634.51 5,629,258,626	－ －	0.74
13	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	270,541	20,823.13 5,633,510,884	19,930.35 5,391,978,604	－ －	0.71
14	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	186,998	29,821.11 5,576,489,375	28,449.82 5,320,060,094	－ －	0.70
15	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	317,300	16,532.18 5,245,661,155	16,505.19 5,237,096,787	－ －	0.69
16	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	333,755	19,804.12 6,609,724,312	15,454.57 5,158,041,378	－ －	0.68
17	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	117,817	45,788.54 5,394,669,449	40,333.19 4,751,935,952	－ －	0.62
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	98,406	49,342.82 4,855,630,440	47,443.29 4,668,704,838	－ －	0.61

19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	219,749	19,273.42 4,235,316,231	20,243.99 4,448,598,294	－ －	0.58
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	634,358	6,760.54 4,288,607,222	6,827.41 4,331,027,988	－ －	0.57
21	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	91,316	33,477.63 3,057,043,467	44,528.98 4,066,209,068	－ －	0.53
22	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	200,408	19,544.53 3,916,880,416	20,157.84 4,039,793,901	－ －	0.53
23	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	465,102	8,214.30 3,820,489,119	8,623.11 4,010,628,776	－ －	0.53
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	822,779	6,096.05 5,015,702,722	4,485.20 3,690,332,649	－ －	0.48
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	156,147	22,373.83 3,493,606,446	23,535.21 3,674,952,810	－ －	0.48
26	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	79,959	48,207.95 3,854,659,556	45,741.94 3,657,480,380	－ －	0.48
27	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 食品・生活必需品小売り	50,179	67,957.42 3,410,035,790	72,175.18 3,621,678,848	－ －	0.48
28	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC アメリカ	株式 ライフサイエンス・ツール／サービス	44,225	75,400.16 3,334,572,453	80,448.32 3,557,826,969	－ －	0.47
29	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	285,212	10,595.30 3,021,909,013	12,106.82 3,453,011,315	－ －	0.45
30	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	45,996	76,566.24 3,521,740,828	74,856.14 3,443,083,475	－ －	0.45

（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7月29日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.22
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.31
合計	97.70

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年7月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	7.21
銀行		5.54
医薬品		5.42
コンピュータ・周辺機器		5.35
石油・ガス・消耗燃料		4.76
半導体・半導体製造装置		4.54
情報技術サービス		3.77
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.63
資本市場		3.17
保険		2.95
インターネット販売・通信販売		2.57
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.42
ヘルスケア機器・用品		2.30
自動車		2.08
化学		1.98
電力		1.91
バイオテクノロジー		1.89
飲料		1.84
ホテル・レストラン・レジャー		1.72
食品		1.69
機械		1.59
専門小売り		1.58
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.56
食品・生活必需品小売り		1.53
航空宇宙・防衛		1.52
金属・鉱業		1.40
繊維・アパレル・贅沢品		1.29
各種電気通信サービス		1.19
家庭用品		1.18
娯楽		1.12
陸運・鉄道		1.07
各種金融サービス		1.00
総合公益事業		0.88
コングロマリット		0.87
メディア		0.80
電気設備		0.78
専門サービス		0.70
タバコ		0.70
通信機器		0.65
パーソナル用品		0.60
航空貨物・物流サービス		0.59
電子装置・機器・部品		0.55
建設関連製品		0.50
商業サービス・用品		0.49
複合小売り		0.48
消費者金融		0.40
不動産管理・開発		0.36
商社・流通業		0.34
無線通信サービス		0.30

家庭用耐久財	0.29
容器・包装	0.27
建設・土木	0.25
建設資材	0.23
エネルギー設備・サービス	0.21
自動車部品	0.19
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
ガス	0.14
運送インフラ	0.14
水道	0.12
販売	0.11
紙製品・林産品	0.10
海運業	0.09
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
旅客航空輸送業	0.05
レジャー用品	0.03
各種消費者サービス	0.01
合計	95.22

（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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	20,771	709,806.10 14,743,382,607	706,000.00 14,664,326,000	－ －	7.16
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	17,805	640,776.73 11,409,029,724	643,000.00 11,448,615,000	－ －	5.59
3	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	29,176	346,439.60 10,107,722,002	346,000.00 10,094,896,000	－ －	4.93
4	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	89,837	106,282.46 9,548,097,981	108,400.00 9,738,330,800	－ －	4.75
5	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	54,833	168,265.14 9,226,482,496	175,100.00 9,601,258,300	－ －	4.69
6	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	57,578	168,475.00 9,700,453,703	166,700.00 9,598,252,600	－ －	4.69
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	26,839	316,237.79 8,487,506,071	320,500.00 8,601,899,500	－ －	4.20
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	35,477	183,989.94 6,527,411,405	191,100.00 6,779,654,700	－ －	3.31
9	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	17,803	360,034.45 6,409,693,448	367,000.00 6,533,701,000	－ －	3.19
10	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	40,083	145,723.29 5,841,026,819	145,000.00 5,812,035,000	－ －	2.84

11	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,177	412,141.05 5,018,641,660	406,500.00 4,949,950,500	－ －	2.42
12	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	26,608	186,514.91 4,962,788,762	185,100.00 4,925,140,800	－ －	2.40
13	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	54,109	80,031.11 4,330,403,746	83,400.00 4,512,690,600	－ －	2.20
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	6,148	671,351.55 4,127,469,356	696,000.00 4,279,008,000	－ －	2.09
15	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	57,418	66,711.68 3,830,451,567	69,000.00 3,961,842,000	－ －	1.93
16	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,400	413,116.72 3,883,297,173	417,500.00 3,924,500,000	－ －	1.92
17	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	12,006	325,837.39 3,912,003,800	320,000.00 3,841,920,000	－ －	1.88
18	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	21,797	177,439.80 3,867,655,489	175,600.00 3,827,553,200	－ －	1.87
19	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	5,233	665,080.51 3,480,366,338	715,000.00 3,741,595,000	－ －	1.83
20	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,034	547,768.24 3,853,001,817	523,000.00 3,678,782,000	－ －	1.80
21	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,606	530,573.69 3,504,969,837	543,000.00 3,587,058,000	－ －	1.75
22	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	78,368	41,830.07 3,278,139,046	41,850.00 3,279,700,800	－ －	1.60
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	20,937	152,157.45 3,185,720,562	153,000.00 3,203,361,000	－ －	1.56
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	19,709	153,918.68 3,033,583,431	156,100.00 3,076,574,900	－ －	1.50
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	24,090	116,462.36 2,805,578,277	125,800.00 3,030,522,000	－ －	1.48
26	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	12,770	214,483.27 2,738,951,463	223,700.00 2,856,649,000	－ －	1.39
27	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,283	337,750.95 2,797,591,119	336,500.00 2,787,229,500	－ －	1.36
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	16,659	161,923.02 2,697,475,605	166,700.00 2,777,055,300	－ －	1.36
29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	5,494	466,216.92 2,561,395,783	477,500.00 2,623,385,000	－ －	1.28

30	ＮＴＴ都市開発リート投資法人 日本	投資証券	17,116	149,856.48 2,564,943,656	152,500.00 2,610,190,000	－ －	1.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.64
合計	97.64

（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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	285,977	15,327.75 4,383,386,629	17,822.36 5,096,786,189	－ －	6.77
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	35,171	86,796.14 3,052,707,384	95,749.43 3,367,603,522	－ －	4.47
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	59,014	40,967.52 2,417,657,696	45,377.03 2,677,880,107	－ －	3.56
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	232,507	8,922.05 2,074,440,214	9,899.21 2,301,637,805	－ －	3.06
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	175,468	10,710.48 1,879,347,701	11,573.76 2,030,825,888	－ －	2.70
6	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	110,038	17,357.29 1,909,962,561	18,432.14 2,028,236,624	－ －	2.69
7	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	126,928	13,071.30 1,659,114,422	14,465.19 1,836,037,712	－ －	2.44
8	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	372,295	4,041.88 1,504,771,735	4,549.81 1,693,874,492	－ －	2.25
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	54,062	25,912.41 1,400,877,129	28,569.62 1,544,531,142	－ －	2.05
10	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	132,331	9,632.18 1,274,636,639	10,465.92 1,384,966,652	－ －	1.84
11	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	51,931	22,066.68 1,145,945,224	25,325.52 1,315,179,859	－ －	1.75
12	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	57,444	18,123.26 1,041,072,925	21,968.35 1,261,950,012	－ －	1.68
13	DUKE REALTY TRUST アメリカ	投資証券	148,690	7,175.51 1,066,927,995	8,406.39 1,249,946,798	－ －	1.66
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	236,057	4,631.41 1,093,277,076	5,198.63 1,227,174,937	－ －	1.63

15	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	657,527	1,677.79 1,103,192,234	1,864.21 1,225,773,668	－ －	1.63
16	VENTAS INC アメリカ	投資証券	154,608	6,614.62 1,022,673,652	7,177.40 1,109,684,263	－ －	1.47
17	MID AMERICA アメリカ	投資証券	44,653	22,302.71 995,883,190	24,766.89 1,105,916,113	－ －	1.47
18	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	47,047	21,003.29 988,142,017	21,992.58 1,034,684,995	－ －	1.37
19	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	25,279	34,651.80 875,963,017	38,336.92 969,119,202	－ －	1.29
20	LINK REIT 香港	投資証券	816,520	1,108.14 904,819,461	1,117.32 912,316,167	－ －	1.21
21	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	74,648	11,331.58 845,880,159	11,418.96 852,402,996	－ －	1.13
22	SEGRO PLC イギリス	投資証券	465,416	1,631.61 759,379,884	1,737.73 808,769,812	－ －	1.07
23	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	41,235	17,668.43 728,558,048	19,024.43 784,472,424	－ －	1.04
24	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	208,866	3,373.80 704,672,780	3,700.42 772,893,782	－ －	1.03
25	UDR INC アメリカ	投資証券	115,872	5,994.57 694,603,936	6,496.27 752,736,793	－ －	1.00
26	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	112,495	6,395.59 719,471,973	6,461.27 726,861,693	－ －	0.97
27	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	239,294	2,597.62 621,595,293	2,942.57 704,140,446	－ －	0.94
28	BOSTON PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	55,224	12,137.23 670,266,834	12,125.66 669,627,933	－ －	0.89
29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	276,823	2,208.51 611,368,717	2,410.86 667,382,909	－ －	0.89
30	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	66,993	9,428.75 631,660,656	9,823.83 658,128,365	－ －	0.87

（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7月29日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	9.95
投資証券	89.66
合計	99.61

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	2,719,122,000	88.68 2,411,393,040	89.48 2,433,274,598	6 2033/2/22	1.77
2	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,019,150,000	105.50 2,130,259,786	106.71 2,154,707,654	4.817 2049/3/14	1.57
3	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 カタール	国債証券	1,749,930,000	109.00 1,907,443,891	110.11 1,926,847,923	5.103 2048/4/23	1.40
4	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,019,150,000	92.51 1,868,110,849	91.74 1,852,454,367	5.5 2029/2/22	1.35
5	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,749,930,000	102.84 1,799,759,929	103.62 1,813,364,962	4 2029/3/14	1.32
6	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,019,150,000	87.41 1,765,039,972	87.39 1,764,571,166	2.783 2031/1/23	1.28
7	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,288,370,000	73.97 1,692,763,825	75.26 1,722,419,896	5.875 2060/1/30	1.25
8	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,615,320,000	103.36 1,669,697,055	104.65 1,690,448,533	4.375 2031/1/23	1.23
9	BRAZIL 4.625 01/13/28 ブラジル	国債証券	1,615,320,000	96.14 1,553,109,988	97.32 1,572,178,534	4.625 2028/1/13	1.14
10	STATE OF QATAR 4.5 04/23/28 カタール	国債証券	1,480,710,000	105.53 1,562,678,067	105.36 1,560,076,056	4.5 2028/4/23	1.14
11	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55 ウルグアイ	国債証券	1,480,710,000	101.94 1,509,446,542	104.24 1,543,618,719	4.975 2055/4/20	1.12
12	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28 サウジアラビア	国債証券	1,480,710,000	100.60 1,489,594,260	101.00 1,495,517,100	3.625 2028/3/4	1.09
13	ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27 アラブ首長国連邦	国債証券	1,480,710,000	99.25 1,469,705,632	100.13 1,482,698,593	3.125 2027/10/11	1.08
14	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,615,320,000	87.87 1,419,471,872	89.20 1,441,018,200	3.875 2030/6/12	1.05
15	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,346,100,000	101.57 1,367,280,883	102.24 1,376,318,598	3.75 2030/4/16	1.00
16	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,346,100,000	99.01 1,332,813,993	100.50 1,352,830,500	4.4 2050/4/16	0.98
17	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,480,710,000	92.27 1,366,259,193	90.27 1,336,755,373	4.85 2029/9/30	0.97

18	COLOMBIA 3.125 04/15/31 コロンビア	国債証券	1,615,320,000	78.21 1,263,378,116	78.42 1,266,814,710	3.125 2031/4/15	0.92
19	PANAMA 4.5 04/16/50 パナマ	国債証券	1,521,093,000	87.34 1,328,637,448	82.14 1,249,484,184	4.5 2050/4/16	0.91
20	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25 サウジアラビア	国債証券	1,211,490,000	101.79 1,233,244,322	101.37 1,228,147,987	4 2025/4/17	0.89
21	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	1,615,320,000	76.83 1,241,182,273	73.87 1,193,349,956	5.75 2049/9/30	0.87
22	PANAMA 4.5 04/01/56 パナマ	国債証券	1,480,710,000	86.30 1,277,938,880	80.58 1,193,188,456	4.5 2056/4/1	0.87
23	PHILIPPINES 3.0 02/01/28 フィリピン	国債証券	1,211,490,000	96.63 1,170,708,554	96.97 1,174,844,365	3 2028/2/1	0.85
24	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	1,076,880,000	103.70 1,116,791,865	104.70 1,127,501,975	4.375 2029/4/16	0.82
25	ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49 アラブ首長国連邦	国債証券	1,346,100,000	80.37 1,081,941,336	83.11 1,118,843,321	3.125 2049/9/30	0.81
26	COLOMBIA 4.5 03/15/29 コロンビア	国債証券	1,211,490,000	90.79 1,099,940,039	90.07 1,091,292,904	4.5 2029/3/15	0.79
27	PANAMA 3.16 01/23/30 パナマ	国債証券	1,211,490,000	91.42 1,107,592,617	89.68 1,086,464,232	3.16 2030/1/23	0.79
28	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,346,100,000	79.03 1,063,935,902	80.61 1,085,128,900	2.125 2031/9/22	0.79
29	STATE OF QATAR 3.375 03/14/24 カタール	国債証券	1,076,880,000	100.61 1,083,529,734	99.97 1,076,556,936	3.375 2024/3/14	0.78
30	PANAMA 2.252 09/29/32 パナマ	国債証券	1,346,100,000	80.35 1,081,677,500	79.79 1,074,163,502	2.252 2032/9/29	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7月29日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.23
合計	98.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

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

1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	1,643,083	2,516.00 4,134,011,612	2,251.29 3,699,062,242	－ －	5.76
2	TENCENT HOLDINGS LTD ケイマン諸島	株式 インタラクティブ・メディアおよびサービス	416,600	6,441.66 2,683,599,561	5,501.72 2,292,016,552	－ －	3.57
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	318,493	6,904.75 2,199,116,294	6,431.40 2,048,359,065	－ －	3.19
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	1,014,568	1,664.96 1,689,215,529	1,700.42 1,725,194,254	－ －	2.68
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	273,400	2,772.88 758,108,042	3,224.20 881,496,280	－ －	1.37
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	202,640	4,380.68 887,701,542	4,177.06 846,441,464	－ －	1.32
7	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	223,517	2,924.64 653,707,875	2,579.57 576,579,982	－ －	0.90
8	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	134,435	3,940.58 529,752,919	4,201.74 564,862,261	－ －	0.88
9	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	6,389,530	100.11 639,682,244	85.92 548,998,001	－ －	0.85
10	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	266,389	2,376.76 633,142,786	1,834.27 488,629,667	－ －	0.76
11	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	340,870	1,289.70 439,623,275	1,384.81 472,043,593	－ －	0.73
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 貯蓄・抵当・不動産金融	115,081	4,019.29 462,545,026	3,973.83 457,312,905	－ －	0.71

13	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	129,980	3,918.83 509,370,303	3,216.63 418,098,867	－ －	0.65
14	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	827,225	468.23 387,335,976	487.55 403,318,181	－ －	0.63
15	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	36,324	11,196.92 406,716,954	10,327.65 375,141,921	－ －	0.58
16	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	145,313	2,680.78 389,553,341	2,516.58 365,693,242	－ －	0.57
17	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	138,300	2,625.20 363,065,495	2,589.65 358,148,595	－ －	0.56
18	BAIDU INC 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	149,050	2,542.48 378,957,600	2,376.98 354,290,359	－ －	0.55
19	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	422,000	966.36 407,805,268	820.62 346,304,805	－ －	0.54
20	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	61,234	6,179.30 378,383,685	5,542.84 339,410,876	－ －	0.53
21	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	54,475	6,214.74 338,548,201	5,922.29 322,617,292	－ －	0.50
22	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC ケイマン諸島	株式 ライフサイエンス・ツール／サービス	240,000	1,102.32 264,557,031	1,319.69 316,726,200	－ －	0.49
23	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	100,507	3,715.11 373,394,604	3,064.63 308,017,290	－ －	0.48
24	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	14,541	12,735.30 185,184,064	20,040.93 291,415,184	－ －	0.45

25	PETROLEO BRASILEIRO SA ブラジル	株式 石油・ガス・消耗燃料	321,612	809.20 260,249,267	837.86 269,467,164	－ －	0.42
26	BYD CO LTD 中国	株式 自動車	54,000	4,221.96 227,986,357	4,959.78 267,828,120	－ －	0.42
27	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	3,747,235	81.17 304,185,305	71.00 266,057,432	－ －	0.41
28	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	5,246,200	53.46 280,490,192	48.02 251,922,524	－ －	0.39
29	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	3,660,600	69.97 256,167,448	66.88 244,839,231	－ －	0.38
30	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	1,894,478	144.90 274,510,325	128.43 243,314,800	－ －	0.38

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（%）
株式	90.37
投資信託受益証券	0.51
投資証券	0.09
合計	90.98

（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

2022年7月29日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	14.08
半導体・半導体製造装置		8.30
インターネット販売・通信販売		6.06
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.13
コンピュータ・周辺機器		4.79
石油・ガス・消耗燃料		4.50
金属・鉱業		3.46
化学		3.03
自動車		3.02
電子装置・機器・部品		2.48
保険		2.35
情報技術サービス		2.10
食品		1.80
不動産管理・開発		1.66
無線通信サービス		1.53
各種電気通信サービス		1.40
飲料		1.31
医薬品		1.20
食品・生活必需品小売り		1.14
電力		1.06
娯楽		1.02

繊維・アパレル・贅沢品	1.00
コングロマリット	0.97
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.96
ホテル・レストラン・レジャー	0.94
電気設備	0.92
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.90
資本市場	0.87
建設資材	0.78
パーソナル用品	0.78
各種金融サービス	0.73
貯蓄・抵当・不動産金融	0.71
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.71
バイオテクノロジー	0.67
消費者金融	0.63
運送インフラ	0.63
ガス	0.63
専門小売り	0.61
建設・土木	0.53
海運業	0.51
自動車部品	0.48
機械	0.42
タバコ	0.34
家庭用耐久財	0.34
ソフトウェア	0.30
航空貨物・物流サービス	0.29
陸運・鉄道	0.26
複合小売り	0.24
旅客航空輸送業	0.23
ヘルスケア機器・用品	0.18
紙製品・林産品	0.17
航空宇宙・防衛	0.17
商社・流通業	0.17
通信機器	0.15
メディア	0.13
水道	0.11
商業サービス・用品	0.09
各種消費者サービス	0.09
家庭用品	0.07
レジャー用品	0.07
エネルギー設備・サービス	0.06
建設関連製品	0.04
総合公益事業	0.03
容器・包装	0.03
ヘルスケア・テクノロジー	0.00
合計	90.37

（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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０４０９月	買建	679	13,046,579,070	13,155,625,000	2.86

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	シカゴ商品取引所	S&P500 EMINI FUT Sep22	買建	493	12,926,726,179	13,516,429,032	1.77

	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Sep22	買建	492	2,377,185,097	2,462,709,690	0.32
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Sep22	買建	68	800,541,307	812,955,340	0.11
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Sep22	買建	27	653,940,160	665,654,479	0.09
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Sep22	買建	25	388,534,965	399,820,125	0.05

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

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０４０９月	買建	2,337	4,642,824,420	4,697,370,000	2.29

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Sep22	買建	866	5,838,569,428	5,847,264,561	9.10

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

直近日（2022年7月末）、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（分配落）（百万円）	純資産総額（分配付）（百万円）	１口当たりの純資産額（分配落）（円）	１口当たりの純資産額（分配付）（円）
第1計算期間末（2022年1月11日）	14	14	1.0186	1.0186
2021年7月末日	2	－	1.0018	－
8月末日	2	－	1.0121	－
9月末日	2	－	1.0034	－
10月末日	7	－	1.0233	－

11月末日	12	－	1.0121	－
12月末日	14	－	1.0289	－
2022年1月末日	20	－	0.9946	－
2月末日	18	－	0.9793	－
3月末日	32	－	0.9985	－
4月末日	47	－	0.9754	－
5月末日	74	－	0.9680	－
6月末日	79	－	0.9445	－
7月末日	85	－	0.9676	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1計算期間	0.0000
2022年1月12日～2022年7月11日	－

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	1.9
2022年1月12日～2022年7月11日	△6.8

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

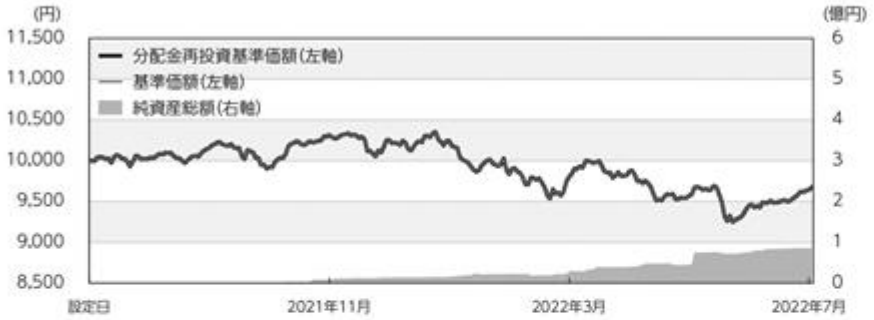
	設定口数	解約口数
第1計算期間	14,595,154	490,560
2022年1月12日～ 2022年7月11日	89,463,083	16,068,724

（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7月29日

基準価額・純資産の推移 〈2021年6月30日～2022年7月29日〉



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2021年6月30日)

分配の推移(税引前)

2022年 1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	49.41
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	16.14
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.85
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.96
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.54
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.06
7	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.58
8	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.46

■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	333回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/3/20	1.34
2	350回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2028/3/20	1.11
3	341回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.3	2025/12/20	0.98
4	339回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	0.95
5	138回　利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2023/12/20	0.93

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.81
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.87
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	1.86
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.68
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.64

○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7月29日

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.48
2	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.48
3	US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	アメリカ	0.875	2030/11/15	0.47
4	FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	フランス	0.5	2029/5/25	0.46
5	US T N/B 1.625 05/15/31	国債証券	アメリカ	1.625	2031/5/15	0.45

■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	5.11
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.92
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	2.23
4	TESLA INC	株式	アメリカ	自動車	1.47
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	1.37

■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	7.16
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.59
3	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.93
4	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.75
5	GLP投資法人	投資証券	日本	4.69

■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	6.77
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.47
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.56
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.06
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.70

○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7月29日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	ドミニカ共和国	6	2033/2/22	1.77
2	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.57
3	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	国債証券	カタール	5.103	2048/4/23	1.40
4	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.35
5	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	国債証券	カタール	4	2029/3/14	1.32

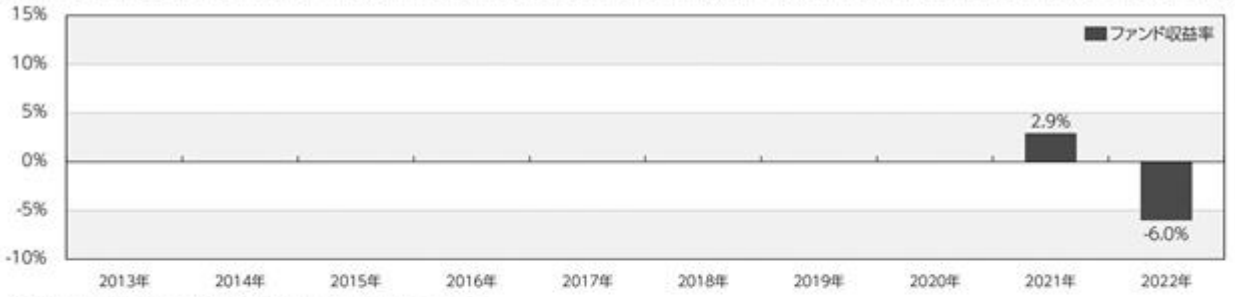
■エマージング株式パッシブ・マザーファンド

※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	5.76
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.57
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.19
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	2.68
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.37

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。
※2021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。

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。

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

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

当ファンドのお申込みは、原則として販売会社の毎営業日に行われます。お申込みの受付は、原則として午後3時までにお申込みが行われ、かつ、お申込みの受付にかかる販売会社の所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込みとします。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ニューヨークの銀行、ロンドンの銀行のいずれかの休業日に該当する日（以下「海外休業日」という場合があります。）には、お申込みの受付を行いません。

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2022年10月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

※「分配金再投資コース」により、収益分配金を再投資する場合は、お申込手数料はかかりません。

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※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。

※当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、2021年6月30日（設定日）から原則として2080年1月11日までです。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

（５）【その他】

イ.償還規定

a.委託会社は、信託期間中において、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、信託財産の純資産総額が30億円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発します。

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

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

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

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

任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

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

ロ.信託約款の変更等

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

b.委託会社は、上記a.の事項（上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

f.上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、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。

ハ.関係法人との契約の更改

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

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

- **委託会社は、毎年1月11日（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ます。）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。

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

再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（2021年6月30日から2022年1月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	322,644
親投資信託受益証券	14,047,799
派生商品評価勘定	5,322
流動資産合計	14,375,765
資産合計	14,375,765
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,249
未払受託者報酬	164
未払委託者報酬	4,513
その他未払費用	13
流動負債合計	8,939
負債合計	8,939
純資産の部	
元本等	
元本	14,104,594
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	262,232
（分配準備積立金）	29,670
元本等合計	14,366,826
純資産合計	14,366,826
負債純資産合計	14,375,765

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
営業収益	
有価証券売買等損益	7,799
為替差損益	3,460
営業収益合計	11,259
営業費用	
支払利息	4
受託者報酬	1,015
委託者報酬	28,223
その他費用	62
営業費用合計	29,304
営業利益又は営業損失（△）	△18,045
経常利益又は経常損失（△）	△18,045
当期純利益又は当期純損失（△）	△18,045
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（△）	3,448
期首剰余金又は期首欠損金（△）	－
剰余金増加額又は欠損金減少額	293,909
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	293,909
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,184
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,184
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（△）	262,232

（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1期 自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 2022年1月11日現在
１．　期首元本額	2,000,000円
期中追加設定元本額	12,595,154円
期中一部解約元本額	490,560円
２．　受益権の総数	14,104,594口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（29,670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（232,562円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象収益は262,232円（1万口当たり185.91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1期 自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	第1期 2022年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第1期 2022年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△23,366
合計	△23,366

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第1期 2022年1月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち １年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	515,039	－	516,980	△1,941
アメリカ・ドル	151,016	－	149,887	1,129
イギリス・ポンド	76,194	－	78,287	△2,093
オーストラリア・ドル	82,849	－	82,895	△46

カナダ・ドル	126,787	－	127,466	△679
ユーロ	78,193	－	78,445	△252
買建	289,476	－	292,490	3,014
イギリス・ポンド	78,618	－	78,288	△330
オーストラリア・ドル	8,078	－	8,289	211
カナダ・ドル	124,090	－	127,467	3,377
ユーロ	78,690	－	78,446	△244
合計	804,515	－	809,470	1,073

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0186円 (10,186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

2022年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	630,801	2,075,461	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	535,780	696,621	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	292,005	703,264	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	429,183	2,560,934	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	362,289	632,991	

	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	3,884,939	5,495,246	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	855,182	1,246,427	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	289,875	636,855	
親投資信託受益証券　合計		7,280,054	14,047,799	
合計			14,047,799	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,658,389,005
国債証券	389,777,102,350
地方債証券	32,219,027,720
特殊債券	28,365,250,137
社債券	27,900,914,290
未収入金	718,224,000
未収利息	598,133,081
前払費用	90,497,397
流動資産合計	489,327,537,980
資産合計	489,327,537,980
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,547,081,000
流動負債合計	8,547,081,000
負債合計	8,547,081,000
純資産の部	
元本等	
元本	369,783,791,323
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	110,996,665,657
元本等合計	480,780,456,980
純資産合計	480,780,456,980
負債純資産合計	489,327,537,980

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	274,108,204,822円
同期中追加設定元本額	364,928,383,927円
同期中一部解約元本額	269,252,797,426円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	23,602,749,276円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	75,643,720円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	138,076,297円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	88,969,905円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	666,257,880円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	135,008,019円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	24,113,669円
たわらノーロード　国内債券	15,658,870,413円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,444,017,775円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	866,117,947円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,484,044,477円
たわらノーロード　バランス（積極型）	189,141,676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）	67,967,273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）	1,225,173,509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）	1,226,391,789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）	328,020,983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）	22,916,215円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	16,579,240円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	13,307,949円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	88,422,738円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,042,272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＞	14,291,100,216円
Ｏｎｅグローバルバランス	7,788,113円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	8,977,461,313円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	12,479,687,193円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,167,333,519円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,197,778,083円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,345,473,243円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	389,026,693円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	87,660,620円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,040,981,442円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	11,641,769円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,313,831,442円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,576,117,456円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	340,130,669円
投資のソムリエ	29,896,768,653円
クルーズコントロール	1,226,334,746円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,791,607,871円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	4,529,302,418円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	700,098,251円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	3,072,376円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	12,693,547円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,762,239,023円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	47,437,358,145円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	34,264,057円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	16,630,508円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	54,360,224円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	110,183,063円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	2,194,733,184円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,289,816,429円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,330,425,728円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	35,256,776円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	14,642,382円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	12,505,311円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	288,006,473円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	535,780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）	1,307,786,406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）	1,339,034,889円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,290,645,501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）	811,536,376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）	1,281,882,631円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	2,311,204,106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）	675,498,058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）	1,282,320,198円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	8,841,119,898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）	463,351,202円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	784,306,404円
Ｏｎｅ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）	379,250,637円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	280,906,519円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	3,244,504,751円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	3,251,938,545円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	3,223,328,742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）	2,194,512,161円

リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	16,605,908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）	175,451,442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）	101,733,807円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,793,886円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,387,501円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	40,768,416円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,434,892円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,357,156円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	129,197,328円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,717,255,120円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,378,629,979円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,577,922,879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）	118,329,749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）	197,366,449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）	2,258,356,954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）	185,397,280円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	10,592,653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）	2,328,071,297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）	52,492,961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）	362,692,546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）	575,765,343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）	1,001,140,080円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	310,212,984円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,046,750円
Ｏｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドＩ（適格機関投資家限定）	1,043,766,730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＞	335,905,532円
コア資産形成ファンド	232,863,696円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	42,732,929,060円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	46,869,637,487円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	14,400,101,080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］	1,664,504,156円
計	369,783,791,323円
２．　受益権の総数	369,783,791,323口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

２． 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
３． 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,495,371,200
地方債証券	△257,602,352
特殊債券	△211,852,711
社債券	△198,194,330
合計	△4,163,020,593

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3002円 (13,002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

2022年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	４２３回　利付国庫債券（２年）	3,000,000,000	3,003,270,000	
	４２４回　利付国庫債券（２年）	500,000,000	500,585,000	
	４２５回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	2,002,480,000	
	４２６回　利付国庫債券（２年）	2,100,000,000	2,102,772,000	
	４２７回　利付国庫債券（２年）	2,400,000,000	2,403,336,000	
	４２８回　利付国庫債券（２年）	2,500,000,000	2,503,675,000	
	４２９回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	2,003,080,000	
	４３０回　利付国庫債券（２年）	2,000,000,000	2,003,240,000	
	１３６回　利付国庫債券（５年）	3,250,000,000	3,258,612,500	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	3,610,000,000	3,621,263,200	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	5,000,000,000	5,017,900,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	3,750,000,000	3,765,150,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	3,490,000,000	3,505,321,100	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	3,610,000,000	3,627,472,400	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	3,530,000,000	3,548,179,500	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,200,000,000	3,217,856,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	4,600,000,000	4,628,520,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	4,350,000,000	4,376,491,500	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	3,900,000,000	3,923,829,000	

１４７回　利付国庫債券（５年）	1,900,000,000	1,903,971,000	
１４８回　利付国庫債券（５年）	3,700,000,000	3,707,363,000	
１４９回　利付国庫債券（５年）	2,800,000,000	2,804,592,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	156,039,400	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	866,596,500	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	747,381,600	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	1,002,362,400	
５回　利付国庫債券（４０年）	940,000,000	1,266,593,600	
６回　利付国庫債券（４０年）	760,000,000	1,010,245,200	
７回　利付国庫債券（４０年）	910,000,000	1,164,308,600	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,210,151,700	
９回　利付国庫債券（４０年）	1,730,000,000	1,560,996,300	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,520,000,000	1,603,554,400	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,280,000,000	1,311,270,400	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,300,000,000	1,205,503,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,630,000,000	1,506,804,600	
１４回　利付国庫債券（４０年）	1,100,000,000	1,081,696,000	
３２９回　利付国庫債券（１０年）	8,350,000,000	8,455,544,000	
３３０回　利付国庫債券（１０年）	3,460,000,000	3,511,450,200	
３３１回　利付国庫債券（１０年）	1,950,000,000	1,972,405,500	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	3,880,000,000	3,931,177,200	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	1,730,000,000	1,755,725,100	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	4,640,000,000	4,716,977,600	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	4,000,000,000	4,062,480,000	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,135,532,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	3,010,000,000	3,043,200,300	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	2,130,000,000	2,161,928,700	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	4,210,000,000	4,278,117,800	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	4,310,000,000	4,384,045,800	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	3,320,000,000	3,366,480,000	

３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,780,000,000	3,802,944,600	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,350,000,000	4,377,057,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	3,290,000,000	3,310,069,000	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	3,790,000,000	3,814,331,800	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,290,000,000	4,317,799,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	3,630,000,000	3,653,667,600	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	3,990,000,000	4,016,094,600	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	4,230,000,000	4,256,352,900	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	5,010,000,000	5,040,961,800	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	3,200,000,000	3,219,552,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	3,140,000,000	3,158,871,400	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	3,310,000,000	3,329,495,900	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	3,010,000,000	3,027,247,300	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	2,710,000,000	2,724,064,900	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	2,840,000,000	2,853,035,600	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	2,590,000,000	2,600,230,500	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	3,350,000,000	3,360,887,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	2,910,000,000	2,917,304,100	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	3,940,000,000	3,946,776,800	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	3,900,000,000	3,903,432,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	3,750,000,000	3,748,275,000	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	3,900,000,000	3,892,707,000	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	3,600,000,000	3,587,940,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	133,216,600	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	118,974,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	249,588,000	
６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	244,174,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	234,512,000	

１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	291,760,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	279,588,000	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	181,056,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	427,692,800	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	331,151,600	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	306,595,200	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	342,746,100	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	504,012,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	353,693,200	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	426,855,000	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	393,731,000	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	377,310,300	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	456,855,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	353,313,900	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	423,446,100	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	806,148,800	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	819,447,800	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	1,022,767,900	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,133,497,200	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,149,755,200	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	931,773,600	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,276,985,600	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,496,570,400	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,569,444,000	
３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,860,857,600	

３６回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,879,409,700	
３７回　利付国庫債券（３０年）	1,860,000,000	2,350,407,600	
３８回　利付国庫債券（３０年）	950,000,000	1,184,289,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,547,679,800	
４０回　利付国庫債券（３０年）	940,000,000	1,175,639,200	
４１回　利付国庫債券（３０年）	680,000,000	837,998,000	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,070,000,000	1,319,802,200	
４３回　利付国庫債券（３０年）	570,000,000	703,722,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,458,126,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	1,517,269,000	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,170,000,000	1,398,536,100	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,534,642,200	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	1,222,696,800	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,060,000,000	1,246,623,600	
５０回　利付国庫債券（３０年）	960,000,000	1,000,540,800	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,253,002,500	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,410,000,000	1,370,830,200	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,192,236,000	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,402,920,000	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	1,163,008,000	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,230,000,000	1,276,223,400	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,244,088,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,600,000,000	1,655,552,000	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	1,131,356,800	
６０回　利付国庫債券（３０年）	1,130,000,000	1,192,884,500	

６１回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	1,045,917,600	
６２回　利付国庫債券（３０年）	610,000,000	582,135,200	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,160,000,000	1,076,190,000	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,092,821,600	
６５回　利付国庫債券（３０年）	1,010,000,000	932,654,200	
６６回　利付国庫債券（３０年）	990,000,000	914,700,600	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,118,743,000	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,280,000,000	1,246,438,400	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,368,342,300	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	1,117,289,600	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,296,828,000	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,195,584,000	
６４回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	31,003,800	
６５回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	62,304,600	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,159,500	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,019,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,220,400	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	486,942,200	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	403,149,600	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,554,400	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	192,430,800	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	74,387,600	
７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,634,800	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	266,915,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,555,000	

８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	96,708,600	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	430,452,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	151,176,200	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	75,936,700	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	183,746,200	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	642,905,300	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	131,766,000	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	131,263,200	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	651,200,700	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,992,900	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	519,199,600	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	122,030,700	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,281,846,400	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	408,887,000	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	743,894,300	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	619,432,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	133,843,200	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	743,212,800	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	179,262,400	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	843,757,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	942,904,900	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	264,132,000	
１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	577,040,000	
１０３回　利付国債（２０年）	160,000,000	183,622,400	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	124,825,800	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	729,388,800	

１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	573,180,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	686,688,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	780,127,800	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	397,197,500	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	505,648,000	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	534,055,400	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	853,641,800	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,354,719,600	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	952,889,200	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	421,189,200	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	622,617,500	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,248,262,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	645,093,150	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	538,408,500	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	756,282,600	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	914,440,800	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	654,867,300	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,237,656,000	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	701,910,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	714,654,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	598,173,900	
１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	628,446,600	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,599,009,200	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	879,943,200	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,055,891,200	

１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	909,092,500	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	956,898,700	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,197,570,700	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	932,400,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	739,500,800	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	755,983,800	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	800,000,000	925,976,000	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	727,648,000	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	1,055,433,200	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	1,590,000,000	1,844,384,100	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,350,000,000	1,569,240,000	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,055,808,000	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,480,000,000	1,707,579,600	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,039,975,300	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	1,550,000,000	1,808,912,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	1,480,000,000	1,730,564,000	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,644,435,200	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	1,390,000,000	1,598,263,700	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	1,400,000,000	1,612,030,000	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	1,510,000,000	1,722,487,200	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	1,640,000,000	1,831,798,000	
１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,250,000,000	2,514,780,000	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,320,000,000	2,624,708,800	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	1,990,000,000	2,226,929,400	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	1,860,000,000	2,032,812,600	

	１５６回　利付国庫債券（２０年）	1,950,000,000	1,969,812,000	
	１５７回　利付国庫債券（２０年）	1,830,000,000	1,795,980,300	
	１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,190,000,000	2,239,012,200	
	１５９回　利付国庫債券（２０年）	1,980,000,000	2,050,250,400	
	１６０回　利付国庫債券（２０年）	1,710,000,000	1,793,687,400	
	１６１回　利付国庫債券（２０年）	1,890,000,000	1,953,466,200	
	１６２回　利付国庫債券（２０年）	1,820,000,000	1,879,277,400	
	１６３回　利付国庫債券（２０年）	1,920,000,000	1,980,480,000	
	１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,080,000,000	2,111,595,200	
	１６５回　利付国庫債券（２０年）	1,810,000,000	1,835,068,500	
	１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,830,000,000	1,911,380,100	
	１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,240,000,000	1,253,702,000	
	１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,680,000,000	1,667,920,800	
	１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,350,000,000	1,315,129,500	
	１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,290,000,000	1,254,176,700	
	１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,640,000,000	1,591,242,800	
	１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,460,000,000	1,439,253,400	
	１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,020,000,000	1,987,579,000	
	１７４回　利付国庫債券（２０年）	1,950,000,000	1,916,655,000	
	１７５回　利付国庫債券（２０年）	1,860,000,000	1,858,381,800	
	１７６回　利付国庫債券（２０年）	1,580,000,000	1,575,860,400	
	１７７回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,858,105,000	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	1,700,000,000	1,690,905,000	
国債証券　合計		370,485,000,000	389,777,102,350	
地方債証券	７１９回　東京都公募公債	200,000,000	202,030,000	
	７２０回　東京都公募公債	300,000,000	303,726,000	
	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	405,624,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	100,117,000	

７８３回　東京都公募公債	110,000,000	110,773,300	
７９６回　東京都公募公債	200,000,000	198,324,000	
８０２回　東京都公募公債	400,000,000	399,184,000	
８１３回　東京都公募公債	300,000,000	299,970,000	
１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	243,054,000	
１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	128,385,000	
１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	102,207,000	
５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	106,684,000	
７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	107,927,000	
９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	221,456,000	
１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	332,445,000	
１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	114,884,000	
２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	115,971,000	
２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	100,161,000	
３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	401,676,000	
令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	99,549,000	
２９回１号　宮城県公募公債　１０年	100,000,000	101,206,000	
３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	249,130,000	
２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	303,993,000	
２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,667,000	
２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	200,218,000	
２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	200,250,000	
３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	131,898,000	
１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	114,404,000	
１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	350,982,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	115,748,000	
３７４回　大阪府公募公債	300,000,000	304,266,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,908,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,765,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	197,896,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	199,256,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	198,398,000	

４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	197,710,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	230,396,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	110,949,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	101,658,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	354,788,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,966,300	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	399,344,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	200,520,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	202,812,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	198,458,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	99,819,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	131,699,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	214,898,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	308,067,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	322,782,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	106,496,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	103,508,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	198,476,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	99,698,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	199,092,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	107,428,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	107,865,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	211,170,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	108,000,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	344,097,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	350,265,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	129,297,000	
２５年度４回　愛知県公募公債	300,000,000	303,525,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	179,446,500	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	101,772,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	199,784,000	

３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	100,931,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	200,520,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	100,649,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	98,802,000	
２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	101,364,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	406,172,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	199,758,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	211,830,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	116,485,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	114,573,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	343,992,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	110,363,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	202,928,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	101,018,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	201,114,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	198,362,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	99,652,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	107,384,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	113,337,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	116,688,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	343,053,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	202,702,000	
２５年度６回　千葉県公募公債	100,000,000	101,355,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,310,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	197,996,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	109,406,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	110,054,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	100,119,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	101,418,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	200,002,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	114,514,000	
１１９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,460,000	

１２１回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,630,000	
１２７回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,206,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,672,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,441,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	505,080,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	405,884,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	610,944,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	509,590,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,793,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,304,800	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,444,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,510,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,447,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,750,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,105,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,592,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	299,448,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,517,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	100,453,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	101,491,000	
２５年度２回　島根県公募公債	106,000,000	107,321,820	
令和元年度１回　島根県公募公債	200,000,000	192,670,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	199,210,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	101,454,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,985,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	200,952,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	299,277,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	228,878,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	457,182,000	

５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	198,620,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	114,385,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	110,975,000	
５回　京都市公募公債　３０年定時償還	200,000,000	193,206,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	111,659,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	234,536,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	230,830,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	101,511,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	302,787,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	197,476,000	
２５年度２回　横浜市公募公債	400,000,000	405,308,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	396,924,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	127,315,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	113,475,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	114,506,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	128,434,000	
２５年度４回　札幌市公募公債	200,000,000	202,284,000	
２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	101,304,000	
２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	306,717,000	
第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	200,942,000	
６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	230,292,000	
５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	128,334,000	
６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	113,121,000	
１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	114,389,000	
２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	130,687,000	
３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	207,010,000	
２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	96,342,000	
２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	101,308,000	
２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	205,160,000	
２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	302,280,000	
３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	103,940,000	
１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	199,290,000	
令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	199,210,000	

	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	101,409,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	101,317,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	200,284,000	
地方債証券　合計		30,945,330,000	32,219,027,720	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	215,018,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	213,464,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	302,418,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,055,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	97,696,000	
	１９回　政保日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,806,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	218,049,000	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	265,918,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	116,296,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	101,203,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,011,000	
	１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,290,000	
	１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,554,000	
	１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	118,744,000	
	１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	127,023,000	
	１６９回　高速道路機構債	100,000,000	110,020,000	
	１７２回　高速道路機構債	200,000,000	195,884,000	
	２１０回　高速道路機構債	100,000,000	102,562,000	
	９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,625,000	
	１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	122,187,000	
	１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	571,975,000	
	１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,521,000	
	１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,440,000	
	１８９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	503,620,000	
	１９３回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,600,000	
	１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	436,200,600	
	２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	106,360,800	

２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,427,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,596,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	203,218,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	331,146,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	507,315,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,154,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,597,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	231,198,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,233,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,325,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	803,544,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	206,004,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,189,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	192,772,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	193,960,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	197,098,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	643,990,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	226,560,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	346,605,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	347,640,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	117,232,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	321,405,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	230,920,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	114,392,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	229,572,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	212,660,000	

５０回　政保地方公共団体金融機構債券	500,000,000	506,995,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	550,292,600	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	114,395,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	304,437,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,300,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	223,378,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	345,093,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	401,104,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,344,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	102,988,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,543,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,502,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,873,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	229,804,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,018,540	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	108,102,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	106,889,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	212,098,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	195,808,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	110,595,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	101,445,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	230,080,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,079,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	409,699,500	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,271,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	115,745,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,845,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	314,220,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,259,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,821,000	

１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,231,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,031,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	302,637,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,334,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	499,410,000	
６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	29,904,000	30,034,680	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	20,918,000	21,169,434	
９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	31,908,000	32,295,682	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	33,699,000	34,364,218	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,792,000	52,262,936	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,293,000	11,528,120	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,295,000	55,078,476	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,625,000	33,187,128	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,690,000	54,371,326	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	11,099,000	11,298,338	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,827,000	19,906,540	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	113,905,000	121,402,227	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,944,000	185,374,598	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,547,000	25,819,761	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,331,000	22,394,563	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,511,000	26,720,221	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	26,863,000	28,154,841	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,205,000	37,978,682	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,132,000	84,710,732	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,230,000	36,805,837	

８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,442,000	42,971,209	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,037,000	43,623,896	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,928,000	47,659,026	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,974,000	49,474,146	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,297,000	54,201,450	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,806,000	61,304,140	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,995,000	64,039,595	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,539,000	229,718,040	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,852,000	78,484,158	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,482,000	78,194,834	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,640,000	78,299,940	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,136,000	243,738,940	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	242,124,000	243,567,059	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,214,000	165,205,852	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	246,744,000	247,842,010	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	246,672,000	247,851,092	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	426,510,000	430,531,988	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,771,000	85,509,355	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,399,000	87,327,332	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,272,000	276,553,865	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	370,444,000	370,781,104	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	284,160,000	284,839,142	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,729,000	293,085,539	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	884,250,000	885,258,045	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,047,000	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,177,000	

	い第８４３号　利付商工債	100,000,000	100,126,000	
	い第８５１号　利付商工債	300,000,000	299,670,000	
	い第８５４号　利付商工債	300,000,000	299,523,000	
	い第８５５号　利付商工債	200,000,000	199,676,000	
	３４２回　利附信金中金債（５年）	100,000,000	100,101,000	
	３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,996,000	
	３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	299,478,000	
	７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	101,198,000	
	１５回　国際協力機構債	100,000,000	114,855,000	
	１８回　国際協力機構債券	100,000,000	101,232,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	200,204,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	299,910,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	300,261,000	
	５５回　鉄道建設運輸施設債	500,000,000	504,935,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,441,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	105,083,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	199,458,000	
特殊債券　合計		26,983,135,000	28,365,250,137	
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	301,449,000	
	２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,313,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	100,094,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	203,042,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	99,701,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,986,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	400,156,000	
	３４４回　東京交通債券	100,000,000	101,745,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	101,487,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	96,580,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	100,243,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	200,314,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	299,931,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,954,000	
	５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	101,432,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	199,908,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	499,530,000	
	２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	202,842,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	101,873,000	

３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	303,018,000	
３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	202,532,000	
６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	499,530,000	
２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,438,000	
１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,442,000	
９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	101,190,000	
１２回　セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	102,136,000	
１４回　セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	200,130,000	
３０回　東レ社債	300,000,000	300,954,000	
４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	199,300,000	
４９回　住友化学社債	100,000,000	101,777,000	
２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	205,644,000	
４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,589,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	302,673,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	497,800,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,862,000	
６回　ＪＸホールディングス社債	100,000,000	101,534,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	301,338,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	298,767,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	101,090,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	99,975,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	199,626,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	101,334,000	
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	100,378,000	
１４回　トヨタ自動車社債	200,000,000	202,152,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	202,550,000	
２６回　トヨタ自動車	200,000,000	199,616,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	102,847,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	398,820,000	
４７回　住友商事社債	100,000,000	101,290,000	
４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	101,611,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	400,736,000	
１３回　新生銀行社債	200,000,000	199,642,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	111,131,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	109,512,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	299,667,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	202,594,000	
１０回　セブン銀行社債	100,000,000	100,879,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	202,528,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	298,740,000	

１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	301,050,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	402,128,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	299,016,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	100,128,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,784,000	
４７回　日立キャピタル社債	200,000,000	201,856,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	198,292,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	299,310,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	100,125,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	200,194,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,630,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	302,472,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	105,739,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,673,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,974,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	106,600,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	99,707,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	319,773,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	214,494,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	114,843,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	113,970,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	231,934,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	112,607,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,090,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	101,542,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	100,039,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,069,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,593,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	198,300,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	197,074,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	309,924,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	114,151,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	199,750,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,830,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,528,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	99,593,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	197,648,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	207,414,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	104,564,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	111,664,000	

	４回　東京地下鉄社債	120,000,000	131,736,000	
	４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	96,261,000	
	１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	398,360,000	
	３０回　光通信社債	200,000,000	202,412,000	
	５２７回　中部電力社債	100,000,000	102,899,000	
	５３２回　中部電力社債	200,000,000	197,926,000	
	４９７回　関西電力社債	100,000,000	102,844,000	
	５０８回　関西電力社債	300,000,000	302,949,000	
	５３０回　関西電力社債	400,000,000	400,136,000	
	５３１回　関西電力社債	200,000,000	197,718,000	
	５４１回　関西電力社債	300,000,000	298,035,000	
	３７７回　中国電力社債	400,000,000	406,600,000	
	３９６回　中国電力社債	200,000,000	202,996,000	
	４２５回　中国電力社債	100,000,000	99,915,000	
	３０１回　北陸電力社債	100,000,000	101,259,000	
	３０７回　北陸電力社債	100,000,000	103,750,000	
	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	103,204,000	
	４７１回　東北電力社債	400,000,000	408,088,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	100,259,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	402,424,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	199,286,000	
	２５３回　四国電力社債	200,000,000	202,552,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	204,110,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	407,804,000	
	４２８回　九州電力社債	100,000,000	101,997,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	101,881,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	100,743,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	297,720,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	98,552,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	198,958,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	266,452,290	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	302,868,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	202,318,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	212,812,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	304,965,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	100,374,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	198,742,000	
	２３回　東京瓦斯社債	300,000,000	303,834,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	201,228,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	97,967,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	94,431,000	
	２７回　ＮＴＴデータ社債	200,000,000	202,250,000	
	5回　ファーストリテイリング社債	100,000,000	100,019,000	
	7回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	201,432,000	
	8回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	204,824,000	
社債券　合計		27,581,000,000	27,900,914,290	
合計			478,262,294,497	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,449,665,015
株式	459,100,440,990
未収配当金	631,194,952
前払金	4,100,000
差入委託証拠金	148,200,000
流動資産合計	464,333,600,957
資産合計	464,333,600,957
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,113,510
未払金	5,608,380
未払解約金	1,406,007,000
流動負債合計	1,424,728,890
負債合計	1,424,728,890
純資産の部	
元本等	
元本	140,692,906,135
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	322,215,965,932
元本等合計	462,908,872,067
純資産合計	462,908,872,067
負債純資産合計	464,333,600,957

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	107,064,989,240円
同期中追加設定元本額	112,957,148,759円
同期中一部解約元本額	79,329,231,864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	2,720,918,084円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	7,107,572,120円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	20,005,969,021円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	5,146,452,405円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,115,548円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	21,808,037円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	59,570,751円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	27,365,048円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	21,325,859円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	16,150,865円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,218,485,732円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,002,164,704円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	38,225,826円
たわらノーロード　バランス（標準型）	246,189,049円
たわらノーロード　バランス（積極型）	383,429,619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）	2,712,349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）	164,697,653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）	411,879,269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）	274,904,152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）	399,107,063円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	661,037円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,804,729円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	36,119,991円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,859,208円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	18,742,643円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,692,005,513円
Ｏｎｅグローバルバランス	4,560,030円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,029,942,374円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,438,520,518円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,733,712,875円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	333,218,585円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,107,985,798円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,112,221,436円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	30,317,366円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,055,563,450円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	18,425,550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）	299,695,939円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	543,780,050円
投資のソムリエ	25,720,898,298円
クルーズコントロール	486,444,549円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,541,714,244円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	317,582,855円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	508,910,757円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	3,605,093円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	15,073,508円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	881,862,789円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	6,188,220,082円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	38,532,332円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	18,856,335円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	7,090,378円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	137,155,511円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	333,059,142円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,076,260,441円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	279,108,977円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	39,615,477円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	16,465,496円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	14,065,155円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	92,090,384円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	630,801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）	34,691,586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）	35,472,411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）	21,616,254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）	34,089,777円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	123,615,360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）	41,677,610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）	134,960,368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）	68,984,011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）	47,924,787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）	34,184,939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）	49,987,822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）	70,694,127円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	674,849,257円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,852,079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）	160,289,564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）	58,237,800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）	14,290,490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）	57,866,300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）	100,747,359円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,902,785円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,541,054円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,453,875円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,316,463円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,745,090円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,087,134円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	551,489,581円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	627,529,740円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,812,041,771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）	31,214,820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）	31,199,084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）	298,020,250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）	73,382,652円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,396,580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）	345,451,391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）	20,778,661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）	71,750,840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）	170,984,783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）	237,664,019円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,462,665円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,644,708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＞	19,323,385円
コア資産形成ファンド	13,474,707円
ＭＨＡＭトピックスファンド	678,003,991円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	66,196,092円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	2,760,118,084円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	2,062,490,621円
計	140,692,906,135円
２．　受益権の総数	140,692,906,135口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	6,876,117,879
合計	6,876,117,879

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	2,928,810,000	－	2,915,745,000	△13,065,000
合計	2,928,810,000	－	2,915,745,000	△13,065,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（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）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2902円 (32,902円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	8,200	3,085.00	25,297,000	

日本水産	229,600	547.00	125,591,200	
マルハニチロ	36,000	2,425.00	87,300,000	
ホウスイ	700	845.00	591,500	
雪国まいたけ	16,900	1,239.00	20,939,100	
カネコ種苗	5,600	1,455.00	8,148,000	
サカタのタネ	27,500	3,220.00	88,550,000	
ホクト	19,500	1,919.00	37,420,500	
ホクリヨウ	3,800	708.00	2,690,400	
ヒノキヤグループ	5,100	2,042.00	10,414,200	
ショーボンドホールディングス	32,800	4,990.00	163,672,000	
ミライト・ホールディングス	73,900	1,893.00	139,892,700	
タマホーム	13,900	2,240.00	31,136,000	
サンヨーホームズ	2,800	735.00	2,058,000	
日本アクア	9,300	627.00	5,831,100	
ファーストコーポレーション	7,300	700.00	5,110,000	
ベステラ	4,600	1,336.00	6,145,600	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	38,200	229.00	8,747,800	
キャンディル	4,300	505.00	2,171,500	
住石ホールディングス	40,300	146.00	5,883,800	
日鉄鉱業	5,300	6,630.00	35,139,000	
三井松島ホールディングス	9,500	1,748.00	16,606,000	
ＩＮＰＥＸ	920,800	1,019.00	938,295,200	
石油資源開発	27,000	2,641.00	71,307,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11,300	1,456.00	16,452,800	
ダイセキ環境ソリューション	4,400	1,339.00	5,891,600	
第一カッター興業	5,900	1,367.00	8,065,300	
明豊ファシリティワークス	7,500	807.00	6,052,500	
安藤・間	114,000	878.00	100,092,000	
東急建設	67,200	688.00	46,233,600	
コムシスホールディングス	73,900	2,617.00	193,396,300	
ビーアールホールディングス	31,100	352.00	10,947,200	
高松コンストラクショングループ	14,400	1,970.00	28,368,000	
東建コーポレーション	7,100	9,290.00	65,959,000	
ソネック	2,500	1,016.00	2,540,000	
ヤマウラ	11,700	965.00	11,290,500	
オリエンタル白石	77,900	235.00	18,306,500	
大成建設	153,100	3,480.00	532,788,000	
大林組	529,900	902.00	477,969,800	
清水建設	496,400	729.00	361,875,600	
飛島建設	14,100	1,032.00	14,551,200	
長谷工コーポレーション	157,800	1,439.00	227,074,200	
松井建設	21,100	727.00	15,339,700	
錢高組	2,000	3,995.00	7,990,000	
鹿島建設	388,400	1,352.00	525,116,800	
不動テトラ	11,200	1,672.00	18,726,400	
大末建設	5,700	1,344.00	7,660,800	
鉄建建設	11,700	1,829.00	21,399,300	
西松建設	32,200	3,700.00	119,140,000	
三井住友建設	119,300	434.00	51,776,200	
大豊建設	7,700	3,870.00	29,799,000	

佐田建設	11,600	467.00	5,417,200	
ナカノフドー建設	12,400	341.00	4,228,400	
奥村組	31,100	3,265.00	101,541,500	
東鉄工業	24,600	2,477.00	60,934,200	
イチケン	3,900	1,849.00	7,211,100	
富士ピー・エス	6,700	478.00	3,202,600	
淺沼組	6,000	5,540.00	33,240,000	
戸田建設	220,000	724.00	159,280,000	
熊谷組	27,000	2,909.00	78,543,000	
北野建設	3,300	2,093.00	6,906,900	
植木組	4,700	1,389.00	6,528,300	
矢作建設工業	23,600	745.00	17,582,000	
ピーエス三菱	17,600	608.00	10,700,800	
日本ハウスホールディングス	36,400	469.00	17,071,600	
大東建託	54,200	13,060.00	707,852,000	
新日本建設	22,800	792.00	18,057,600	
東亜道路工業	2,900	4,845.00	14,050,500	
日本道路	5,200	8,250.00	42,900,000	
東亜建設工業	13,100	2,389.00	31,295,900	
日本国土開発	52,200	551.00	28,762,200	
若築建設	8,800	1,770.00	15,576,000	
東洋建設	59,400	569.00	33,798,600	
五洋建設	210,000	643.00	135,030,000	
世紀東急工業	25,700	804.00	20,662,800	
福田組	5,700	4,250.00	24,225,000	
日本ドライケミカル	4,300	1,932.00	8,307,600	
住友林業	135,600	2,185.00	296,286,000	
日本基礎技術	14,600	588.00	8,584,800	
巴コーポレーション	23,800	506.00	12,042,800	
大和ハウス工業	489,400	3,345.00	1,637,043,000	
ライト工業	33,300	1,898.00	63,203,400	
積水ハウス	574,900	2,459.50	1,413,966,550	
日特建設	11,200	657.00	7,358,400	
北陸電気工事	11,280	846.00	9,542,880	
ユアテック	30,400	664.00	20,185,600	
日本リーテック	11,000	1,487.00	16,357,000	
四電工	6,000	1,692.00	10,152,000	
中電工	24,500	2,106.00	51,597,000	
関電工	86,500	873.00	75,514,500	
きんでん	118,600	1,718.00	203,754,800	
東京エネシス	17,800	975.00	17,355,000	
トーエネック	5,400	3,335.00	18,009,000	
住友電設	13,100	2,112.00	27,667,200	
日本電設工業	29,100	1,567.00	45,599,700	
エクシオグループ	80,200	2,420.00	194,084,000	
新日本空調	14,000	2,154.00	30,156,000	
日本工営	9,500	3,145.00	29,877,500	
九電工	40,900	3,460.00	141,514,000	
三機工業	34,600	1,427.00	49,374,200	
日揮ホールディングス	163,200	1,041.00	169,891,200	

中外炉工業	5,400	1,629.00	8,796,600	
ヤマト	15,800	735.00	11,613,000	
太平電業	11,900	2,835.00	33,736,500	
高砂熱学工業	47,900	1,908.00	91,393,200	
三晃金属工業	2,000	2,401.00	4,802,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	54,900	1,742.00	95,635,800	
朝日工業社	3,700	3,125.00	11,562,500	
明星工業	34,300	740.00	25,382,000	
大氣社	25,900	3,070.00	79,513,000	
ダイダン	11,800	2,228.00	26,290,400	
日比谷総合設備	17,100	1,932.00	33,037,200	
ニップン	50,000	1,642.00	82,100,000	
日清製粉グループ本社	191,900	1,617.00	310,302,300	
日東富士製粉	1,800	3,730.00	6,714,000	
昭和産業	16,300	2,684.00	43,749,200	
鳥越製粉	15,600	658.00	10,264,800	
中部飼料	19,200	1,009.00	19,372,800	
フィード・ワン	23,200	701.00	16,263,200	
東洋精糖	2,100	1,012.00	2,125,200	
日本甜菜製糖	9,300	1,699.00	15,800,700	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	15,600	1,947.00	30,373,200	
塩水港精糖	22,800	214.00	4,879,200	
日新製糖	8,700	1,709.00	14,868,300	
ＬＩＦＵＬＬ	49,400	238.00	11,757,200	
ミクシィ	36,900	2,048.00	75,571,200	
ジェイエイシーリクルートメント	13,100	2,027.00	26,553,700	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	265,000	2,512.00	665,680,000	
メンバーズ	4,800	2,313.00	11,102,400	
中広	1,400	372.00	520,800	
ＵＴグループ	23,300	3,925.00	91,452,500	
アイティメディア	7,600	1,696.00	12,889,600	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,500	1,202.00	10,217,000	
夢真ビーネックスグループ	43,000	1,722.00	74,046,000	
コシダカホールディングス	43,000	624.00	26,832,000	
アルトナー	4,100	889.00	3,644,900	
パソナグループ	17,500	2,977.00	52,097,500	
ＣＤＳ	2,800	1,559.00	4,365,200	
リンクアンドモチベーション	35,600	498.00	17,728,800	
エス・エム・エス	54,900	3,720.00	204,228,000	
サニーサイドアップグループ	5,900	721.00	4,253,900	
パーソルホールディングス	161,500	3,030.00	489,345,000	
リニカル	9,300	702.00	6,528,600	
クックパッド	50,700	269.00	13,638,300	
エスクリ	7,000	388.00	2,716,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7,600	594.00	4,514,400	
森永製菓	39,900	3,745.00	149,425,500	
中村屋	2,900	3,600.00	10,440,000	
江崎グリコ	46,800	3,725.00	174,330,000	
名糖産業	7,800	1,654.00	12,901,200	
井村屋グループ	9,800	2,322.00	22,755,600	

不二家	9,700	2,286.00	22,174,200	
山崎製パン	127,300	1,548.00	197,060,400	
第一屋製パン	3,900	543.00	2,117,700	
モロゾフ	2,100	5,710.00	11,991,000	
亀田製菓	9,800	4,215.00	41,307,000	
寿スピリッツ	16,400	4,920.00	80,688,000	
カルビー	77,300	2,728.00	210,874,400	
森永乳業	31,400	5,470.00	171,758,000	
六甲バター	12,600	1,547.00	19,492,200	
ヤクルト本社	125,700	5,920.00	744,144,000	
明治ホールディングス	112,200	7,110.00	797,742,000	
雪印メグミルク	40,900	2,043.00	83,558,700	
プリマハム	21,300	2,494.00	53,122,200	
日本ハム	64,900	4,260.00	276,474,000	
林兼産業	4,300	515.00	2,214,500	
丸大食品	16,900	1,550.00	26,195,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	15,300	3,435.00	52,555,500	
柿安本店	6,000	2,775.00	16,650,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	109,900	662.00	72,753,800	
学情	6,400	1,008.00	6,451,200	
スタジオアリス	7,200	2,044.00	14,716,800	
クロスキャット	4,400	1,583.00	6,965,200	
シミックホールディングス	9,100	1,488.00	13,540,800	
エプコ	3,700	773.00	2,860,100	
システナ	236,500	385.00	91,052,500	
ＮＪＳ	3,300	1,912.00	6,309,600	
デジタルアーツ	9,000	7,480.00	67,320,000	
日鉄ソリューションズ	24,000	3,445.00	82,680,000	
綜合警備保障	64,200	4,325.00	277,665,000	
キューブシステム	8,500	991.00	8,423,500	
いちご	185,800	283.00	52,581,400	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,400	1,496.00	3,590,400	
日本駐車場開発	181,600	137.00	24,879,200	
コア	7,200	1,560.00	11,232,000	
カカクコム	118,600	2,784.00	330,182,400	
アイロムグループ	5,700	1,595.00	9,091,500	
セントケア・ホールディング	10,500	746.00	7,833,000	
サイネックス	2,800	605.00	1,694,000	
ルネサンス	11,200	1,049.00	11,748,800	
ディップ	28,400	3,695.00	104,938,000	
ＳＢＳホールディングス	12,600	3,495.00	44,037,000	
デジタルホールディングス	11,000	1,273.00	14,003,000	
新日本科学	19,700	1,342.00	26,437,400	
キャリアデザインセンター	4,100	950.00	3,895,000	
ベネフィット・ワン	58,800	3,910.00	229,908,000	
エムスリー	285,000	5,103.00	1,454,355,000	
ツカダ・グローバルホールディング	9,700	270.00	2,619,000	
ブラス	2,400	703.00	1,687,200	
アウトソーシング	92,500	1,505.00	139,212,500	
ウェルネット	16,400	447.00	7,330,800	

ワールドホールディングス	6,400	2,401.00	15,366,400	
ディー・エヌ・エー	61,500	1,742.00	107,133,000	
博報堂ＤＹホールディングス	224,900	1,918.00	431,358,200	
ぐるなび	26,300	395.00	10,388,500	
タカミヤ	20,100	427.00	8,582,700	
ジャパンベストレスキューシステム	10,800	862.00	9,309,600	
ファンコミュニケーションズ	40,300	386.00	15,555,800	
ライク	4,300	1,719.00	7,391,700	
ビジネス・ブレークスルー	6,300	400.00	2,520,000	
エスプール	45,600	1,031.00	47,013,600	
ＷＤＢホールディングス	7,500	2,836.00	21,270,000	
手間いらず	2,100	4,555.00	9,565,500	
ティア	10,000	442.00	4,420,000	
ＣＤＧ	1,600	1,384.00	2,214,400	
アドウェイズ	24,000	806.00	19,344,000	
バリューコマース	12,800	4,000.00	51,200,000	
インフォマート	176,900	841.00	148,772,900	
サッポロホールディングス	57,900	2,239.00	129,638,100	
アサヒグループホールディングス	399,200	4,587.00	1,831,130,400	
キリンホールディングス	623,600	1,865.50	1,163,325,800	
宝ホールディングス	115,400	1,208.00	139,403,200	
オエノンホールディングス	49,400	337.00	16,647,800	
養命酒製造	5,900	1,760.00	10,384,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	119,100	1,348.00	160,546,800	
サントリー食品インターナショナル	113,500	4,265.00	484,077,500	
ダイドーグループホールディングス	8,800	4,865.00	42,812,000	
伊藤園	51,600	6,240.00	321,984,000	
キーコーヒー	16,900	2,033.00	34,357,700	
ユニカフェ	5,700	964.00	5,494,800	
ジャパンフーズ	2,000	1,202.00	2,404,000	
日清オイリオグループ	21,400	2,923.00	62,552,200	
不二製油グループ本社	36,800	2,358.00	86,774,400	
かどや製油	1,200	3,930.00	4,716,000	
Ｊ－オイルミルズ	16,200	1,696.00	27,475,200	
ローソン	36,900	5,020.00	185,238,000	
サンエー	12,600	4,040.00	50,904,000	
カワチ薬品	12,900	2,201.00	28,392,900	
エービーシー・マート	26,000	4,920.00	127,920,000	
ハードオフコーポレーション	7,900	732.00	5,782,800	
高千穂交易	6,700	1,523.00	10,204,100	
アスクル	26,900	1,540.00	41,426,000	
ゲオホールディングス	22,300	1,204.00	26,849,200	
アダストリア	17,800	1,624.00	28,907,200	
ジーフット	11,400	343.00	3,910,200	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,500	370.00	925,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,000	1,462.00	2,924,000	
伊藤忠食品	3,400	4,930.00	16,762,000	
くら寿司	17,300	3,755.00	64,961,500	
キャンドゥ	7,900	2,250.00	17,775,000	

エレマテック	13,400	1,082.00	14,498,800	
アイケイ	4,600	406.00	1,867,600	
パルグループホールディングス	14,500	1,601.00	23,214,500	
ＪＡＬＵＸ	4,700	2,550.00	11,985,000	
エディオン	76,200	1,038.00	79,095,600	
あらた	13,300	4,335.00	57,655,500	
サーラコーポレーション	33,900	618.00	20,950,200	
ワッツ	8,200	710.00	5,822,000	
トーメンデバイス	2,600	6,920.00	17,992,000	
ハローズ	7,600	2,869.00	21,804,400	
ＪＰホールディングス	41,000	240.00	9,840,000	
フジオフードグループ本社	14,100	1,291.00	18,203,100	
あみやき亭	3,800	2,965.00	11,267,000	
東京エレクトロン　デバイス	4,800	6,050.00	29,040,000	
ひらまつ	35,300	178.00	6,283,400	
フィールズ	14,500	512.00	7,424,000	
双日	183,800	1,773.00	325,877,400	
アルフレッサ　ホールディングス	184,900	1,599.00	295,655,100	
大黒天物産	5,400	5,210.00	28,134,000	
ハニーズホールディングス	13,200	1,000.00	13,200,000	
ファーマライズホールディングス	4,600	726.00	3,339,600	
キッコーマン	122,200	9,090.00	1,110,798,000	
味の素	374,600	3,517.00	1,317,468,200	
ブルドックソース	7,200	2,022.00	14,558,400	
キユーピー	89,200	2,491.00	222,197,200	
ハウス食品グループ本社	63,500	2,915.00	185,102,500	
カゴメ	64,400	3,025.00	194,810,000	
焼津水産化学工業	5,900	904.00	5,333,600	
アリアケジャパン	15,500	6,070.00	94,085,000	
ピエトロ	1,400	1,761.00	2,465,400	
エバラ食品工業	2,800	2,716.00	7,604,800	
やまみ	2,000	1,875.00	3,750,000	
ニチレイ	77,400	2,641.00	204,413,400	
横浜冷凍	47,500	849.00	40,327,500	
東洋水産	81,600	4,865.00	396,984,000	
イートアンドホールディングス	6,600	2,247.00	14,830,200	
大冷	2,200	1,919.00	4,221,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,000	563.00	5,067,000	
日清食品ホールディングス	66,500	8,270.00	549,955,000	
永谷園ホールディングス	7,800	1,941.00	15,139,800	
一正蒲鉾	7,000	798.00	5,586,000	
フジッコ	15,800	1,925.00	30,415,000	
ロック・フィールド	18,400	1,527.00	28,096,800	
日本たばこ産業	909,900	2,365.50	2,152,368,450	
ケンコーマヨネーズ	9,700	1,362.00	13,211,400	
わらべや日洋ホールディングス	11,000	2,017.00	22,187,000	
なとり	9,300	2,010.00	18,693,000	
イフジ産業	2,800	890.00	2,492,000	
ピックルスコーポレーション	8,200	1,650.00	13,530,000	
ファーマフーズ	16,000	1,882.00	30,112,000	

北の達人コーポレーション	59,100	305.00	18,025,500	
ユーグレナ	86,200	688.00	59,305,600	
紀文食品	9,900	972.00	9,622,800	
スター・マイカ・ホールディングス	9,100	1,285.00	11,693,500	
ＳＲＥホールディングス	4,000	5,440.00	21,760,000	
ＡＤワークスグループ	34,400	144.00	4,953,600	
片倉工業	15,800	2,299.00	36,324,200	
グンゼ	11,000	4,025.00	44,275,000	
ヒューリック	397,900	1,079.00	429,334,100	
神栄	2,200	972.00	2,138,400	
ラサ商事	9,400	962.00	9,042,800	
アルペン	12,800	2,166.00	27,724,800	
ハブ	5,500	599.00	3,294,500	
ラクーンホールディングス	11,800	1,376.00	16,236,800	
クオールホールディングス	20,300	1,377.00	27,953,100	
アルコニックス	17,700	1,373.00	24,302,100	
神戸物産	129,300	3,930.00	508,149,000	
ソリトンシステムズ	8,300	1,316.00	10,922,800	
ジンズホールディングス	11,300	6,980.00	78,874,000	
ビックカメラ	98,500	954.00	93,969,000	
ＤＣＭホールディングス	102,600	1,090.00	111,834,000	
ペッパーフードサービス	22,600	322.00	7,277,200	
ハイパー	2,500	500.00	1,250,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	210,500	2,082.00	438,261,000	
東京一番フーズ	4,500	606.00	2,727,000	
ＤＤホールディングス	8,800	520.00	4,576,000	
あい　ホールディングス	23,700	1,949.00	46,191,300	
ディーブイエックス	5,500	1,066.00	5,863,000	
きちりホールディングス	4,700	386.00	1,814,200	
アークランドサービスホールディングス	12,300	2,201.00	27,072,300	
Ｊ．フロント　リテイリング	198,700	1,054.00	209,429,800	
ドトール・日レスホールディングス	28,700	1,587.00	45,546,900	
マツキヨココカラ&カンパニー	102,400	4,085.00	418,304,000	
ブロンコビリー	9,500	2,419.00	22,980,500	
ＺＯＺＯ	114,600	3,340.00	382,764,000	
トレジャー・ファクトリー	4,900	879.00	4,307,100	
物語コーポレーション	9,000	6,190.00	55,710,000	
三越伊勢丹ホールディングス	291,200	856.00	249,267,200	
東洋紡	65,300	1,345.00	87,828,500	
ユニチカ	45,000	312.00	14,040,000	
富士紡ホールディングス	7,300	4,090.00	29,857,000	
日清紡ホールディングス	103,200	926.00	95,563,200	
倉敷紡績	14,100	1,929.00	27,198,900	
ダイワボウホールディングス	80,900	1,768.00	143,031,200	
シキボウ	9,000	929.00	8,361,000	
日東紡績	25,200	2,913.00	73,407,600	
トヨタ紡織	69,000	2,401.00	165,669,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	39,600	2,633.00	104,266,800	
Ｈａｍｅｅ	4,300	1,179.00	5,069,700	

マーケットエンタープライズ	1,200	698.00	837,600	
ラクト・ジャパン	5,700	2,398.00	13,668,600	
ウエルシアホールディングス	88,000	3,315.00	291,720,000	
クリエイトＳＤホールディングス	24,500	3,140.00	76,930,000	
グリムス	7,500	2,226.00	16,695,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	29,000	807.00	23,403,000	
八洲電機	12,600	979.00	12,335,400	
メディアスホールディングス	9,700	933.00	9,050,100	
レスターホールディングス	15,800	1,941.00	30,667,800	
ジューテックホールディングス	4,100	1,104.00	4,526,400	
丸善ＣＨＩホールディングス	21,600	360.00	7,776,000	
大光	7,700	681.00	5,243,700	
ＯＣＨＩホールディングス	4,100	1,302.00	5,338,200	
ＴＯＫＡＩホールディングス	80,900	873.00	70,625,700	
黒谷	4,500	671.00	3,019,500	
ミサワ	3,400	720.00	2,448,000	
ティーライフ	2,200	1,438.00	3,163,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,100	731.00	1,535,100	
エー・ピーホールディングス	2,400	441.00	1,058,400	
三洋貿易	16,800	1,000.00	16,800,000	
チムニー	5,200	1,137.00	5,912,400	
シュッピン	13,800	1,025.00	14,145,000	
ビューティガレージ	2,800	2,739.00	7,669,200	
オイシックス・ラ・大地	23,900	2,869.00	68,569,100	
ウイン・パートナーズ	12,400	973.00	12,065,200	
ネクステージ	33,600	2,870.00	96,432,000	
ジョイフル本田	48,700	1,513.00	73,683,100	
鳥貴族ホールディングス	6,100	1,715.00	10,461,500	
ホットランド	12,600	1,268.00	15,976,800	
すかいらーくホールディングス	214,900	1,494.00	321,060,600	
ＳＦＰホールディングス	8,200	1,385.00	11,357,000	
綿半ホールディングス	12,600	1,264.00	15,926,400	
日本毛織	49,900	919.00	45,858,100	
ダイトウボウ	27,300	102.00	2,784,600	
トーア紡コーポレーション	4,900	415.00	2,033,500	
ダイドーリミテッド	23,600	138.00	3,256,800	
ヨシックスホールディングス	3,300	1,882.00	6,210,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	48,600	1,035.00	50,301,000	
三栄建築設計	6,700	1,707.00	11,436,900	
野村不動産ホールディングス	86,200	2,661.00	229,378,200	
三重交通グループホールディングス	34,300	477.00	16,361,100	
サムティ	26,800	2,111.00	56,574,800	
ディア・ライフ	21,600	526.00	11,361,600	
コーセーアールイー	5,200	732.00	3,806,400	
地主	10,600	1,720.00	18,232,000	
プレサンスコーポレーション	21,700	2,093.00	45,418,100	
フィル・カンパニー	3,100	2,199.00	6,816,900	
ＴＨＥグローバル社	10,500	181.00	1,900,500	

ハウスコム	1,400	1,252.00	1,752,800	
日本管理センター	8,000	983.00	7,864,000	
サンセイランディック	5,300	807.00	4,277,100	
エストラスト	1,600	624.00	998,400	
フージャースホールディングス	21,500	681.00	14,641,500	
オープンハウスグループ	52,900	5,930.00	313,697,000	
東急不動産ホールディングス	490,700	649.00	318,464,300	
飯田グループホールディングス	139,100	2,735.00	380,438,500	
イーグランド	2,800	1,475.00	4,130,000	
ムゲンエステート	10,800	480.00	5,184,000	
帝国繊維	18,700	2,101.00	39,288,700	
日本コークス工業	142,300	136.00	19,352,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,700	1,106.00	9,622,200	
ミタチ産業	4,600	1,029.00	4,733,400	
ＢＥＥＮＯＳ	8,500	2,267.00	19,269,500	
あさひ	13,700	1,398.00	19,152,600	
日本調剤	10,100	1,355.00	13,685,500	
コスモス薬品	16,800	15,730.00	264,264,000	
シップヘルスケアホールディングス	53,400	2,622.00	140,014,800	
トーエル	7,700	857.00	6,598,900	
ソフトクリエイトホールディングス	7,200	3,990.00	28,728,000	
セブン＆アイ・ホールディングス	651,400	5,019.00	3,269,376,600	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	88,600	717.00	63,526,200	
明治電機工業	5,400	1,270.00	6,858,000	
ツルハホールディングス	36,300	10,680.00	387,684,000	
デリカフーズホールディングス	6,800	595.00	4,046,000	
スターティアホールディングス	3,800	858.00	3,260,400	
サンマルクホールディングス	13,200	1,478.00	19,509,600	
フェリシモ	3,800	1,282.00	4,871,600	
トリドールホールディングス	41,300	2,374.00	98,046,200	
帝人	155,600	1,457.00	226,709,200	
東レ	1,198,600	718.70	861,433,820	
クラレ	241,900	1,039.00	251,334,100	
旭化成	1,097,000	1,123.00	1,231,931,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	15,200	531.00	8,071,200	
稲葉製作所	9,500	1,361.00	12,929,500	
宮地エンジニアリンググループ	5,200	3,175.00	16,510,000	
トーカロ	43,100	1,392.00	59,995,200	
アルファ	5,500	1,124.00	6,182,000	
ＳＵＭＣＯ	257,300	2,288.00	588,702,400	
川田テクノロジーズ	3,400	4,270.00	14,518,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,400	6,300.00	34,020,000	
ジェイテックコーポレーション	1,800	1,816.00	3,268,800	
信和	10,500	832.00	8,736,000	
ビーロット	11,300	502.00	5,672,600	
ファーストブラザーズ	4,000	948.00	3,792,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,200	870.00	7,134,000	
シーアールイー	4,600	1,618.00	7,442,800	
プロパティエージェント	2,000	1,689.00	3,378,000	

ケイアイスター不動産	7,500	8,140.00	61,050,000	
アグレ都市デザイン	2,800	1,528.00	4,278,400	
グッドコムアセット	7,200	1,107.00	7,970,400	
ジェイ・エス・ビー	3,400	3,130.00	10,642,000	
テンポイノベーション	4,700	878.00	4,126,600	
グローバル・リンク・マネジメント	3,000	833.00	2,499,000	
フェイスネットワーク	1,600	1,266.00	2,025,600	
住江織物	3,800	1,573.00	5,977,400	
日本フエルト	6,700	430.00	2,881,000	
イチカワ	1,600	1,365.00	2,184,000	
エコナックホールディングス	29,800	90.00	2,682,000	
日東製網	2,000	1,448.00	2,896,000	
芦森工業	2,800	925.00	2,590,000	
アツギ	13,100	544.00	7,126,400	
ウイルプラスホールディングス	2,800	981.00	2,746,800	
ＪＭホールディングス	11,200	1,615.00	18,088,000	
コメダホールディングス	36,300	2,040.00	74,052,000	
サツドラホールディングス	8,400	629.00	5,283,600	
アレンザホールディングス	12,800	1,110.00	14,208,000	
串カツ田中ホールディングス	4,400	1,995.00	8,778,000	
バロックジャパンリミテッド	12,100	867.00	10,490,700	
クスリのアオキホールディングス	16,500	6,820.00	112,530,000	
ダイニック	4,300	713.00	3,065,900	
共和レザー	10,600	661.00	7,006,600	
ピーバンドットコム	2,600	514.00	1,336,400	
力の源ホールディングス	8,800	570.00	5,016,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	97,300	4,095.00	398,443,500	
アセンテック	5,600	867.00	4,855,200	
セーレン	33,900	2,555.00	86,614,500	
ソトー	7,000	801.00	5,607,000	
東海染工	1,600	1,132.00	1,811,200	
小松マテーレ	27,100	1,248.00	33,820,800	
ワコールホールディングス	41,300	2,103.00	86,853,900	
ホギメディカル	22,400	3,140.00	70,336,000	
クラウディアホールディングス	2,800	268.00	750,400	
ＴＳＩホールディングス	55,000	329.00	18,095,000	
マツオカコーポレーション	5,300	1,226.00	6,497,800	
ワールド	21,700	1,161.00	25,193,700	
ＴＩＳ	158,200	3,105.00	491,211,000	
ＪＮＳホールディングス	7,600	442.00	3,359,200	
グリー	101,800	852.00	86,733,600	
GMOペパボ	1,700	2,384.00	4,052,800	
コーエーテクモホールディングス	52,900	4,310.00	227,999,000	
三菱総合研究所	7,100	3,845.00	27,299,500	
ボルテージ	4,500	345.00	1,552,500	
電算	1,200	2,274.00	2,728,800	
ＡＧＳ	8,200	843.00	6,912,600	
ファインデックス	13,900	963.00	13,385,700	
ブレインパッド	12,900	1,281.00	16,524,900	

ＫＬａｂ	30,200	463.00	13,982,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	24,000	953.00	22,872,000	
ネクソン	374,100	2,152.00	805,063,200	
アイスタイル	50,200	243.00	12,198,600	
エムアップホールディングス	18,800	836.00	15,716,800	
エイチーム	11,300	792.00	8,949,600	
エニグモ	17,800	722.00	12,851,600	
テクノスジャパン	12,800	513.00	6,566,400	
ｅｎｉｓｈ	10,100	390.00	3,939,000	
コロプラ	54,400	645.00	35,088,000	
オルトプラス	12,800	309.00	3,955,200	
ブロードリーフ	82,200	390.00	32,058,000	
クロス・マーケティンググループ	6,200	879.00	5,449,800	
デジタルハーツホールディングス	7,600	1,919.00	14,584,400	
システム情報	12,400	855.00	10,602,000	
メディアドゥ	5,900	3,755.00	22,154,500	
じげん	46,700	300.00	14,010,000	
ブイキューブ	16,800	987.00	16,581,600	
エンカレッジ・テクノロジ	3,800	582.00	2,211,600	
サイバーリンクス	5,500	1,009.00	5,549,500	
ディー・エル・イー	11,000	258.00	2,838,000	
フィックスターズ	17,600	836.00	14,713,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,600	1,932.00	12,751,200	
オプティム	11,400	1,144.00	13,041,600	
セレス	6,100	2,189.00	13,352,900	
ＳＨＩＦＴ	8,500	18,250.00	155,125,000	
特種東海製紙	10,200	4,055.00	41,361,000	
ティーガイア	14,600	1,668.00	24,352,800	
セック	2,500	2,294.00	5,735,000	
テクマトリックス	27,900	1,593.00	44,444,700	
プロシップ	5,600	1,445.00	8,092,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,000	2,450.00	110,250,000	
GMOペイメントゲートウェイ	32,200	12,180.00	392,196,000	
ザッパラス	6,400	522.00	3,340,800	
システムリサーチ	4,500	1,909.00	8,590,500	
インターネットイニシアティブ	44,200	4,245.00	187,629,000	
さくらインターネット	17,600	553.00	9,732,800	
ヴィンクス	4,800	918.00	4,406,400	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,700	3,710.00	13,727,000	
ＳＲＡホールディングス	8,200	2,814.00	23,074,800	
システムインテグレータ	5,500	558.00	3,069,000	
朝日ネット	15,300	616.00	9,424,800	
ｅＢＡＳＥ	19,800	565.00	11,187,000	
アバント	17,800	1,109.00	19,740,200	
アドソル日進	5,900	1,719.00	10,142,100	
ＯＤＫソリューションズ	3,400	647.00	2,199,800	
フリービット	9,900	949.00	9,395,100	

コムチュア	18,600	2,997.00	55,744,200	
サイバーコム	2,600	1,168.00	3,036,800	
アステリア	11,900	940.00	11,186,000	
アイル	9,200	1,364.00	12,548,800	
王子ホールディングス	692,500	563.00	389,877,500	
日本製紙	79,300	1,164.00	92,305,200	
三菱製紙	24,500	318.00	7,791,000	
北越コーポレーション	108,900	714.00	77,754,600	
中越パルプ工業	6,400	956.00	6,118,400	
巴川製紙所	5,200	849.00	4,414,800	
大王製紙	80,000	1,858.00	148,640,000	
阿波製紙	4,500	327.00	1,471,500	
マークラインズ	8,400	2,700.00	22,680,000	
メディカル・データ・ビジョン	20,900	1,167.00	24,390,300	
ｇｕｍｉ	22,900	619.00	14,175,100	
ショーケース	3,800	456.00	1,732,800	
モバイルファクトリー	3,700	823.00	3,045,100	
テラスカイ	6,000	1,579.00	9,474,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,300	1,275.00	9,307,500	
ＰＣＩホールディングス	7,500	1,146.00	8,595,000	
パイプドHD	3,100	2,214.00	6,863,400	
アイビーシー	2,900	678.00	1,966,200	
ネオジャパン	4,600	1,291.00	5,938,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,600	2,741.00	9,867,600	
ラクス	57,000	2,452.00	139,764,000	
ランドコンピュータ	2,800	866.00	2,424,800	
ダブルスタンダード	5,100	2,641.00	13,469,100	
オープンドア	9,800	1,632.00	15,993,600	
マイネット	5,900	530.00	3,127,000	
アカツキ	7,300	2,770.00	20,221,000	
ベネフィットジャパン	1,200	2,188.00	2,625,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,400	2,278.00	10,023,200	
カナミックネットワーク	17,700	445.00	7,876,500	
ノムラシステムコーポレーション	8,700	261.00	2,270,700	
レンゴー	156,700	891.00	139,619,700	
トーモク	10,300	1,751.00	18,035,300	
ザ・パック	12,600	2,627.00	33,100,200	
チェンジ	30,400	1,578.00	47,971,200	
シンクロ・フード	8,500	316.00	2,686,000	
オークネット	8,800	1,553.00	13,666,400	
キャピタル・アセット・プランニング	3,300	770.00	2,541,000	
セグエグループ	4,300	741.00	3,186,300	
エイトレッド	2,400	2,221.00	5,330,400	
マクロミル	33,800	1,054.00	35,625,200	
ビーグリー	3,800	1,348.00	5,122,400	
オロ	5,300	2,550.00	13,515,000	
ユーザーローカル	5,100	1,660.00	8,466,000	
テモナ	3,700	446.00	1,650,200	
ニーズウェル	3,800	577.00	2,192,600	

マネーフォワード	25,200	5,520.00	139,104,000	
サインポスト	5,300	983.00	5,209,900	
昭和電工	143,500	2,582.00	370,517,000	
住友化学	1,216,100	570.00	693,177,000	
住友精化	7,300	3,205.00	23,396,500	
日産化学	90,100	6,500.00	585,650,000	
ラサ工業	5,700	1,639.00	9,342,300	
クレハ	13,100	8,710.00	114,101,000	
多木化学	6,400	5,620.00	35,968,000	
テイカ	12,300	1,276.00	15,694,800	
石原産業	27,300	1,171.00	31,968,300	
片倉コープアグリ	2,800	1,112.00	3,113,600	
日本曹達	21,100	3,305.00	69,735,500	
東ソー	238,800	1,780.00	425,064,000	
トクヤマ	52,800	1,828.00	96,518,400	
セントラル硝子	27,000	2,127.00	57,429,000	
東亞合成	94,000	1,177.00	110,638,000	
大阪ソーダ	15,500	3,005.00	46,577,500	
関東電化工業	36,300	1,117.00	40,547,100	
デンカ	60,300	3,915.00	236,074,500	
イビデン	88,700	6,450.00	572,115,000	
信越化学工業	284,300	19,385.00	5,511,155,500	
日本カーバイド工業	6,000	1,309.00	7,854,000	
電算システムホールディングス	6,800	2,567.00	17,455,600	
堺化学工業	11,400	2,304.00	26,265,600	
第一稀元素化学工業	15,400	1,201.00	18,495,400	
エア・ウォーター	156,600	1,795.00	281,097,000	
日本酸素ホールディングス	159,200	2,508.00	399,273,600	
日本化学工業	5,200	2,760.00	14,352,000	
東邦アセチレン	2,900	1,260.00	3,654,000	
日本パーカライジング	83,400	1,097.00	91,489,800	
高圧ガス工業	26,500	782.00	20,723,000	
チタン工業	2,000	1,706.00	3,412,000	
四国化成工業	21,800	1,392.00	30,345,600	
戸田工業	3,600	3,840.00	13,824,000	
ステラ　ケミファ	8,200	2,633.00	21,590,600	
保土谷化学工業	5,300	5,960.00	31,588,000	
日本触媒	27,800	5,370.00	149,286,000	
大日精化工業	13,700	2,296.00	31,455,200	
カネカ	42,800	3,850.00	164,780,000	
協和キリン	198,500	3,090.00	613,365,000	
三菱瓦斯化学	153,800	2,020.00	310,676,000	
三井化学	150,300	3,290.00	494,487,000	
ＪＳＲ	154,400	4,130.00	637,672,000	
東京応化工業	28,400	6,430.00	182,612,000	
大阪有機化学工業	14,000	3,335.00	46,690,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,106,800	877.50	971,217,000	
ＫＨネオケム	27,200	3,125.00	85,000,000	
ダイセル	238,200	833.00	198,420,600	
住友ベークライト	26,100	5,850.00	152,685,000	

積水化学工業	346,400	1,957.00	677,904,800	
日本ゼオン	149,200	1,390.00	207,388,000	
アイカ工業	46,100	3,325.00	153,282,500	
宇部興産	77,900	2,087.00	162,577,300	
積水樹脂	25,100	2,090.00	52,459,000	
タキロンシーアイ	36,100	552.00	19,927,200	
旭有機材	9,300	1,737.00	16,154,100	
ニチバン	9,900	1,781.00	17,631,900	
リケンテクノス	40,600	498.00	20,218,800	
大倉工業	8,600	2,084.00	17,922,400	
積水化成品工業	22,500	478.00	10,755,000	
群栄化学工業	3,900	3,745.00	14,605,500	
タイガースポリマー	9,700	463.00	4,491,100	
ミライアル	5,400	1,710.00	9,234,000	
ダイキアクシス	6,400	753.00	4,819,200	
ダイキョーニシカワ	35,200	617.00	21,718,400	
竹本容器	6,100	800.00	4,880,000	
森六ホールディングス	9,000	1,917.00	17,253,000	
恵和	4,100	5,980.00	24,518,000	
日本化薬	130,300	1,154.00	150,366,200	
カーリットホールディングス	16,300	710.00	11,573,000	
ソルクシーズ	14,000	431.00	6,034,000	
ＣＬホールディングス	3,400	1,332.00	4,528,800	
プレステージ・インターナショナル	60,300	679.00	40,943,700	
フェイス	4,500	673.00	3,028,500	
プロトコーポレーション	17,600	1,336.00	23,513,600	
ハイマックス	4,500	1,133.00	5,098,500	
アミューズ	8,800	2,033.00	17,890,400	
野村総合研究所	320,600	4,290.00	1,375,374,000	
ドリームインキュベータ	4,400	1,475.00	6,490,000	
サイバネットシステム	11,800	671.00	7,917,800	
クイック	11,000	1,360.00	14,960,000	
ＴＡＣ	9,900	218.00	2,158,200	
ＣＥホールディングス	8,700	468.00	4,071,600	
日本システム技術	3,300	2,277.00	7,514,100	
電通グループ	166,400	3,995.00	664,768,000	
インテージホールディングス	20,800	1,597.00	33,217,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,600	952.00	7,235,200	
東邦システムサイエンス	4,700	990.00	4,653,000	
ぴあ	5,600	3,075.00	17,220,000	
イオンファンタジー	6,200	1,858.00	11,519,600	
ソースネクスト	70,900	164.00	11,627,600	
シーティーエス	18,400	774.00	14,241,600	
ネクシィーズグループ	5,700	683.00	3,893,100	
インフォコム	18,200	2,149.00	39,111,800	
メディカルシステムネットワーク	16,200	561.00	9,088,200	
日本精化	13,300	2,373.00	31,560,900	
扶桑化学工業	14,800	4,550.00	67,340,000	
トリケミカル研究所	17,000	3,375.00	57,375,000	
シンプレクス・ホールディングス	17,500	2,407.00	42,122,500	

ＨＥＲＯＺ	4,600	1,179.00	5,423,400	
ラクスル	18,200	4,750.00	86,450,000	
ＩＰＳ	4,500	2,114.00	9,513,000	
ＦＩＧ	18,400	295.00	5,428,000	
システムサポート	4,900	1,073.00	5,257,700	
ＡＤＥＫＡ	76,200	2,474.00	188,518,800	
日油	56,500	5,460.00	308,490,000	
ミヨシ油脂	7,000	1,178.00	8,246,000	
新日本理化	27,100	258.00	6,991,800	
ハリマ化成グループ	12,600	825.00	10,395,000	
イーソル	10,000	681.00	6,810,000	
アルテリア・ネットワークス	21,000	1,477.00	31,017,000	
ＥＤＵＬＡＢ	1,800	910.00	1,638,000	
東海ソフト	2,600	998.00	2,594,800	
ウイングアーク１ｓｔ	9,400	1,990.00	18,706,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,800	2,044.00	7,767,200	
サーバーワークス	2,900	2,900.00	8,410,000	
東名	1,700	1,058.00	1,798,600	
ヴィッツ	1,400	1,417.00	1,983,800	
トビラシステムズ	3,300	787.00	2,597,100	
Ｓａｎｓａｎ	59,000	1,968.00	116,112,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,000	931.00	2,793,000	
ギフティ	14,400	1,707.00	24,580,800	
花王	373,900	5,872.00	2,195,540,800	
第一工業製薬	6,200	3,175.00	19,685,000	
石原ケミカル	8,500	1,346.00	11,441,000	
日華化学	5,700	822.00	4,685,400	
ニイタカ	3,400	2,175.00	7,395,000	
三洋化成工業	9,900	5,310.00	52,569,000	
ベース	2,900	4,075.00	11,817,500	
ＪＭＤＣ	15,500	5,800.00	89,900,000	
武田薬品工業	1,328,500	3,275.00	4,350,837,500	
アステラス製薬	1,465,700	1,879.00	2,754,050,300	
大日本住友製薬	104,500	1,355.00	141,597,500	
塩野義製薬	212,500	7,577.00	1,610,112,500	
わかもと製薬	20,100	308.00	6,190,800	
日本新薬	44,200	7,780.00	343,876,000	
中外製薬	528,900	3,769.00	1,993,424,100	
科研製薬	26,500	4,205.00	111,432,500	
エーザイ	202,400	6,548.00	1,325,315,200	
理研ビタミン	17,700	1,665.00	29,470,500	
ロート製薬	86,800	3,330.00	289,044,000	
小野薬品工業	388,100	2,797.00	1,085,515,700	
久光製薬	44,600	4,060.00	181,076,000	
有機合成薬品工業	11,800	278.00	3,280,400	
持田製薬	21,400	3,465.00	74,151,000	
参天製薬	315,100	1,427.00	449,647,700	
扶桑薬品工業	6,000	2,493.00	14,958,000	
日本ケミファ	1,400	2,006.00	2,808,400	

ツムラ	52,400	3,360.00	176,064,000	
日医工	52,300	731.00	38,231,300	
テルモ	478,300	4,520.00	2,161,916,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	42,200	2,952.00	124,574,400	
キッセイ薬品工業	30,000	2,246.00	67,380,000	
生化学工業	29,800	968.00	28,846,400	
栄研化学	29,700	1,878.00	55,776,600	
日水製薬	6,700	1,013.00	6,787,100	
鳥居薬品	9,200	2,845.00	26,174,000	
ＪＣＲファーマ	47,600	2,145.00	102,102,000	
東和薬品	24,300	2,925.00	71,077,500	
富士製薬工業	10,500	1,003.00	10,531,500	
ゼリア新薬工業	30,900	1,937.00	59,853,300	
第一三共	1,328,400	2,756.00	3,661,070,400	
キョーリン製薬ホールディングス	33,900	1,808.00	61,291,200	
大幸薬品	25,500	736.00	18,768,000	
ダイト	10,800	2,904.00	31,363,200	
大塚ホールディングス	351,300	4,235.00	1,487,755,500	
大正製薬ホールディングス	40,200	5,500.00	221,100,000	
ペプチドリーム	88,600	2,333.00	206,703,800	
大日本塗料	20,300	817.00	16,585,100	
日本ペイントホールディングス	622,200	1,100.00	684,420,000	
関西ペイント	171,700	2,466.00	423,412,200	
神東塗料	11,400	173.00	1,972,200	
中国塗料	39,000	948.00	36,972,000	
日本特殊塗料	12,400	887.00	10,998,800	
藤倉化成	21,000	486.00	10,206,000	
太陽ホールディングス	24,400	3,360.00	81,984,000	
ＤＩＣ	69,900	2,982.00	208,441,800	
サカタインクス	33,000	994.00	32,802,000	
東洋インキＳＣホールディングス	35,000	1,914.00	66,990,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	13,400	801.00	10,733,400	
アルプス技研	14,400	1,835.00	26,424,000	
サニックス	28,000	234.00	6,552,000	
ダイオーズ	4,000	1,008.00	4,032,000	
日本空調サービス	17,200	799.00	13,742,800	
オリエンタルランド	190,900	18,500.00	3,531,650,000	
フォーカスシステムズ	11,000	942.00	10,362,000	
ダスキン	37,500	2,750.00	103,125,000	
パーク２４	89,400	1,551.00	138,659,400	
明光ネットワークジャパン	19,000	567.00	10,773,000	
ファルコホールディングス	7,700	2,098.00	16,154,600	
クレスコ	12,200	1,886.00	23,009,200	
フジ・メディア・ホールディングス	159,700	1,143.00	182,537,100	
秀英予備校	4,100	415.00	1,701,500	
田谷	2,100	539.00	1,131,900	
ラウンドワン	45,000	1,273.00	57,285,000	
リゾートトラスト	73,900	1,885.00	139,301,500	
オービック	52,300	19,110.00	999,453,000	
ジャストシステム	23,600	4,995.00	117,882,000	

ＴＤＣソフト	14,500	1,056.00	15,312,000	
Ｚホールディングス	2,410,900	615.00	1,482,703,500	
ビー・エム・エル	20,800	3,665.00	76,232,000	
トレンドマイクロ	88,600	5,840.00	517,424,000	
りらいあコミュニケーションズ	24,500	986.00	24,157,000	
ＩＤホールディングス	10,800	860.00	9,288,000	
リソー教育	73,800	373.00	27,527,400	
日本オラクル	33,600	8,390.00	281,904,000	
早稲田アカデミー	9,200	1,044.00	9,604,800	
アルファシステムズ	3,700	3,895.00	14,411,500	
フューチャー	35,000	1,584.00	55,440,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,900	1,388.00	13,741,200	
ＳＢテクノロジー	7,200	2,383.00	17,157,600	
トーセ	5,100	725.00	3,697,500	
ユー・エス・エス	180,800	1,916.00	346,412,800	
オービックビジネスコンサルタント	15,900	4,605.00	73,219,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	75,500	3,455.00	260,852,500	
アイティフォー	20,000	800.00	16,000,000	
東京個別指導学院	14,100	647.00	9,122,700	
東計電算	2,000	5,050.00	10,100,000	
サイバーエージェント	398,000	1,818.00	723,564,000	
楽天グループ	829,500	1,148.00	952,266,000	
エックスネット	2,800	974.00	2,727,200	
クリーク・アンド・リバー社	8,500	1,793.00	15,240,500	
モーニングスター	28,400	608.00	17,267,200	
テー・オー・ダブリュー	28,500	296.00	8,436,000	
大塚商会	89,600	5,220.00	467,712,000	
サイボウズ	22,200	1,578.00	35,031,600	
山田コンサルティンググループ	8,500	1,108.00	9,418,000	
セントラルスポーツ	6,000	2,396.00	14,376,000	
パラカ	4,500	1,583.00	7,123,500	
電通国際情報サービス	23,900	3,440.00	82,216,000	
ＡＣＣＥＳＳ	18,800	671.00	12,614,800	
デジタルガレージ	27,300	4,600.00	125,580,000	
イーエムシステムズ	27,600	694.00	19,154,400	
ウェザーニューズ	5,100	7,820.00	39,882,000	
ＣＩＪ	11,200	844.00	9,452,800	
ビジネスエンジニアリング	2,000	3,745.00	7,490,000	
日本エンタープライズ	17,100	181.00	3,095,100	
WOWOW	8,000	1,731.00	13,848,000	
スカラ	14,600	642.00	9,373,200	
インテリジェント　ウェイブ	10,000	538.00	5,380,000	
フルキャストホールディングス	13,800	2,082.00	28,731,600	
エン・ジャパン	26,200	3,010.00	78,862,000	
あすか製薬ホールディングス	19,300	1,001.00	19,319,300	
サワイグループホールディングス	37,000	4,455.00	164,835,000	
富士フイルムホールディングス	297,200	8,494.00	2,524,416,800	
コニカミノルタ	369,000	532.00	196,308,000	
資生堂	314,900	6,000.00	1,889,400,000	
ライオン	204,100	1,534.00	313,089,400	

高砂香料工業	11,800	2,810.00	33,158,000	
マンダム	35,500	1,381.00	49,025,500	
ミルボン	20,900	5,520.00	115,368,000	
ファンケル	68,500	3,075.00	210,637,500	
コーセー	31,800	11,520.00	366,336,000	
コタ	10,800	1,602.00	17,301,600	
シーボン	1,600	1,717.00	2,747,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	72,200	1,794.00	129,526,800	
ノエビアホールディングス	14,400	5,150.00	74,160,000	
アジュバンホールディングス	4,000	1,129.00	4,516,000	
新日本製薬	4,600	1,126.00	5,179,600	
エステー	10,900	1,531.00	16,687,900	
アグロ　カネショウ	5,700	1,218.00	6,942,600	
コニシ	27,700	1,685.00	46,674,500	
長谷川香料	29,200	2,604.00	76,036,800	
星光ＰＭＣ	9,800	689.00	6,752,200	
小林製薬	47,400	8,690.00	411,906,000	
荒川化学工業	14,100	1,165.00	16,426,500	
メック	12,600	3,565.00	44,919,000	
日本高純度化学	4,700	2,540.00	11,938,000	
タカラバイオ	44,200	2,614.00	115,538,800	
ＪＣＵ	19,100	5,210.00	99,511,000	
新田ゼラチン	10,700	583.00	6,238,100	
ＯＡＴアグリオ	3,600	1,818.00	6,544,800	
デクセリアルズ	43,900	3,695.00	162,210,500	
アース製薬	13,900	6,100.00	84,790,000	
北興化学工業	15,800	895.00	14,141,000	
大成ラミック	5,300	2,751.00	14,580,300	
クミアイ化学工業	63,000	781.00	49,203,000	
日本農薬	30,300	502.00	15,210,600	
富士興産	4,300	1,023.00	4,398,900	
ニチレキ	21,600	1,367.00	29,527,200	
ユシロ化学工業	9,000	1,113.00	10,017,000	
ビーピー・カストロール	6,300	1,337.00	8,423,100	
富士石油	45,200	261.00	11,797,200	
ＭＯＲＥＳＣＯ	5,900	1,165.00	6,873,500	
出光興産	187,700	3,110.00	583,747,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,542,000	449.80	1,143,391,600	
コスモエネルギーホールディングス	48,900	2,314.00	113,154,600	
テスホールディングス	9,700	1,713.00	16,616,100	
インフロニア・ホールディングス	225,900	1,077.00	243,294,300	
横浜ゴム	97,700	1,869.00	182,601,300	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	89,000	1,819.00	161,891,000	
ブリヂストン	487,000	5,092.00	2,479,804,000	
住友ゴム工業	151,800	1,184.00	179,731,200	
藤倉コンポジット	13,600	947.00	12,879,200	
オカモト	10,100	4,065.00	41,056,500	
アキレス	10,800	1,254.00	13,543,200	
フコク	7,500	1,017.00	7,627,500	
ニッタ	17,500	2,873.00	50,277,500	

クリエートメディック	4,900	969.00	4,748,100	
住友理工	33,000	616.00	20,328,000	
三ツ星ベルト	20,500	2,108.00	43,214,000	
バンドー化学	27,500	894.00	24,585,000	
ＡＧＣ	155,300	5,300.00	823,090,000	
日本板硝子	81,000	537.00	43,497,000	
石塚硝子	2,800	2,111.00	5,910,800	
有沢製作所	24,600	1,008.00	24,796,800	
日本山村硝子	6,600	782.00	5,161,200	
日本電気硝子	67,900	2,862.00	194,329,800	
オハラ	6,700	1,171.00	7,845,700	
住友大阪セメント	31,300	3,640.00	113,932,000	
太平洋セメント	96,000	2,351.00	225,696,000	
リソルホールディングス	1,800	4,245.00	7,641,000	
日本ヒューム	17,600	712.00	12,531,200	
日本コンクリート工業	33,400	280.00	9,352,000	
三谷セキサン	7,800	6,610.00	51,558,000	
アジアパイルホールディングス	26,700	447.00	11,934,900	
東海カーボン	141,600	1,251.00	177,141,600	
日本カーボン	8,700	4,205.00	36,583,500	
東洋炭素	10,900	3,065.00	33,408,500	
ノリタケカンパニーリミテド	9,400	4,860.00	45,684,000	
ＴＯＴＯ	120,700	5,150.00	621,605,000	
日本碍子	183,100	2,013.00	368,580,300	
日本特殊陶業	128,600	2,038.00	262,086,800	
ダントーホールディングス	10,900	221.00	2,408,900	
ＭＡＲＵＷＡ	5,900	16,020.00	94,518,000	
品川リフラクトリーズ	3,900	4,110.00	16,029,000	
黒崎播磨	3,000	4,685.00	14,055,000	
ヨータイ	10,800	1,252.00	13,521,600	
イソライト工業	7,500	1,197.00	8,977,500	
東京窯業	22,200	304.00	6,748,800	
ニッカトー	7,700	685.00	5,274,500	
フジミインコーポレーテッド	13,600	7,310.00	99,416,000	
クニミネ工業	5,600	1,038.00	5,812,800	
エーアンドエーマテリアル	3,600	925.00	3,330,000	
ニチアス	39,200	2,762.00	108,270,400	
日本製鉄	748,000	2,048.50	1,532,278,000	
神戸製鋼所	311,700	608.00	189,513,600	
中山製鋼所	26,500	451.00	11,951,500	
合同製鐵	9,000	1,438.00	12,942,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	451,300	1,631.00	736,070,300	
東京製鐵	56,900	1,435.00	81,651,500	
共英製鋼	19,000	1,546.00	29,374,000	
大和工業	32,100	3,790.00	121,659,000	
東京鐵鋼	7,300	1,386.00	10,117,800	
大阪製鐵	9,000	1,193.00	10,737,000	
淀川製鋼所	22,100	2,542.00	56,178,200	
丸一鋼管	59,200	2,615.00	154,808,000	

モリ工業	5,100	2,831.00	14,438,100	
大同特殊鋼	27,300	4,335.00	118,345,500	
日本高周波鋼業	4,800	349.00	1,675,200	
日本冶金工業	12,300	2,387.00	29,360,100	
山陽特殊製鋼	17,200	2,228.00	38,321,600	
愛知製鋼	9,400	2,564.00	24,101,600	
日立金属	180,200	2,130.00	383,826,000	
日本金属	4,100	1,073.00	4,399,300	
大平洋金属	10,200	2,207.00	22,511,400	
新日本電工	107,600	303.00	32,602,800	
栗本鐵工所	7,700	1,585.00	12,204,500	
虹　技	2,500	989.00	2,472,500	
日本鋳鉄管	1,800	1,027.00	1,848,600	
日本製鋼所	50,700	4,150.00	210,405,000	
三菱製鋼	10,600	1,068.00	11,320,800	
日亜鋼業	22,400	270.00	6,048,000	
日本精線	2,800	5,150.00	14,420,000	
エンビプロ・ホールディングス	7,100	1,691.00	12,006,100	
大紀アルミニウム工業所	25,200	1,693.00	42,663,600	
日本軽金属ホールディングス	42,200	1,817.00	76,677,400	
三井金属鉱業	45,200	3,190.00	144,188,000	
東邦亜鉛	9,300	2,341.00	21,771,300	
三菱マテリアル	110,200	2,052.00	226,130,400	
住友金属鉱山	213,500	4,716.00	1,006,866,000	
ＤＯＷＡホールディングス	45,600	4,915.00	224,124,000	
古河機械金属	27,700	1,280.00	35,456,000	
エス・サイエンス	79,300	24.00	1,903,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,200	817.00	15,686,400	
東邦チタニウム	30,000	956.00	28,680,000	
ＵＡＣＪ	25,400	2,809.00	71,348,600	
ＣＫサンエツ	3,600	4,165.00	14,994,000	
古河電気工業	51,900	2,387.00	123,885,300	
住友電気工業	624,900	1,630.50	1,018,899,450	
フジクラ	186,200	583.00	108,554,600	
昭和電線ホールディングス	14,500	1,765.00	25,592,500	
東京特殊電線	2,000	2,815.00	5,630,000	
タツタ電線	29,400	486.00	14,288,400	
カナレ電気	3,100	1,673.00	5,186,300	
平河ヒューテック	9,400	1,167.00	10,969,800	
リョービ	20,500	1,213.00	24,866,500	
アーレスティ	17,600	416.00	7,321,600	
アサヒホールディングス	67,000	2,074.00	138,958,000	
東洋製罐グループホールディングス	106,400	1,399.00	148,853,600	
ホッカンホールディングス	9,400	1,438.00	13,517,200	
コロナ	9,900	897.00	8,880,300	
横河ブリッジホールディングス	28,700	2,191.00	62,881,700	
駒井ハルテック	3,200	2,433.00	7,785,600	
高田機工	800	2,827.00	2,261,600	
三和ホールディングス	157,600	1,247.00	196,527,200	
文化シヤッター	53,300	1,063.00	56,657,900	

三協立山	21,700	740.00	16,058,000	
アルインコ	12,500	969.00	12,112,500	
東洋シヤッター	2,800	555.00	1,554,000	
ＬＩＸＩＬ	263,100	2,932.00	771,409,200	
日本フイルコン	12,500	520.00	6,500,000	
ノーリツ	32,100	1,687.00	54,152,700	
長府製作所	17,100	2,031.00	34,730,100	
リンナイ	31,500	10,190.00	320,985,000	
ユニプレス	25,100	884.00	22,188,400	
ダイニチ工業	8,200	733.00	6,010,600	
日東精工	21,100	613.00	12,934,300	
三洋工業	1,600	1,829.00	2,926,400	
岡部	34,000	745.00	25,330,000	
ジーテクト	20,800	1,460.00	30,368,000	
東プレ	31,100	1,287.00	40,025,700	
高周波熱錬	29,700	635.00	18,859,500	
東京製綱	10,200	917.00	9,353,400	
サンコール	14,800	630.00	9,324,000	
モリテックスチール	13,000	366.00	4,758,000	
パイオラックス	24,700	1,815.00	44,830,500	
エイチワン	16,500	686.00	11,319,000	
日本発条	153,700	979.00	150,472,300	
中央発條	8,200	830.00	6,806,000	
アドバネクス	2,400	1,354.00	3,249,600	
三浦工業	72,400	3,590.00	259,916,000	
タクマ	56,500	1,416.00	80,004,000	
テクノプロ・ホールディングス	96,600	3,395.00	327,957,000	
アトラグループ	2,900	279.00	809,100	
インターワークス	5,100	393.00	2,004,300	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,500	5,500.00	41,250,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	10,300	2,064.00	21,259,200	
ファーストロジック	3,200	829.00	2,652,800	
三機サービス	3,400	999.00	3,396,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	10,100	740.00	7,474,000	
デザインワン・ジャパン	4,100	206.00	844,600	
イー・ガーディアン	6,400	3,070.00	19,648,000	
リブセンス	10,000	174.00	1,740,000	
ジャパンマテリアル	49,600	1,838.00	91,164,800	
ベクトル	22,600	1,045.00	23,617,000	
ウチヤマホールディングス	8,400	315.00	2,646,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,100	1,349.00	16,322,900	
キャリアリンク	5,900	1,206.00	7,115,400	
ＩＢＪ	13,200	837.00	11,048,400	
アサンテ	7,200	1,705.00	12,276,000	
バリューＨＲ	6,400	2,588.00	16,563,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	13,300	4,815.00	64,039,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,200	1,577.00	9,777,400	
ＥＲＩホールディングス	4,500	1,271.00	5,719,500	

アビスト	2,400	2,910.00	6,984,000	
シグマクシス・ホールディングス	9,800	2,210.00	21,658,000	
ウィルグループ	11,900	1,237.00	14,720,300	
エスクロー・エージェント・ジャパン	21,600	202.00	4,363,200	
メドピア	12,500	3,225.00	40,312,500	
レアジョブ	3,100	813.00	2,520,300	
リクルートホールディングス	1,246,100	6,408.00	7,985,008,800	
エラン	22,300	1,039.00	23,169,700	
ツガミ	36,700	1,656.00	60,775,200	
オークマ	19,400	5,150.00	99,910,000	
芝浦機械	19,000	3,675.00	69,825,000	
アマダ	263,700	1,172.00	309,056,400	
アイダエンジニアリング	43,800	1,048.00	45,902,400	
滝澤鉄工所	5,500	1,180.00	6,490,000	
ＦＵＪＩ	77,000	2,691.00	207,207,000	
牧野フライス製作所	18,300	4,030.00	73,749,000	
オーエスジー	77,300	1,809.00	139,835,700	
ダイジェット工業	1,200	960.00	1,152,000	
旭ダイヤモンド工業	44,000	638.00	28,072,000	
ＤＭＧ森精機	99,200	1,956.00	194,035,200	
ソディック	37,000	806.00	29,822,000	
ディスコ	24,600	34,700.00	853,620,000	
日東工器	9,300	1,759.00	16,358,700	
日進工具	13,300	1,479.00	19,670,700	
パンチ工業	14,000	526.00	7,364,000	
冨士ダイス	7,700	616.00	4,743,200	
土木管理総合試験所	7,800	320.00	2,496,000	
ネットマーケティング	7,800	403.00	3,143,400	
日本郵政	2,109,100	991.90	2,092,016,290	
ベルシステム２４ホールディングス	23,100	1,203.00	27,789,300	
鎌倉新書	18,400	570.00	10,488,000	
ＳＭＮ	3,800	632.00	2,401,600	
一蔵	2,500	390.00	975,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	3,000	772.00	2,316,000	
エアトリ	10,300	2,402.00	24,740,600	
アトラエ	11,200	2,009.00	22,500,800	
ストライク	6,100	4,615.00	28,151,500	
ソラスト	39,600	1,164.00	46,094,400	
セラク	5,200	1,459.00	7,586,800	
インソース	15,600	2,344.00	36,566,400	
豊田自動織機	136,900	9,400.00	1,286,860,000	
豊和工業	9,000	776.00	6,984,000	
ＯＫＫ	6,400	1,086.00	6,950,400	
石川製作所	4,400	1,369.00	6,023,600	
東洋機械金属	11,300	516.00	5,830,800	
津田駒工業	3,800	630.00	2,394,000	
エンシュウ	4,000	610.00	2,440,000	
島精機製作所	24,400	1,970.00	48,068,000	
オプトラン	20,900	2,332.00	48,738,800	
ＮＣホールディングス	4,700	1,613.00	7,581,100	

イワキ	10,800	1,009.00	10,897,200	
フリュー	14,700	1,261.00	18,536,700	
ヤマシンフィルタ	33,600	481.00	16,161,600	
日阪製作所	20,900	824.00	17,221,600	
やまびこ	32,500	1,207.00	39,227,500	
野村マイクロ・サイエンス	4,400	4,920.00	21,648,000	
平田機工	7,900	6,400.00	50,560,000	
ペガサスミシン製造	17,200	503.00	8,651,600	
マルマエ	6,800	2,722.00	18,509,600	
タツモ	7,800	1,464.00	11,419,200	
ナブテスコ	95,300	3,650.00	347,845,000	
三井海洋開発	17,800	1,465.00	26,077,000	
レオン自動機	17,900	1,195.00	21,390,500	
ＳＭＣ	49,500	72,510.00	3,589,245,000	
ホソカワミクロン	11,800	3,250.00	38,350,000	
ユニオンツール	6,300	3,900.00	24,570,000	
オイレス工業	23,600	1,668.00	39,364,800	
日精エー・エス・ビー機械	5,600	3,250.00	18,200,000	
サトーホールディングス	22,100	2,139.00	47,271,900	
技研製作所	14,700	4,015.00	59,020,500	
日本エアーテック	7,700	1,137.00	8,754,900	
カワタ	5,400	1,116.00	6,026,400	
日精樹脂工業	11,900	1,128.00	13,423,200	
オカダアイヨン	5,400	1,508.00	8,143,200	
ワイエイシイホールディングス	6,600	1,061.00	7,002,600	
小松製作所	765,900	2,940.00	2,251,746,000	
住友重機械工業	96,600	2,993.00	289,123,800	
日立建機	67,700	3,445.00	233,226,500	
日工	23,400	614.00	14,367,600	
巴工業	6,700	2,220.00	14,874,000	
井関農機	15,600	1,410.00	21,996,000	
ＴＯＷＡ	14,400	2,928.00	42,163,200	
丸山製作所	3,600	1,516.00	5,457,600	
北川鉄工所	7,700	1,431.00	11,018,700	
シンニッタン	20,600	233.00	4,799,800	
ローツェ	8,400	11,260.00	94,584,000	
タカキタ	5,700	608.00	3,465,600	
クボタ	824,500	2,614.50	2,155,655,250	
荏原実業	7,800	2,339.00	18,244,200	
東洋エンジニアリング	22,300	710.00	15,833,000	
三菱化工機	5,400	2,186.00	11,804,400	
月島機械	31,300	1,076.00	33,678,800	
帝国電機製作所	12,100	1,471.00	17,799,100	
新東工業	37,500	711.00	26,662,500	
澁谷工業	14,700	2,854.00	41,953,800	
アイチコーポレーション	24,900	826.00	20,567,400	
小森コーポレーション	43,000	705.00	30,315,000	
鶴見製作所	13,100	1,681.00	22,021,100	
住友精密工業	2,600	2,102.00	5,465,200	
日本ギア工業	6,800	265.00	1,802,000	

酒井重工業	3,000	2,621.00	7,863,000	
荏原製作所	70,100	6,220.00	436,022,000	
石井鐵工所	1,400	2,979.00	4,170,600	
酉島製作所	15,500	927.00	14,368,500	
北越工業	16,000	978.00	15,648,000	
ダイキン工業	215,400	25,755.00	5,547,627,000	
オルガノ	4,800	8,570.00	41,136,000	
トーヨーカネツ	6,300	2,541.00	16,008,300	
栗田工業	91,600	5,200.00	476,320,000	
椿本チエイン	22,300	3,155.00	70,356,500	
大同工業	7,600	995.00	7,562,000	
日機装	50,700	810.00	41,067,000	
木村化工機	14,000	809.00	11,326,000	
レイズネクスト	25,900	1,172.00	30,354,800	
アネスト岩田	26,400	871.00	22,994,400	
ダイフク	93,000	9,190.00	854,670,000	
サムコ	4,100	2,501.00	10,254,100	
加藤製作所	7,900	854.00	6,746,600	
油研工業	2,100	1,714.00	3,599,400	
タダノ	88,400	1,135.00	100,334,000	
フジテック	62,700	2,446.00	153,364,200	
ＣＫＤ	49,900	2,230.00	111,277,000	
キトー	14,400	1,917.00	27,604,800	
平和	47,100	1,926.00	90,714,600	
理想科学工業	14,100	2,140.00	30,174,000	
ＳＡＮＫＹＯ	36,500	3,020.00	110,230,000	
日本金銭機械	17,200	639.00	10,990,800	
マースグループホールディングス	10,800	1,651.00	17,830,800	
フクシマガリレイ	11,700	4,685.00	54,814,500	
オーイズミ	6,200	393.00	2,436,600	
ダイコク電機	7,800	1,234.00	9,625,200	
竹内製作所	25,700	2,863.00	73,579,100	
アマノ	44,200	2,554.00	112,886,800	
ＪＵＫＩ	23,600	830.00	19,588,000	
サンデン	23,400	221.00	5,171,400	
ジャノメ	14,300	698.00	9,981,400	
ブラザー工業	206,400	2,213.00	456,763,200	
マックス	22,600	1,863.00	42,103,800	
モリタホールディングス	27,100	1,321.00	35,799,100	
グローリー	43,300	2,228.00	96,472,400	
新晃工業	15,800	1,919.00	30,320,200	
大和冷機工業	24,400	1,250.00	30,500,000	
セガサミーホールディングス	167,700	1,824.00	305,884,800	
日本ピストンリング	6,200	1,342.00	8,320,400	
リケン	7,200	2,729.00	19,648,800	
ＴＰＲ	22,800	1,514.00	34,519,200	
ツバキ・ナカシマ	37,000	1,504.00	55,648,000	
ホシザキ	49,400	8,610.00	425,334,000	
大豊工業	13,800	941.00	12,985,800	
日本精工	318,000	806.00	256,308,000	

ＮＴＮ	361,900	252.00	91,198,800	
ジェイテクト	162,000	1,069.00	173,178,000	
不二越	14,400	4,215.00	60,696,000	
ミネベアミツミ	291,300	3,100.00	903,030,000	
日本トムソン	46,200	650.00	30,030,000	
ＴＨＫ	95,400	2,946.00	281,048,400	
ユーシン精機	13,400	738.00	9,889,200	
前澤給装工業	13,000	1,004.00	13,052,000	
イーグル工業	20,900	1,119.00	23,387,100	
前澤工業	10,200	592.00	6,038,400	
日本ピラー工業	17,100	3,410.00	58,311,000	
キッツ	57,100	710.00	40,541,000	
日立製作所	813,000	6,784.00	5,515,392,000	
東芝	295,300	4,866.00	1,436,929,800	
三菱電機	1,690,300	1,513.00	2,557,423,900	
富士電機	101,800	6,200.00	631,160,000	
東洋電機製造	6,700	1,018.00	6,820,600	
安川電機	182,000	5,440.00	990,080,000	
シンフォニア　テクノロジー	20,200	1,273.00	25,714,600	
明電舎	28,600	2,713.00	77,591,800	
オリジン	4,500	1,262.00	5,679,000	
山洋電気	7,500	5,680.00	42,600,000	
デンヨー	14,400	1,748.00	25,171,200	
ＰＨＣホールディングス	19,400	2,019.00	39,168,600	
ベイカレント・コンサルティング	11,300	35,900.00	405,670,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,100	3,025.00	9,377,500	
アイモバイル	4,500	1,203.00	5,413,500	
キャリアインデックス	5,500	762.00	4,191,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,600	884.00	5,834,400	
船場	2,000	753.00	1,506,000	
グレイステクノロジー	20,800	406.00	8,444,800	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	51,100	1,935.00	98,878,500	
フルテック	2,400	1,393.00	3,343,200	
グリーンズ	6,100	470.00	2,867,000	
ツナググループ・ホールディングス	3,800	259.00	984,200	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	4,900	456.00	2,234,400	
ソウルドアウト	3,900	1,111.00	4,332,900	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,600	781.00	2,030,600	
ウェルビー	10,500	1,216.00	12,768,000	
エル・ティー・エス	2,100	2,417.00	5,075,700	
ミダックホールディングス	7,000	3,340.00	23,380,000	
日総工産	12,600	851.00	10,722,600	
キュービーネットホールディングス	7,500	1,695.00	12,712,500	
ＲＰＡホールディングス	22,600	336.00	7,593,600	
三櫻工業	23,200	965.00	22,388,000	
マキタ	205,800	4,790.00	985,782,000	
東芝テック	18,300	4,495.00	82,258,500	
芝浦メカトロニクス	3,000	8,840.00	26,520,000	

マブチモーター	39,600	3,830.00	151,668,000	
日本電産	438,100	12,345.00	5,408,344,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	7,500	451.00	3,382,500	
トレックス・セミコンダクター	8,500	3,125.00	26,562,500	
東光高岳	9,400	1,513.00	14,222,200	
ダブル・スコープ	48,600	924.00	44,906,400	
宮越ホールディングス	6,300	999.00	6,293,700	
ダイヘン	18,500	4,540.00	83,990,000	
ヤーマン	27,500	928.00	25,520,000	
ＪＶＣケンウッド	137,300	182.00	24,988,600	
ミマキエンジニアリング	15,300	861.00	13,173,300	
Ｉ－ＰＥＸ	7,800	1,918.00	14,960,400	
日新電機	39,800	1,612.00	64,157,600	
大崎電気工業	30,800	468.00	14,414,400	
オムロン	140,700	10,620.00	1,494,234,000	
日東工業	22,500	1,576.00	35,460,000	
ＩＤＥＣ	20,900	2,626.00	54,883,400	
正興電機製作所	5,300	1,139.00	6,036,700	
不二電機工業	3,800	1,206.00	4,582,800	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	55,000	2,555.00	140,525,000	
サクサホールディングス	3,300	1,338.00	4,415,400	
メルコホールディングス	4,600	3,890.00	17,894,000	
テクノメディカ	4,000	1,663.00	6,652,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,700	1,195.00	5,616,500	
日本電気	214,900	5,230.00	1,123,927,000	
富士通	152,200	18,400.00	2,800,480,000	
沖電気工業	68,700	913.00	62,723,100	
岩崎通信機	7,100	816.00	5,793,600	
電気興業	9,000	2,420.00	21,780,000	
サンケン電気	15,800	5,770.00	91,166,000	
ナカヨ	2,400	1,160.00	2,784,000	
アイホン	9,700	2,151.00	20,864,700	
ルネサスエレクトロニクス	916,000	1,386.00	1,269,576,000	
セイコーエプソン	209,700	2,047.00	429,255,900	
ワコム	131,000	885.00	115,935,000	
アルバック	31,000	6,510.00	201,810,000	
アクセル	7,100	1,125.00	7,987,500	
ＥＩＺＯ	13,200	4,015.00	52,998,000	
ジャパンディスプレイ	574,900	37.00	21,271,300	
日本信号	43,000	898.00	38,614,000	
京三製作所	36,300	446.00	16,189,800	
能美防災	22,400	2,122.00	47,532,800	
ホーチキ	12,500	1,250.00	15,625,000	
星和電機	8,200	517.00	4,239,400	
エレコム	38,700	1,497.00	57,933,900	
パナソニック	1,803,000	1,299.50	2,342,998,500	
シャープ	192,700	1,312.00	252,822,400	
アンリツ	108,800	1,787.00	194,425,600	
富士通ゼネラル	45,900	2,723.00	124,985,700	

ソニーグループ	1,059,000	14,405.00	15,254,895,000	
ＴＤＫ	244,800	4,405.00	1,078,344,000	
帝国通信工業	7,600	1,322.00	10,047,200	
タムラ製作所	65,200	656.00	42,771,200	
アルプスアルパイン	149,400	1,160.00	173,304,000	
池上通信機	5,700	660.00	3,762,000	
日本電波工業	15,300	1,539.00	23,546,700	
鈴木	7,700	870.00	6,699,000	
メイコー	13,700	4,395.00	60,211,500	
日本トリム	3,200	3,265.00	10,448,000	
ローランド　ディー．ジー．	10,000	3,505.00	35,050,000	
フォスター電機	16,900	736.00	12,438,400	
ＳＭＫ	4,000	2,208.00	8,832,000	
ヨコオ	12,500	2,843.00	35,537,500	
ティアック	27,000	161.00	4,347,000	
ホシデン	40,700	1,159.00	47,171,300	
ヒロセ電機	26,100	17,810.00	464,841,000	
日本航空電子工業	38,700	1,951.00	75,503,700	
ＴＯＡ	18,400	803.00	14,775,200	
マクセル	33,600	1,447.00	48,619,200	
古野電気	20,000	1,162.00	23,240,000	
ユニデンホールディングス	3,700	3,565.00	13,190,500	
スミダコーポレーション	15,900	1,145.00	18,205,500	
アイコム	6,300	2,385.00	15,025,500	
リオン	6,400	2,200.00	14,080,000	
本多通信工業	13,600	427.00	5,807,200	
横河電機	169,200	2,014.00	340,768,800	
新電元工業	6,400	3,705.00	23,712,000	
アズビル	99,100	4,895.00	485,094,500	
東亜ディーケーケー	8,700	880.00	7,656,000	
日本光電工業	69,900	3,145.00	219,835,500	
チノー	5,500	1,582.00	8,701,000	
共和電業	17,100	385.00	6,583,500	
日本電子材料	8,200	2,683.00	22,000,600	
堀場製作所	31,300	6,530.00	204,389,000	
アドバンテスト	125,600	10,470.00	1,315,032,000	
小野測器	7,900	481.00	3,799,900	
エスペック	13,800	2,069.00	28,552,200	
キーエンス	153,100	62,500.00	9,568,750,000	
日置電機	8,000	7,800.00	62,400,000	
シスメックス	143,000	12,620.00	1,804,660,000	
日本マイクロニクス	29,300	1,702.00	49,868,600	
メガチップス	15,800	4,855.00	76,709,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,700	3,330.00	25,641,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	14,000	614.00	8,596,000	
澤藤電機	2,100	1,632.00	3,427,200	
デンソー	372,100	10,060.00	3,743,326,000	
原田工業	8,600	985.00	8,471,000	
コーセル	20,500	825.00	16,912,500	
イリソ電子工業	14,100	4,415.00	62,251,500	

オプテックスグループ	27,600	1,561.00	43,083,600	
千代田インテグレ	7,200	1,949.00	14,032,800	
アイ・オー・データ機器	6,300	778.00	4,901,400	
レーザーテック	74,100	30,730.00	2,277,093,000	
スタンレー電気	118,200	2,918.00	344,907,600	
岩崎電気	6,200	2,301.00	14,266,200	
ウシオ電機	86,600	1,817.00	157,352,200	
岡谷電機産業	10,700	327.00	3,498,900	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	14,800	303.00	4,484,400	
エノモト	4,600	1,813.00	8,339,800	
日本セラミック	15,800	2,657.00	41,980,600	
遠藤照明	7,800	1,027.00	8,010,600	
古河電池	12,200	1,392.00	16,982,400	
双信電機	7,300	804.00	5,869,200	
山一電機	12,300	2,211.00	27,195,300	
図研	10,900	3,340.00	36,406,000	
日本電子	35,300	7,490.00	264,397,000	
カシオ計算機	122,400	1,457.00	178,336,800	
ファナック	148,400	24,180.00	3,588,312,000	
日本シイエムケイ	33,200	609.00	20,218,800	
エンプラス	4,100	2,822.00	11,570,200	
大真空	22,800	1,394.00	31,783,200	
ローム	75,600	10,330.00	780,948,000	
浜松ホトニクス	121,200	6,580.00	797,496,000	
三井ハイテック	16,700	9,480.00	158,316,000	
新光電気工業	49,600	5,100.00	252,960,000	
京セラ	237,900	7,191.00	1,710,738,900	
協栄産業	2,000	1,720.00	3,440,000	
太陽誘電	82,000	6,380.00	523,160,000	
村田製作所	496,600	9,028.00	4,483,304,800	
双葉電子工業	28,800	690.00	19,872,000	
日東電工	102,200	9,040.00	923,888,000	
北陸電気工業	6,300	1,354.00	8,530,200	
東海理化電機製作所	44,500	1,608.00	71,556,000	
ニチコン	53,200	1,246.00	66,287,200	
日本ケミコン	16,000	1,731.00	27,696,000	
ＫＯＡ	25,500	1,543.00	39,346,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	60,800	399.00	24,259,200	
日立造船	142,800	790.00	112,812,000	
三菱重工業	265,600	3,076.00	816,985,600	
川崎重工業	123,300	2,241.00	276,315,300	
ＩＨＩ	105,500	2,452.00	258,686,000	
名村造船所	50,200	214.00	10,742,800	
サノヤスホールディングス	19,500	128.00	2,496,000	
スプリックス	4,500	1,623.00	7,303,500	
マネジメントソリューションズ	7,900	3,315.00	26,188,500	
プロレド・パートナーズ	3,400	928.00	3,155,200	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,700	386.00	1,428,200	
テノ．ホールディングス	2,200	563.00	1,238,600	
フロンティア・マネジメント	4,100	705.00	2,890,500	

ピアラ	2,500	635.00	1,587,500	
コプロ・ホールディングス	3,200	1,220.00	3,904,000	
ギークス	2,900	1,463.00	4,242,700	
カーブスホールディングス	44,400	749.00	33,255,600	
フォーラムエンジニアリング	11,300	837.00	9,458,100	
日本車輌製造	6,300	2,062.00	12,990,600	
三菱ロジスネクスト	22,400	1,081.00	24,214,400	
近畿車輌	2,000	1,007.00	2,014,000	
一家ホールディングス	3,000	516.00	1,548,000	
フルサト・マルカホールディングス	16,000	2,292.00	36,672,000	
ヤマエグループホールディングス	11,200	1,050.00	11,760,000	
藤久ホールディングス	4,000	784.00	3,136,000	
ＦＰＧ	56,000	704.00	39,424,000	
島根銀行	5,100	586.00	2,988,600	
じもとホールディングス	12,300	693.00	8,523,900	
全国保証	39,800	5,240.00	208,552,000	
めぶきフィナンシャルグループ	864,300	259.00	223,853,700	
ジャパンインベストメントアドバイザー	12,900	1,195.00	15,415,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21,000	1,647.00	34,587,000	
九州フィナンシャルグループ	340,600	450.00	153,270,000	
かんぽ生命保険	167,800	2,085.00	349,863,000	
ゆうちょ銀行	394,100	1,123.00	442,574,300	
あんしん保証	5,600	288.00	1,612,800	
富山第一銀行	41,000	321.00	13,161,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	951,900	476.00	453,104,400	
ジェイリース	5,600	1,926.00	10,785,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	108,800	810.00	88,128,000	
イントラスト	7,100	720.00	5,112,000	
日本モーゲージサービス	9,400	1,099.00	10,330,600	
ＣＡＳＡ	5,900	930.00	5,487,000	
アルヒ	24,500	1,158.00	28,371,000	
プレミアグループ	8,500	3,565.00	30,302,500	
日産自動車	1,993,600	622.30	1,240,617,280	
いすゞ自動車	530,400	1,465.00	777,036,000	
トヨタ自動車	8,562,300	2,322.00	19,881,660,600	
日野自動車	211,100	1,012.00	213,633,200	
三菱自動車工業	625,500	334.00	208,917,000	
エフテック	11,800	623.00	7,351,400	
レシップホールディングス	6,600	562.00	3,709,200	
ＧＭＢ	3,100	772.00	2,393,200	
ファルテック	3,300	702.00	2,316,600	
武蔵精密工業	37,600	2,023.00	76,064,800	
日産車体	24,800	710.00	17,608,000	
新明和工業	47,800	887.00	42,398,600	
極東開発工業	31,300	1,513.00	47,356,900	
トピー工業	13,900	1,152.00	16,012,800	
ティラド	4,800	2,904.00	13,939,200	

曙ブレーキ工業	92,600	191.00	17,686,600	
タチエス	29,500	1,298.00	38,291,000	
ＮＯＫ	81,800	1,280.00	104,704,000	
フタバ産業	42,300	467.00	19,754,100	
ＫＹＢ	17,600	3,320.00	58,432,000	
市光工業	20,200	551.00	11,130,200	
大同メタル工業	32,800	636.00	20,860,800	
プレス工業	83,800	411.00	34,441,800	
ミクニ	22,500	395.00	8,887,500	
太平洋工業	35,400	1,273.00	45,064,200	
河西工業	20,200	322.00	6,504,400	
アイシン	123,700	4,730.00	585,101,000	
マツダ	530,400	994.00	527,217,600	
今仙電機製作所	11,000	601.00	6,611,000	
本田技研工業	1,330,900	3,482.00	4,634,193,800	
スズキ	386,600	4,695.00	1,815,087,000	
ＳＵＢＡＲＵ	484,300	2,196.00	1,063,522,800	
安永	8,200	915.00	7,503,000	
ヤマハ発動機	220,600	2,907.00	641,284,200	
小糸製作所	92,700	6,380.00	591,426,000	
ＴＢＫ	19,400	397.00	7,701,800	
エクセディ	25,600	1,715.00	43,904,000	
ミツバ	31,000	445.00	13,795,000	
豊田合成	54,500	2,664.00	145,188,000	
愛三工業	26,500	861.00	22,816,500	
盟和産業	2,000	1,020.00	2,040,000	
日本プラスト	13,200	575.00	7,590,000	
ヨロズ	15,900	1,087.00	17,283,300	
エフ・シー・シー	27,500	1,552.00	42,680,000	
新家工業	4,300	1,653.00	7,107,900	
シマノ	67,900	30,060.00	2,041,074,000	
テイ・エス　テック	71,300	1,481.00	105,595,300	
三十三フィナンシャルグループ	15,600	1,532.00	23,899,200	
第四北越フィナンシャルグループ	27,100	2,670.00	72,357,000	
ひろぎんホールディングス	246,300	736.00	181,276,800	
マーキュリアホールディングス	5,900	549.00	3,239,100	
おきなわフィナンシャルグループ	15,100	2,393.00	36,134,300	
ダイレクトマーケティングミックス	17,400	1,418.00	24,673,200	
ポピンズホールディングス	3,800	2,722.00	10,343,600	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	13,100	3,280.00	42,968,000	
十六フィナンシャルグループ	22,400	2,286.00	51,206,400	
北國フィナンシャルホールディングス	15,400	2,885.00	44,429,000	
ジャムコ	9,900	912.00	9,028,800	
小野建	16,300	1,662.00	27,090,600	
はるやまホールディングス	7,900	492.00	3,886,800	
南陽	2,500	1,869.00	4,672,500	
ノジマ	26,900	2,368.00	63,699,200	
佐鳥電機	10,500	1,066.00	11,193,000	
カッパ・クリエイト	23,400	1,335.00	31,239,000	
エコートレーディング	3,200	625.00	2,000,000	

伯東	10,000	2,639.00	26,390,000	
コンドーテック	13,300	1,026.00	13,645,800	
中山福	8,700	356.00	3,097,200	
ライトオン	12,800	717.00	9,177,600	
ナガイレーベン	22,100	2,209.00	48,818,900	
三菱食品	16,200	2,833.00	45,894,600	
良品計画	191,600	1,646.00	315,373,600	
三城ホールディングス	18,000	229.00	4,122,000	
松田産業	12,200	2,417.00	29,487,400	
第一興商	31,600	3,470.00	109,652,000	
メディパルホールディングス	179,600	2,114.00	379,674,400	
アドヴァングループ	17,100	950.00	16,245,000	
ＳＰＫ	6,800	1,346.00	9,152,800	
萩原電気ホールディングス	6,200	1,999.00	12,393,800	
アルビス	5,500	2,206.00	12,133,000	
アズワン	24,200	6,840.00	165,528,000	
スズデン	6,100	1,786.00	10,894,600	
尾家産業	3,600	966.00	3,477,600	
シモジマ	10,300	1,085.00	11,175,500	
ドウシシャ	15,800	1,572.00	24,837,600	
小津産業	2,800	1,932.00	5,409,600	
コナカ	19,400	340.00	6,596,000	
高速	10,100	1,548.00	15,634,800	
ハウス　オブ　ローゼ	1,400	1,656.00	2,318,400	
Ｇ－７ホールディングス	18,600	1,575.00	29,295,000	
たけびし	6,400	1,462.00	9,356,800	
イオン北海道	29,400	1,210.00	35,574,000	
コジマ	28,500	513.00	14,620,500	
ヒマラヤ	5,900	1,003.00	5,917,700	
コーナン商事	23,700	3,320.00	78,684,000	
ネットワンシステムズ	63,200	2,876.00	181,763,200	
エコス	6,200	1,880.00	11,656,000	
ワタミ	20,100	882.00	17,728,200	
マルシェ	4,600	385.00	1,771,000	
リックス	2,800	1,483.00	4,152,400	
システムソフト	35,300	117.00	4,130,100	
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	332,900	1,550.00	515,995,000	
丸文	14,600	770.00	11,242,000	
西松屋チェーン	36,400	1,364.00	49,649,600	
ゼンショーホールディングス	81,400	2,722.00	221,570,800	
ハピネット	13,900	1,492.00	20,738,800	
幸楽苑ホールディングス	10,600	1,400.00	14,840,000	
ハークスレイ	7,100	439.00	3,116,900	
橋本総業ホールディングス	3,400	2,027.00	6,891,800	
日本ライフライン	49,300	1,113.00	54,870,900	
サイゼリヤ	24,600	2,782.00	68,437,200	
タカショー	12,600	759.00	9,563,400	
ＶＴホールディングス	62,700	469.00	29,406,300	
アルゴグラフィックス	13,000	3,245.00	42,185,000	

魚力	4,400	2,021.00	8,892,400	
ＩＤＯＭ	50,400	753.00	37,951,200	
日本エム・ディ・エム	9,800	1,722.00	16,875,600	
ポプラ	5,300	142.00	752,600	
フジ・コーポレーション	9,000	1,178.00	10,602,000	
ユナイテッドアローズ	17,300	1,793.00	31,018,900	
進和	10,000	2,156.00	21,560,000	
エスケイジャパン	3,700	456.00	1,687,200	
ダイトロン	7,100	2,098.00	14,895,800	
ハイデイ日高	24,000	1,716.00	41,184,000	
シークス	23,700	1,479.00	35,052,300	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	9,900	205.00	2,029,500	
コロワイド	68,400	1,651.00	112,928,400	
ピーシーデポコーポレーション	19,400	300.00	5,820,000	
田中商事	3,700	642.00	2,375,400	
オーハシテクニカ	9,400	1,348.00	12,671,200	
壱番屋	11,800	4,630.00	54,634,000	
白銅	5,400	2,899.00	15,654,600	
トップカルチャー	6,300	282.00	1,776,600	
ＰＬＡＮＴ	4,100	715.00	2,931,500	
スギホールディングス	33,200	6,950.00	230,740,000	
ダイコー通産	2,000	1,196.00	2,392,000	
薬王堂ホールディングス	8,300	2,181.00	18,102,300	
島津製作所	217,500	4,290.00	933,075,000	
ＪＭＳ	14,100	611.00	8,615,100	
クボテック	3,700	310.00	1,147,000	
長野計器	12,300	1,477.00	18,167,100	
ブイ・テクノロジー	7,300	3,565.00	26,024,500	
スター精密	26,100	1,546.00	40,350,600	
東京計器	10,800	1,014.00	10,951,200	
愛知時計電機	1,400	5,790.00	8,106,000	
インターアクション	8,500	2,391.00	20,323,500	
オーバル	15,300	256.00	3,916,800	
東京精密	28,500	4,940.00	140,790,000	
マニー	67,300	1,597.00	107,478,100	
ニコン	258,000	1,284.00	331,272,000	
トプコン	79,400	1,546.00	122,752,400	
オリンパス	886,600	2,495.50	2,212,510,300	
理研計器	13,700	5,310.00	72,747,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	29,300	12,050.00	353,065,000	
キヤノン電子	15,600	1,610.00	25,116,000	
タムロン	13,100	2,838.00	37,177,800	
ＨＯＹＡ	329,900	15,770.00	5,202,523,000	
シード	7,900	568.00	4,487,200	
ノーリツ鋼機	15,200	2,399.00	36,464,800	
エー・アンド・デイ	15,400	1,155.00	17,787,000	
朝日インテック	185,300	2,276.00	421,742,800	
キヤノン	839,900	2,817.50	2,366,418,250	
リコー	469,200	1,070.00	502,044,000	

シチズン時計	197,900	496.00	98,158,400	
リズム	5,300	1,208.00	6,402,400	
大研医器	13,700	546.00	7,480,200	
メニコン	56,000	3,050.00	170,800,000	
シンシア	2,100	527.00	1,106,700	
中本パックス	4,800	1,746.00	8,380,800	
スノーピーク	22,100	2,953.00	65,261,300	
パラマウントベッドホールディングス	32,400	1,936.00	62,726,400	
トランザクション	9,300	1,047.00	9,737,100	
粧美堂	5,700	392.00	2,234,400	
ニホンフラッシュ	14,400	1,023.00	14,731,200	
前田工繊	18,700	3,755.00	70,218,500	
永大産業	23,600	285.00	6,726,000	
アートネイチャー	14,600	714.00	10,424,400	
バンダイナムコホールディングス	151,500	8,590.00	1,301,385,000	
アイフィスジャパン	4,900	698.00	3,420,200	
共立印刷	28,800	137.00	3,945,600	
ＳＨＯＥＩ	15,900	4,355.00	69,244,500	
フランスベッドホールディングス	22,100	905.00	20,000,500	
マーベラス	26,100	723.00	18,870,300	
パイロットコーポレーション	28,600	4,180.00	119,548,000	
萩原工業	11,000	1,261.00	13,871,000	
エイベックス	28,600	1,358.00	38,838,800	
フジシールインターナショナル	41,000	2,225.00	91,225,000	
タカラトミー	70,600	1,125.00	79,425,000	
広済堂ホールディングス	10,300	747.00	7,694,100	
エステールホールディングス	4,500	635.00	2,857,500	
レック	21,900	873.00	19,118,700	
タカノ	6,200	704.00	4,364,800	
三光合成	17,800	383.00	6,817,400	
プロネクサス	13,200	1,088.00	14,361,600	
ホクシン	12,600	150.00	1,890,000	
ウッドワン	5,200	1,027.00	5,340,400	
大建工業	10,000	2,139.00	21,390,000	
きもと	26,300	225.00	5,917,500	
凸版印刷	257,000	2,158.00	554,606,000	
大日本印刷	199,700	2,874.00	573,937,800	
共同印刷	5,300	2,858.00	15,147,400	
ＮＩＳＳＨＡ	34,600	1,593.00	55,117,800	
光村印刷	800	1,358.00	1,086,400	
藤森工業	15,200	4,085.00	62,092,000	
ヴィア・ホールディングス	22,100	145.00	3,204,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,400	1,906.00	16,010,400	
前澤化成工業	10,900	1,278.00	13,930,200	
未来工業	6,300	1,585.00	9,985,500	
アシックス	149,400	2,417.00	361,099,800	
ツツミ	4,300	1,860.00	7,998,000	
ウェーブロックホールディングス	6,400	736.00	4,710,400	
ＪＳＰ	10,000	1,632.00	16,320,000	
ニチハ	23,600	2,922.00	68,959,200	

ローランド	11,800	3,765.00	44,427,000	
エフピコ	31,000	3,885.00	120,435,000	
小松ウオール工業	4,900	1,921.00	9,412,900	
ヤマハ	100,600	5,530.00	556,318,000	
河合楽器製作所	4,700	3,215.00	15,110,500	
クリナップ	16,000	554.00	8,864,000	
ピジョン	102,200	2,353.00	240,476,600	
天馬	13,300	2,567.00	34,141,100	
兼松サステック	700	1,734.00	1,213,800	
キングジム	14,100	886.00	12,492,600	
象印マホービン	45,700	1,364.00	62,334,800	
リンテック	36,300	2,694.00	97,792,200	
信越ポリマー	30,300	1,086.00	32,905,800	
東リ	44,600	215.00	9,589,000	
イトーキ	30,800	352.00	10,841,600	
任天堂	95,500	53,830.00	5,140,765,000	
三菱鉛筆	27,800	1,209.00	33,610,200	
松風	7,200	1,892.00	13,622,400	
タカラスタンダード	35,000	1,420.00	49,700,000	
コクヨ	81,000	1,708.00	138,348,000	
ナカバヤシ	16,000	517.00	8,272,000	
ニフコ	56,400	3,770.00	212,628,000	
立川ブラインド工業	7,600	1,106.00	8,405,600	
グローブライド	15,200	3,030.00	46,056,000	
オカムラ	58,100	1,242.00	72,160,200	
バルカー	13,800	2,690.00	37,122,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,400	1,744.00	2,441,600	
伊藤忠商事	1,164,500	3,528.00	4,108,356,000	
丸紅	1,642,200	1,126.50	1,849,938,300	
スクロール	25,600	865.00	22,144,000	
高島	2,500	2,359.00	5,897,500	
ヨンドシーホールディングス	15,300	1,690.00	25,857,000	
三陽商会	7,900	857.00	6,770,300	
長瀬産業	91,500	1,884.00	172,386,000	
ナイガイ	4,700	301.00	1,414,700	
蝶理	9,400	1,815.00	17,061,000	
豊田通商	167,100	5,320.00	888,972,000	
オンワードホールディングス	99,200	297.00	29,462,400	
三共生興	22,500	567.00	12,757,500	
兼松	61,900	1,277.00	79,046,300	
美津濃	16,800	2,230.00	37,464,000	
ツカモトコーポレーション	2,100	1,289.00	2,706,900	
ルックホールディングス	5,300	1,196.00	6,338,800	
三井物産	1,292,800	2,805.00	3,626,304,000	
日本紙パルプ商事	8,800	4,045.00	35,596,000	
東京エレクトロン	107,200	62,750.00	6,726,800,000	
カメイ	19,700	1,048.00	20,645,600	
東都水産	700	4,010.00	2,807,000	
ＯＵＧホールディングス	2,500	2,771.00	6,927,500	
スターゼン	12,400	1,999.00	24,787,600	

セイコーホールディングス	23,800	2,186.00	52,026,800	
山善	69,900	1,032.00	72,136,800	
椿本興業	2,500	4,090.00	10,225,000	
住友商事	1,050,700	1,709.00	1,795,646,300	
日本ユニシス	51,800	3,080.00	159,544,000	
内田洋行	7,100	5,040.00	35,784,000	
三菱商事	1,247,600	3,772.00	4,705,947,200	
第一実業	7,600	4,730.00	35,948,000	
キヤノンマーケティングジャパン	41,300	2,270.00	93,751,000	
西華産業	9,000	1,604.00	14,436,000	
佐藤商事	13,900	1,157.00	16,082,300	
菱洋エレクトロ	9,800	2,402.00	23,539,600	
東京産業	15,200	760.00	11,552,000	
ユアサ商事	15,800	2,922.00	46,167,600	
神鋼商事	3,800	3,365.00	12,787,000	
トルク	6,800	205.00	1,394,000	
阪和興業	33,200	3,205.00	106,406,000	
正栄食品工業	10,800	3,830.00	41,364,000	
カナデン	13,700	1,023.00	14,015,100	
菱電商事	13,300	1,714.00	22,796,200	
ニプロ	126,000	1,076.00	135,576,000	
岩谷産業	40,000	5,830.00	233,200,000	
ナイス	5,900	1,759.00	10,378,100	
ニチモウ	2,600	2,421.00	6,294,600	
極東貿易	4,700	2,561.00	12,036,700	
アステナホールディングス	23,300	487.00	11,347,100	
兼松エレクトロニクス	9,100	3,875.00	35,262,500	
三愛石油	40,900	1,338.00	54,724,200	
稲畑産業	36,500	1,676.00	61,174,000	
ＧＳＩクレオス	7,900	1,275.00	10,072,500	
明和産業	15,300	1,107.00	16,937,100	
クワザワホールディングス	5,300	612.00	3,243,600	
キムラタン	91,700	19.00	1,742,300	
ゴールドウイン	29,800	6,360.00	189,528,000	
ユニ・チャーム	325,800	4,807.00	1,566,120,600	
デサント	32,300	4,015.00	129,684,500	
キング	7,600	529.00	4,020,400	
ワキタ	35,600	1,054.00	37,522,400	
ヤマトインターナショナル	15,300	289.00	4,421,700	
東邦ホールディングス	53,400	1,730.00	92,382,000	
サンゲツ	44,100	1,620.00	71,442,000	
ミツウロコグループホールディングス	24,500	1,167.00	28,591,500	
シナネンホールディングス	6,200	3,430.00	21,266,000	
伊藤忠エネクス	36,900	1,006.00	37,121,400	
サンリオ	51,500	2,387.00	122,930,500	
サンワ　テクノス	10,100	1,457.00	14,715,700	
リョーサン	18,400	2,301.00	42,338,400	
新光商事	25,200	893.00	22,503,600	
トーホー	7,700	1,191.00	9,170,700	
三信電気	7,700	1,476.00	11,365,200	

東陽テクニカ	16,400	1,100.00	18,040,000	
モスフードサービス	21,900	3,080.00	67,452,000	
加賀電子	15,100	3,120.00	47,112,000	
三益半導体工業	13,100	2,514.00	32,933,400	
都築電気	8,600	1,649.00	14,181,400	
ソーダニッカ	17,300	815.00	14,099,500	
立花エレテック	13,400	1,553.00	20,810,200	
木曽路	22,100	2,203.00	48,686,300	
ＳＲＳホールディングス	23,000	773.00	17,779,000	
千趣会	30,300	383.00	11,604,900	
タカキュー	14,800	117.00	1,731,600	
リテールパートナーズ	20,100	1,299.00	26,109,900	
ケーヨー	30,900	848.00	26,203,200	
上新電機	19,100	2,117.00	40,434,700	
日本瓦斯	80,900	1,595.00	129,035,500	
ロイヤルホールディングス	28,600	1,843.00	52,709,800	
東天紅	700	984.00	688,800	
いなげや	20,600	1,371.00	28,242,600	
チヨダ	16,000	791.00	12,656,000	
ライフコーポレーション	15,500	3,260.00	50,530,000	
リンガーハット	20,500	2,207.00	45,243,500	
ＭｒＭａｘＨＤ	20,800	616.00	12,812,800	
テンアライド	17,500	305.00	5,337,500	
ＡＯＫＩホールディングス	32,100	613.00	19,677,300	
オークワ	26,100	933.00	24,351,300	
コメリ	25,700	2,573.00	66,126,100	
青山商事	34,000	687.00	23,358,000	
しまむら	19,300	9,630.00	185,859,000	
はせがわ	9,100	288.00	2,620,800	
高島屋	121,000	1,088.00	131,648,000	
松屋	33,400	824.00	27,521,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	78,600	811.00	63,744,600	
近鉄百貨店	6,300	2,593.00	16,335,900	
丸井グループ	131,400	2,222.00	291,970,800	
クレディセゾン	106,800	1,288.00	137,558,400	
アクシアル　リテイリング	13,000	3,315.00	43,095,000	
井筒屋	7,800	403.00	3,143,400	
イオン	640,600	2,640.00	1,691,184,000	
イズミ	30,100	3,220.00	96,922,000	
フォーバル	7,500	885.00	6,637,500	
平和堂	30,700	1,932.00	59,312,400	
フジ	20,100	1,916.00	38,511,600	
ヤオコー	19,000	6,820.00	129,580,000	
ゼビオホールディングス	22,600	916.00	20,701,600	
ケーズホールディングス	153,300	1,094.00	167,710,200	
ＰＡＬＴＡＣ	23,300	4,550.00	106,015,000	
三谷産業	19,700	315.00	6,205,500	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	9,000	711.00	6,399,000	
日産東京販売ホールディングス	26,100	226.00	5,898,600	
新生銀行	108,800	2,118.00	230,438,400	

あおぞら銀行	93,100	2,708.00	252,114,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,455,700	701.40	7,333,627,980	
りそなホールディングス	1,908,000	498.00	950,184,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	315,100	4,268.00	1,344,846,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,153,900	4,255.00	4,909,844,500	
千葉銀行	556,300	743.00	413,330,900	
群馬銀行	319,500	381.00	121,729,500	
武蔵野銀行	24,700	1,879.00	46,411,300	
千葉興業銀行	39,600	289.00	11,444,400	
筑波銀行	65,300	196.00	12,798,800	
七十七銀行	52,200	1,439.00	75,115,800	
青森銀行	12,900	1,948.00	25,129,200	
秋田銀行	10,800	1,714.00	18,511,200	
山形銀行	18,700	946.00	17,690,200	
岩手銀行	10,800	1,968.00	21,254,400	
東邦銀行	139,600	217.00	30,293,200	
東北銀行	8,500	1,050.00	8,925,000	
みちのく銀行	10,900	895.00	9,755,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	140,300	2,250.00	315,675,000	
静岡銀行	406,000	880.00	357,280,000	
スルガ銀行	145,900	521.00	76,013,900	
八十二銀行	374,800	421.00	157,790,800	
山梨中央銀行	18,300	962.00	17,604,600	
大垣共立銀行	33,100	2,012.00	66,597,200	
福井銀行	14,300	1,473.00	21,063,900	
清水銀行	7,100	1,678.00	11,913,800	
富山銀行	2,400	2,026.00	4,862,400	
滋賀銀行	31,300	2,255.00	70,581,500	
南都銀行	26,100	2,036.00	53,139,600	
百五銀行	160,900	360.00	57,924,000	
京都銀行	59,600	5,620.00	334,952,000	
紀陽銀行	56,500	1,473.00	83,224,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	104,000	968.00	100,672,000	
山陰合同銀行	99,200	676.00	67,059,200	
中国銀行	133,300	957.00	127,568,100	
鳥取銀行	4,800	1,161.00	5,572,800	
伊予銀行	221,100	610.00	134,871,000	
百十四銀行	17,600	1,577.00	27,755,200	
四国銀行	25,600	810.00	20,736,000	
阿波銀行	25,600	2,330.00	59,648,000	
大分銀行	9,800	2,000.00	19,600,000	
宮崎銀行	10,500	2,192.00	23,016,000	
佐賀銀行	9,800	1,528.00	14,974,400	
琉球銀行	36,300	806.00	29,257,800	
セブン銀行	494,800	252.00	124,689,600	
みずほフィナンシャルグループ	2,132,200	1,587.50	3,384,867,500	
高知銀行	4,900	819.00	4,013,100	
山口フィナンシャルグループ	194,000	726.00	140,844,000	
芙蓉総合リース	17,500	7,870.00	137,725,000	
みずほリース	25,900	3,215.00	83,268,500	

東京センチュリー	32,300	5,820.00	187,986,000	
ＳＢＩホールディングス	205,600	3,145.00	646,612,000	
日本証券金融	65,500	940.00	61,570,000	
アイフル	279,400	375.00	104,775,000	
日本アジア投資	13,100	193.00	2,528,300	
長野銀行	5,600	1,281.00	7,173,600	
名古屋銀行	12,500	3,010.00	37,625,000	
北洋銀行	251,600	269.00	67,680,400	
愛知銀行	6,100	4,755.00	29,005,500	
中京銀行	6,100	1,739.00	10,607,900	
大光銀行	4,100	1,454.00	5,961,400	
愛媛銀行	23,600	905.00	21,358,000	
トマト銀行	6,600	1,091.00	7,200,600	
京葉銀行	71,800	501.00	35,971,800	
栃木銀行	81,000	235.00	19,035,000	
北日本銀行	5,400	1,677.00	9,055,800	
東和銀行	29,700	568.00	16,869,600	
福島銀行	19,300	246.00	4,747,800	
大東銀行	8,400	771.00	6,476,400	
リコーリース	14,700	3,875.00	56,962,500	
イオンフィナンシャルサービス	90,600	1,332.00	120,679,200	
アコム	328,800	345.00	113,436,000	
ジャックス	18,500	3,070.00	56,795,000	
オリエントコーポレーション	450,000	133.00	59,850,000	
オリックス	1,012,200	2,465.50	2,495,579,100	
三菱ＨＣキャピタル	615,800	606.00	373,174,800	
ジャフコ　グループ	21,300	6,340.00	135,042,000	
九州リースサービス	9,000	592.00	5,328,000	
トモニホールディングス	129,100	339.00	43,764,900	
大和証券グループ本社	1,248,600	697.60	871,023,360	
野村ホールディングス	2,545,700	532.40	1,355,330,680	
岡三証券グループ	130,800	400.00	52,320,000	
丸三証券	49,300	540.00	26,622,000	
東洋証券	53,700	155.00	8,323,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	190,400	416.00	79,206,400	
光世証券	3,300	499.00	1,646,700	
水戸証券	44,400	280.00	12,432,000	
いちよし証券	31,300	681.00	21,315,300	
松井証券	81,800	815.00	66,667,000	
ＳＯＭＰＯホールディングス	273,700	5,353.00	1,465,116,100	
日本取引所グループ	422,100	2,502.00	1,056,094,200	
マネックスグループ	135,700	654.00	88,747,800	
極東証券	22,400	779.00	17,449,600	
岩井コスモホールディングス	15,600	1,426.00	22,245,600	
アイザワ証券グループ	27,500	1,060.00	29,150,000	
フィデアホールディングス	15,200	1,470.00	22,344,000	
池田泉州ホールディングス	190,500	185.00	35,242,500	
アニコム　ホールディングス	51,000	788.00	40,188,000	

ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	373,800	3,898.00	1,457,072,400	
マネーパートナーズグループ	17,700	216.00	3,823,200	
スパークス・グループ	76,600	275.00	21,065,000	
小林洋行	3,600	232.00	835,200	
第一生命ホールディングス	820,600	2,671.50	2,192,232,900	
東京海上ホールディングス	549,100	7,010.00	3,849,191,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	8,200	783.00	6,420,600	
イー・ギャランティ	24,400	2,078.00	50,703,200	
アサックス	9,700	700.00	6,790,000	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,000	2,008.00	14,056,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	432,600	1,699.00	734,987,400	
アドバンスクリエイト	8,000	1,100.00	8,800,000	
三井不動産	759,800	2,318.50	1,761,596,300	
三菱地所	1,095,400	1,625.50	1,780,572,700	
平和不動産	28,600	3,900.00	111,540,000	
東京建物	164,400	1,694.00	278,493,600	
ダイビル	42,300	2,201.00	93,102,300	
京阪神ビルディング	25,900	1,512.00	39,160,800	
住友不動産	349,800	3,397.00	1,188,270,600	
太平洋興発	6,400	635.00	4,064,000	
テーオーシー	30,000	677.00	20,310,000	
東京楽天地	2,500	3,920.00	9,800,000	
レオパレス２１	172,600	175.00	30,205,000	
スターツコーポレーション	22,800	2,469.00	56,293,200	
フジ住宅	19,800	679.00	13,444,200	
空港施設	17,200	548.00	9,425,600	
明和地所	8,000	602.00	4,816,000	
ゴールドクレスト	13,200	1,609.00	21,238,800	
リログループ	88,300	1,991.00	175,805,300	
エスリード	6,600	1,678.00	11,074,800	
日神グループホールディングス	27,100	498.00	13,495,800	
日本エスコン	31,300	777.00	24,320,100	
タカラレーベン	70,000	295.00	20,650,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	8,800	891.00	7,840,800	
イオンモール	83,500	1,633.00	136,355,500	
毎日コムネット	6,200	709.00	4,395,800	
ファースト住建	6,400	1,200.00	7,680,000	
ランド	905,200	11.00	9,957,200	
カチタス	41,300	3,935.00	162,515,500	
東祥	12,100	1,515.00	18,331,500	
トーセイ	23,000	1,013.00	23,299,000	
穴吹興産	3,800	1,902.00	7,227,600	
サンフロンティア不動産	22,900	1,019.00	23,335,100	
ＦＪネクストホールディングス	16,700	1,002.00	16,733,400	
インテリックス	3,900	638.00	2,488,200	
ランドビジネス	6,800	268.00	1,822,400	
サンネクスタグループ	5,700	1,023.00	5,831,100	
グランディハウス	11,700	493.00	5,768,100	
東武鉄道	165,100	2,653.00	438,010,300	

相鉄ホールディングス	54,000	2,087.00	112,698,000	
東急	426,300	1,543.00	657,780,900	
京浜急行電鉄	217,000	1,154.00	250,418,000	
小田急電鉄	251,400	2,124.00	533,973,600	
京王電鉄	87,600	5,110.00	447,636,000	
京成電鉄	117,800	3,005.00	353,989,000	
富士急行	20,100	4,010.00	80,601,000	
新京成電鉄	3,800	2,026.00	7,698,800	
東日本旅客鉄道	297,600	6,744.00	2,007,014,400	
西日本旅客鉄道	205,000	4,762.00	976,210,000	
東海旅客鉄道	140,400	14,815.00	2,080,026,000	
西武ホールディングス	220,500	1,067.00	235,273,500	
鴻池運輸	27,000	1,197.00	32,319,000	
西日本鉄道	46,800	2,537.00	118,731,600	
ハマキョウレックス	12,100	2,920.00	35,332,000	
サカイ引越センター	7,800	4,365.00	34,047,000	
近鉄グループホールディングス	160,100	3,240.00	518,724,000	
阪急阪神ホールディングス	200,100	3,240.00	648,324,000	
南海電気鉄道	71,600	2,217.00	158,737,200	
京阪ホールディングス	71,300	2,672.00	190,513,600	
神戸電鉄	3,700	3,165.00	11,710,500	
名古屋鉄道	131,600	1,830.00	240,828,000	
山陽電気鉄道	12,600	1,985.00	25,011,000	
アルプス物流	11,300	1,042.00	11,774,600	
トランコム	4,500	8,640.00	38,880,000	
ヤマトホールディングス	224,400	2,590.00	581,196,000	
山九	42,100	4,725.00	198,922,500	
日新	12,900	1,655.00	21,349,500	
丸運	9,500	249.00	2,365,500	
丸全昭和運輸	13,100	3,155.00	41,330,500	
センコーグループホールディングス	80,300	932.00	74,839,600	
トナミホールディングス	3,800	3,705.00	14,079,000	
ニッコンホールディングス	53,800	2,182.00	117,391,600	
日本石油輸送	1,200	2,630.00	3,156,000	
福山通運	26,400	3,785.00	99,924,000	
セイノーホールディングス	109,100	1,150.00	125,465,000	
エスライン	3,600	895.00	3,222,000	
神奈川中央交通	3,800	3,350.00	12,730,000	
日立物流	30,900	5,310.00	164,079,000	
丸和運輸機関	33,800	1,445.00	48,841,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	16,300	1,554.00	25,330,200	
日本郵船	133,800	9,290.00	1,243,002,000	
商船三井	88,600	9,090.00	805,374,000	
川崎汽船	49,300	7,550.00	372,215,000	
ＮＳユナイテッド海運	8,800	3,445.00	30,316,000	
明治海運	19,000	760.00	14,440,000	
飯野海運	74,100	546.00	40,458,600	
共栄タンカー	2,800	893.00	2,500,400	
九州旅客鉄道	123,800	2,350.00	290,930,000	
ＳＧホールディングス	302,600	2,538.00	767,998,800	

ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	55,400	7,070.00	391,678,000	
日本航空	367,000	2,194.00	805,198,000	
ＡＮＡホールディングス	406,700	2,395.50	974,249,850	
パスコ	3,100	1,311.00	4,064,100	
ＴＲＥホールディングス	22,200	1,619.00	35,941,800	
人・夢・技術グループ	6,400	1,872.00	11,980,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,800	3,100.00	11,780,000	
シルバーライフ	3,400	1,156.00	3,930,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,400	2,048.00	2,867,200	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,300	4,680.00	34,164,000	
コーア商事ホールディングス	12,500	662.00	8,275,000	
国際紙パルプ商事	34,400	319.00	10,973,600	
ナルミヤ・インターナショナル	3,800	929.00	3,530,200	
ブックオフグループホールディングス	10,100	1,013.00	10,231,300	
ギフト	2,600	2,451.00	6,372,600	
三菱倉庫	50,700	2,821.00	143,024,700	
三井倉庫ホールディングス	17,000	2,439.00	41,463,000	
住友倉庫	56,500	1,911.00	107,971,500	
澁澤倉庫	9,700	2,185.00	21,194,500	
ヤマタネ	7,900	1,603.00	12,663,700	
東陽倉庫	26,100	316.00	8,247,600	
乾汽船	10,800	2,506.00	27,064,800	
日本トランスシティ	35,400	618.00	21,877,200	
ケイヒン	3,100	1,404.00	4,352,400	
中央倉庫	10,100	977.00	9,867,700	
川西倉庫	3,200	1,058.00	3,385,600	
安田倉庫	13,700	958.00	13,124,600	
ファイズホールディングス	3,300	532.00	1,755,600	
東洋埠頭	3,600	1,420.00	5,112,000	
宇徳	11,700	724.00	8,470,800	
上組	88,100	2,207.00	194,436,700	
サンリツ	4,500	867.00	3,901,500	
キムラユニティー	4,600	1,306.00	6,007,600	
キユーソー流通システム	8,300	919.00	7,627,700	
近鉄エクスプレス	30,200	2,937.00	88,697,400	
東海運	9,900	304.00	3,009,600	
エーアイテイー	10,100	1,423.00	14,372,300	
内外トランスライン	6,200	2,052.00	12,722,400	
ショーエイコーポレーション	4,600	660.00	3,036,000	
日本コンセプト	5,200	1,668.00	8,673,600	
ＴＢＳホールディングス	100,700	1,627.00	163,838,900	
日本テレビホールディングス	138,400	1,207.00	167,048,800	
朝日放送グループホールディングス	17,100	697.00	11,918,700	
テレビ朝日ホールディングス	39,800	1,456.00	57,948,800	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	140,200	430.00	60,286,000	
テレビ東京ホールディングス	12,100	2,020.00	24,442,000	
日本ＢＳ放送	6,100	1,129.00	6,886,900	
ビジョン	28,300	1,064.00	30,111,200	

スマートバリュー	4,100	484.00	1,984,400	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	15,800	2,837.00	44,824,600	
ワイヤレスゲート	6,300	338.00	2,129,400	
コネクシオ	11,900	1,429.00	17,005,100	
日本通信	137,700	191.00	26,300,700	
クロップス	3,200	986.00	3,155,200	
日本電信電話	1,735,200	3,307.00	5,738,306,400	
ＫＤＤＩ	1,209,300	3,593.00	4,345,014,900	
ソフトバンク	2,512,500	1,450.00	3,643,125,000	
光通信	19,500	17,630.00	343,785,000	
エムティーアイ	16,200	602.00	9,752,400	
GMOインターネット	58,700	2,593.00	152,209,100	
ファイバーゲート	5,400	1,116.00	6,026,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,900	298.00	1,162,200	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	90,500	2,723.00	246,431,500	
学研ホールディングス	23,200	1,051.00	24,383,200	
ゼンリン	26,900	1,014.00	27,276,600	
昭文社ホールディングス	5,300	440.00	2,332,000	
インプレスホールディングス	13,400	214.00	2,867,600	
東京電力ホールディングス	1,264,900	298.00	376,940,200	
中部電力	517,100	1,219.00	630,344,900	
関西電力	640,400	1,116.00	714,686,400	
中国電力	264,200	945.00	249,669,000	
北陸電力	154,600	591.00	91,368,600	
東北電力	395,300	815.00	322,169,500	
四国電力	152,300	813.00	123,819,900	
九州電力	348,300	858.00	298,841,400	
北海道電力	146,900	516.00	75,800,400	
沖縄電力	36,100	1,434.00	51,767,400	
電源開発	143,900	1,501.00	215,993,900	
エフオン	10,200	609.00	6,211,800	
イーレックス	24,800	1,795.00	44,516,000	
レノバ	33,000	1,706.00	56,298,000	
東京瓦斯	324,000	2,166.00	701,784,000	
大阪瓦斯	306,000	1,970.00	602,820,000	
東邦瓦斯	77,600	3,045.00	236,292,000	
北海道瓦斯	8,700	1,524.00	13,258,800	
広島ガス	33,400	366.00	12,224,400	
西部ガスホールディングス	19,100	2,103.00	40,167,300	
静岡ガス	44,100	992.00	43,747,200	
メタウォーター	17,500	1,935.00	33,862,500	
アイネット	8,700	1,348.00	11,727,600	
松竹	10,900	11,740.00	127,966,000	
東宝	97,900	4,740.00	464,046,000	
エイチ・アイ・エス	35,900	1,873.00	67,240,700	
東映	5,400	16,280.00	87,912,000	
ラックランド	4,700	2,878.00	13,526,600	
エヌ・ティ・ティ・データ	441,700	2,327.00	1,027,835,900	

共立メンテナンス	28,700	3,985.00	114,369,500	
イチネンホールディングス	16,700	1,329.00	22,194,300	
建設技術研究所	9,700	2,434.00	23,609,800	
スペース	11,900	900.00	10,710,000	
アインホールディングス	24,100	5,790.00	139,539,000	
燦ホールディングス	7,100	1,510.00	10,721,000	
ピー・シー・エー	9,800	1,599.00	15,670,200	
スバル興業	800	9,100.00	7,280,000	
東京テアトル	6,200	1,209.00	7,495,800	
タナベ経営	5,500	657.00	3,613,500	
ビジネスブレイン太田昭和	5,900	1,735.00	10,236,500	
ナガワ	5,200	10,480.00	54,496,000	
東京都競馬	12,200	4,105.00	50,081,000	
常磐興産	6,200	1,353.00	8,388,600	
カナモト	28,500	2,428.00	69,198,000	
ＤＴＳ	31,800	2,452.00	77,973,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,100	5,800.00	447,180,000	
シーイーシー	17,700	1,078.00	19,080,600	
カプコン	156,400	2,537.00	396,786,800	
西尾レントオール	14,800	2,757.00	40,803,600	
アイ・エス・ビー	7,700	954.00	7,345,800	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	86,400	22.00	1,900,800	
日本空港ビルデング	63,500	4,760.00	302,260,000	
トランス・コスモス	20,500	3,150.00	64,575,000	
乃村工藝社	69,200	922.00	63,802,400	
ジャステック	9,800	1,023.00	10,025,400	
ＳＣＳＫ	114,900	2,162.00	248,413,800	
藤田観光	7,000	2,257.00	15,799,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,000	1,341.00	13,410,000	
日本管財	17,300	2,836.00	49,062,800	
トーカイ	14,300	1,980.00	28,314,000	
白洋舎	2,000	1,432.00	2,864,000	
セコム	159,200	7,940.00	1,264,048,000	
日本システムウエア	6,200	2,230.00	13,826,000	
セントラル警備保障	7,700	2,388.00	18,387,600	
アイネス	15,200	1,515.00	23,028,000	
丹青社	33,000	763.00	25,179,000	
メイテック	19,500	6,660.00	129,870,000	
ＴＫＣ	28,000	3,185.00	89,180,000	
富士ソフト	17,700	5,160.00	91,332,000	
応用地質	18,300	2,051.00	37,533,300	
船井総研ホールディングス	33,100	2,383.00	78,877,300	
ＮＳＤ	53,400	1,967.00	105,037,800	
進学会ホールディングス	5,900	306.00	1,805,400	
丸紅建材リース	1,200	1,766.00	2,119,200	
オオバ	11,600	766.00	8,885,600	
コナミホールディングス	60,200	5,520.00	332,304,000	
いであ	4,400	1,748.00	7,691,200	

学究社	5,400	1,534.00	8,283,600	
ベネッセホールディングス	53,800	2,195.00	118,091,000	
イオンディライト	19,900	3,090.00	61,491,000	
ナック	8,400	959.00	8,055,600	
福井コンピュータホールディングス	7,600	3,125.00	23,750,000	
ダイセキ	29,800	4,420.00	131,716,000	
ステップ	6,100	1,902.00	11,602,200	
日鉄物産	11,900	5,180.00	61,642,000	
泉州電業	4,700	6,260.00	29,422,000	
元気寿司	4,700	2,500.00	11,750,000	
トラスコ中山	34,600	2,603.00	90,063,800	
ヤマダホールディングス	608,000	398.00	241,984,000	
オートバックスセブン	56,000	1,412.00	79,072,000	
モリト	12,500	744.00	9,300,000	
アークランドサカモト	26,100	1,593.00	41,577,300	
ニトリホールディングス	66,100	17,285.00	1,142,538,500	
グルメ杵屋	13,800	996.00	13,744,800	
愛眼	9,300	178.00	1,655,400	
ケーユーホールディングス	9,000	1,041.00	9,369,000	
吉野家ホールディングス	58,100	2,249.00	130,666,900	
加藤産業	24,100	3,350.00	80,735,000	
北恵	4,500	913.00	4,108,500	
イノテック	10,000	1,607.00	16,070,000	
イエローハット	28,800	1,640.00	47,232,000	
松屋フーズホールディングス	8,000	3,610.00	28,880,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,200	1,697.00	19,006,400	
ＪＫホールディングス	13,400	1,079.00	14,458,600	
サガミホールディングス	25,600	1,039.00	26,598,400	
日伝	13,900	2,209.00	30,705,100	
関西スーパーマーケット	12,600	1,037.00	13,066,200	
ミロク情報サービス	14,600	1,337.00	19,520,200	
北沢産業	8,700	229.00	1,992,300	
杉本商事	7,500	2,355.00	17,662,500	
因幡電機産業	44,400	2,740.00	121,656,000	
王将フードサービス	10,900	6,090.00	66,381,000	
プレナス	18,800	2,023.00	38,032,400	
ミニストップ	12,800	1,403.00	17,958,400	
アークス	31,800	2,132.00	67,797,600	
バローホールディングス	36,900	2,144.00	79,113,600	
東テク	5,300	2,433.00	12,894,900	
ミスミグループ本社	208,800	4,185.00	873,828,000	
アルテック	11,700	269.00	3,147,300	
ベルク	7,300	5,640.00	41,172,000	
大　庄	9,100	971.00	8,836,100	
タキヒヨー	4,700	1,524.00	7,162,800	
ファーストリテイリング	22,300	59,260.00	1,321,498,000	
ソフトバンクグループ	994,500	5,360.00	5,330,520,000	
蔵王産業	2,400	1,790.00	4,296,000	
スズケン	65,000	3,365.00	218,725,000	
サンドラッグ	62,600	3,015.00	188,739,000	

サックスバー　ホールディングス	15,800	512.00	8,089,600	
ジェコス	12,300	814.00	10,012,200	
ヤマザワ	3,200	1,596.00	5,107,200	
やまや	3,400	2,428.00	8,255,200	
グローセル	19,700	406.00	7,998,200	
ベルーナ	35,700	719.00	25,668,300	
合計	185,758,580		459,100,440,990	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,200,541,371
コール・ローン	58,944,280,036
国債証券	497,892,231,539
派生商品評価勘定	611,909,233
未収入金	510,482
未収利息	1,735,279,915
前払費用	647,441,947
流動資産合計	561,032,194,523
資産合計	561,032,194,523
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	623,026,043
未払金	58,357,438,622
未払解約金	23,013,000
流動負債合計	59,003,477,665
負債合計	59,003,477,665
純資産の部	
元本等	
元本	354,922,285,046
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	147,106,431,812
元本等合計	502,028,716,858
純資産合計	502,028,716,858
負債純資産合計	561,032,194,523

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	402,709,470,087円
同期中追加設定元本額	358,112,156,780円
同期中一部解約元本額	405,899,341,821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＞	7,448,673,078円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	736,990,821円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,897,006,049円
たわらノーロード　バランス（積極型）	901,921,631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）	42,591,096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）	1,265,978,280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）	1,492,405,331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）	457,908,756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）	209,168,223円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	6,611,882円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	17,283,866円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	140,579,686円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	11,662,562円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	17,721,746円
投資のソムリエ	192,627,163,769円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	11,536,822,002円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,852,628,336円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	48,073,830,623円
ワールドアセットバランス（基本コース）	2,577,145,361円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	6,895,234,427円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	237,626,882円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	118,443,748円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	55,029,385円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,130,958,075円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	22,862,762,692円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	4,880,161,548円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	264,141,981円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	101,584,657円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	86,767,566円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,884,939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）	19,915,393,117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）	7,238,852,934円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	5,047,186,707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）	106,888,404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）	530,944,679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）	47,909,819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）	331,022,839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）	656,930,502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）	913,722,314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	354,922,285,046円
２．　受益権の総数	354,922,285,046口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△10,491,427,773
合計	△10,491,427,773

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	509,292,203,613	－	509,208,298,105	83,905,508
アメリカ・ドル	242,445,765,332	－	242,688,085,543	△242,320,211
イギリス・ポンド	30,381,420,495	－	30,498,321,133	△116,900,638
イスラエル・シュケル	2,302,767,130	－	2,288,492,026	14,275,104
オーストラリア・ドル	8,244,870,844	－	8,175,877,202	68,993,642

オフショア・人民元	3,334,783,231	－	3,333,464,664	1,318,567
カナダ・ドル	10,244,370,710	－	10,240,700,293	3,670,417
シンガポール・ドル	2,239,477,906	－	2,232,868,396	6,609,510
スウェーデン・クローナ	1,469,205,903	－	1,464,285,837	4,920,066
デンマーク・クローネ	2,222,396,273	－	2,218,208,927	4,187,346
ノルウェー・クローネ	1,249,277,942	－	1,245,455,469	3,822,473
ポーランド・ズロチ	2,475,354,297	－	2,494,063,881	△18,709,584
マレーシア・リンギット	2,355,901,800	－	2,344,803,300	11,098,500
メキシコ・ペソ	3,632,282,964	－	3,657,733,997	△25,451,033
ユーロ	196,694,328,786	－	196,325,937,437	368,391,349
買建	59,800,708,528	－	59,705,686,210	△95,022,318
アメリカ・ドル	28,669,530,000	－	28,576,548,035	△92,981,965
イギリス・ポンド	3,563,567,000	－	3,565,021,745	1,454,745
イスラエル・シュケル	257,934,000	－	255,388,537	△2,545,463
オーストラリア・ドル	938,681,000	－	939,627,980	946,980
カナダ・ドル	1,166,808,000	－	1,170,791,079	3,983,079
シンガポール・ドル	228,486,000	－	228,653,005	167,005
スウェーデン・クローナ	160,047,000	－	160,164,563	117,563
デンマーク・クローネ	234,868,000	－	234,782,480	△85,520
ノルウェー・クローネ	143,078,000	－	143,105,499	27,499
ポーランド・ズロチ	266,896,000	－	267,554,674	658,674
マレーシア・リンギット	443,342,528	－	441,903,930	△1,438,598
メキシコ・ペソ	402,138,000	－	402,376,025	238,025
ユーロ	23,325,333,000	－	23,319,768,658	△5,564,342
合計	569,092,912,141	－	568,913,984,315	△11,116,810

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.4145円
（1万口当たり純資産額）	(14,145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

2022年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	13,000,000.000	12,793,320.280	
		US T N/B 0.125 02/15/24	15,000,000.000	14,746,875.000	
		US T N/B 0.125 05/15/23	8,630,000.000	8,567,803.330	
		US T N/B 0.125 06/30/23	8,000,000.000	7,930,624.960	
		US T N/B 0.125 07/15/23	9,000,000.000	8,917,382.790	
		US T N/B 0.125 07/31/23	1,850,000.000	1,831,716.780	
		US T N/B 0.125 08/15/23	8,310,000.000	8,224,627.710	
		US T N/B 0.125 08/31/23	18,040,000.000	17,841,982.670	
		US T N/B 0.125 09/15/23	11,120,000.000	10,993,596.840	
		US T N/B 0.125 10/15/23	10,000,000.000	9,874,609.300	
		US T N/B 0.125 12/15/23	10,000,000.000	9,854,296.800	
		US T N/B 0.25 04/15/23	8,130,000.000	8,091,890.620	
		US T N/B 0.25 05/15/24	20,000,000.000	19,635,937.400	
		US T N/B 0.25 05/31/25	8,970,000.000	8,656,050.000	
		US T N/B 0.25 06/15/24	6,810,000.000	6,676,992.180	
		US T N/B 0.25 06/30/25	8,990,000.000	8,664,112.500	
		US T N/B 0.25 07/31/25	8,980,000.000	8,639,742.140	
		US T N/B 0.25 08/31/25	9,920,000.000	9,527,850.000	
		US T N/B 0.25 09/30/23	20,960,000.000	20,756,131.090	
		US T N/B 0.25 09/30/25	10,000,000.000	9,593,750.000	
		US T N/B 0.25 10/31/25	12,000,000.000	11,495,625.000	
		US T N/B 0.25 11/15/23	12,280,000.000	12,143,288.960	
		US T N/B 0.375 01/31/26	14,430,000.000	13,824,616.330	
		US T N/B 0.375 04/15/24	12,740,000.000	12,555,369.490	
		US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,667,925.400	
		US T N/B 0.375 07/15/24	9,000,000.000	8,841,796.830	
		US T N/B 0.375 07/31/27	11,250,000.000	10,527,539.060	
		US T N/B 0.375 08/15/24	12,240,000.000	12,011,456.180	
		US T N/B 0.375 09/15/24	10,000,000.000	9,800,390.600	
		US T N/B 0.375 09/30/27	6,470,000.000	6,031,758.560	
		US T N/B 0.375 10/31/23	40,230,000.000	39,881,130.260	
		US T N/B 0.375 11/30/25	10,540,000.000	10,123,340.620	
		US T N/B 0.375 12/31/25	11,000,000.000	10,554,843.750	
		US T N/B 0.5 02/28/26	10,350,000.000	9,949,746.040	
		US T N/B 0.5 04/30/27	14,200,000.000	13,434,531.250	
		US T N/B 0.5 05/31/27	12,450,000.000	11,754,550.710	
		US T N/B 0.5 06/30/27	5,320,000.000	5,017,840.590	
		US T N/B 0.5 08/31/27	10,590,000.000	9,959,564.050	
		US T N/B 0.5 10/31/27	10,000,000.000	9,375,000.000	
		US T N/B 0.5 11/30/23	2,000,000.000	1,986,015.620	
		US T N/B 0.625 03/31/27	3,000,000.000	2,861,601.570	
		US T N/B 0.625 05/15/30	21,100,000.000	19,299,906.250	
		US T N/B 0.625 07/31/26	11,960,000.000	11,500,287.500	
		US T N/B 0.625 08/15/30	23,270,000.000	21,219,331.250	

		US T N/B 0.625 10/15/24	4,060,000.000	4,001,478.870	
		US T N/B 0.625 11/30/27	8,510,000.000	8,025,328.860	
		US T N/B 0.625 12/31/27	14,160,000.000	13,338,056.170	
		US T N/B 0.75 01/31/28	10,270,000.000	9,735,639.050	
		US T N/B 0.75 03/31/26	12,400,000.000	12,029,937.500	
		US T N/B 0.75 04/30/26	11,530,000.000	11,183,199.160	
		US T N/B 0.75 05/31/26	12,100,000.000	11,717,148.370	
		US T N/B 0.75 08/31/26	12,830,000.000	12,395,985.090	
		US T N/B 0.75 11/15/24	5,000,000.000	4,939,648.400	
		US T N/B 0.875 06/30/26	10,300,000.000	10,020,773.380	
		US T N/B 0.875 09/30/26	8,320,000.000	8,076,249.950	
		US T N/B 0.875 11/15/30	13,300,000.000	12,364,324.110	
		US T N/B 1.0 07/31/28	9,000,000.000	8,611,171.830	
		US T N/B 1.0 12/15/24	5,000,000.000	4,971,679.650	
		US T N/B 1.125 02/15/31	24,380,000.000	23,127,667.900	
		US T N/B 1.125 02/28/25	7,790,000.000	7,760,787.500	
		US T N/B 1.125 02/28/27	3,840,000.000	3,760,050.000	
		US T N/B 1.125 02/29/28	14,380,000.000	13,946,353.120	
		US T N/B 1.125 05/15/40	2,360,000.000	1,994,937.500	
		US T N/B 1.125 08/15/40	10,540,000.000	8,878,303.120	
		US T N/B 1.125 08/31/28	9,870,000.000	9,512,983.540	
		US T N/B 1.125 10/31/26	10,000,000.000	9,814,062.500	
		US T N/B 1.25 03/31/28	8,000,000.000	7,804,374.960	
		US T N/B 1.25 04/30/28	11,000,000.000	10,724,140.570	
		US T N/B 1.25 05/15/50	12,230,000.000	9,934,486.350	
		US T N/B 1.25 05/31/28	10,850,000.000	10,567,730.400	
		US T N/B 1.25 06/30/28	10,000,000.000	9,730,468.700	
		US T N/B 1.25 07/31/23	8,400,000.000	8,468,578.100	
		US T N/B 1.25 08/15/31	15,670,000.000	14,963,013.620	
		US T N/B 1.25 08/31/24	8,400,000.000	8,428,546.810	
		US T N/B 1.25 09/30/28	16,000,000.000	15,536,249.920	
		US T N/B 1.25 11/30/26	14,460,000.000	14,274,731.240	
		US T N/B 1.375 01/31/25	7,340,000.000	7,372,112.500	
		US T N/B 1.375 02/15/23	7,680,000.000	7,751,399.960	
		US T N/B 1.375 06/30/23	8,960,000.000	9,046,449.920	
		US T N/B 1.375 08/15/50	9,240,000.000	7,745,718.740	
		US T N/B 1.375 08/31/23	7,880,000.000	7,953,875.000	
		US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,723,281.250	
		US T N/B 1.375 09/30/23	14,410,000.000	14,545,093.750	
		US T N/B 1.375 10/31/28	15,000,000.000	14,674,218.750	
		US T N/B 1.375 11/15/31	12,960,000.000	12,491,212.430	
		US T N/B 1.375 11/15/40	12,120,000.000	10,649,503.060	
		US T N/B 1.5 01/15/23	8,000,000.000	8,080,624.960	
		US T N/B 1.5 01/31/27	4,000,000.000	3,990,937.480	
		US T N/B 1.5 02/15/30	13,730,000.000	13,513,323.430	
		US T N/B 1.5 02/28/23	7,620,000.000	7,703,046.030	
		US T N/B 1.5 03/31/23	7,740,000.000	7,823,749.190	
		US T N/B 1.5 08/15/26	12,540,000.000	12,531,182.740	
		US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,552,111.310	

		US T N/B 1.5 10/31/24	8,000,000.000	8,072,812.480	
		US T N/B 1.5 11/30/24	9,140,000.000	9,221,760.120	
		US T N/B 1.5 11/30/28	10,000,000.000	9,860,937.500	
		US T N/B 1.625 02/15/26	10,300,000.000	10,376,445.260	
		US T N/B 1.625 05/15/26	11,040,000.000	11,101,237.440	
		US T N/B 1.625 05/15/31	21,570,000.000	21,344,189.060	
		US T N/B 1.625 05/31/23	5,460,000.000	5,531,022.640	
		US T N/B 1.625 08/15/29	11,400,000.000	11,338,546.810	
		US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,838,801.540	
		US T N/B 1.625 10/31/26	5,100,000.000	5,125,101.530	
		US T N/B 1.625 11/15/50	14,120,000.000	12,587,759.300	
		US T N/B 1.625 11/30/26	5,310,000.000	5,336,550.000	
		US T N/B 1.75 01/31/23	8,180,000.000	8,286,403.880	
		US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,871,962.500	
		US T N/B 1.75 07/31/24	8,000,000.000	8,130,937.440	
		US T N/B 1.75 08/15/41	14,510,000.000	13,557,781.250	
		US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	6,929,648.400	
		US T N/B 1.75 12/31/24	8,300,000.000	8,432,281.240	
		US T N/B 1.75 12/31/26	4,990,000.000	5,045,747.630	
		US T N/B 1.875 02/15/41	14,440,000.000	13,790,200.000	
		US T N/B 1.875 02/15/51	16,240,000.000	15,373,443.660	
		US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	5,001,871.850	
		US T N/B 1.875 07/31/26	5,000,000.000	5,084,765.600	
		US T N/B 1.875 08/31/24	7,030,000.000	7,172,522.200	
		US T N/B 1.875 11/15/51	11,550,000.000	10,955,355.410	
		US T N/B 2.0 02/15/25	14,270,000.000	14,596,649.140	
		US T N/B 2.0 02/15/50	8,190,000.000	7,975,012.500	
		US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	7,014,081.960	
		US T N/B 2.0 05/31/24	8,440,000.000	8,629,570.240	
		US T N/B 2.0 06/30/24	6,710,000.000	6,864,382.390	
		US T N/B 2.0 08/15/25	5,000,000.000	5,112,500.000	
		US T N/B 2.0 08/15/51	16,000,000.000	15,605,000.000	
		US T N/B 2.0 11/15/26	12,150,000.000	12,414,831.970	
		US T N/B 2.0 11/15/41	6,940,000.000	6,768,397.600	
		US T N/B 2.125 02/29/24	8,810,000.000	9,026,808.540	
		US T N/B 2.125 03/31/24	13,170,000.000	13,495,648.780	
		US T N/B 2.125 05/31/26	5,000,000.000	5,137,500.000	
		US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	6,331,239.430	
		US T N/B 2.125 09/30/24	6,400,000.000	6,568,249.970	
		US T N/B 2.125 11/30/23	8,000,000.000	8,186,562.480	
		US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	6,846,390.210	
		US T N/B 2.25 01/31/24	8,160,000.000	8,379,300.000	
		US T N/B 2.25 02/15/27	8,770,000.000	9,068,728.120	
		US T N/B 2.25 03/31/26	7,630,000.000	7,873,802.300	
		US T N/B 2.25 04/30/24	8,000,000.000	8,222,812.480	
		US T N/B 2.25 05/15/41	10,160,000.000	10,309,224.990	
		US T N/B 2.25 08/15/27	12,080,000.000	12,496,193.680	
		US T N/B 2.25 08/15/46	6,890,000.000	7,002,500.740	
		US T N/B 2.25 08/15/49	10,490,000.000	10,767,001.560	

		US T N/B 2.25 10/31/24	6,560,000.000	6,756,543.700	
		US T N/B 2.25 11/15/24	6,020,000.000	6,199,424.170	
		US T N/B 2.25 11/15/25	11,630,000.000	11,996,163.220	
		US T N/B 2.25 11/15/27	10,710,000.000	11,079,829.680	
		US T N/B 2.25 12/31/23	8,000,000.000	8,209,687.440	
		US T N/B 2.25 12/31/24	7,210,000.000	7,430,524.550	
		US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,973,320.290	
		US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,439,831.250	
		US T N/B 2.375 05/15/27	10,000,000.000	10,405,468.700	
		US T N/B 2.375 05/15/29	9,450,000.000	9,882,632.800	
		US T N/B 2.375 05/15/51	12,240,000.000	12,953,362.500	
		US T N/B 2.375 08/15/24	1,620,000.000	1,673,092.950	
		US T N/B 2.375 11/15/49	10,680,000.000	11,257,387.490	
		US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	6,227,812.500	
		US T N/B 2.5 02/15/45	7,670,000.000	8,127,203.860	
		US T N/B 2.5 02/15/46	5,270,000.000	5,605,139.050	
		US T N/B 2.5 02/28/26	5,520,000.000	5,749,856.220	
		US T N/B 2.5 03/31/23	6,720,000.000	6,875,137.440	
		US T N/B 2.5 05/15/24	35,000,000.000	36,204,492.100	
		US T N/B 2.5 05/15/46	6,280,000.000	6,679,368.420	
		US T N/B 2.5 08/15/23	10,000,000.000	10,274,609.300	
		US T N/B 2.625 01/31/26	7,280,000.000	7,618,974.990	
		US T N/B 2.625 02/15/29	14,530,000.000	15,417,692.170	
		US T N/B 2.625 03/31/25	4,430,000.000	4,620,005.440	
		US T N/B 2.625 06/30/23	8,780,000.000	9,025,222.580	
		US T N/B 2.625 12/31/23	7,320,000.000	7,563,618.750	
		US T N/B 2.75 02/15/24	13,390,000.000	13,890,555.820	
		US T N/B 2.75 02/15/28	10,000,000.000	10,635,156.200	
		US T N/B 2.75 02/28/25	6,290,000.000	6,582,878.120	
		US T N/B 2.75 04/30/23	7,660,000.000	7,870,949.190	
		US T N/B 2.75 05/31/23	7,220,000.000	7,427,010.900	
		US T N/B 2.75 06/30/25	5,150,000.000	5,399,050.740	
		US T N/B 2.75 07/31/23	8,860,000.000	9,134,106.250	
		US T N/B 2.75 08/15/42	3,000,000.000	3,302,343.750	
		US T N/B 2.75 08/15/47	7,630,000.000	8,538,446.870	
		US T N/B 2.75 08/31/23	7,030,000.000	7,252,158.960	
		US T N/B 2.75 08/31/25	6,430,000.000	6,740,950.740	
		US T N/B 2.75 11/15/42	4,920,000.000	5,414,690.600	
		US T N/B 2.75 11/15/47	6,310,000.000	7,066,214.050	
		US T N/B 2.875 04/30/25	6,920,000.000	7,277,353.080	
		US T N/B 2.875 05/15/28	6,000,000.000	6,433,593.720	
		US T N/B 2.875 05/15/43	4,520,000.000	5,073,700.000	
		US T N/B 2.875 05/15/49	13,430,000.000	15,531,585.080	
		US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,783,542.940	
		US T N/B 2.875 07/31/25	5,270,000.000	5,553,674.190	
		US T N/B 2.875 08/15/28	12,860,000.000	13,811,438.990	
		US T N/B 2.875 08/15/45	3,040,000.000	3,441,375.000	
		US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	8,083,655.050	
		US T N/B 2.875 11/15/46	4,030,000.000	4,590,107.000	

	US T N/B 2.875 11/30/23	8,670,000.000	8,993,092.920	
	US T N/B 2.875 11/30/25	6,140,000.000	6,481,537.500	
	US T N/B 3.0 02/15/47	6,890,000.000	8,031,694.490	
	US T N/B 3.0 02/15/48	5,010,000.000	5,880,878.870	
	US T N/B 3.0 02/15/49	10,770,000.000	12,722,903.840	
	US T N/B 3.0 05/15/42	3,270,000.000	3,741,339.800	
	US T N/B 3.0 05/15/45	1,290,000.000	1,488,085.530	
	US T N/B 3.0 05/15/47	6,780,000.000	7,917,768.740	
	US T N/B 3.0 08/15/48	6,120,000.000	7,200,562.500	
	US T N/B 3.0 10/31/25	5,620,000.000	5,954,565.620	
	US T N/B 3.0 11/15/44	6,170,000.000	7,099,356.250	
	US T N/B 3.0 11/15/45	3,370,000.000	3,903,407.800	
	US T N/B 3.125 02/15/42	4,040,000.000	4,701,865.580	
	US T N/B 3.125 02/15/43	4,760,000.000	5,542,425.000	
	US T N/B 3.125 05/15/48	7,980,000.000	9,589,715.620	
	US T N/B 3.125 08/15/44	4,050,000.000	4,747,042.940	
	US T N/B 3.125 11/15/28	15,380,000.000	16,793,037.500	
	US T N/B 3.125 11/15/41	3,780,000.000	4,390,706.250	
	US T N/B 3.375 05/15/44	5,050,000.000	6,142,457.000	
	US T N/B 3.375 11/15/48	7,850,000.000	9,874,441.360	
	US T N/B 3.5 02/15/39	2,390,000.000	2,902,356.250	
	US T N/B 3.625 02/15/44	5,280,000.000	6,642,900.000	
	US T N/B 3.625 08/15/43	5,050,000.000	6,334,199.180	
	US T N/B 3.75 08/15/41	3,000,000.000	3,792,070.290	
	US T N/B 3.75 11/15/43	5,700,000.000	7,290,656.250	
	US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	3,289,500.000	
	US T N/B 4.25 05/15/39	3,000,000.000	3,984,843.750	
	US T N/B 4.25 11/15/40	3,320,000.000	4,438,943.750	
	US T N/B 4.375 02/15/38	1,890,000.000	2,523,150.000	
	US T N/B 4.375 05/15/40	2,770,000.000	3,755,405.830	
	US T N/B 4.375 05/15/41	3,500,000.000	4,769,433.580	
	US T N/B 4.375 11/15/39	2,700,000.000	3,645,210.910	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,910,000.000	2,548,507.020	
	US T N/B 4.5 05/15/38	2,140,000.000	2,899,031.240	
	US T N/B 4.5 08/15/39	2,510,000.000	3,433,503.470	
	US T N/B 4.625 02/15/40	2,790,000.000	3,882,677.320	
	US T N/B 4.75 02/15/41	3,470,000.000	4,936,075.000	
	US T N/B 5.0 05/15/37	1,450,000.000	2,046,992.180	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	2,092,328.120	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	2,999,900.000	
	US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	2,140,042.170	
	US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,706,874.990	
	US T N/B 6.25 08/15/23	2,390,000.000	2,599,218.350	
アメリカ・ドル　小計		2,027,400,000.000 (233,840,316,000)	2,052,414,792.380 (236,725,522,152)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	740,000.000	716,468.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	7,920,000.000	7,807,032.520	

		UK TREASURY 0.125 01/31/28	2,970,000.000	2,815,411.500	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	3,000,000.000	2,940,097.200	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	5,960,000.000	5,457,121.420	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	3,380,000.000	3,280,744.940	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	3,740,000.000	3,503,258.000	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,080,000.000	1,036,858.800	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	2,960,000.000	2,334,001.440	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	2,110,000.000	2,094,234.750	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,920,000.000	2,657,513.020	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,430,000.000	1,197,911.000	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	3,400,000.000	3,404,930.000	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	2,000,000.000	1,790,000.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	3,560,000.000	3,421,338.000	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	3,840,000.000	3,782,298.490	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	5,000,000.000	5,023,100.000	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	3,000,000.000	3,044,880.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	2,650,000.000	2,598,886.800	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	3,890,000.000	3,795,084.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	3,170,000.000	3,251,933.390	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	3,480,000.000	3,587,239.680	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,410,000.000	1,488,445.630	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	2,940,000.000	3,057,445.930	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	2,200,000.000	2,395,838.720	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,120,000.000	2,575,349.710	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	2,790,000.000	3,052,310.220	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	3,720,000.000	4,254,788.680	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	3,760,000.000	3,964,506.400	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	2,750,000.000	2,859,576.500	

		UK TREASURY 2.25 09/07/23	4,130,000.000	4,232,156.780	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	3,490,000.000	5,102,533.560	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,000,000.000	1,049,414.400	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	6,200,000.000	8,400,578.400	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	2,750,000.000	3,899,160.090	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	3,490,000.000	6,452,591.200	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	1,930,000.000	3,106,914.000	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,160,000.000	2,147,306.620	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,120,000.000	2,927,643.680	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,650,000.000	4,733,429.500	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	2,720,000.000	3,961,151.230	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,280,000.000	2,702,179.380	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	3,190,000.000	4,720,542.860	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,860,000.000	4,591,692.240	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	3,480,000.000	5,840,010.720	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	2,880,000.000	5,231,043.070	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	2,640,000.000	3,634,233.500	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	3,010,000.000	4,724,629.040	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	3,480,000.000	4,549,015.630	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	3,560,000.000	5,406,892.400	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	5,060,000.000	5,701,381.300	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,929,471.500	
イギリス・ポンド　小計			160,420,000.000 (25,126,584,600)	188,232,575.840 (29,482,868,354)	
イスラエル・シュケル		ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	2,340,000.000	2,343,322.800	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,450,000.000	1,443,306.800	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	5,760,000.000	5,765,581.440	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	4,170,000.000	4,121,740.590	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	2,710,000.000	2,563,963.520	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	6,230,000.000	6,382,342.190	

	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	3,500,000.000	3,655,907.500	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	5,650,000.000	6,016,255.600	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	4,620,000.000	5,021,380.980	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	5,170,000.000	5,570,126.980	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	5,840,000.000	7,413,494.560	
	ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	1,280,000.000	1,345,640.960	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	3,530,000.000	5,531,838.290	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,250,000.000	2,845,125.000	
イスラエル・シュケル　小計		54,500,000.000 (2,004,580,850)	60,020,027.210 (2,207,614,627)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	2,410,000.000	2,359,639.820	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	3,500,000.000	3,355,825.060	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	5,270,000.000	5,038,056.160	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	5,540,000.000	5,094,490.690	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	5,710,000.000	5,302,191.800	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	3,340,000.000	3,131,381.890	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	2,320,000.000	2,243,044.040	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	2,490,000.000	2,066,202.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,800,000.000	3,729,447.830	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	1,600,000.000	1,655,920.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	4,540,000.000	4,776,747.820	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	3,500,000.000	3,661,399.700	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,890,000.000	1,975,608.110	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,140,000.000	1,228,197.920	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	3,750,000.000	4,000,559.620	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	5,260,000.000	5,627,674.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	2,390,000.000	2,583,446.360	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	4,820,000.000	5,135,892.180	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	5,000,000.000	5,515,480.480	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	3,640,000.000	4,108,372.620	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	1,830,000.000	2,194,398.190	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	5,490,000.000	6,138,316.840	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	6,760,000.000	8,511,022.520	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	5,110,000.000	5,943,954.040	
オーストラリア・ドル　小計		91,100,000.000 (7,554,923,000)	95,377,269.690 (7,909,636,975)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	25,000,000.000	25,031,500.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	31,600,000.000	31,716,604.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	19,500,000.000	19,180,593.310	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	40,500,000.000	40,676,175.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	22,500,000.000	22,655,587.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	10,500,000.000	10,648,785.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	9,500,000.000	9,831,677.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	9,000,000.000	9,302,937.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,950,000.000	8,409,303.300	
オフショア・人民元　小計		176,050,000.000 (3,182,843,160)	177,453,162.710 (3,208,211,219)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 02/01/23	1,950,000.000	1,936,699.050	
	CANADA 0.25 03/01/26	5,260,000.000	5,006,183.960	
	CANADA 0.25 04/01/24	6,750,000.000	6,614,102.250	
	CANADA 0.25 08/01/23	1,770,000.000	1,749,053.820	
	CANADA 0.5 09/01/25	4,490,000.000	4,342,054.500	
	CANADA 0.5 11/01/23	4,990,000.000	4,938,897.410	
	CANADA 0.5 12/01/30	4,500,000.000	4,064,400.000	
	CANADA 0.75 02/01/24	850,000.000	843,334.300	
	CANADA 0.75 10/01/24	3,250,000.000	3,203,911.750	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,500,000.000	1,460,380.500	
	CANADA 1.0 09/01/26	4,710,000.000	4,602,720.330	
	CANADA 1.25 03/01/25	2,200,000.000	2,193,648.600	
	CANADA 1.25 03/01/27	910,000.000	896,085.190	
	CANADA 1.25 06/01/30	7,990,000.000	7,750,579.650	
	CANADA 1.5 06/01/23	3,110,000.000	3,132,563.050	
	CANADA 1.5 06/01/26	1,900,000.000	1,903,708.800	
	CANADA 1.5 06/01/31	8,000,000.000	7,850,928.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	350,000.000	352,398.900	
	CANADA 1.5 12/01/31	600,000.000	585,297.000	
	CANADA 1.75 03/01/23	1,490,000.000	1,504,099.870	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,700,000.000	2,542,730.400	
	CANADA 2.0 06/01/28	1,670,000.000	1,714,852.860	
	CANADA 2.0 09/01/23	6,220,000.000	6,317,635.340	
	CANADA 2.0 12/01/51	8,410,000.000	8,483,621.140	
	CANADA 2.25 03/01/24	3,660,000.000	3,745,321.920	
	CANADA 2.25 06/01/25	3,000,000.000	3,088,854.000	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	1,999,586.640	
	CANADA 2.5 06/01/24	20,000.000	20,609.180	
	CANADA 2.75 12/01/48	2,470,000.000	2,880,160.790	
	CANADA 2.75 12/01/64	780,000.000	936,627.120	
	CANADA 3.5 12/01/45	3,240,000.000	4,198,518.360	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,520,000.000	2,026,071.840	
	CANADA 5.0 06/01/37	470,000.000	663,824.710	

	CANADA 5.75 06/01/29	1,440,000.000	1,856,992.320	
	CANADA 5.75 06/01/33	2,240,000.000	3,134,201.280	
カナダ・ドル　小計		106,320,000.000 (9,683,625,600)	108,540,654.830 (9,885,882,842)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	1,300,000.000	1,259,050.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	1,000,000.000	983,102.180	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	1,100,000.000	1,021,900.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	1,310,000.000	1,223,618.600	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	1,700,000.000	1,737,230.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	2,150,000.000	2,210,200.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,440,000.000	1,473,343.200	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	1,230,000.000	1,276,002.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	780,000.000	809,640.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	840,000.000	887,460.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	1,330,000.000	1,460,340.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	940,000.000	1,032,890.800	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	2,280,000.000	2,347,488.000	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,530,000.000	1,646,280.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,300,800.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	1,550,000.000	1,625,950.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	630,000.000	720,405.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	1,760,000.000	1,922,272.000	
シンガポール・ドル　小計		24,070,000.000 (2,048,838,400)	24,937,971.780 (2,122,720,158)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	9,990,000.000	9,707,128.840	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	13,480,000.000	13,867,587.720	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	12,440,000.000	12,825,142.400	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	17,010,000.000	17,649,150.750	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	18,930,000.000	19,510,041.700	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	8,960,000.000	10,592,332.800	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	14,600,000.000	15,794,947.220	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	8,550,000.000	12,511,525.360	
スウェーデン・クローナ　小計		103,960,000.000 (1,317,173,200)	112,457,856.790 (1,424,841,046)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	7,530,000.000	7,629,923.100	
	DENMARK 0.0 11/15/31	8,860,000.000	8,748,469.850	
	DENMARK 0.25 11/15/52	10,650,000.000	10,229,112.000	
	DENMARK 0.5 11/15/27	8,600,000.000	8,929,386.880	
	DENMARK 0.5 11/15/29	22,280,000.000	23,205,065.600	
	DENMARK 1.5 11/15/23	11,900,000.000	12,362,469.700	
	DENMARK 1.75 11/15/25	10,950,000.000	11,827,160.700	
	DENMARK 4.5 11/15/39	23,010,000.000	40,470,227.290	
デンマーク・クローネ　小計		103,780,000.000 (1,823,414,600)	123,401,815.120 (2,168,169,892)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	7,450,000.000	7,073,775.000	

	NORWAY 1.375 08/19/30	9,170,000.000	8,850,287.950	
	NORWAY 1.5 02/19/26	9,370,000.000	9,310,687.900	
	NORWAY 1.75 02/17/27	9,840,000.000	9,857,712.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	14,620,000.000	14,690,907.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	8,410,000.000	8,382,078.800	
	NORWAY 2.0 04/26/28	7,380,000.000	7,477,785.000	
	NORWAY 2.0 05/24/23	4,550,000.000	4,600,787.100	
	NORWAY 3.0 03/14/24	21,640,000.000	22,357,366.000	
ノルウェー・クローネ　小計		92,430,000.000 (1,202,514,300)	92,601,386.750 (1,204,744,042)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	921,910.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	5,980,000.000	5,418,177.440	
	POLAND 04/25/23	7,310,000.000	6,993,111.500	
	POLAND 1.25 10/25/30	11,420,000.000	9,158,374.060	
	POLAND 2.25 10/25/24	6,610,000.000	6,360,802.260	
	POLAND 2.5 01/25/23	660,000.000	653,751.720	
	POLAND 2.5 04/25/24	6,080,000.000	5,928,305.210	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,000,000.000	8,452,808.790	
	POLAND 2.5 07/25/27	7,990,000.000	7,377,571.370	
	POLAND 2.75 04/25/28	11,960,000.000	11,141,338.000	
	POLAND 2.75 10/25/29	4,360,000.000	3,987,002.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	9,190,000.000	8,992,874.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	8,000,000.000	8,054,400.000	
ポーランド・ズロチ　小計		89,660,000.000 (2,580,531,358)	83,440,426.850 (2,401,523,957)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	6,490,000.000	5,955,421.620	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	4,330,000.000	4,394,189.650	
	MALAYSIA 3.48 03/15/23	2,110,000.000	2,141,506.940	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	2,000,000.000	2,020,705.800	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	5,090,000.000	5,166,431.930	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	2,550,000.000	2,409,434.710	
	MALAYSIA 3.8 08/17/23	1,070,000.000	1,093,495.270	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	5,650,000.000	5,566,128.800	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,900,000.000	1,895,439.510	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	3,000,000.000	3,085,725.900	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	1,910,000.000	1,950,931.300	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,412,867.300	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,370,000.000	1,412,501.090	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	4,140,000.000	4,255,816.500	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,810,000.000	1,865,982.570	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	3,840,000.000	3,961,058.300	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	3,100,000.000	3,203,271.850	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	4,020,000.000	3,904,296.590	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	2,480,000.000	2,568,322.950	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	4,200,000.000	4,370,223.060	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	4,560,000.000	4,681,363.480	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	3,030,000.000	3,179,886.220	

	MALAYSIA 4.498 04/15/30	3,050,000.000	3,235,004.450	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,400,000.000	2,571,916.560	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	1,700,000.000	1,807,986.720	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	3,730,000.000	4,065,282.980	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	230,000.000	251,327.670	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,400,000.000	2,606,741.760	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,970,000.000	2,159,990.740	
マレーシア・リンギット　小計		85,500,000.000 (2,348,086,500)	87,193,252.220 (2,394,588,286)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	18,127,800.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	23,000,000.000	21,274,298.040	
	MEXICAN BONDS 03/09/23	3,630,000.000	3,618,928.500	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	18,223,000.000	21,509,886.150	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	58,893,000.000	62,499,465.960	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	75,484,000.000	70,360,682.760	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	54,445,000.000	53,929,577.870	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	48,030,000.000	47,847,966.300	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	37,918,000.000	36,271,221.260	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	16,011,000.000	15,862,417.920	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	50,550,000.000	51,003,939.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	44,626,000.000	43,691,892.130	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	62,523,000.000	63,030,274.100	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	67,501,000.000	70,372,499.250	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	41,073,000.000	42,652,433.460	
メキシコ・ペソ　小計		621,907,000.000 (3,522,543,439)	622,053,282.700 (3,523,371,999)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	2,720,000.000	2,701,776.000	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,000,000.000	984,039.680	
	AUSTRIA 0.0 04/20/23	20,000.000	20,164.940	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	1,210,000.000	1,086,580.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	740,000.000	712,398.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	790,000.000	819,484.380	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	4,010,000.000	4,167,296.260	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	4,840,000.000	5,105,101.320	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	500,000.000	503,857.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	4,830,000.000	5,069,186.430	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	1,210,000.000	1,016,301.350	
	AUSTRIA 07/15/24	3,070,000.000	3,112,749.750	

		AUSTRIA 1.2 10/20/25	2,200,000.000	2,337,280.000	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	2,610,000.000	3,132,459.360	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	3,680,000.000	3,906,573.920	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	5,280,000.000	5,506,163.520	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	1,220,000.000	1,822,778.820	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,960,000.000	2,461,146.520	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	650,000.000	1,013,029.870	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	1,060,000.000	2,135,673.160	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	3,260,000.000	5,077,776.000	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	60,000.000	81,721.200	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	800,000.000	808,360.000	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	2,190,000.000	2,132,646.090	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	3,100,000.000	3,098,140.000	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	6,290,000.000	6,378,689.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	2,630,000.000	2,476,628.920	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	3,640,000.000	3,744,704.600	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	1,240,000.000	1,007,280.970	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	4,720,000.000	4,920,750.090	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	3,060,000.000	3,229,003.800	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	3,000,000.000	3,177,000.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	5,000,000.000	5,292,210.000	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	5,110,000.000	5,496,418.200	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,664,000.000	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	500,000.000	563,821.200	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	2,190,000.000	2,532,877.350	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	1,890,000.000	2,236,077.900	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	2,770,000.000	3,333,080.060	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	1,340,000.000	1,821,998.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	700,000.000	954,120.300	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	2,140,000.000	2,818,876.480	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	3,070,000.000	4,992,225.240	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,950,000.000	2,698,876.240	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	2,560,000.000	4,184,174.590	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	2,490,000.000	3,011,256.600	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	4,130,000.000	6,572,197.030	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	3,490,000.000	4,740,819.490	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	5,100,000.000	5,192,616.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	4,910,000.000	4,992,193.400	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	6,720,000.000	6,840,892.800	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	6,960,000.000	7,082,217.600	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,000,000.000	2,039,100.000	
		BUNDESOBL 04/05/24	4,920,000.000	4,988,697.960	
		BUNDESOBL 04/14/23	5,060,000.000	5,101,982.820	
		BUNDESOBL 10/13/23	3,940,000.000	3,986,255.600	
		BUNDESOBL 10/18/24	5,610,000.000	5,699,788.050	
		BUNDESSCHAT 0.0 09/15/23	3,000,000.000	3,031,597.800	
		BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	1,410,000.000	1,426,336.260	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	7,490,000.000	7,609,989.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	4,670,000.000	4,720,576.100	

		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	3,700,000.000	3,661,705.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	5,450,000.000	5,358,603.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	5,000,000.000	5,069,950.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,320,000.000	2,363,430.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,610,000.000	2,629,836.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	5,000,000.000	5,050,980.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	5,150,000.000	4,790,782.350	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	1,700,000.000	1,596,776.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,850,000.000	1,695,118.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	3,310,000.000	3,372,194.900	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	7,000,000.000	7,128,624.300	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,650,000.000	7,890,592.500	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	6,540,000.000	6,779,233.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	440,000.000	455,637.600	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	6,490,000.000	6,740,838.500	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	5,260,000.000	5,522,263.600	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	6,000,000.000	6,283,854.000	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	5,680,000.000	5,786,164.880	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	7,680,000.000	7,812,864.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	5,710,000.000	5,947,949.970	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	6,350,000.000	6,690,360.000	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	5,270,000.000	6,672,399.700	
		DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	4,550,000.000	4,659,525.320	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	7,990,000.000	8,388,629.090	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	3,570,000.000	3,750,688.410	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	10,870,000.000	11,333,850.070	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	5,040,000.000	7,716,492.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	6,840,000.000	10,717,930.470	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	3,260,000.000	5,359,440.000	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,510,000.000	7,227,193.820	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	4,280,000.000	7,430,593.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	2,380,000.000	3,176,324.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	5,510,000.000	8,864,322.700	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	4,480,000.000	8,368,998.400	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	4,840,000.000	7,360,623.600	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	3,390,000.000	4,620,027.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,343,205.800	

		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	1,400,000.000	2,139,158.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,308,658.100	
		FINLAND 0.0 09/15/24	1,230,000.000	1,247,855.910	
		FINLAND 0.0 09/15/30	1,280,000.000	1,270,051.840	
		FINLAND 0.125 04/15/36	180,000.000	172,598.040	
		FINLAND 0.125 04/15/52	540,000.000	469,755.250	
		FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	179,283.960	
		FINLAND 0.25 09/15/40	1,720,000.000	1,649,103.320	
		FINLAND 0.5 04/15/26	1,500,000.000	1,555,657.500	
		FINLAND 0.5 09/15/27	2,310,000.000	2,404,317.300	
		FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	93,631.990	
		FINLAND 0.5 09/15/29	1,560,000.000	1,623,314.160	
		FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	1,037,716.120	
		FINLAND 0.875 09/15/25	160,000.000	167,657.820	
		FINLAND 09/15/23	2,750,000.000	2,778,127.000	
		FINLAND 1.125 04/15/34	40,000.000	44,005.200	
		FINLAND 1.375 04/15/47	1,430,000.000	1,727,794.640	
		FINLAND 2.625 07/04/42	880,000.000	1,254,571.120	
		FINLAND 2.75 07/04/28	1,340,000.000	1,595,157.440	
		FINLAND 4.0 07/04/25	2,710,000.000	3,136,800.610	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/23	4,660,000.000	4,693,225.800	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	7,000,000.000	7,079,625.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	9,050,000.000	9,161,695.100	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,000,000.000	4,036,120.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	9,760,000.000	9,703,006.480	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	10,180,000.000	10,017,804.600	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	10,570,000.000	10,282,559.420	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	4,040,000.000	4,135,780.320	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	11,400,000.000	11,746,742.400	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	9,220,000.000	9,535,702.020	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	5,590,000.000	5,791,607.260	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	4,460,000.000	4,306,679.910	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	2,000,000.000	1,527,358.000	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	810,000.000	765,467.010	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	14,410,000.000	15,188,060.740	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	5,940,000.000	5,613,775.200	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,100,000.000	1,028,974.650	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	7,030,000.000	7,413,414.090	
		FRANCE OAT 03/25/23	10,160,000.000	10,238,286.850	
		FRANCE OAT 03/25/24	10,810,000.000	10,939,168.690	
		FRANCE OAT 03/25/25	11,000,000.000	11,144,698.400	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	8,780,000.000	9,345,519.800	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	9,000,000.000	9,470,445.300	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	5,810,000.000	6,372,280.180	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	8,260,000.000	9,052,960.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	12,910,000.000	14,461,252.690	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	7,970,000.000	9,151,177.910	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/23	9,640,000.000	9,955,382.240	

		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	2,390,000.000	2,963,368.170	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	7,820,000.000	9,334,734.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	6,370,000.000	6,780,068.750	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	5,430,000.000	6,909,499.060	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	13,080,000.000	13,950,212.400	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	11,550,000.000	13,879,715.850	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	7,520,000.000	8,806,010.240	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	6,840,000.000	10,443,749.760	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	9,430,000.000	10,970,862.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	4,230,000.000	7,882,605.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	3,520,000.000	6,881,467.280	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	5,520,000.000	8,568,237.840	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	2,000,000.000	2,175,160.000	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	7,400,000.000	12,540,014.090	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	5,890,000.000	9,183,994.280	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	7,560,000.000	10,622,752.560	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	8,090,000.000	12,817,820.270	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,220,000.000	2,764,263.410	
		IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	899,167.510	
		IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,656,458.800	
		IRISH 0.4 05/15/35	2,070,000.000	2,022,772.950	
		IRISH 0.55 04/22/41	150,000.000	144,561.900	
		IRISH 0.9 05/15/28	2,790,000.000	2,957,305.140	
		IRISH 1.0 05/15/26	3,820,000.000	4,032,743.440	
		IRISH 1.1 05/15/29	420,000.000	451,435.820	
		IRISH 1.35 03/18/31	1,420,000.000	1,567,969.680	
		IRISH 1.5 05/15/50	1,590,000.000	1,808,291.100	
		IRISH 1.7 05/15/37	1,660,000.000	1,922,380.430	
		IRISH 2.0 02/18/45	2,250,000.000	2,836,246.500	
		IRISH 2.4 05/15/30	2,610,000.000	3,098,208.330	
		IRISH 3.4 03/18/24	2,790,000.000	3,031,109.010	
		IRISH 3.9 03/20/23	10,000.000	10,532.350	
		IRISH 5.4 03/13/25	2,680,000.000	3,175,676.720	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,854,440.000	
		ITALY BTPS 0.0 01/30/24	4,000,000.000	4,004,800.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	6,920,000.000	6,799,592.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	4,700,000.000	4,701,880.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	4,000,000.000	3,915,600.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	10,000,000.000	9,981,000.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	4,610,000.000	4,464,324.000	
		ITALY BTPS 0.3 08/15/23	3,710,000.000	3,743,761.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	5,200,000.000	5,234,564.400	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	5,000,000.000	4,844,500.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	4,100,000.000	4,124,600.000	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	5,500,000.000	5,393,850.000	
		ITALY BTPS 0.6 06/15/23	3,500,000.000	3,549,350.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	3,810,000.000	3,595,256.580	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	3,840,000.000	3,899,550.720	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	5,390,000.000	5,474,084.000	

		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	7,770,000.000	7,571,903.850	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,450,000.000	3,126,390.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	2,000,000.000	1,924,800.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	4,750,000.000	4,693,000.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,720,000.000	2,766,240.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,080,000.000	1,047,643.690	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	5,780,000.000	5,997,293.320	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	5,000,000.000	5,123,865.000	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	720,000.000	709,704.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,620,000.000	1,688,040.320	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	4,690,000.000	4,870,895.170	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	2,130,000.000	1,934,679.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	4,010,000.000	4,187,851.520	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	5,790,000.000	6,087,606.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	4,780,000.000	4,953,222.420	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	6,000,000.000	6,254,160.000	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	3,400,000.000	3,092,895.000	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	4,630,000.000	4,826,728.700	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	3,510,000.000	3,468,231.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,925,440.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	4,670,000.000	4,929,185.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	8,900,000.000	9,585,842.900	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	3,610,000.000	3,849,667.900	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	4,000,000.000	4,311,184.000	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	3,540,000.000	3,806,413.320	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	1,253,040.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	4,000,000.000	4,343,600.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	4,130,000.000	4,483,115.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	3,200,000.000	3,560,145.910	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	3,480,000.000	3,727,080.000	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	6,560,000.000	6,865,204.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	4,000,000.000	4,341,168.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	4,090,000.000	4,373,567.880	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	4,030,000.000	4,573,647.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,600,000.000	1,732,000.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	4,660,000.000	5,280,043.290	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,850,000.000	3,339,915.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	4,790,000.000	5,519,397.250	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,770,000.000	2,122,373.370	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	2,500,000.000	3,094,832.500	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	2,660,000.000	3,232,982.620	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	3,660,000.000	4,699,679.730	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	5,860,000.000	7,014,168.020	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	2,000,000.000	2,195,726.000	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	2,500,000.000	3,428,675.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	5,720,000.000	7,514,364.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	5,190,000.000	5,697,063.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	6,220,000.000	7,282,998.000	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	5,830,000.000	6,288,121.400	

		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	4,340,000.000	6,584,295.150	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	3,820,000.000	4,400,416.910	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	5,020,000.000	7,056,614.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	4,300,000.000	6,400,550.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	3,670,000.000	5,532,158.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	4,940,000.000	6,562,296.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	3,690,000.000	5,374,116.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	6,155,880.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	3,400,000.000	4,529,480.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	5,260,000.000	5,334,786.680	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	3,510,000.000	3,353,343.780	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	2,090,000.000	1,862,043.700	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	3,640,000.000	3,646,985.160	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	2,480,000.000	2,466,895.680	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	6,880,000.000	7,043,510.080	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,830,000.000	1,877,978.940	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	2,970,000.000	3,102,539.220	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	2,000,000.000	2,075,700.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	5,330,000.000	5,633,138.420	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	5,970,000.000	6,344,104.080	
		NETHERLANDS 01/15/24	9,330,000.000	9,440,775.090	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	1,060,000.000	1,098,662.010	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	3,620,000.000	4,568,990.240	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	4,290,000.000	6,835,857.600	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	2,530,000.000	4,253,203.240	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,580,000.000	2,466,380.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	980,000.000	1,321,377.120	
		NETHERLANDS 7.5 01/15/23	90,000.000	97,632.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	4,920,000.000	4,964,280.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	5,690,000.000	5,713,425.730	
		SPAIN 0.0 01/31/27	1,000,000.000	998,050.000	
		SPAIN 0.0 01/31/28	3,000,000.000	2,918,100.000	
		SPAIN 0.0 04/30/23	1,430,000.000	1,440,610.600	
		SPAIN 0.0 05/31/24	3,940,000.000	3,973,486.840	
		SPAIN 0.1 04/30/31	6,890,000.000	6,562,725.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	8,470,000.000	8,603,614.250	
		SPAIN 0.35 07/30/23	270,000.000	273,663.900	
		SPAIN 0.5 04/30/30	3,040,000.000	3,060,796.640	
		SPAIN 0.5 10/31/31	7,000,000.000	6,906,214.000	
		SPAIN 0.6 10/31/29	6,030,000.000	6,151,389.930	
		SPAIN 0.8 07/30/27	5,000,000.000	5,173,750.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,750,427.470	

		SPAIN 1.0 07/30/42	2,000,000.000	1,928,600.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	3,730,000.000	3,341,691.510	
		SPAIN 1.2 10/31/40	4,110,000.000	4,113,781.200	
		SPAIN 1.25 10/31/30	6,470,000.000	6,876,963.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,540,000.000	1,641,316.600	
		SPAIN 1.4 04/30/28	4,040,000.000	4,348,664.080	
		SPAIN 1.4 07/30/28	7,420,000.000	8,001,357.000	
		SPAIN 1.45 04/30/29	4,930,000.000	5,344,185.560	
		SPAIN 1.45 10/31/27	5,390,000.000	5,805,757.650	
		SPAIN 1.45 10/31/71	1,730,000.000	1,492,150.950	
		SPAIN 1.5 04/30/27	4,340,000.000	4,676,784.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	4,000,000.000	4,249,596.000	
		SPAIN 1.85 07/30/35	4,870,000.000	5,450,065.700	
		SPAIN 1.95 04/30/26	4,170,000.000	4,535,704.830	
		SPAIN 1.95 07/30/30	5,660,000.000	6,375,129.100	
		SPAIN 2.15 10/31/25	5,460,000.000	5,950,111.440	
		SPAIN 2.7 10/31/48	4,020,000.000	5,219,808.390	
		SPAIN 2.75 10/31/24	6,860,000.000	7,467,900.950	
		SPAIN 2.9 10/31/46	2,770,000.000	3,704,202.990	
		SPAIN 3.45 07/30/66	2,440,000.000	3,642,358.800	
		SPAIN 3.8 04/30/24	2,000,000.000	2,196,238.000	
		SPAIN 4.2 01/31/37	4,880,000.000	7,120,896.000	
		SPAIN 4.4 10/31/23	4,750,000.000	5,171,101.750	
		SPAIN 4.65 07/30/25	5,310,000.000	6,239,706.660	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,100,000.000	1,790,061.570	
		SPAIN 4.8 01/31/24	3,840,000.000	4,259,700.480	
		SPAIN 4.9 07/30/40	4,360,000.000	7,156,940.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	8,440,000.000	11,244,190.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	2,530,000.000	4,514,974.750	
		SPAIN 5.4 01/31/23	2,480,000.000	2,636,554.960	
		SPAIN 5.75 07/30/32	5,510,000.000	8,392,005.500	
		SPAIN 5.9 07/30/26	5,590,000.000	7,119,625.240	
		SPAIN 6.0 01/31/29	820,000.000	1,154,567.380	
	ユーロ　小計		1,312,310,000.000 (171,518,917,000)	1,478,443,274.600 (193,232,535,990)	
国債証券　合計			467,754,892,006.700 (467,754,892,007)	497,892,231,539 (497,892,231,539)	
合計				497,892,231,539 (497,892,231,539)	

（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　234銘柄	47.15	47.55
イギリス・ポンド	国債証券　52銘柄	5.87	5.92

イスラエル・シュケル	国債証券	14銘柄	0.44	0.44
オーストラリア・ドル	国債証券	24銘柄	1.58	1.59
オフショア・人民元	国債証券	9銘柄	0.64	0.64
カナダ・ドル	国債証券	35銘柄	1.97	1.99
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	0.28	0.29
デンマーク・クローネ	国債証券	8銘柄	0.43	0.44
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.24	0.24
ポーランド・ズロチ	国債証券	13銘柄	0.48	0.48
マレーシア・リンギット	国債証券	29銘柄	0.48	0.48
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.70	0.71
ユーロ	国債証券	319銘柄	38.49	38.81

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,405,233,384
コール・ローン	46,281,269,621
株式	632,160,531,530
投資信託受益証券	1,105,709,322
投資証券	13,849,531,562
派生商品評価勘定	37,128,628
未収入金	67,804,924
未収配当金	573,058,063
差入委託証拠金	4,767,753,492
流動資産合計	705,248,020,526
資産合計	705,248,020,526
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	167,039,985
未払解約金	45,696,715,000
流動負債合計	45,863,754,985
負債合計	45,863,754,985
純資産の部	
元本等	
元本	110,505,806,204
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	548,878,459,337
元本等合計	659,384,265,541
純資産合計	659,384,265,541
負債純資産合計	705,248,020,526

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	106,247,503,758円
同期中追加設定元本額	62,209,615,334円
同期中一部解約元本額	57,951,312,888円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,304,873,073円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,204,231円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	11,976,941円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	41,926,811円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,418,626円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	11,712,711円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	11,362,713円
たわらノーロード　先進国株式	28,214,895,061円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	353,413,375円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,706,715,508円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	549,620,380円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	62,409,528円
たわらノーロード　バランス（標準型）	508,269,125円
たわらノーロード　バランス（積極型）	637,021,292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）	881,601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）	137,117,579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）	394,416,608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）	292,928,957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）	447,564,070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）	1,136,958円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	17,101,571円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,168,275円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	10,504,233円
たわらノーロード　全世界株式	203,745,571円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	50,726,972,975円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,176,784,015円
Ｏｎｅグローバルバランス	2,504,129円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	150,929,048円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	769,839,621円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	996,708,517円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	92,089,962円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	267,759,123円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	246,760,592円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	20,541,627円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	686,570,224円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	132,720,655円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	169,423,261円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	169,641,069円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	297,952,311円
投資のソムリエ	3,623,423,932円
クルーズコントロール	144,530,676円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	217,264,832円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	174,131,893円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	133,231,418円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	718,936円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	2,984,963円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	178,752,545円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,252,642,677円
ワールドアセットバランス（基本コース）	210,986,462円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	563,898,465円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	26,253,693円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	13,078,343円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,434,461円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	36,743,163円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	93,260,672円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	633,861,887円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	152,723,425円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	24,737,854円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	11,216,416円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	9,580,256円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	25,497,752円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	429,183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）	126,295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）	83,555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）	13,744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）	111,606円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	557,287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）	84,943,463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）	75,883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）	963,755,148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）	63,392,709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）	1,192,389,124円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,190,213,522円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,052,517,890円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	95,004,323円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,838,123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）	206,917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）	2,012,296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）	31,289,432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）	54,474,099円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,191,711円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,350,181円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,743,468円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	474,890円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,187,000円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	27,662,083円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	198,694,470円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	296,820,291円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	979,549,567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）	83,910,464円
ＤＩＡＭグローバル・アセット・バランスＶＡ２（適格機関投資家限定）	50,930,583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）	322,574,475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）	13,210,553円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,391,593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）	124,480,476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）	11,232,274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）	38,786,066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）	61,622,013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）	128,481,888円
計	110,505,806,204円
２．　受益権の総数	110,505,806,204口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	53,157,478,993
投資信託受益証券	94,156,037
投資証券	1,871,718,971
合計	55,123,354,001

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	13,853,246	－	13,854,454	△1,208
ユーロ	13,853,246	－	13,854,454	△1,208
買建	594,582,336	－	592,586,882	△1,995,454
アメリカ・ドル	452,184,300	－	450,396,688	△1,787,612
イギリス・ポンド	28,389,513	－	28,349,712	△39,801
オーストラリア・ドル	10,703,130	－	10,697,776	△5,354
カナダ・ドル	24,608,650	－	24,591,285	△17,365
ユーロ	78,696,743	－	78,551,421	△145,322
合計	608,435,582	－	606,441,336	△1,996,662

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	12,376,460,240	－	12,248,545,545	△127,914,695
合計	12,376,460,240	－	12,248,545,545	△127,914,695

（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）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.9670円 (59,670円)

附属明細表
第１ 有価証券明細表
（１）株式

2022年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	44,664	3,229.720	144,252,214.080	
	ABBOTT LABORATORIES	173,696	135.260	23,494,120.960	
	AES CORP	65,452	22.960	1,502,777.920	
	ABIOMED INC	4,271	306.800	1,310,342.800	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	87,775	135.030	11,852,258.250	
	ADVANCED MICRO DEVICES	118,563	132.000	15,650,316.000	
	ADOBE INC	46,631	525.830	24,519,978.730	
	CHUBB LTD	42,930	198.820	8,535,342.600	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21,651	295.100	6,389,210.100	
	ALLEGHANY CORP	1,577	678.030	1,069,253.310	
	ALLSTATE CORP	30,168	123.540	3,726,954.720	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	67,826	213.460	14,478,137.960	
	AMGEN INC	55,541	230.370	12,794,980.170	
	HESS CORP	28,694	85.150	2,443,294.100	

AMERICAN EXPRESS CO	65,923	173.740	11,453,462.020	
AMERICAN ELECTRIC POWER	48,416	90.500	4,381,648.000	
AFLAC INC	64,718	62.910	4,071,409.380	
AMERICAN INTL GROUP	82,686	61.410	5,077,747.260	
AMERCO	929	694.310	645,013.990	
ANALOG DEVICES	52,611	170.400	8,964,914.400	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	69,389	78.410	5,440,791.490	
VALERO ENERGY CORP	42,031	81.030	3,405,771.930	
ANSYS INC	8,394	363.180	3,048,532.920	
APPLE INC	1,620,056	172.190	278,957,442.640	
APPLIED MATERIALS INC	88,275	149.590	13,205,057.250	
ALBEMARLE CORP	11,180	226.970	2,537,524.600	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	57,285	69.930	4,005,940.050	
AMEREN CORP	25,436	87.510	2,225,904.360	
ARROW ELECTRONICS INC	6,295	131.570	828,233.150	
AUTODESK INC	21,423	262.390	5,621,180.970	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	41,390	232.890	9,639,317.100	
AUTOZONE INC	2,067	2,012.660	4,160,168.220	
AVERY DENNISON CORP	8,095	207.460	1,679,388.700	
BALL CORP	33,376	89.940	3,001,837.440	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	130,193	318.930	41,522,453.490	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	78,968	62.800	4,959,190.400	
BAXTER INTERNATIONAL INC	48,418	86.310	4,178,957.580	
BECTON DICKINSON & CO	28,024	259.170	7,262,980.080	
AMETEK INC	23,520	140.230	3,298,209.600	
VERIZON COMM INC	406,919	53.870	21,920,726.530	
WR BERKLEY CORP	12,804	84.390	1,080,529.560	
BEST BUY CO INC	21,238	102.750	2,182,204.500	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,324	664.480	1,544,251.520	
YUM! BRANDS INC	28,666	133.460	3,825,764.360	
FIRSTENERGY CORP	51,827	41.520	2,151,857.040	
BOEING CO	54,378	209.310	11,381,859.180	
ROBERT HALF INTL INC	11,238	110.350	1,240,113.300	
BORGWARNER INC	20,923	48.050	1,005,350.150	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	138,796	42.410	5,886,338.360	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,382	107.840	1,335,274.880	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	12,033	142.990	1,720,598.670	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,229	1,565.990	3,490,591.710	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	216,639	65.100	14,103,198.900	
ONEOK INC	42,020	60.780	2,553,975.600	

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,444	136.450	1,015,733.800	
UNITED RENTALS INC	7,334	322.210	2,363,088.140	
SEMPRA ENERGY	31,048	137.700	4,275,309.600	
FEDEX CORP	24,748	256.550	6,349,099.400	
VERISIGN INC	10,340	236.600	2,446,444.000	
AMPHENOL CORP	58,123	81.920	4,761,436.160	
BROWN-FORMAN CORP	29,733	65.800	1,956,431.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,136	6.260	608,071.360	
CSX CORP	221,322	36.540	8,087,105.880	
COTERRA ENERGY INC	78,516	21.360	1,677,101.760	
CAMPBELL SOUP CO	20,334	45.840	932,110.560	
CONSTELLATION BRANDS INC	16,421	247.080	4,057,300.680	
CARDINAL HEALTH INC	29,005	51.030	1,480,125.150	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	85,956	21.400	1,839,458.400	
CATERPILLAR INC	53,407	221.640	11,837,127.480	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,258	121.110	1,242,346.380	
CITRIX SYSTEMS INC	11,530	97.220	1,120,946.600	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	92,188	13.650	1,258,366.200	
CERNER CORP	30,373	92.300	2,803,427.900	
JPMORGAN CHASE & CO	292,866	167.320	49,002,339.120	
CHURCH & DWIGHT CO INC	24,563	102.800	2,525,076.400	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14,465	118.250	1,710,486.250	
CINTAS CORP	8,931	399.230	3,565,523.130	
CISCO SYSTEMS INC	412,593	61.820	25,506,499.260	
CLOROX COMPANY	12,700	179.700	2,282,190.000	
COCA-COLA CO/THE	402,753	60.430	24,338,363.790	
COPART INC	21,725	136.090	2,956,555.250	
COGNEX CORP	16,262	71.910	1,169,400.420	
COLGATE-PALMOLIVE CO	78,414	83.710	6,564,035.940	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	26,314	162.050	4,264,183.700	
MOLINA HEALTHCARE INC	5,504	289.700	1,594,508.800	
NRG ENERGY, INC.	27,688	40.380	1,118,041.440	
COMCAST CORP-CL A	447,185	50.520	22,591,786.200	
CONAGRA BRANDS INC	42,744	34.170	1,460,562.480	
CONSOLIDATED EDISON INC	35,907	84.780	3,044,195.460	
CMS ENERGY CORP	30,078	64.780	1,948,452.840	
COOPER COS INC	5,074	416.090	2,111,240.660	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	16,984	49.290	837,141.360	
CORNING INC	83,254	37.600	3,130,350.400	
SEALED AIR CORP	13,382	65.420	875,450.440	
HEICO CORP-CL A	7,477	129.310	966,850.870	
CUMMINS INC	14,483	231.380	3,351,076.540	
DR HORTON INC	32,490	95.720	3,109,942.800	
DANAHER CORP	62,839	303.030	19,042,102.170	

MOODY'S CORP	16,335	361.790	5,909,839.650	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	51,262	86.680	4,443,390.160	
TARGET CORP	47,613	227.420	10,828,148.460	
DEERE & CO	28,734	379.860	10,914,897.240	
MORGAN STANLEY	133,951	104.130	13,948,317.630	
REPUBLIC SERVICES INC	20,753	131.630	2,731,717.390	
COSTAR GROUP INC	40,523	71.510	2,897,799.730	
THE WALT DISNEY CO	177,627	156.600	27,816,388.200	
DOLLAR TREE INC	23,104	135.740	3,136,136.960	
DOVER CORP	14,172	179.350	2,541,748.200	
OMNICOM GROUP	20,313	77.760	1,579,538.880	
DTE ENERGY CO	18,419	120.150	2,213,042.850	
DUKE ENERGY CORP	75,500	104.560	7,894,280.000	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,337	146.980	1,960,272.260	
EBAY INC	62,816	64.570	4,056,029.120	
BANK OF AMERICA CORP	741,357	48.930	36,274,598.010	
CITIGROUP INC	198,385	66.030	13,099,361.550	
EASTMAN CHEMICAL CO	12,571	119.640	1,503,994.440	
EATON CORP PLC	38,518	166.420	6,410,165.560	
CADENCE DESIGN SYS INC	26,813	165.880	4,447,740.440	
DISH NETWORK CORP	28,418	33.950	964,791.100	
ECOLAB INC	25,297	225.840	5,713,074.480	
PERKINELMER INC	11,565	183.750	2,125,068.750	
ELECTRONIC ARTS INC	27,561	128.900	3,552,612.900	
SALESFORCE.COM INC	95,835	229.630	22,006,591.050	
ERIE INDEMNITY CO	2,243	192.730	432,293.390	
EMERSON ELECTRIC CO	57,661	95.300	5,495,093.300	
ATMOS ENERGY CORP	13,760	105.150	1,446,864.000	
ENTERGY CORP	20,713	111.700	2,313,642.100	
EOG RESOURCES INC	55,943	98.060	5,485,770.580	
EQUIFAX INC	12,459	260.780	3,249,058.020	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	22,791	335.890	7,655,268.990	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	17,654	124.770	2,202,689.580	
EXXON MOBIL CORP	414,069	68.470	28,351,304.430	
FMC CORP	12,183	107.400	1,308,454.200	
NEXTERA ENERGY INC	192,775	84.290	16,249,004.750	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3,874	442.910	1,715,833.340	
FAIR ISAAC CORP	2,810	440.190	1,236,933.900	
ASSURANT INC	5,523	156.350	863,521.050	
FASTENAL CO	54,913	60.170	3,304,115.210	
FIFTH THIRD BANCORP	70,646	48.800	3,447,524.800	
M&T BANK CORP	11,606	177.490	2,059,948.940	
FISERV INC	57,864	107.750	6,234,846.000	
FORD MOTOR CO	380,860	23.850	9,083,511.000	
FRANKLIN RESOURCES INC	34,431	34.920	1,202,330.520	
FREEPORT-MCMORAN INC	142,579	41.620	5,934,137.980	

FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,192	906.000	1,079,952.000	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,172	162.430	3,438,967.960	
DENTSPLY SIRONA INC	20,222	55.450	1,121,309.900	
GENERAL DYNAMICS CORP	23,198	210.610	4,885,730.780	
GENERAL MILLS INC	57,558	68.770	3,958,263.660	
GENUINE PARTS CO	13,045	138.040	1,800,731.800	
GILEAD SCIENCES INC	122,229	72.090	8,811,488.610	
GARTNER INC	8,576	293.690	2,518,685.440	
MCKESSON CORP	14,873	250.720	3,728,958.560	
NVIDIA CORP	244,819	274.000	67,080,406.000	
GENERAL ELECTRIC CO	107,215	99.420	10,659,315.300	
WW GRAINGER INC	4,584	500.100	2,292,458.400	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,923	55.120	1,704,475.760	
HALLIBURTON CO	83,843	25.850	2,167,341.550	
MONSTER BEVERAGE CORP	38,622	92.730	3,581,418.060	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,217	399.170	13,259,229.890	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	19,375	223.440	4,329,150.000	
HASBRO INC	12,184	101.400	1,235,457.600	
HENRY SCHEIN INC	14,358	79.150	1,136,435.700	
HEICO CORP	3,596	148.290	533,250.840	
HERSHEY FOODS CORP	14,989	194.640	2,917,458.960	
HP INC	116,273	38.960	4,529,996.080	
F5 INC	5,557	237.340	1,318,898.380	
CROWN HOLDINGS INC NPR	14,182	108.850	1,543,710.700	
JUNIPER NETWORKS INC	35,290	34.510	1,217,857.900	
HOLOGIC INC	24,310	73.450	1,785,569.500	
HOME DEPOT INC	103,348	387.460	40,043,216.080	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19,315	84.390	1,629,992.850	
HORMEL FOODS CORP	29,021	49.850	1,446,696.850	
CENTERPOINT ENERGY INC	61,105	27.690	1,691,997.450	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,421	305.800	1,046,141.800	
HUMANA INC	12,574	385.180	4,843,253.320	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	8,752	197.980	1,732,720.960	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	152,327	17.030	2,594,128.810	
BIOGEN INC	14,344	235.310	3,375,286.640	
IDEX CORP	7,332	224.840	1,648,526.880	
ILLINOIS TOOL WORKS	30,786	243.840	7,506,858.240	
INTUIT INC	26,734	570.190	15,243,459.460	
IDEXX LABORATORIES INC	8,268	558.650	4,618,918.200	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	23,051	190.140	4,382,917.140	
INTEL CORP	397,631	55.210	21,953,207.510	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	23,991	140.590	3,372,894.690	

INTERNATIONAL PAPER CO	34,388	48.570	1,670,225.160	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	34,877	37.330	1,301,958.410	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	13,148	133.550	1,755,915.400	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7,748	169.560	1,313,750.880	
INCYTE CORP	17,958	74.660	1,340,744.280	
JOHNSON & JOHNSON	258,286	173.090	44,706,723.740	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,528	71.840	2,552,331.520	
KLA CORPORATION	14,805	418.730	6,199,297.650	
DEVON ENERGY CORP	65,295	48.500	3,166,807.500	
KELLOGG CO	26,578	66.980	1,780,194.440	
KEYCORP	88,456	26.330	2,329,046.480	
KIMBERLY-CLARK CORP	32,466	144.590	4,694,258.940	
BLACKROCK INC/NEW YORK	14,938	873.340	13,045,952.920	
KROGER CO	72,634	49.100	3,566,329.400	
LAM RESEARCH CORP	13,876	664.290	9,217,688.040	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4,417	421.290	1,860,837.930	
PACKAGING CORP OF AMERICA	8,522	135.970	1,158,736.340	
AKAMAI TECHNOLOGIES	15,264	112.650	1,719,489.600	
PLUG POWER INC	52,624	24.750	1,302,444.000	
LENNAR CORP	27,976	104.030	2,910,343.280	
ELI LILLY & CO	79,525	260.110	20,685,247.750	
BATH & BODY WORKS INC	26,967	58.420	1,575,412.140	
LINCOLN NATIONAL CORP	19,280	72.250	1,392,980.000	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	71,382	211.730	15,113,710.860	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	29,278	145.160	4,249,994.480	
LOCKHEED MARTIN CORP	24,424	363.250	8,872,018.000	
LOEWS CORP	22,394	60.730	1,359,987.620	
LOWE'S COS INC	67,695	247.690	16,767,374.550	
DOMINION ENERGY INC	78,703	79.830	6,282,860.490	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38,700	43.620	1,688,094.000	
MCCORMICK & CO INC	24,905	94.620	2,356,511.100	
MCDONALD'S CORPORATION	73,201	264.410	19,355,076.410	
S&P GLOBAL INC	23,593	435.390	10,272,156.270	
EVEREST RE GROUP LTD	4,282	280.200	1,199,816.400	
MARKEL CORPORATION	1,447	1,256.030	1,817,475.410	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	60,849	120.120	7,309,181.880	
MARSH & MCLENNAN COS	49,558	165.180	8,185,990.440	
MASCO CORP	23,233	66.610	1,547,550.130	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	6,452	416.250	2,685,645.000	

METLIFE INC	70,545	67.500	4,761,787.500	
MEDTRONIC PLC	132,036	105.620	13,945,642.320	
ACTIVISION BLIZZARD INC	75,432	63.110	4,760,513.520	
CVS HEALTH CORP	129,175	105.060	13,571,125.500	
MERCK & CO.INC.	247,358	82.370	20,374,878.460	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	41,360	65.120	2,693,363.200	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9,282	291.620	2,706,816.840	
MICROSOFT CORP	699,778	314.270	219,919,232.060	
MICRON TECH INC	110,073	93.890	10,334,753.970	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	53,322	82.930	4,421,993.460	
3M CO	56,666	177.410	10,053,115.060	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,963	172.460	1,028,378.980	
ENTEGRIS INC	13,639	133.910	1,826,398.490	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,253	334.110	1,755,079.830	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16,301	256.030	4,173,545.030	
ILLUMINA INC	14,246	362.280	5,161,040.880	
XCEL ENERGY INC	51,615	69.860	3,605,823.900	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9,713	76.440	742,461.720	
NETAPP INC	21,220	93.200	1,977,704.000	
NEWELL BRANDS INC	40,489	23.260	941,774.140	
NEWMONT CORP	77,443	60.430	4,679,880.490	
NOVAVAX INC	7,886	134.990	1,064,531.140	
NVR INC	338	5,515.360	1,864,191.680	
NIKE INC-CL B	125,201	150.440	18,835,238.440	
NORDSON CORP	4,787	238.330	1,140,885.710	
NORFOLK SOUTHERN CORP	24,235	287.970	6,978,952.950	
EVERSOURCE ENERGY	32,872	88.990	2,925,279.280	
NISOURCE INC	42,035	27.770	1,167,311.950	
NORTHERN TRUST CORP	20,011	129.250	2,586,421.750	
NORTHROP GRUMMAN CORP	14,823	402.230	5,962,255.290	
WELLS FARGO & CO	401,639	55.350	22,230,718.650	
NUCOR CORP	28,018	111.860	3,134,093.480	
CHENIERE ENERGY INC	24,574	107.950	2,652,763.300	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	43,136	157.150	6,778,822.400	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	95,228	32.380	3,083,482.640	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,578	330.170	3,162,368.260	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6,624	675.080	4,471,729.920	
ORACLE CORP	163,788	89.280	14,622,992.640	
PACCAR INC	35,270	92.360	3,257,537.200	
PTC INC	11,092	114.540	1,270,477.680	
EXELON CORP	95,645	56.820	5,434,548.900	
PARKER HANNIFIN CORP	12,397	317.450	3,935,427.650	

PAYCHEX INC	31,387	126.580	3,972,966.460	
ALIGN TECHNOLOGY INC	7,303	548.910	4,008,689.730	
PPL CORPORATION	73,482	30.230	2,221,360.860	
PEPSICO INC	135,729	174.170	23,639,919.930	
PENTAIR PLC	16,339	69.510	1,135,723.890	
PFIZER INC	548,198	56.240	30,830,655.520	
ESSENTIAL UTILITIES INC	20,910	51.710	1,081,256.100	
CONOCOPHILLIPS	129,793	81.030	10,517,126.790	
PG&E CORP	152,496	12.230	1,865,026.080	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22,238	199.120	4,428,030.560	
ALTRIA GROUP INC	179,751	50.540	9,084,615.540	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41,517	222.450	9,235,456.650	
BROWN & BROWN INC	24,969	68.080	1,699,889.520	
GARMIN LTD	14,529	130.050	1,889,496.450	
PPG INDUSTRIES INC	23,064	166.190	3,833,006.160	
IPG PHOTONICS CORP	3,353	164.340	551,032.020	
COSTCO WHOLESALE CORP	43,190	518.800	22,406,972.000	
T ROWE PRICE GROUP INC	21,851	189.210	4,134,427.710	
QUEST DIAGNOSTICS	12,493	159.600	1,993,882.800	
PROCTER & GAMBLE CO	238,158	160.520	38,229,122.160	
PROGRESSIVE CORP	56,936	110.000	6,262,960.000	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	49,059	66.260	3,250,649.340	
PULTE GROUP INC	23,814	53.000	1,262,142.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	28,331	147.010	4,164,940.310	
QUALCOMM INC	110,545	179.680	19,862,725.600	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,194	107.690	2,067,001.860	
EXACT SCIENCES CORP	17,982	74.420	1,338,220.440	
REGENERON PHARMACEUTICALS	10,205	621.270	6,340,060.350	
RESMED INC	14,092	237.350	3,344,736.200	
US BANCORP	137,325	61.360	8,426,262.000	
SEAGEN INC	12,863	145.080	1,866,164.040	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	37,032	46.020	1,704,212.640	
ROSS STORES INC	34,298	103.120	3,536,809.760	
ROLLINS INC	19,156	33.780	647,089.680	
ROPER TECHNOLOGIES INC	10,243	453.630	4,646,532.090	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,167	330.150	3,686,785.050	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	23,651	79.920	1,890,187.920	
RPM INTERNATIONAL INC	12,897	91.940	1,185,750.180	
ACCENTURE PLC-CL A	62,212	373.000	23,205,076.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	137,034	67.030	9,185,389.020	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,453	232.620	2,896,816.860	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	24,152	164.060	3,962,377.120	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	60,020	116.370	6,984,527.400	
BOOKING HOLDINGS INC	3,993	2,426.400	9,688,615.200	
SCHLUMBERGER LTD	134,081	35.120	4,708,924.720	
SCHWAB (CHARLES) CORP	141,146	91.650	12,936,030.900	
POOL CORP	4,110	496.310	2,039,834.100	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	21,107	126.900	2,678,478.300	
BUNGE LTD	13,581	96.110	1,305,269.910	
SEI INVESTMENTS CO	10,294	63.090	649,448.460	
ANTHEM INC	23,860	437.830	10,446,623.800	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16,243	134.640	2,186,957.520	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24,321	75.810	1,843,775.010	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	24,437	323.300	7,900,482.100	
CENTENE CORP	56,386	77.840	4,389,086.240	
SVB FINANCIAL GROUP	5,617	711.210	3,994,866.570	
SMITH (A.O.) CORP	14,037	82.890	1,163,526.930	
SNAP-ON INC	5,783	217.690	1,258,901.270	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	38,912	114.460	4,453,867.520	
ADVANCE AUTO PARTS	5,694	234.130	1,333,136.220	
EDISON INTERNATIONAL	36,240	65.640	2,378,793.600	
SOUTHERN CO	104,076	68.530	7,132,328.280	
TRUIST FINANCIAL CORP	129,821	65.290	8,476,013.090	
SOUTHWEST AIRLINES	13,220	45.240	598,072.800	
AT&T INC	697,791	26.460	18,463,549.860	
CHEVRON CORP	189,629	125.110	23,724,484.190	
STANLEY BLACK & DECKER INC	16,599	188.090	3,122,105.910	
STATE STREET CORP	34,937	101.200	3,535,624.400	
STARBUCKS CORP	115,294	106.030	12,224,622.820	
STEEL DYNAMICS INC	21,929	60.590	1,328,678.110	
STRYKER CORP	33,323	263.850	8,792,273.550	
NETFLIX INC	43,293	539.850	23,371,726.050	
NORTONLIFELOCK INC	55,231	26.850	1,482,952.350	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	15,887	57.950	920,651.650	
SYNOPSYS INC	14,791	329.630	4,875,557.330	
SYSCO CORP	49,662	79.310	3,938,693.220	
INTUITIVE SURGICAL INC	34,924	325.530	11,368,809.720	
TELEFLEX INC	4,875	323.520	1,577,160.000	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	105,757	9.120	964,503.840	
TERADYNE INC	16,923	156.610	2,650,311.030	
TEXAS INSTRUMENTS INC	90,804	182.960	16,613,499.840	
TEXTRON INC	23,288	76.750	1,787,354.000	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38,489	625.040	24,057,164.560	
GLOBE LIFE INC	8,177	101.010	825,958.770	
DAVITA INC	6,497	113.730	738,903.810	
TRACTOR SUPPLY CO	11,626	227.390	2,643,636.140	
BIO-TECHNE CORP	4,057	427.770	1,735,462.890	
TRIMBLE INC	26,037	78.770	2,050,934.490	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,215	486.410	2,050,218.150	
TYSON FOODS INC	30,193	90.770	2,740,618.610	
UGI CORP	18,469	45.150	833,875.350	
UNION PACIFIC CORP	64,147	250.280	16,054,711.160	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	147,630	89.730	13,246,839.900	
UNITEDHEALTH GROUP INC	92,477	465.000	43,001,805.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	7,737	132.860	1,027,937.820	
VF CORP	34,457	71.040	2,447,825.280	
VIACOMCBS INC	62,426	34.910	2,179,291.660	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,103	223.960	5,622,067.880	
VULCAN MATERIALS CO	12,676	200.080	2,536,214.080	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	70,444	53.730	3,784,956.120	
WALMART INC	150,989	144.610	21,834,519.290	
WASTE MANAGEMENT INC	40,653	159.410	6,480,494.730	
WATERS CORP	6,368	345.030	2,197,151.040	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,013	392.570	2,753,093.410	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	11,399	143.280	1,633,248.720	
VAIL RESORTS INC	4,180	296.840	1,240,791.200	
WESTERN DIGITAL CORP	29,301	65.540	1,920,387.540	
WABTEC CORP	16,168	94.420	1,526,582.560	
WHIRLPOOL CORP	5,737	222.450	1,276,195.650	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15,924	154.090	2,453,729.160	
WYNN RESORTS LTD	8,712	82.170	715,865.040	
NASDAQ INC	11,034	189.120	2,086,750.080	
CME GROUP INC	35,079	222.800	7,815,601.200	
WILLIAMS COS INC	124,741	27.950	3,486,510.950	
LKQ CORP	28,785	57.680	1,660,318.800	
ALLIANT ENERGY CORP	22,337	60.630	1,354,292.310	
WEC ENERGY GROUP INC	32,231	96.900	3,123,183.900	
CARMAX INC	15,287	118.670	1,814,108.290	
XILINX INC	23,939	193.500	4,632,196.500	
TJX COMPANIES INC	117,213	72.490	8,496,770.370	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,495	535.410	2,942,077.950	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	108,700	5.430	590,241.000	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	24,700	57.520	1,420,744.000	

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,272	150.160	1,842,763.520	
SIGNATURE BANK	6,287	353.240	2,220,819.880	
CBRE GROUP INC	34,375	103.400	3,554,375.000	
LIBERTY GLOBAL PLC	14,597	27.290	398,352.130	
REGIONS FINANCIAL CORP	97,423	24.860	2,421,935.780	
DOMINO'S PIZZA INC	3,808	502.650	1,914,091.200	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,452	449.330	2,000,417.160	
T-MOBILE US INC	61,022	105.740	6,452,466.280	
LAS VEGAS SANDS CORP	30,723	36.430	1,119,238.890	
MOSAIC CO/THE	38,515	40.040	1,542,140.600	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3,959	380.810	1,507,626.790	
CELANESE CORP	11,436	170.290	1,947,436.440	
DEXCOM INC	9,350	462.340	4,322,879.000	
DISCOVERY INC-A	13,068	28.590	373,614.120	
EXPEDIA GROUP INC	14,843	180.570	2,680,200.510	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	20,205	67.470	1,363,231.350	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10,828	318.650	3,450,342.200	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	34,023	27.510	935,972.730	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	55,166	131.500	7,254,329.000	
LIVE NATION	15,312	115.320	1,765,779.840	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,713	1,543.460	4,187,406.980	
TRANSDIGM GROUP INC	5,378	644.000	3,463,432.000	
MASTERCARD INC	86,336	363.910	31,418,533.760	
WESTERN UNION CO	44,868	18.700	839,031.600	
OWENS CORNING	9,740	91.770	893,839.800	
LEIDOS HOLDINGS INC	12,303	89.710	1,103,702.130	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	17,350	9.080	157,538.000	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11,780	168.250	1,981,985.000	
DELTA AIR LINES INC	14,723	40.630	598,195.490	
INSULET CORP	6,481	240.700	1,559,976.700	
DISCOVER FINANCIAL	28,645	127.520	3,652,810.400	
TE CONNECTIVITY LTD	31,846	158.270	5,040,266.420	
MASIMO CORP	5,404	254.380	1,374,669.520	
LULULEMON ATHLETICA INC	11,458	348.430	3,992,310.940	
VMWARE INC	21,320	122.540	2,612,552.800	
MERCADOLIBRE INC	4,328	1,053.310	4,558,725.680	
ULTA BEAUTY INC	5,274	381.040	2,009,604.960	
INVESCO LTD	36,904	24.160	891,600.640	
MSCI INC	7,974	541.860	4,320,791.640	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	152,844	100.280	15,327,196.320	

VISA INC	165,405	211.970	35,060,897.850	
KEURIG DR PEPPER INC	70,952	37.310	2,647,219.120	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	17,291	170.030	2,939,988.730	
DISCOVERY INC-C	30,388	27.860	846,609.680	
MARATHON PETROLEUM CORP	60,600	70.450	4,269,270.000	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	12,787	100.370	1,283,431.190	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	210,340	17.430	3,666,226.200	
XYLEM INC	16,604	114.260	1,897,173.040	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	25,524	97.800	2,496,247.200	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	3,482	196.200	683,168.400	
SPLUNK INC	17,045	118.320	2,016,764.400	
EPAM SYSTEMS INC	5,399	545.850	2,947,044.150	
ZILLOW GROUP INC	7,658	55.260	423,181.080	
HCA HEALTHCARE INC	25,049	249.470	6,248,974.030	
VERISK ANALYTICS INC	15,501	206.680	3,203,746.680	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,152	146.490	901,206.480	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7,399	238.020	1,761,109.980	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	16,947	202.470	3,431,259.090	
NXP SEMICONDUCTOR NV	25,851	221.830	5,734,527.330	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	13,687	86.520	1,184,199.240	
LEAR CORP	5,216	186.150	970,958.400	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,527	122.670	1,291,347.090	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	21,554	82.610	1,780,575.940	
DOLLAR GENERAL CORP	22,506	236.310	5,318,392.860	
FORTINET INC	13,408	324.710	4,353,711.680	
HORIZON PHARMA PLC	20,415	94.900	1,937,383.500	
TESLA INC	82,434	1,058.120	87,225,064.080	
GENERAC HOLDINGS INC	5,993	323.730	1,940,113.890	
ENPHASE ENERGY INC	12,217	147.130	1,797,487.210	
GENERAL MOTORS CO	127,123	61.070	7,763,401.610	
ALLY FINANCIAL INC	37,466	50.160	1,879,294.560	
APTIV PLC	26,018	165.070	4,294,791.260	
PHILLIPS 66	44,848	83.860	3,760,953.280	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	8,628	106.920	922,505.760	
META PLATFORMS INC	233,507	328.070	76,606,641.490	
IQVIA HOLDINGS INC	18,572	257.230	4,777,275.560	
DIAMONDBACK ENERGY INC	15,727	121.350	1,908,471.450	
SERVICENOW INC	19,319	572.000	11,050,468.000	
PALO ALTO NETWORKS INC	9,442	522.610	4,934,483.620	
WORKDAY INC	18,602	252.310	4,693,470.620	

ABBVIE INC	173,002	136.390	23,595,742.780	
ZOETIS INC	46,308	212.600	9,845,080.800	
NEWS CORP/NEW-CL A	38,372	22.230	853,009.560	
CDW CORP	14,207	200.210	2,844,383.470	
HOWMET AEROSPACE INC	40,434	33.980	1,373,947.320	
TWILIO INC	15,931	227.520	3,624,621.120	
COUPA SOFTWARE INC	7,732	147.660	1,141,707.120	
SNAP INC	102,774	41.710	4,286,703.540	
TRADE DESK INC A	41,852	81.000	3,390,012.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	17,232	62.690	1,080,274.080	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,324	49.100	408,708.400	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14,346	48.850	700,802.100	
OKTA INC	12,687	201.240	2,553,131.880	
BLACK KNIGHT INC	16,775	78.990	1,325,057.250	
BAKER HUGHES CO	85,741	26.070	2,235,267.870	
BROADCOM INC	40,230	621.160	24,989,266.800	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	8,085	174.430	1,410,266.550	
MONGODB INC	5,943	435.000	2,585,205.000	
BURLINGTON STORES INC	6,861	247.000	1,694,667.000	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	40,449	28.730	1,162,099.770	
VEEVA SYSTEMS INC	13,268	239.860	3,182,462.480	
TWITTER INC	81,843	39.970	3,271,264.710	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	15,985	62.580	1,000,341.300	
EVERGY INC	22,398	66.820	1,496,634.360	
ALLEGION PLC	8,924	125.090	1,116,303.160	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	13,360	89.700	1,198,392.000	
STERIS PLC	10,186	231.520	2,358,262.720	
DOCUSIGN INC	18,360	136.230	2,501,182.800	
WIX.COM LTD	5,567	146.930	817,959.310	
DROPBOX INC	28,170	23.740	668,755.800	
KKR & CO INC	50,261	69.310	3,483,589.910	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	4,758	42.550	202,452.900	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	20,900	172.560	3,606,504.000	
MODERNA INC	33,413	233.700	7,808,618.100	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	26,279	148.610	3,905,322.190	
ARAMARK	21,387	36.350	777,417.450	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	57,124	22.780	1,301,284.720	
CIGNA CORP	33,188	233.690	7,755,703.720	
DELL TECHNOLOGIES INC	27,783	59.880	1,663,646.040	
DOW INC	72,256	58.400	4,219,750.400	
AMCOR PLC	161,822	12.150	1,966,137.300	
PINTEREST INC	52,177	32.700	1,706,187.900	
PELOTON INTERACTIVE INC	31,939	34.370	1,097,743.430	
FOX CORP-A	34,681	39.030	1,353,599.430	

FOX CORP-B	15,080	35.970	542,427.600	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	40,846	20.660	843,878.360	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	18,231	192.500	3,509,467.500	
CHEWY INC	9,068	49.910	452,583.880	
AVANTOR INC	54,446	38.280	2,084,192.880	
LYFT INC	24,589	44.130	1,085,112.570	
DYNATRACE INC	19,417	54.540	1,059,003.180	
CLOUDFLARE INC	22,554	110.750	2,497,855.500	
TRADEWEB MARKETS INC	9,886	91.900	908,523.400	
CARRIER GLOBAL CORP	79,871	52.320	4,178,850.720	
OTIS WORLDWIDE CORP	41,277	84.660	3,494,510.820	
INMODE LTD	5,511	54.630	301,065.930	
UBER TECHNOLOGIES INC	119,109	42.600	5,074,043.400	
CORTEVA INC	71,705	47.390	3,398,099.950	
MATCH GROUP INC	25,322	126.560	3,204,752.320	
BILL.COM HOLDINGS INC	7,830	200.990	1,573,751.700	
BLACKSTONE INC	66,677	114.720	7,649,185.440	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	3,202	95.550	305,951.100	
CARLYLE GROUP INC	17,020	50.140	853,382.800	
10X GENOMICS INC	7,667	127.720	979,229.240	
DATADOG INC	18,367	146.330	2,687,643.110	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	20,924	114.420	2,394,124.080	
UPSTART HOLDINGS INC	2,080	114.420	237,993.600	
INGERSOLL RAND INC	40,529	58.990	2,390,805.710	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,250	364.020	1,911,105.000	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	17,712	81.440	1,442,465.280	
ASANA INC	7,134	61.570	439,240.380	
UNITY SOFTWARE INC	5,367	126.000	676,242.000	
AON PLC	22,029	282.000	6,212,178.000	
SOFI TECHNOLOGIES INC	54,734	13.370	731,793.580	
BENTLEY SYSTEMS INC	16,002	42.950	687,285.900	
COINBASE GLOBAL INC	3,976	225.010	894,639.760	
AFFIRM HOLDINGS INC	9,204	78.240	720,120.960	
IAC/INTERACTIVECORP	7,250	130.490	946,052.500	
AIRBNB INC	22,711	160.710	3,649,884.810	
ZENDESK INC	11,915	99.990	1,191,380.850	
ROYALTY PHARMA PLC	35,564	42.440	1,509,336.160	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	23,577	53.240	1,255,239.480	
VIATRIS INC	124,858	15.010	1,874,118.580	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	21,814	88.300	1,926,176.200	
DRAFTKINGS INC	33,459	26.130	874,283.670	
SNOWFLAKE INC	20,442	302.730	6,188,406.660	
DOORDASH INC	10,922	133.450	1,457,540.900	
OAK STREET HEALTH INC	9,144	24.700	225,856.800	
ARISTA NETWORKS INC	21,859	131.540	2,875,332.860	

APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	33,142	68.350	2,265,255.700	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	153,271	16.500	2,528,971.500	
IHS MARKIT LTD	36,714	122.750	4,506,643.500	
FNF GROUP	25,451	53.570	1,363,410.070	
MARVELL TECHNOLOGY INC	80,068	82.210	6,582,390.280	
ROBINHOOD MARKETS INC	19,872	15.610	310,201.920	
LUCID GROUP INC	42,136	41.720	1,757,913.920	
CATALENT INC	17,439	118.310	2,063,208.090	
SYNCHRONY FINANCIAL	58,631	48.300	2,831,877.300	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	43,554	53.920	2,348,431.680	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,457	157.730	545,272.610	
WAYFAIR INC	6,959	176.490	1,228,193.910	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	17,542	186.780	3,276,494.760	
HUBSPOT INC	4,612	525.890	2,425,404.680	
QORVO INC	11,107	151.560	1,683,376.920	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	2,425	146.980	356,426.500	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	14,520	150.730	2,188,599.600	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	4,959	255.470	1,266,875.730	
GODADDY INC	16,574	76.600	1,269,568.400	
KORNIT DIGITAL LTD	4,978	124.440	619,462.320	
ETSY INC	13,005	183.710	2,389,148.550	
TRANSUNION	18,990	109.380	2,077,126.200	
BLOCK INC	38,605	144.480	5,577,650.400	
DUPONT DE NEMOURS INC	50,680	81.970	4,154,239.600	
CARVANA CO	7,735	183.440	1,418,908.400	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	21,537	57.840	1,245,700.080	
TELADOC HEALTH INC	14,790	82.180	1,215,442.200	
WESTROCK CO	26,297	45.580	1,198,617.260	
KRAFT HEINZ CO	64,001	37.360	2,391,077.360	
NOVOCURE LTD	9,772	65.630	641,336.360	
FORTIVE CORP	34,914	72.090	2,516,950.260	
WASTE CONNECTIONS INC	26,186	127.910	3,349,451.260	
ALPHABET INC-CL A	29,473	2,773.390	81,740,123.470	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	135,429	17.000	2,302,293.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	109,215	182.950	19,980,884.250	
SEA LTD ADR	13,232	187.100	2,475,707.200	
EQUITABLE HOLDINGS INC	40,115	35.170	1,410,844.550	
SUNRUN INC	16,213	31.520	511,033.760	
ZILLOW GROUP INC-C	15,665	56.540	885,699.100	
ALPHABET INC-CL C	28,267	2,771.480	78,341,425.160	

	ZSCALER INC	7,759	275.650	2,138,768.350	
	CABLE ONE INC	542	1,632.010	884,549.420	
	LINDE PLC	50,708	335.430	17,008,984.440	
	ROKU INC	11,901	182.960	2,177,406.960	
	AVALARA INC	7,824	113.820	890,527.680	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,491	605.430	7,562,426.130	
	VISTRA CORP	39,758	22.460	892,964.680	
アメリカ・ドル　小計		31,063,145		4,019,974,214.570 (463,663,825,907)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	35,261	13.455	474,436.750	
	ASHTEAD GROUP	43,003	57.000	2,451,171.000	
	SEVERN TRENT PLC	27,110	28.620	775,888.200	
	BHP GROUP PLC	205,988	22.610	4,657,388.680	
	BARCLAYS PLC	1,632,566	2.079	3,394,104.710	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	92,235	6.996	645,276.060	
	BT GROUP PLC	850,262	1.778	1,511,765.830	
	BUNZL PLC	35,508	26.960	957,295.680	
	AVIVA PLC	406,481	4.339	1,763,721.050	
	CRODA INTERNATIONAL	13,693	90.340	1,237,025.620	
	DIAGEO PLC	229,370	38.485	8,827,304.450	
	SCHRODERS PLC	11,354	35.170	399,320.180	
	DCC PLC	10,684	61.540	657,493.360	
	NATIONAL GRID PLC	352,237	10.534	3,710,464.550	
	KINGFISHER PLC	211,460	3.396	718,118.160	
	BAE SYSTEMS PLC	309,699	5.720	1,771,478.280	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	213,001	28.690	6,110,998.690	
	HALMA PLC	40,467	28.230	1,142,383.410	
	NEXT PLC	13,197	76.540	1,010,098.380	
	IMPERIAL BRANDS PLC	89,652	16.640	1,491,809.280	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,107	20.530	392,266.710	
	ANGLO AMERICAN PLC	125,473	32.420	4,067,834.660	
	COMPASS GROUP PLC	171,251	16.990	2,909,554.490	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,998,425	4.920	9,832,251.000	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	616,482	3.054	1,882,736.020	
	UNILEVER PLC	254,700	39.665	10,102,675.500	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	67,714	10.550	714,382.700	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	32,209	20.810	670,269.290	
	PEARSON PLC	63,746	5.978	381,073.580	
	PERSIMMON PLC	33,688	26.500	892,732.000	
	PRUDENTIAL PLC	254,460	12.960	3,297,801.600	
	RIO TINTO PLC	109,718	52.020	5,707,530.360	
	VODAFONE GROUP PLC	2,691,960	1.174	3,160,361.040	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	69,296	63.210	4,380,200.160	
RELX PLC	189,262	21.880	4,141,052.560	
RENTOKIL INITIAL PLC	193,406	5.320	1,028,919.920	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	795,864	1.276	1,015,522.460	
NATWEST GROUP PLC	572,346	2.470	1,413,694.620	
ST JAMES'S PLACE PLC	47,940	16.505	791,249.700	
SSE PLC	99,967	16.385	1,637,959.290	
BP PLC	1,967,309	3.630	7,141,331.670	
SAGE GROUP PLC(THE)	113,303	8.072	914,581.810	
SMITHS GROUP PLC	35,400	15.930	563,922.000	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7,648	142.150	1,087,163.200	
STANDARD CHARTERED PLC	279,471	4.925	1,376,394.670	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,839,768	0.528	3,611,397.500	
TAYLOR WIMPLEY PLC	346,794	1.669	578,799.180	
TESCO PLC	789,997	2.924	2,309,951.220	
3I GROUP PLC	101,975	14.140	1,441,926.500	
SMITH & NEPHEW PLC	88,029	13.205	1,162,422.940	
GLAXOSMITHKLINE PLC	491,304	16.114	7,916,872.650	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	31,795	71.720	2,280,337.400	
WPP PLC	125,001	11.550	1,443,761.550	
ASTRAZENECA PLC	151,396	83.340	12,617,342.640	
WHITBREAD PLC	18,744	31.620	592,685.280	
INTERTEK GROUP PLC	16,139	54.960	886,999.440	
BURBERRY GROUP PLC	38,764	17.450	676,431.800	
INTERCONTINENTAL HOTELS	15,522	49.340	765,855.480	
SAINSBURY (J) PLC	182,862	2.791	510,367.840	
ADMIRAL GROUP PLC	20,087	30.790	618,478.730	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	10,559	45.900	484,658.100	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	409,030	17.306	7,078,673.180	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	355,347	17.308	6,150,345.870	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,034	21.030	379,255.020	
AVEVA GROUP PLC	10,408	30.170	314,009.360	
ABRDN PLC	206,313	2.414	498,039.580	
EXPERIAN PLC	89,361	32.290	2,885,466.690	
MONDI PLC	45,875	18.690	857,403.750	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,312	13.910	491,189.920	
OCADO GROUP PLC	44,909	15.475	694,966.770	
INFORMA PLC	151,566	5.384	816,031.340	
GLENCORE PLC	968,128	3.889	3,765,049.790	
ENTAIN PLC	58,126	16.665	968,669.790	
EVRAZ PLC	48,765	5.946	289,956.690	
COCA-COLA HBC AG	20,233	26.710	540,423.430	

	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	51,508	6.696	344,897.560	
	FERGUSON PLC	21,607	123.550	2,669,544.850	
	M&G PLC	259,117	2.073	537,149.540	
	JD SPORTS FASHION PLC	235,490	2.128	501,122.720	
	AUTO TRADER GROUP PLC	104,624	6.952	727,346.040	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	470,129	1.696	797,338.780	
イギリス・ポンド　小計		28,505,991		182,416,172.250 (28,571,845,060)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	107,744	33.500	3,609,424.000	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	143,645	34.060	4,892,548.700	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,198	544.400	1,196,591.200	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	106,143	21.800	2,313,917.400	
	ICL GROUP LTD	68,048	32.540	2,214,281.920	
	NICE LTD	6,129	849.000	5,203,521.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,784	124.300	2,086,251.200	
	AZRIELI GROUP	4,414	291.300	1,285,798.200	
イスラエル・シュケル　小計		455,105		22,802,333.620 (838,699,474)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	17,134	67.250	1,152,261.500	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	275,753	28.370	7,823,112.610	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	354,006	21.830	7,727,950.980	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	174,780	20.640	3,607,459.200	
	TELSTRA CORP LTD	389,681	4.140	1,613,279.340	
	ASX LTD	18,926	90.470	1,712,235.220	
	BHP GROUP LTD	287,563	44.780	12,877,071.140	
	AMPOL LTD	20,946	30.010	628,589.460	
	COMPUTERSHARE LT	51,604	20.900	1,078,523.600	
	CSL LIMITED	46,635	280.000	13,057,800.000	
	REA GROUP LTD	5,828	158.650	924,612.200	
	TRANSURBAN GROUP	309,989	13.460	4,172,451.940	
	COCHLEAR LTD	5,699	207.500	1,182,542.500	
	ORIGIN ENERGY LTD	146,360	5.510	806,443.600	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	173,190	103.320	17,893,990.800	
	RIO TINTO LIMITED	38,515	105.990	4,082,204.850	
	APA GROUP	118,205	10.030	1,185,596.150	
	ARISTOCRAT LEISU	62,013	43.920	2,723,610.960	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	269,430	4.440	1,196,269.200	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	46,246	50.890	2,353,458.940	
	ORICA LTD	41,311	13.440	555,219.840	
	LEND LEASE CORP LTD	62,116	10.630	660,293.080	

	BLUESCOPE STEEL LTD	46,946	21.590	1,013,564.140	
	SYDNEY AIRPORT	142,258	8.690	1,236,222.020	
	MACQUARIE GROUP LTD	33,736	207.980	7,016,413.280	
	SUNCORP GROUP LTD	110,487	11.560	1,277,229.720	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	318,861	29.390	9,371,324.790	
	NEWCREST MINING LTD	86,879	24.010	2,085,964.790	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	107,483	5.110	549,238.130	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	133,624	12.180	1,627,540.320	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	96,692	8.920	862,492.640	
	REECE LTD	30,319	26.620	807,091.780	
	SANTOS LTD	333,393	6.840	2,280,408.120	
	SONIC HEALTHCARE	48,014	44.350	2,129,420.900	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	24,711	30.070	743,059.770	
	TABCORP HOLDINGS LTD	214,597	5.100	1,094,444.700	
	WESFARMERS LTD	109,481	57.120	6,253,554.720	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	101,110	23.230	2,348,785.300	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	130,018	37.100	4,823,667.800	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15,553	20.590	320,236.270	
	SEEK LTD	36,140	30.550	1,104,077.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,086	112.920	687,231.120	
	AUSNET SERVICES	165,066	2.560	422,568.960	
	BRAMBLES LTD	124,086	10.550	1,309,107.300	
	CROWN RESORTS LTD	32,861	11.700	384,473.700	
	EVOLUTION MINING LTD	150,230	3.760	564,864.800	
	AURIZON HOLDINGS LTD	138,166	3.640	502,924.240	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	75,903	12.400	941,197.200	
	XERO LTD	14,063	127.230	1,789,235.490	
	IDP EDUCATION LTD	22,852	32.790	749,317.080	
	AFTERPAY LTD	22,311	72.290	1,612,862.190	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	119,574	6.610	790,384.140	
	MEDIBANK PVT LTD	283,154	3.550	1,005,196.700	
	SOUTH32 LTD(AUD)	490,548	4.060	1,991,624.880	
	COLES GROUP LTD	122,726	17.070	2,094,932.820	
	WISETECH GLOBAL LTD	13,604	54.430	740,465.720	
オーストラリア・ドル　小計		6,817,462		151,546,099.640 (12,567,718,043)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	24,166	65.370	1,579,731.420	
	BARRICK GOLD CORP	172,112	23.590	4,060,122.080	
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	21,272	14.110	300,147.920	
	BANK OF MONTREAL	63,076	143.050	9,023,021.800	

BANK OF NOVA SCOTIA	118,889	90.930	10,810,576.770	
NATIONAL BANK OF CANADA	34,543	98.780	3,412,157.540	
BCE INC	7,275	65.720	478,113.000	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	137,930	71.830	9,907,511.900	
BAUSCH HEALTH COS INC	28,192	33.450	943,022.400	
SAPUTO INC	25,395	29.830	757,532.850	
BLACKBERRY LTD	46,671	11.190	522,248.490	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	62,222	17.750	1,104,440.500	
CGI INC	22,985	105.530	2,425,607.050	
CCL INDUSTRIES INC	15,358	65.400	1,004,413.200	
CAE INC	30,443	32.040	975,393.720	
CAMECO CORP	34,676	29.450	1,021,208.200	
ROGERS COMM-CL B	37,308	61.780	2,304,888.240	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	43,621	157.060	6,851,114.260	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	114,588	59.650	6,835,174.200	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	5,889	181.830	1,070,796.870	
CANADIAN UTILITIES LTD	9,793	35.420	346,868.060	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69,343	155.360	10,773,128.480	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	20,815	52.680	1,096,534.200	
OPEN TEXT CORP	29,886	58.390	1,745,043.540	
EMPIRE CO LTD	15,093	38.440	580,174.920	
KINROSS GOLD CORP	118,575	7.040	834,768.000	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	9,452	76.500	723,078.000	
FORTIS INC	44,533	59.180	2,635,462.940	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	56,914	31.000	1,764,334.000	
TELUS CORP	31,890	29.480	940,117.200	
GREAT WEST LIFECO INC	25,250	38.130	962,782.500	
IMPERIAL OIL LTD	22,066	48.770	1,076,158.820	
ENBRIDGE INC	195,720	51.630	10,105,023.600	
IGM FINANCIAL INC	5,366	46.650	250,323.900	
MANULIFE FINANCIAL CORP	187,042	25.630	4,793,886.460	
LOBLAW CO LTD	18,513	101.590	1,880,735.670	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	78,873	50.800	4,006,748.400	
MAGNA INTERNATIONAL INC	29,616	108.180	3,203,858.880	
SUN LIFE FINANCIAL INC	57,083	70.900	4,047,184.700	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,733	631.080	1,724,741.640	
METRO INC	21,254	67.080	1,425,718.320	
EMERA INC	22,870	60.670	1,387,522.900	
ONEX CORP	6,489	96.060	623,333.340	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,766	29.150	547,028.900	
POWER CORP OF CANADA	56,439	42.150	2,378,903.850	

	QUEBECOR INC-B	16,042	29.420	471,955.640	
	ROYAL BANK OF CANADA	140,431	142.530	20,015,630.430	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	91,172	96.090	8,760,717.480	
	SHAW COMM INC-B	39,730	38.150	1,515,699.500	
	SUNCOR ENERGY INC	143,108	33.710	4,824,170.680	
	LUNDIN MINING CORP	64,310	9.970	641,170.700	
	TECK RESOURCES LTD-CL B	43,824	39.520	1,731,924.480	
	THOMSON REUTERS CORP	16,740	140.750	2,356,155.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,388	109.850	1,031,271.800	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	178,816	99.730	17,833,319.680	
	TC ENERGY CORP	93,718	62.390	5,847,066.020	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	9,298	116.880	1,086,750.240	
	WESTON (GEORGE) LTD	7,886	143.080	1,128,328.880	
	INTACT FINANCIAL CORP	17,901	164.450	2,943,819.450	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	47,007	49.850	2,343,298.950	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	1,944	2,164.420	4,207,632.480	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	20,039	166.680	3,340,100.520	
	TOURMALINE OIL CORP	32,364	43.230	1,399,095.720	
	KEYERA CORP	23,772	28.900	687,010.800	
	PARKLAND CORP	14,497	35.110	508,989.670	
	ALTAGAS LTD	24,053	26.770	643,898.810	
	PEMBINA PIPELINE CORP	56,442	39.280	2,217,041.760	
	DOLLARAMA INC	30,727	61.800	1,898,928.600	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	134,422	17.220	2,314,746.840	
	NORTHLAND POWER INC	23,490	35.660	837,653.400	
	TMX GROUP LTD	4,797	123.920	594,444.240	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	26,971	51.480	1,388,467.080	
	IVANHOE MINES LTD	61,930	11.140	689,900.200	
	NUTRIEN LTD	55,262	86.940	4,804,478.280	
	TFI INTERNATIONAL INC	8,999	125.220	1,126,854.780	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	11,346	45.710	518,625.660	
	WSP GLOBAL INC	12,227	172.680	2,111,358.360	
	IA FINANCIAL CORP INC	11,660	77.280	901,084.800	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	16,485	43.780	721,713.300	
	NUVEI CORP	4,960	79.450	394,072.000	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	10,845	43.530	472,082.850	
	AIR CANADA	17,940	22.480	403,291.200	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	30,081	73.780	2,219,376.180	
	SHOPIFY INC	11,035	1,433.890	15,822,976.150	
	FIRSTSERVICE CORP	3,293	218.580	719,783.940	
	CANOPY GROWTH CORP	18,634	11.100	206,837.400	
	HYDRO ONE LTD	35,738	31.560	1,127,891.280	

カナダ・ドル　小計		3,824,309		250,050,298.860 (22,774,581,220)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	109,500	3.740	409,530.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	176,600	35.070	6,193,362.000	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	36,400	6.830	248,612.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	101,600	9.650	980,440.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	724,200	0.770	557,634.000	
	KEPPEL CORP LTD	134,900	5.090	686,641.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	352,853	12.100	4,269,521.300	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	808,422	2.330	1,883,623.260	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	158,050	5.010	791,830.500	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	111,300	29.160	3,245,508.000	
	UOL GROUP LIMITED	40,500	7.020	284,310.000	
	VENTURE CORP LTD	18,900	18.000	340,200.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	181,400	4.300	780,020.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	295,215	3.560	1,050,965.400	
シンガポール・ドル　小計		3,249,840		21,722,197.460 (1,848,993,448)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	269,154	9.402	2,530,585.900	
	LOGITECH INTL-REG	18,008	74.320	1,338,354.560	
	NESTLE SA-REGISTERED	276,350	121.900	33,687,065.000	
	CIE FINANC RICHEMONT	50,742	132.700	6,733,463.400	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	68,373	371.200	25,380,057.600	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,122	233.800	963,723.600	
	SIKA INHABER	13,747	340.300	4,678,104.100	
	SGS SA-REG	613	2,915.000	1,786,895.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	214,719	82.390	17,690,698.410	
	BALOISE HOLDING AG -R	4,259	158.800	676,329.200	
	BARRY CALLEBAUT AG	307	2,190.000	672,330.000	
	CLARIANT AG-REG	19,979	19.075	381,099.420	
	SWISSCOM AG-REG	2,419	519.600	1,256,912.400	
	ABB LTD	159,054	33.800	5,376,025.200	
	ADECCO GROUP AG-REG	12,579	47.710	600,144.090	
	GEBERIT AG	3,539	685.000	2,424,215.000	
	LONZA GROUP AG-REG	7,152	677.400	4,844,764.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	110	11,600.000	1,276,000.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	10	113,600.000	1,136,000.000	
	GIVAUDAN-REG	892	4,405.000	3,929,260.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	14,734	423.400	6,238,375.600	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,604	401.000	1,445,204.000	
	HOLCIM LTD	54,716	48.710	2,665,216.360	
	TEMENOS GROUP	6,753	117.200	791,451.600	

	BACHEM HOLDING AG	500	559.000	279,500.000	
	SONOVA HOLDING AG	5,210	322.500	1,680,225.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,641	272.500	1,537,172.500	
	STRAUMANN HOLDING AG	1,054	1,681.000	1,771,774.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	2,991	295.700	884,438.700	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	4,592	56.850	261,055.200	
	SCHINDLER NAMEN	1,494	231.400	345,711.600	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,053	593.400	1,811,650.200	
	VIFOR PHARMA AG	5,256	164.000	861,984.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	834	962.500	802,725.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,040	87.100	700,284.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,176	1,325.500	2,884,288.000	
	JULIUS BAER GROUP LTD	23,661	62.200	1,471,714.200	
	SWISS RE LTD	30,705	95.000	2,916,975.000	
	ALCON INC	48,573	71.360	3,466,169.280	
	UBS GROUP AG	342,779	17.780	6,094,610.620	
	VAT GROUP AG	2,412	396.600	956,599.200	
スイス・フラン　小計		1,694,906		157,229,151.740 (19,567,167,934)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	68,828	587.400	40,429,567.200	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	33,728	501.600	16,917,964.800	
	ERICSSON LM-B SHS	299,938	101.300	30,383,719.400	
	GETINGE AB-B SHS	24,421	347.400	8,483,855.400	
	INVESTOR AB-A SHS	55,733	226.200	12,606,804.600	
	LUNDBERGS B	7,382	484.100	3,573,626.200	
	SKF AB-B SHS	32,228	221.400	7,135,279.200	
	SANDVIK AB	114,371	250.000	28,592,750.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	166,438	126.600	21,071,050.800	
	SKANSKA AB-B SHS	28,801	233.000	6,710,633.000	
	SWEDBANK AB	89,378	183.500	16,400,863.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	54,382	161.500	8,782,693.000	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	134,020	101.000	13,536,020.000	
	VOLVO AB-A SHS	23,691	215.400	5,103,041.400	
	VOLVO AB-B SHS	141,684	213.550	30,256,618.200	
	SWEDISH MATCH AB	158,329	74.000	11,716,346.000	
	TELE2 AB-B SHS	40,625	126.700	5,147,187.500	
	INDUSTRIVARDEN A	14,273	290.600	4,147,733.800	
	INDUSTRIVARDEN C	11,940	285.800	3,412,452.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	25,219	212.900	5,369,125.100	
	SECURITAS AB-B SHS	19,846	122.450	2,430,142.700	
	INVESTOR AB-B SHS	169,419	218.800	37,068,877.200	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	66,270	176.960	11,727,139.200	
	ASSA ABLOY AB-B	101,025	265.300	26,801,932.500	
	TELIA CO AB	269,954	35.775	9,657,604.350	

	LUNDIN ENERGY AB	20,762	341.000	7,079,842.000	
	BOLIDEN AB	24,047	364.700	8,769,940.900	
	ALFA LAVAL AB	27,930	338.400	9,451,512.000	
	KINNEVIK AB-B	21,449	285.700	6,127,979.300	
	FASTIGHETS AB BALDER	11,401	585.800	6,678,705.800	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,158	137.500	6,209,225.000	
	NIBE INDUSTRIER AB	134,088	109.750	14,716,158.000	
	HEXAGON AB-B SHS	199,293	130.850	26,077,489.050	
	SAGAX AB	18,348	266.200	4,884,237.600	
	EPIROC AB-A	68,223	220.500	15,043,171.500	
	EPIROC AB-B	38,943	184.250	7,175,247.750	
	ESSITY AB-B	55,521	287.900	15,984,495.900	
	EQT AB	30,003	428.300	12,850,284.900	
	EMBRACER GROUP AB	49,142	87.360	4,293,045.120	
	LIFCO AB	25,738	223.200	5,744,721.600	
	EVOLUTION AB	17,528	1,155.200	20,248,345.600	
	NORDEA BANK ABP	310,272	112.740	34,980,065.280	
	INVESTMENT AB LATOUR	14,945	325.000	4,857,125.000	
	SINCH AB	56,299	99.760	5,616,388.240	
スウェーデン・クローナ　小計		3,321,013		584,251,007.090 (7,402,460,260)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,457	1,138.500	11,905,294.500	
	A P MOLLER A/S	527	23,300.000	12,279,100.000	
	AP MOLLER MAERSK A	341	21,580.000	7,358,780.000	
	DANSKE BANK A/S	68,725	120.300	8,267,617.500	
	GENMAB A/S	6,165	2,362.000	14,561,730.000	
	NOVOZYMES-B SHS	19,132	486.400	9,305,804.800	
	ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	813	2,587.000	2,103,231.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	164,285	655.300	107,655,960.500	
	GN STORE NORD A/S	10,448	376.300	3,931,582.400	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	103,382	180.300	18,639,774.600	
	COLOPLAST-B	11,922	1,025.500	12,226,011.000	
	DSV A/S	19,699	1,380.000	27,184,620.000	
	DEMANT A/S	10,739	323.100	3,469,770.900	
	TRYG A/S	35,784	163.500	5,850,684.000	
	PANDORA A/S	9,265	772.200	7,154,433.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	8,984	508.800	4,571,059.200	
	AMBU A/S B	14,156	152.250	2,155,251.000	
	ORSTED A/S	19,205	738.000	14,173,290.000	
デンマーク・クローネ　小計		514,029		272,793,994.400 (4,792,990,482)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	110,226	7.650	843,228.900	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	49,449	11.960	591,410.040	
	FISHER & PAYKEL	57,388	32.120	1,843,302.560	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	262,943	4.470	1,175,355.210	

	MIGHTY RIVER POWER LTD	61,734	6.160	380,281.440	
	MERIDIAN ENERGY LTD	124,162	4.620	573,628.440	
ニュージーランド・ドル　小計		665,902		5,407,206.590 (422,248,763)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	43,202	200.900	8,679,281.800	
	NORSK HYDRO ASA	129,036	69.800	9,006,712.800	
	TELENOR ASA	67,435	140.950	9,504,963.250	
	SCHIBSTED ASA	7,537	311.000	2,344,007.000	
	ORKLA ASA	93,086	86.620	8,063,109.320	
	EQUINOR ASA	94,306	243.700	22,982,372.200	
	YARA INTERNATIONAL ASA	15,193	451.000	6,852,043.000	
	AKER BP ASA	15,217	279.500	4,253,151.500	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	16,683	217.900	3,635,225.700	
	ADEVINTA ASA	22,265	111.250	2,476,981.250	
	DNB BANK ASA	89,596	209.400	18,761,402.400	
	SCHIBSTED ASA	7,445	279.800	2,083,111.000	
ノルウェー・クローネ　小計		601,001		98,642,361.220 (1,283,337,119)	
ユーロ	CRH PLC	79,707	46.250	3,686,448.750	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,228	133.800	2,305,106.400	
	KERRY GROUP PLC-A	14,968	116.050	1,737,036.400	
	KINGSPAN GROUP PLC	14,307	96.020	1,373,758.140	
	UMICORE	23,174	35.600	824,994.400	
	AIR LIQUIDE	46,578	156.080	7,269,894.240	
	AIRBUS SE	57,423	117.920	6,771,320.160	
	AXA SA	188,059	27.405	5,153,756.890	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	67,438	32.370	2,182,968.060	
	ADIDAS AG	18,433	244.250	4,502,260.250	
	ASSICURAZIONI GENERALI	111,777	18.460	2,063,403.420	
	DASSAULT AVIATION SA	2,950	104.000	306,800.000	
	DANONE	62,943	56.900	3,581,456.700	
	SAFRAN SA	33,085	112.640	3,726,694.400	
	INTESA SANPAOLO	1,573,169	2.463	3,874,715.240	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	33,236	97.200	3,230,539.200	
	ACCOR SA	17,380	30.760	534,608.800	
	BOUYGUES	20,222	32.300	653,170.600	
	BNP PARIBAS	109,382	64.000	7,000,448.000	
	THALES SA	10,448	78.780	823,093.440	
	CAPGEMINI SA	15,519	194.450	3,017,669.550	
	UNICREDIT SPA	202,336	14.222	2,877,622.590	
	KONINKLIJKE DSM NV	16,859	181.400	3,058,222.600	
	COMMERZBANK AG	106,215	7.697	817,536.850	
	EIFFAGE	8,477	91.660	777,001.820	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	43,525	36.555	1,591,056.370	
	UNITED INTERNET	9,882	34.730	343,201.860	

FUCHS PETROLUB SE PREF	5,546	39.520	219,177.920	
PUBLICIS GROUPE	24,124	59.480	1,434,895.520	
FAURECIA	10,774	43.910	473,086.340	
IBERDROLA SA	560,605	10.020	5,617,262.100	
ENI SPA	241,813	12.684	3,067,156.090	
JERONIMO MARTINS	33,135	20.400	675,954.000	
KESKO OYJ-B	30,018	27.820	835,100.760	
KBC GROUPE	26,256	79.960	2,099,429.760	
HANNOVER RUECK SE	5,321	174.350	927,716.350	
WARTSILA OYJ	48,612	12.470	606,191.640	
L'OREAL	24,674	394.650	9,737,594.100	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	27,196	702.700	19,110,629.200	
GEA GROUP AG	16,492	44.700	737,192.400	
BOLLORE	70,807	4.816	341,006.510	
MEDIOBANCA SPA	57,442	10.375	595,960.750	
MICHELIN(CGDE)-B	15,910	152.500	2,426,275.000	
CONTINENTAL AG	11,972	96.150	1,151,107.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	96,499	53.510	5,163,661.490	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	21,206	19.455	412,562.730	
OMV AG	12,069	54.060	652,450.140	
VERBUND AG	6,916	92.500	639,730.000	
PERNOD-RICARD	20,447	204.400	4,179,366.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	15,912	89.020	1,416,486.240	
RENAULT SA	19,019	34.025	647,121.470	
REPSOL SA	150,289	10.780	1,620,115.420	
REMY COINTREAU	1,847	200.000	369,400.000	
MERCK KGAA	12,364	198.150	2,449,926.600	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	52,033	63.600	3,309,298.800	
RWE AG	64,426	34.630	2,231,072.380	
SEB SA	2,439	136.600	333,167.400	
SOCIETE GENERALE-A	81,457	33.015	2,689,302.850	
VINCI S.A.	52,174	94.360	4,923,138.640	
SODEXO	9,325	80.660	752,154.500	
SOFINA	1,382	400.800	553,905.600	
SOLVAY SA	6,931	105.850	733,646.350	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	52,855	160.700	8,493,798.500	
VIVENDI SE	68,746	11.790	810,515.340	
SAP SE	102,313	120.740	12,353,271.620	
TELEFONICA S.A	537,523	4.024	2,162,992.550	
TOTALENERGIES SE	245,666	46.740	11,482,428.840	
VALEO	25,393	26.840	681,548.120	
E.ON SE	224,204	11.822	2,650,539.680	
VOEST-ALPINE AG	9,875	33.900	334,762.500	
HENKEL AG & CO KGAA	10,366	71.600	742,205.600	
SIEMENS AG-REG	74,723	147.880	11,050,037.240	

UPM-KYMMENE OYJ	55,982	34.010	1,903,947.820	
ING GROEP NV-CVA	374,828	13.086	4,904,999.200	
PUMA AG	10,448	97.160	1,015,127.680	
BAYER AG	94,619	50.040	4,734,734.760	
STORA ENSO OYJ-R SHS	50,185	16.550	830,561.750	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	17,500	75.540	1,321,950.000	
DAIMLER AG	82,551	73.050	6,030,350.550	
BASF SE	89,204	66.090	5,895,492.360	
BEIERSDORF AG	10,342	88.820	918,576.440	
HEIDELBERGCEMENT AG	12,717	62.260	791,760.420	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	18,836	57.660	1,086,083.760	
ASM INTERNATIONAL NV	4,825	340.400	1,642,430.000	
ORANGE	191,727	9.629	1,846,139.280	
SAMPO OYJ-A SHS	49,985	44.150	2,206,837.750	
RANDSTAD NV	10,028	60.360	605,290.080	
ALLIANZ SE	40,167	223.400	8,973,307.800	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	268,636	4.487	1,205,369.730	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	106,390	30.530	3,248,086.700	
HERMES INTL	3,076	1,374.000	4,226,424.000	
ENDESA S.A.	37,354	19.325	721,866.050	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	70,248	7.268	510,562.460	
ERSTE GROUP BANK AG	31,546	42.560	1,342,597.760	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	13,389	272.350	3,646,494.150	
ARCELOR MITTAL (NL)	63,979	30.190	1,931,526.010	
DASSAULT SYSTEMES SA	64,596	46.580	3,008,881.680	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	22,877	24.180	553,165.860	
HEINEKEN NV	26,670	100.950	2,692,336.500	
AKZO NOBEL	18,717	95.900	1,794,960.300	
ASML HOLDING NV	40,418	622.300	25,152,121.400	
AEGON NV	189,323	4.869	921,813.680	
VOLKSWAGEN AG	3,153	270.600	853,201.800	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,903	187.760	3,361,467.280	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	642,242	5.577	3,581,783.630	
KERING	7,293	694.100	5,062,071.300	
CNP ASSURANCES	13,987	21.780	304,636.860	
FORTUM OYJ	40,820	25.230	1,029,888.600	
AGEAS	17,055	49.180	838,764.900	
UCB SA	12,778	93.180	1,190,654.040	
NEMETSCHEK SE	4,841	88.960	430,655.360	
CARREFOUR SA	61,189	17.670	1,081,209.630	
NATURGY ENERGY GROUP SA	16,289	28.720	467,820.080	
NOKIA OYJ	553,292	5.450	3,015,441.400	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	87,657	33.310	2,919,854.670	

WOLTERS KLUWER-CVA	26,629	95.220	2,535,613.380	
SANOFI	111,159	88.850	9,876,477.150	
STMICROELECTRONICS NV	70,730	42.430	3,001,073.900	
ELISA OYJ	13,642	52.860	721,116.120	
BANCO SANTANDER SA	1,676,783	3.115	5,223,179.040	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	46,237	17.855	825,561.630	
QIAGEN N.V.	24,503	43.760	1,072,251.280	
DEUTSCHE BANK AG-REG	210,395	12.374	2,603,427.730	
BMW VORZUG	6,957	81.500	566,995.500	
ENEL SPA	794,833	6.930	5,508,192.690	
COLRUYT NV	4,673	37.650	175,938.450	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	324,140	15.528	5,033,245.920	
SARTORIUS AG	2,686	494.800	1,329,032.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	7,151	42.760	305,776.760	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	126,618	38.540	4,879,857.720	
RATIONAL AG	479	805.600	385,882.400	
CARL ZEISS MEDITEC AG	3,501	159.500	558,409.500	
BECHTLE AG	7,533	56.920	428,778.360	
KONINKLIJKE KPN NV	341,447	2.760	942,393.720	
EUROFINS SCIENTIFIC	13,943	94.160	1,312,872.880	
TELEPERFORMANCE	5,918	363.700	2,152,376.600	
DEUTSCHE BOERSE AG	19,467	146.800	2,857,755.600	
EURAZEO	3,008	77.400	232,819.200	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,714	97.680	1,046,543.520	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,667	82.600	881,094.200	
INDITEX	104,255	27.680	2,885,778.400	
ESSILORLUXOTTICA	27,852	174.360	4,856,274.720	
SNAM SPA	198,963	5.164	1,027,444.930	
CREDIT AGRICOLE SA	128,627	13.528	1,740,066.050	
ORPEA	4,932	87.160	429,873.120	
ENAGAS	23,477	19.870	466,487.990	
WENDEL	2,220	104.500	231,990.000	
TENARIS SA	52,985	9.748	516,497.780	
TELECOM ITALIA SPA	1,264,710	0.449	567,854.790	
ATLANTIA SPA	45,718	16.515	755,032.770	
PROXIMUS	13,739	17.365	238,577.730	
TERNA SPA	152,700	6.858	1,047,216.600	
BIOMERIEUX	4,612	106.850	492,792.200	
GRIFOLS SA	30,687	16.550	507,869.850	
FERROVIAL SA	46,437	26.840	1,246,369.080	
LANXESS AG	7,194	57.400	412,935.600	
NESTE OYJ	43,290	44.090	1,908,656.100	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	19,572	25.700	503,000.400	
RECORDATI SPA	10,303	54.080	557,186.240	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55,304	12.105	669,454.920	

MTU AERO ENGINES HOLDING AG	5,765	192.500	1,109,762.500	
KONE OYJ	31,956	61.640	1,969,767.840	
ELIA GROUP	2,862	110.500	316,251.000	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2,916	394.400	1,150,070.400	
ENGIE	177,463	13.334	2,366,291.640	
ALSTOM	28,533	33.070	943,586.310	
ELECTRICITE DE FRANCE	41,549	10.170	422,553.330	
IPSEN SA	3,646	82.020	299,044.920	
ARKEMA SA	7,025	128.850	905,171.250	
LEGRAND SA	27,223	98.320	2,676,565.360	
AMPLIFON SPA	11,372	41.660	473,757.520	
ADP	2,313	122.650	283,689.450	
ORION OYJ	8,106	35.180	285,169.080	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	38,282	9.434	361,152.380	
SYMRISE AG	11,606	120.650	1,400,263.900	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	24,228	49.080	1,189,110.240	
PRYSMIAN SPA	21,822	32.850	716,852.700	
DIASORIN SPA	2,223	148.100	329,226.300	
CAIXABANK	485,422	2.692	1,306,756.020	
BUREAU VERITAS SA	29,810	27.430	817,688.300	
GETLINK	38,302	14.380	550,782.760	
EDP RENOVAVEIS SA	27,972	19.350	541,258.200	
SUEZ SA	34,245	19.880	680,790.600	
AMADEUS IT GROUP SA	46,518	62.080	2,887,837.440	
BRENNTAG SE	16,310	75.520	1,231,731.200	
EVONIK INDUSTRIES AG	23,340	28.780	671,725.200	
EDENRED	24,865	43.120	1,072,178.800	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	98,385	2.468	242,814.180	
LEG IMMOBILIEN SE	6,113	116.500	712,164.500	
KION GROUP AG	7,508	92.960	697,943.680	
VONOVIA SE	70,086	46.740	3,275,819.640	
KNORR-BREMSE AG	6,860	87.760	602,033.600	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28,475	60.980	1,736,405.500	
FERRARI NV	12,050	221.000	2,663,050.000	
CNH INDUSTRIAL NV	106,155	13.980	1,484,046.900	
AROUNDTOWN SA	106,018	5.436	576,313.840	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,092	38.470	311,299.240	
MONCLER SPA	21,477	60.620	1,301,935.740	
NEXI SPA	43,586	13.370	582,744.820	
PROSUS NV	90,530	70.620	6,393,228.600	
JDE PEET'S BV	7,308	27.630	201,920.040	
SIEMENS ENERGY AG	35,761	22.050	788,530.050	
INPOST SA	20,395	8.256	168,381.120	
EURONEXT NV	9,619	85.100	818,576.900	
IMCD NV	4,889	161.650	790,306.850	

	WORLDLINE SA	23,570	48.710	1,148,094.700	
	NN GROUP NV	28,124	50.200	1,411,824.800	
	FINECOBANK SPA	65,274	15.200	992,164.800	
	ARGENX SE	4,255	266.000	1,131,830.000	
	IBERDROLA SA-RTS	560,605	0.166	93,060.430	
	UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	75,904	23.045	1,749,207.680	
	DAIMLER TRUCK HOLDING AG	43,184	33.490	1,446,232.160	
	ZALANDO SE	22,986	64.500	1,482,597.000	
	STELLANTIS NV	196,248	17.864	3,505,774.270	
	AENA SME SA	7,076	145.600	1,030,265.600	
	CELLNEX TELECOM SAU	48,760	42.000	2,047,920.000	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	16,029	42.350	678,828.150	
	ABN AMRO BANK NV	34,382	14.038	482,654.510	
	EXOR NV	9,966	75.260	750,041.160	
	SCOUT24 SE	9,670	60.000	580,200.000	
	COVESTRO AG	19,158	56.260	1,077,829.080	
	HELLOFRESH SE	16,990	56.660	962,653.400	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	73,896	56.730	4,192,120.080	
	POSTE ITALIANE SPA	55,749	11.665	650,312.080	
	AMUNDI SA	5,924	72.150	427,416.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	44,754	9.836	440,200.340	
	ADYEN NV	1,920	1,965.600	3,773,952.000	
	UNIPER SE	10,427	40.680	424,170.360	
	DELIVERY HERO SE	16,645	81.940	1,363,891.300	
ユーロ　小計		18,995,345		485,448,189.910 (63,448,078,421)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	164,000	16.120	2,643,680.000	
	CLP HOLDINGS LTD	162,000	77.850	12,611,700.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	53,500	48.850	2,613,475.000	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	117,340	458.200	53,765,188.000	
	MTR CORP	137,500	42.750	5,878,125.000	
	HANG SENG BANK LTD	75,800	154.600	11,718,680.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	120,450	33.000	3,974,850.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	146,000	48.700	7,110,200.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,175,456	12.100	14,223,017.600	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	186,000	40.550	7,542,300.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	353,500	28.700	10,145,450.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	163,066	30.250	4,932,746.500	
	SINO LAND CO	255,400	9.750	2,490,150.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	138,500	95.000	13,157,500.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	49,500	45.900	2,272,050.000	

	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	132,000	139.000	18,348,000.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	166,000	19.000	3,154,000.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	217,200	12.760	2,771,472.000	
	AIA GROUP LTD	1,184,627	80.000	94,770,160.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	445,000	10.620	4,725,900.000	
	SANDS CHINA LTD	252,000	17.260	4,349,520.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	133,000	29.200	3,883,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	104,200	20.350	2,120,470.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	151,750	38.750	5,880,312.500	
	ESR CAYMAN LTD	203,800	26.750	5,451,650.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	230,000	7.710	1,773,300.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	150,600	21.000	3,162,600.000	
	WH GROUP LTD	897,000	5.250	4,709,250.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	287,832	54.050	15,557,319.600	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	219,832	49.500	10,881,684.000	
香港・ドル　小計		8,072,853		336,618,350.200 (4,978,585,399)	
合計		107,780,901		632,160,531,530 (632,160,531,530)	

（２）株式以外の有価証券

2022年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	86,481.000	971,181.630	
		GOODMAN GROUP	158,185.000	3,837,568.100	
		GPT GROUP	207,292.000	1,129,741.400	
		MIRVAC GROUP	414,125.000	1,192,680.000	
		SCENTRE GROUP	479,376.000	1,519,621.920	
		STOCKLAND	243,481.000	1,042,098.680	
		VICINITY CENTRES	371,711.000	650,494.250	
	オーストラリア・ドル　小計		1,960,651.000	10,343,385.980 (857,777,000)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	398,606.000	1,147,985.280	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	545,177.000	1,079,450.460	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192,300.000	351,909.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	187,300.000	333,394.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,323,383.000	2,912,738.740	

				(247,932,322)	
投資信託受益証券　合計			3,284,034	1,105,709,322 (1,105,709,322)	
投資証券	アメリカ・ドル	AGNC INVESTMENT CORP	44,320.000	679,868.800	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,788.000	2,865,422.160	
		AMERICAN TOWER CORP	44,520.000	11,771,533.200	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	150,150.000	1,196,695.500	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,356.000	3,320,835.840	
		BOSTON PROPERTIES INC	14,801.000	1,851,753.110	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,440.000	1,727,715.600	
		CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	42,173.000	8,041,125.910	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,360.000	4,356,806.400	
		DUKE REALTY TRUST	38,708.000	2,328,286.200	
		EQUINIX INC	8,727.000	6,670,307.910	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,787.000	1,269,274.800	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,078.000	3,235,475.040	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,132.000	2,115,662.640	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	13,719.000	2,860,548.690	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	49,946.000	1,789,565.180	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	75,616.000	1,342,184.000	
		INVITATION HOMES INC	59,509.000	2,537,463.760	
		IRON MOUNTAIN INC	28,440.000	1,327,579.200	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	54,080.000	1,271,420.800	
		MID AMERICA	11,699.000	2,511,775.300	
		PROLOGIS INC	72,318.000	11,066,100.360	
		PUBLIC STORAGE	15,276.000	5,496,610.320	
		REALTY INCOME CORP	52,672.000	3,772,895.360	
		REGENCY CENTERS CORP	14,665.000	1,118,646.200	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	10,551.000	3,614,561.580	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	31,871.000	5,127,406.480	
		SUN COMMUNITIES INC	10,735.000	2,093,325.000	
		UDR INC	30,930.000	1,794,249.300	
		VENTAS INC	40,408.000	2,146,472.960	
		VICI PROPERTIES INC	64,021.000	1,838,042.910	
		VORNADO REALTY TRUST	13,103.000	597,627.830	
		WELLTOWER INC	40,744.000	3,566,729.760	
		WEYERHAEUSER CO	72,184.000	2,898,187.600	
		WP CAREY INC	19,446.000	1,558,596.900	
	アメリカ・ドル　小計		1,248,273.000	111,760,752.600 (12,890,485,204)	
	イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	75,770.000	416,886.540	

		LAND SECURITIES GROUP PLC	74,028.000	572,976.720	
		SEGRO PLC	120,360.000	1,579,123.200	
	イギリス・ポンド　小計		270,158.000	2,568,986.460 (402,380,349)	
	カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,220.000	468,786.600	
		RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13,467.000	304,488.870	
	カナダ・ドル　小計		21,687.000	773,275.470 (70,429,930)	
	ユーロ	COVIVIO	4,663.000	346,833.940	
		GECINA SA	4,763.000	582,276.750	
		KLEPIERRE	17,099.000	392,251.060	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	12,920.000	864,477.200	
	ユーロ　小計		39,445.000	2,185,838.950 (285,689,151)	
	香港・ドル	LINK REIT	199,700.000	13,559,630.000	
	香港・ドル　小計		199,700.000	13,559,630.000 (200,546,928)	
投資証券　合計			1,779,263	13,849,531,562 (13,849,531,562)	
合計				14,955,240,884 (14,955,240,884)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率（%）	組入投資信託受益証券時価比率（%）	組入投資証券時価比率（%）	有価証券の合計金額に対する比率（%）
アメリカ・ドル	株式　606銘柄	70.32	－	－	73.64
	投資証券　35銘柄	－	－	1.95	
イギリス・ポンド	株式　81銘柄	4.33	－	－	4.48
	投資証券　3銘柄	－	－	0.06	
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	0.13	－	－	0.13
オーストラリア・ドル	株式　56銘柄	1.91	－	－	2.07
	投資信託受益証券　7銘柄	－	0.13	－	
カナダ・ドル	株式　87銘柄	3.45	－	－	3.53
	投資証券　2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式　14銘柄	0.28	－	－	0.32
	投資信託受益証券　4銘柄	－	0.04	－	
スイス・フラン	株式　41銘柄	2.97	－	－	3.02
スウェーデン・クローナ	株式　44銘柄	1.12	－	－	1.14
デンマーク・クローネ	株式　18銘柄	0.73	－	－	0.74
ニュージーランド・ドル	株式　6銘柄	0.06	－	－	0.07
ノルウェー・クローネ	株式　12銘柄	0.19	－	－	0.20

ユーロ	株式	229銘柄	9.62	－	－	9.85
	投資証券	4銘柄	－	－	0.04	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.76	－	－	0.80
	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。

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1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,904,156,504
投資証券	195,700,182,500
未収配当金	1,419,996,639
前払金	25,707,000
差入委託証拠金	225,520,500
流動資産合計	201,275,563,143
資産合計	201,275,563,143
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	44,660,070
未払金	180,308,587
未払解約金	537,125,000
流動負債合計	762,093,657
負債合計	762,093,657
純資産の部	
元本等	
元本	83,254,722,505
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	117,258,746,981
元本等合計	200,513,469,486
純資産合計	200,513,469,486
負債純資産合計	201,275,563,143

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	35,959,661,943円
同期中追加設定元本額	105,227,960,775円
同期中一部解約元本額	57,932,900,213円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	208,011円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,136,753円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	3,974,793円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	1,829,324円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,111,558円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,077,542円
たわらノーロード　国内リート	4,588,435,169円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	674,335,780円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,363,191,883円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	25,912,285円
たわらノーロード　バランス（標準型）	480,511,247円
たわらノーロード　バランス（積極型）	525,451,565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）	122,272,681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）	314,529,284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）	204,111,892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）	266,655,334円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,181,578円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	27,153,516円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,268,564円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,508,237円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	11,690,890円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	399,062,510円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,233,255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）	158,939,893円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	330,992,158円
投資のソムリエ	9,219,995,245円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	552,579,958円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	128,072,701円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	323,195,237円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,267,740,330円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	18,010,184円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	8,778,859円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,599,443円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	65,270,573円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,130,495,900円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	113,395,926円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	18,593,540円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,702,619円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,580,747円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	292,005円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	45,893,263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）	81,135,682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）	729,870,241円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	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）	391,702,812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）	149,745,793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）	205,500,206円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	79,858,367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）	186,933,447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Ⅱ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	18,965,480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）	354,701,898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）	582,031,988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）	408,114,372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）	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）	406,978,200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）	585,402,889円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	4,001,160,845円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	241,903,198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）	652,016,939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）	5,122,651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）	141,775,644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）	2,057,549,518円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,573,742,809円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	38,099,234,216円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,546,827,783円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	107,671,833円
計	83,254,722,505円
２．　受益権の総数	83,254,722,505口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、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。運用評価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	2022年1月11日現在

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△10,107,742,360
合計	△10,107,742,360

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,712,560,500	－	4,668,157,500	△44,403,000
合計	4,712,560,500	－	4,668,157,500	△44,403,000

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4084円 (24,084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

2022年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	6,846	1,435,606,200	
	ＧＬＰ投資法人	57,253	10,712,036,300	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	16,945	2,602,752,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,068	931,138,000	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	8,224	1,377,520,000	
	いちごオフィスリート投資法人	14,485	1,186,321,500	
	いちごホテルリート投資法人	2,929	226,411,700	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,421	3,905,004,500	
	アドバンス・レジデンス投資法人	17,675	6,539,750,000	
	イオンリート投資法人	20,789	3,326,240,000	
	インヴィンシブル投資法人	77,806	2,808,796,600	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,560	512,284,000	
	オリックス不動産投資法人	35,222	6,118,061,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	12,275	1,436,175,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	5,469	3,850,176,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12,074	2,582,628,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	7,058	1,974,122,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	7,959	2,594,634,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,004	508,107,600	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,599	681,398,300	
	ザイマックス・リート投資法人	2,566	301,505,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	54,156	2,983,995,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	16,403	2,204,563,200	

	ジャパンリアルエステイト投資法人	17,678	11,402,310,000	
	スターアジア不動産投資法人	18,269	1,176,523,600	
	スターツプロシード投資法人	2,753	632,639,400	
	タカラレーベン不動産投資法人	6,971	821,880,900	
	トーセイ・リート投資法人	3,694	483,544,600	
	ヒューリックリート投資法人	16,491	2,818,311,900	
	フロンティア不動産投資法人	6,197	3,030,333,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	3,770	593,775,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	1,656	216,936,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	39,795	5,443,956,000	
	ラサールロジポート投資法人	21,641	4,165,892,500	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	6,893	1,208,342,900	
	阪急阪神リート投資法人	7,985	1,255,242,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,571	4,093,733,000	
	三菱地所物流リート投資法人	4,492	2,272,952,000	
	産業ファンド投資法人	25,096	5,235,025,600	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	4,148	496,515,600	
	森トラスト総合リート投資法人	12,634	1,796,554,800	
	森ヒルズリート投資法人	20,787	3,163,781,400	
	星野リゾート・リート投資法人	2,962	1,951,958,000	
	積水ハウス・リート投資法人	53,659	4,496,624,200	
	大江戸温泉リート投資法人	2,853	198,568,800	
	大和ハウスリート投資法人	26,543	9,223,692,500	
	大和証券オフィス投資法人	3,737	2,627,111,000	
	大和証券リビング投資法人	23,887	2,761,337,200	
	投資法人みらい	21,413	1,062,084,800	
	東海道リート投資法人	1,354	147,044,400	
	東急リアル・エステート投資法人	11,852	2,319,436,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,104	3,992,016,000	
	日本ビルファンド投資法人	20,034	13,282,542,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	11,617	4,455,119,500	
	日本プロロジスリート投資法人	28,921	10,874,296,000	
	日本リート投資法人	5,455	2,151,997,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	11,550	3,967,425,000	
	日本都市ファンド投資法人	89,193	8,696,317,500	
	福岡リート投資法人	9,143	1,523,223,800	
	平和不動産リート投資法人	11,452	1,715,509,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人	57,165	9,146,400,000	
投資証券　合計		1,028,201	195,700,182,500	
合計			195,700,182,500	

（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）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	230,211,798
コール・ローン	1,256,187,609
投資信託受益証券	8,111,395,615
投資証券	72,569,545,504
派生商品評価勘定	195,778
未収入金	99,067,128
未収配当金	268,605,009
流動資産合計	82,535,208,441
資産合計	82,535,208,441
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,542
未払解約金	1,214,032,000
流動負債合計	1,214,041,542
負債合計	1,214,041,542
純資産の部	
元本等	
元本	46,542,419,917
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	34,778,746,982
元本等合計	81,321,166,899
純資産合計	81,321,166,899
負債純資産合計	82,535,208,441

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	50,788,631,457円
同期中追加設定元本額	64,155,936,325円
同期中一部解約元本額	68,402,147,865円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	85,645,562円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	54,351,831円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,460,463円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	18,829,607円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	65,840,002円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	30,484,484円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	18,414,514円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	17,841,511円
たわらノーロード　先進国リート	10,719,148,176円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,520,052,676円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	361,553,589円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,889,196,023円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	17,545,373円

たわらノーロード　バランス（標準型）	326,037,631円
たわらノーロード　バランス（積極型）	658,714,257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）	54,145,304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）	140,619,523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）	267,211,759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）	4,155,844円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,959,216円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,063,939円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	845,647,717円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,973,268円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	599,255,242円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	49,790,786円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	186,908,935円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	242,613,410円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	471,486,347円
投資のソムリエ	12,655,584,340円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	758,484,931円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	187,052,892円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	534,439,635円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,750,796,470円
ワールドアセットバランス（基本コース）	452,570,498円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,309,215,603円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	22,194,879円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	11,054,543円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,295,191円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	79,130,892円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,858,416,970円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	160,285,706円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	22,824,757円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	9,485,779円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,100,049円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	362,289円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	322,225,898円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	216,388,690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）	88,594,697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）	221,196,746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）	90,910,554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）	84,172,890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）	55,236,135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）	55,470,683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）	87,048,396円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	450,303,122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）	87,157,404円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	332,119,035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）	149,119,142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）	7,028,482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）	89,989,517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）	211,752,655円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	3,049,525,145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）	436,961,423円
計	46,542,419,917円
２．　受益権の総数	46,542,419,917口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	84,843,349
投資証券	2,596,282,037
合計	2,681,125,386

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	196,841,285	－	196,655,049	186,236
アメリカ・ドル	150,124,000	－	149,939,240	184,760
イギリス・ポンド	11,747,250	－	11,747,032	218
オーストラリア・ドル	7,047,435	－	7,048,897	△1,462
シンガポール・ドル	4,255,400	－	4,255,880	△480
香港・ドル	23,667,200	－	23,664,000	3,200
合計	196,841,285	－	196,655,049	186,236

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場の

うち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
・計算日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
２．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
３．　換算において円未満の端数は切捨てております。
※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7472円 (17,472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

2022年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	352,400.000	278,396.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	635,100.000	425,517.000	
		PRIME US REIT	287,100.000	236,857.500	
	アメリカ・ドル　小計		1,347,300.000	940,770.500 (108,508,469)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	166,637.000	624,888.750	
		ARENA REIT	143,755.000	695,774.200	
		AVENTUS RETAIL PROPERTY FUND LTD	170,002.000	613,707.220	
		BWP TRUST	216,007.000	898,589.120	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	265,100.000	885,434.000	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	232,555.000	930,220.000	
		CENTURIA OFFICE REIT	177,824.000	419,664.640	
		CHARTER HALL GROUP	199,430.000	3,829,056.000	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	255,842.000	1,279,210.000	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	218,314.000	938,750.200	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	136,634.000	546,536.000	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	602,990.000	521,586.350	
		DEXUS	461,085.000	5,177,984.550	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	100,519.000	341,764.600	

		GDI PROPERTY GROUP	194,023.000	214,395.410	
		GOODMAN GROUP	724,567.000	17,577,995.420	
		GPT GROUP	820,575.000	4,472,133.750	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	120,588.000	511,293.120	
		HOME CONSORTIUM LTD	89,165.000	705,295.150	
		HOMECO DAILY NEEDS REIT	244,384.000	371,463.680	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	75,497.000	271,034.230	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	153,514.000	950,251.660	
		IRONGATE GROUP	208,545.000	355,569.220	
		MIRVAC GROUP	1,689,833.000	4,866,719.040	
		NATIONAL STORAGE REIT	456,340.000	1,204,737.600	
		RURAL FUNDS GROUP	154,845.000	481,567.950	
		SCENTRE GROUP	2,204,206.000	6,987,333.020	
		SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	469,760.000	1,376,396.800	
		STOCKLAND	1,022,442.000	4,376,051.760	
		VICINITY CENTRES	1,652,007.000	2,891,012.250	
		WAYPOINT REIT LTD	302,583.000	838,154.910	
	オーストラリア・ドル　小計		13,929,568.000	66,154,570.600 (5,486,198,540)	
	シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	189,395.000	268,940.900	
		ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	541,780.000	479,475.300	
		ASCENDAS REAL ESTATE INVT	1,437,460.000	4,139,884.800	
		ASCOTT RESIDENCE TRUST	868,216.000	885,580.320	
		CAPITALAND CHINA TRUST	465,680.000	549,502.400	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,137,909.000	4,233,059.820	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	305,000.000	350,750.000	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	77,000.000	57,750.000	
		ESR REIT	1,155,430.000	548,829.250	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	531,500.000	316,242.500	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	525,400.000	162,874.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	451,100.000	1,010,464.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,238,464.000	1,795,772.800	
		IREIT GLOBAL	186,300.000	121,095.000	
		KEPPEL DC REIT	558,900.000	1,296,648.000	
		KEPPEL REIT	822,000.000	928,860.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	401,200.000	345,032.000	

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	931,800.000	1,705,194.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	827,520.000	2,151,552.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,274,020.000	2,267,755.600	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	910,500.000	983,340.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	975,155.000	429,068.200	
		PARKWAY LIFE REIT	160,500.000	802,500.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	276,800.000	231,128.000	
		SPH REIT	381,700.000	368,340.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	575,500.000	368,320.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	917,990.000	1,395,344.800	
	シンガポール・ドル　小計		19,124,219.000	28,193,304.190 (2,399,814,053)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	126,540.000	320,146.200	
	ユーロ　小計		126,540.000	320,146.200 (41,843,108)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	624,000.000	5,073,120.000	
	香港・ドル　小計		624,000.000	5,073,120.000 (75,031,445)	
投資信託受益証券　合計			35,151,627	8,111,395,615 (8,111,395,615)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	37,280.000	821,651.200	
		AGREE REALTY CORP	29,805.000	2,057,439.150	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	30,523.000	742,319.360	
		ALEXANDER'S INC.	849.000	226,258.500	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	60,096.000	12,489,150.720	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,917.000	98,635.020	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	22,182.000	850,679.700	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	59,629.000	3,312,987.240	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	50,768.000	472,142.400	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	121,797.000	5,005,856.700	
		AMERICOLD REALTY TRUST	114,367.000	3,468,751.110	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	67,297.000	3,611,829.990	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	62,620.000	449,611.600	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	90,382.000	1,493,110.640	

		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,096.000	363,641.040	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,030.000	175,238.700	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	59,563.000	14,809,744.320	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH REIT INC	10,529.000	277,649.730	
		BOSTON PROPERTIES INC	60,515.000	7,571,031.650	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	24,777.000	128,344.860	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	72,425.000	1,055,956.500	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	127,231.000	3,309,278.310	
		BROADSTONE NET LEASE INC	68,734.000	1,649,616.000	
		BRT APARTMENTS CORP	4,397.000	93,963.890	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	43,509.000	7,200,304.410	
		CARETRUST REIT INC	41,016.000	948,700.080	
		CEDAR REALTY TRUST INC	5,320.000	132,414.800	
		CENTERSPACE	5,984.000	609,769.600	
		CHATHAM LODGING TRUST	19,480.000	261,811.200	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	4,068.000	31,242.240	
		CITY OFFICE REIT INC	17,708.000	358,764.080	
		CLIPPER REALTY INC	5,086.000	48,367.860	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	9,637.000	460,359.490	
		COREPOINT LODGING INC	15,811.000	247,600.260	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	47,752.000	1,367,139.760	
		COUSINS PROPERTIES INC	63,615.000	2,630,480.250	
		CTO REALTY GROUTH INC	2,436.000	152,737.200	
		CUBESMART	93,061.000	4,860,576.030	
		CYRUSONE INC	54,472.000	4,863,804.880	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	88,858.000	860,145.440	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	120,997.000	19,267,562.280	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	219,008.000	1,653,510.400	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	96,491.000	320,350.120	
		DOUGLAS EMMETT INC	75,077.000	2,702,772.000	
		DUKE REALTY TRUST	162,241.000	9,758,796.150	
		EAST GROUP	17,446.000	3,659,647.420	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	35,986.000	821,200.520	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	58,456.000	576,376.160	
		EPR PROPERTIES	31,851.000	1,524,707.370	
		EQUINIX INC	38,402.000	29,351,800.660	

EQUITY COMMONWEALTH	51,392.000	1,370,110.720	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	72,647.000	5,840,818.800	
EQUITY RESIDENTIAL	145,436.000	13,042,700.480	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	51,748.000	1,456,706.200	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27,725.000	9,565,679.500	
EXTRA SPACE STORAGE INC	57,056.000	11,896,746.560	
FARMLAND PARTNERS INC	11,176.000	128,412.240	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	29,747.000	3,991,154.990	
FIRST INDUSTRIAL RT	55,850.000	3,444,828.000	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	32,704.000	923,233.920	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	47,392.000	289,565.120	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	97,174.000	4,502,071.420	
GEO GROUP INC	49,986.000	385,891.920	
GETTY REALTY CORP	16,266.000	512,541.660	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,199.000	374,047.390	
GLADSTONE LAND CORP	12,766.000	401,618.360	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	24,773.000	438,234.370	
GLOBAL NET LEASE INC	43,462.000	677,137.960	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	62,988.000	1,990,420.800	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	94,602.000	3,123,758.040	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	229,552.000	8,224,848.160	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,586.000	163,901.520	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	44,570.000	2,086,321.700	
HOST HOTELS & RESORTS INC	306,581.000	5,441,812.750	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	64,979.000	1,731,690.350	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	44,309.000	1,073,163.980	
INDUS REALTY TRUST INC	3,241.000	259,020.720	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	27,450.000	692,563.500	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,235.000	2,179,031.500	
INVITATION HOMES INC	254,266.000	10,841,902.240	
IRON MOUNTAIN INC	123,413.000	5,760,918.840	
JBG SMITH PROPERTIES	48,561.000	1,449,545.850	
KILROY REALTY CORP	44,889.000	3,178,590.090	
KIMCO REALTY	262,007.000	6,584,235.910	

KITE REALTY GROUP TRUST	93,526.000	2,044,478.360	
LIFE STORAGE INC	35,211.000	4,958,060.910	
LTC PROPERTIES INC	16,294.000	579,251.700	
LXP INDUSTRIAL TRUST	120,663.000	1,717,034.490	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	253,383.000	5,957,034.330	
MID AMERICA	49,055.000	10,532,108.500	
MONMOUTH RE INVEST CP - CL A	41,499.000	868,574.070	
NATIONAL HEALTH INVS INC	19,441.000	1,194,649.450	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	75,278.000	3,576,457.780	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	35,032.000	2,277,080.000	
NETSTREIT CORP	16,118.000	370,875.180	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	9,570.000	761,963.400	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	19,997.000	552,917.050	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	102,347.000	3,186,062.110	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,149.000	281,629.440	
ORION OFFICE REIT INC	22,152.000	390,761.280	
PARAMOUNT GROUP INC	74,534.000	700,619.600	
PARK HOTELS & RESORTS INC	100,932.000	1,908,624.120	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	55,791.000	1,282,077.180	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	29,075.000	34,599.250	
PHILLIPS EDISON & CO INC	8,740.000	294,712.800	
PHYSICIANS REALTY TRUST	93,927.000	1,781,795.190	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	52,512.000	1,019,783.040	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	14,172.000	398,658.360	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,941.000	111,750.210	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	21,626.000	380,401.340	
PROLOGIS INC	314,981.000	48,198,392.620	
PS BUSINESS PARKS	8,567.000	1,520,556.830	
PUBLIC STORAGE	65,054.000	23,407,730.280	
REALTY INCOME CORP	241,186.000	17,276,153.180	
REGENCY CENTERS CORP	66,145.000	5,045,540.600	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	51,390.000	1,001,591.100	
RETAIL VALUE INC	7,197.000	45,341.100	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	65,035.000	4,875,673.950	
RLJ LODGING TRUST	70,473.000	1,007,059.170	

	RPT REALTY	34,675.000	469,846.250	
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	23,527.000	2,135,545.790	
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	97,201.000	1,384,142.240	
	SAFEHOLD INC	5,809.000	406,223.370	
	SAUL CENTERS INC	5,233.000	282,268.020	
	SERITAGE GROWTH PROPERTIES	13,967.000	177,660.240	
	SERVICE PROPERTIES TRUST	69,161.000	651,496.620	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	140,122.000	22,542,827.360	
	SITE CENTERS CORP	76,211.000	1,216,327.560	
	SL GREEN	28,504.000	2,258,371.920	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	52,745.000	2,540,199.200	
	STAG INDUSTRIAL INC	75,013.000	3,314,824.470	
	STORE CAPITAL CORP	105,197.000	3,560,918.450	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	43,627.000	437,142.540	
	SUN COMMUNITIES INC	49,403.000	9,633,585.000	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	92,957.000	1,073,653.350	
	TANGER FACTORY OUTLET	43,839.000	864,505.080	
	TERRENO REALTY CORP	32,017.000	2,496,685.660	
	THE MACERICH COMPANY	90,739.000	1,620,598.540	
	UDR INC	123,729.000	7,177,519.290	
	UMH PROPERTIES INC	18,773.000	464,819.480	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	5,173.000	306,293.330	
	URBAN EDGE PROPERTIES	46,489.000	907,000.390	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,988.000	252,347.400	
	VENTAS INC	170,006.000	9,030,718.720	
	VERIS RESIDENTIAL INC	33,508.000	649,385.040	
	VICI PROPERTIES INC	267,799.000	7,688,509.290	
	VORNADO REALTY TRUST	68,081.000	3,105,174.410	
	WASHINGTON REIT	35,765.000	920,591.100	
	WELLTOWER INC	185,546.000	16,242,696.840	
	WHITESTONE REIT	23,871.000	242,768.070	
	WP CAREY INC	79,174.000	6,345,796.100	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	48,218.000	853,458.600	
アメリカ・ドル　小計		9,541,365.000	534,022,952.240 (61,594,207,312)	
イギリス・ポンド	AEW UK REIT PLC	88,412.000	101,496.970	
	ASSURA PLC	1,249,385.000	867,073.190	
	BIG YELLOW GROUP PLC	73,707.000	1,182,997.350	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	331,495.000	350,721.710	

		BRITISH LAND CO PLC	401,536.000	2,209,251.070	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	358,705.000	614,102.960	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	252,024.000	244,967.320	
		CUSTODIAN REIT PLC	166,801.000	175,474.650	
		DERWENT LONDON PLC	47,940.000	1,642,424.400	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	278,016.000	240,483.840	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	107,511.000	807,407.610	
		HAMMERSON PLC	1,769,776.000	631,810.030	
		HOME REIT PLC	245,660.000	308,303.300	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	138,492.000	165,359.440	
		INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	321,930.000	2,491,738.200	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	387,394.000	1,041,315.070	
		LXI REIT PLC	292,152.000	428,294.830	
		NEWRIVER REIT PLC	123,080.000	116,310.600	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	220,651.000	233,890.060	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	565,029.000	850,368.640	
		PRS REIT PLC/THE	241,997.000	257,726.800	
		REGIONAL REIT LTD	176,860.000	166,602.120	
		SAFESTORE HOLDINGS LTD	89,861.000	1,213,123.500	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	284,570.000	151,391.240	
		SEGRO PLC	512,171.000	6,719,683.520	
		SHAFTESBURY PLC	121,943.000	760,924.320	
		STANDARD LIFE INVESTMENT PROPERTY INCOME TRUST LTD	168,076.000	136,813.860	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	413,448.000	514,742.760	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	164,321.000	158,569.760	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	799,222.000	1,841,407.480	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	385,365.000	289,023.750	
		UNITE GROUP PLC	170,670.000	1,834,702.500	
		WORKSPACE GROUP PLC	53,726.000	442,433.610	
イギリス・ポンド　小計			11,232,966.000	29,190,936.460 (4,572,176,378)	
イスラエル・シュケル		REIT 1 LTD	77,263.000	1,741,508.020	
イスラエル・シュケル　小計			77,263.000	1,741,508.020	

			(64,054,929)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	26,335.000	1,162,426.900	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	24,219.000	291,354.570	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,708.000	152,696.080	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	10,084.000	555,830.080	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,246.000	93,448.920	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	36,138.000	2,060,950.140	
	CHOICE PROPERTIES REIT	67,608.000	995,865.840	
	COMINAR REAL ESTATE INVT TR	35,472.000	414,312.960	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	19,068.000	342,461.280	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	21,020.000	353,136.000	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	47,146.000	770,365.640	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	10,990.000	270,903.500	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,129.000	61,885.020	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	45,110.000	827,317.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	13,647.000	1,367,019.990	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	67,290.000	888,228.000	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	44,944.240	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	28,129.000	467,503.980	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,287.000	510,818.040	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,112.000	198,094.880	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	7,850.000	138,003.000	
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,776.000	87,713.280	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	44,217.000	595,602.990	
	PLAZA RETAIL REIT	20,611.000	95,222.820	
	PRIMARIS REIT	16,822.000	220,704.640	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	65,960.000	1,491,355.600	
	SLATE GROCERY REIT	15,046.000	223,583.560	

	SLATE OFFICE REIT	11,634.000	58,286.340	
	SMARTCENTRES REIT	29,807.000	940,708.920	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	36,067.000	763,177.720	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	23,442.000	171,595.440	
カナダ・ドル　小計		815,613.000	16,615,517.770 (1,513,341,358)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	358,703.000	570,337.770	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	441,077.000	1,182,086.360	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	653,957.000	788,018.180	
	PRECINCT PROPERTIES	568,924.000	938,724.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	183,035.000	578,390.600	
ニュージーランド・ドル　小計		2,205,696.000	4,057,557.510 (316,854,666)	
ユーロ	AEDIFICA	15,503.000	1,733,235.400	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	75,873.000	1,479,523.500	
	ALTAREA	1,920.000	324,096.000	
	BEFIMMO	10,063.000	339,123.100	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,397.000	272,401.400	
	CARMILA SA	18,210.000	266,594.400	
	COFINIMMO SA	12,586.000	1,762,040.000	
	COIMA RES SPA	9,550.000	69,046.500	
	COVIVIO	20,151.000	1,498,831.380	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,351.000	345,215.490	
	GECINA SA	23,277.000	2,845,613.250	
	HAMBORNER REIT AG	30,393.000	304,841.790	
	HIBERNIA REIT PLC	289,015.000	368,205.110	
	ICADE	13,542.000	888,355.200	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	21,702.000	87,350.550	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	115,046.000	956,607.490	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	10,848.000	300,489.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	181,239.000	307,743.820	
	KLEPIERRE	84,297.000	1,933,773.180	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	26,919.000	139,440.420	
	MERCIALYS	19,457.000	183,090.370	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	142,031.000	1,382,245.690	
	MONTEA SCA	4,281.000	552,249.000	
	NSI NV	7,605.000	274,540.500	
	RETAIL ESTATES	5,140.000	376,248.000	

		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	49,898.000	3,338,675.180	
		VASTNED RETAIL	8,224.000	204,777.600	
		WAREHOUSES DE PAUW	60,110.000	2,333,470.200	
		WERELDHAVE NV	16,102.000	219,792.300	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	7,832.000	381,026.800	
	ユーロ　小計		1,308,562.000	25,468,643.220 (3,328,751,669)	
	韓国・ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	64,730.000	401,973,300.000	
		IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	9,512.000	54,598,880.000	
		JR REIT XXVII	49,274.000	264,108,640.000	
		KORAMCO ENERGY PLUS REIT	11,737.000	76,994,720.000	
		LOTTE REIT CO LTD	48,411.000	264,808,170.000	
		MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	44,752.000	209,886,880.000	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	20,286.000	162,490,860.000	
	韓国・ウォン　小計		248,702.000	1,434,861,450.000 (138,607,616)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	783,070.000	3,147,941.400	
		LINK REIT	890,720.000	60,479,888.000	
		PROSPERITY REIT	514,000.000	1,593,400.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	504,000.000	2,162,160.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	921,000.000	3,039,300.000	
	香港・ドル　小計		3,612,790.000	70,422,689.400 (1,041,551,576)	
投資証券　合計			29,042,957	72,569,545,504 (72,569,545,504)	
合計				80,680,941,119 (80,680,941,119)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券　4銘柄 投資証券　152銘柄	0.13 －	－ 75.74	76.48
イギリス・ポンド	投資証券　34銘柄	－	5.62	5.67
イスラエル・シュケル	投資証券　1銘柄	－	0.08	0.08
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券　31銘柄	6.75	－	6.80

カナダ・ドル	投資証券	31銘柄	－	1.86	1.88
シンガポール・ドル	投資信託受益証券	27銘柄	2.95	－	2.97
ニュージーランド・ドル	投資証券	5銘柄	－	0.39	0.39
ユーロ	投資信託受益証券	1銘柄	0.05	－	4.18
	投資証券	30銘柄	－	4.09	
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	0.09	－	1.38
	投資証券	5銘柄	－	1.28	

（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）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	8,934,046,330
コール・ローン	143,747,600
国債証券	145,138,976,019
未収利息	1,141,228,585
前払費用	784,874,903
流動資産合計	156,142,873,437
資産合計	156,142,873,437
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	26,358
未払金	8,291,987,525
未払解約金	2,627,000
流動負債合計	8,294,640,883
負債合計	8,294,640,883
純資産の部	
元本等	
元本	67,295,763,529
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	80,552,469,025
元本等合計	147,848,232,554
純資産合計	147,848,232,554
負債純資産合計	156,142,873,437

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	73,287,488,629円
同期中追加設定元本額	74,632,546,690円
同期中一部解約元本額	80,624,271,790円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	187,441,030円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,475,678,025円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	112,993,205円
たわらノーロード　バランス（標準型）	312,413,631円
たわらノーロード　バランス（積極型）	131,396,448円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	969,769円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,740,619円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	23,191,485円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,953,060円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	1,953,378円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	50,815,239円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	209,855,895円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	293,236,790円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	599,865,518円
投資のソムリエ	20,330,796,398円
クルーズコントロール	369,397,882円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,217,406,954円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	234,025,550円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	1,840,962円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	7,657,977円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	999,776,372円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	7,011,691,010円
ワールドアセットバランス（基本コース）	546,743,564円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,500,192,882円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	17,792,759円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	8,857,963円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	8,025,985円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	63,686,570円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,391,871,820円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	207,741,564円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	20,356,988円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	7,603,795円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,496,672円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	289,875円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	19,368,820,462円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	532,787,127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）	2,547,220,003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）	589,908,915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）	11,279,855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）	8,819,807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）	168,933,691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）	83,582,380円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,627,653,655円
計	67,295,763,529円
２．　受益権の総数	67,295,763,529口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△5,195,209,645
合計	△5,195,209,645

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	400,000,000	－	400,026,358	△26,358
アメリカ・ドル	400,000,000	－	400,026,358	△26,358
合計	400,000,000	－	400,026,358	△26,358

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.1970円 (21,970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

2022年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	9,061,290.000	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	16,000,000.000	15,068,800.000	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	10,000,000.000	10,004,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	14,800,000.000	15,238,006.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	14,000,000.000	11,875,640.000	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	14,800,000.000	13,372,540.000	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	11,100,000.000	10,975,791.000	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	10,600,000.000	10,143,776.000	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	10,800,000.000	12,006,738.000	
		BRAZIL 7.125 01/20/37	8,300,000.000	9,746,731.500	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	8,200,000.000	10,405,800.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	5,800,000.000	6,926,360.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	9,000,000.000	8,090,775.000	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	13,000,000.000	11,498,890.000	
		COLOMBIA 3.25 04/22/32	11,000,000.000	9,707,500.000	
		COLOMBIA 3.875 02/15/61	6,000,000.000	4,469,940.000	
		COLOMBIA 4.125 02/22/42	8,000,000.000	6,508,000.000	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	6,000,000.000	4,719,720.000	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	10,000,000.000	10,444,950.000	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	11,000,000.000	11,136,400.000	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	18,000,000.000	15,738,120.000	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	11,000,000.000	9,706,400.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	12,000,000.000	11,323,680.000	
		CROATIA 5.5 04/04/23	10,400,000.000	10,963,066.400	
		CROATIA 6.0 01/26/24	12,400,000.000	13,545,536.800	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	9,358,000.000	9,819,405.540	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	12,380,000.000	13,400,978.600	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	13,000,000.000	14,056,510.000	

		HUNGARY 7.625 03/29/41	9,000,000.000	14,393,088.000	
		INDONESIA 1.85 03/12/31	6,000,000.000	5,706,699.240	
		INDONESIA 2.85 02/14/30	6,000,000.000	6,119,255.460	
		INDONESIA 3.05 03/12/51	7,000,000.000	6,520,293.010	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	5,000,000.000	5,292,625.000	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	8,200,000.000	8,752,166.350	
		INDONESIA 3.7 10/30/49	4,000,000.000	4,021,343.880	
		INDONESIA 3.85 10/15/30	8,000,000.000	8,797,367.920	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	6,000,000.000	6,625,651.320	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	9,800,000.000	10,524,991.940	
		INDONESIA 4.2 10/15/50	6,000,000.000	6,556,518.720	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	7,000,000.000	7,718,843.300	
		INDONESIA 4.35 01/11/48	7,000,000.000	7,644,254.240	
		INDONESIA 4.45 04/15/70	5,000,000.000	5,639,205.450	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	10,800,000.000	11,986,143.150	
		INDONESIA 4.75 02/11/29	6,000,000.000	6,860,550.000	
		INDONESIA 5.125 01/15/45	8,400,000.000	10,079,750.520	
		INDONESIA 5.25 01/17/42	10,300,000.000	12,425,362.250	
		INDONESIA 5.35 02/11/49	4,000,000.000	5,023,899.800	
		INDONESIA 5.875 01/15/24	8,200,000.000	8,965,817.680	
		INDONESIA 5.95 01/08/46	6,200,000.000	8,223,006.370	
		INDONESIA 6.75 01/15/44	8,500,000.000	12,114,843.110	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	8,500,000.000	12,532,315.000	
		PANAMA 2.252 09/29/32	13,000,000.000	11,958,310.000	
		PANAMA 3.16 01/23/30	10,000,000.000	10,123,000.000	
		PANAMA 3.75 03/16/25	7,200,000.000	7,549,776.000	
		PANAMA 3.875 03/17/28	8,100,000.000	8,567,127.000	
		PANAMA 4.5 04/01/56	12,000,000.000	12,588,840.000	
		PANAMA 4.5 04/16/50	11,300,000.000	11,890,312.000	
		PANAMA 6.7 01/26/36	9,900,000.000	12,810,600.000	
		PANAMA 7.125 01/29/26	5,800,000.000	6,833,966.000	
		PERU 1.862 12/01/32	8,000,000.000	7,092,080.000	
		PERU 2.392 01/23/26	7,000,000.000	7,038,080.000	
		PERU 2.78 12/01/60	10,000,000.000	8,133,900.000	
		PERU 2.783 01/23/31	17,000,000.000	16,493,740.000	
		PERU 2.844 06/20/30	5,000,000.000	4,959,950.000	
		PERU 3.3 03/11/41	11,000,000.000	10,423,930.000	
		PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	6,858,950.000	
		PERU 5.625 11/18/50	11,000,000.000	14,751,110.000	
		PHILIPPINES 1.648 06/10/31	7,000,000.000	6,598,106.830	
		PHILIPPINES 2.457 05/05/30	7,000,000.000	7,071,126.300	
		PHILIPPINES 2.65 12/10/45	7,000,000.000	6,272,486.710	
		PHILIPPINES 2.95 05/05/45	6,000,000.000	5,612,107.620	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	10,631,834.500	
		PHILIPPINES 3.7 02/02/42	8,000,000.000	8,253,927.760	

		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	8,000,000.000	8,866,054.880	
		PHILIPPINES 3.95 01/20/40	7,800,000.000	8,285,162.650	
		PHILIPPINES 4.2 01/21/24	9,800,000.000	10,424,813.400	
		PHILIPPINES 5.0 01/13/37	5,800,000.000	6,967,541.160	
		PHILIPPINES 6.375 10/23/34	10,000,000.000	13,625,278.000	
		PHILIPPINES 7.75 01/14/31	8,100,000.000	11,575,831.740	
		PHILIPPINES 9.5 02/02/30	7,800,000.000	11,903,962.270	
		ROMANIA 3.0 02/14/31	11,000,000.000	10,945,264.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	12,000,000.000	11,589,384.000	
		ROMANIA 4.875 01/22/24	7,600,000.000	8,075,497.800	
		ROMANIA 5.125 06/15/48	7,600,000.000	8,702,813.200	
		ROMANIA 6.125 01/22/44	7,400,000.000	9,434,045.400	
		RUSSIAN FEDERATION 03/31/30	8,853,000.000	9,967,592.700	
		RUSSIAN FEDERATION 4.25 06/23/27	15,400,000.000	16,476,460.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.375 03/21/29	14,400,000.000	15,624,000.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.75 05/27/26	18,000,000.000	19,497,600.000	
		RUSSIAN FEDERATION 4.875 09/16/23	13,400,000.000	14,077,102.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.1 03/28/35	21,000,000.000	24,044,160.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.25 06/23/47	27,000,000.000	32,447,061.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.625 04/04/42	15,000,000.000	18,667,125.000	
		RUSSIAN FEDERATION 5.875 09/16/43	7,200,000.000	9,371,520.000	
		SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	12,200,000.000	12,256,486.000	
		SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	13,000,000.000	13,283,270.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	8,400,000.000	8,884,260.000	
		SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	8,200,000.000	7,624,975.000	
		SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	11,000,000.000	10,167,300.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	9,400,000.000	10,332,856.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	12,200,000.000	13,405,970.000	
		SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	5,000,000.000	5,028,250.000	

		UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	16,000,000.000	15,328,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	13,000,000.000	13,201,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	8,200,000.000	8,670,270.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	9,200,000.000	9,821,046.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	11,000,000.000	9,235,160.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	12,000,000.000	10,376,460.000	
		UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	5,000,000.000	5,330,200.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	10,000,000.000	10,924,400.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	11,400,000.000	12,507,339.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	10,000,000.000	9,969,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	15,000,000.000	16,452,975.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	14,000,000.000	14,268,380.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	10,400,000.000	10,583,820.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	14,000,000.000	15,596,000.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	9,000,000.000	9,664,740.000	
		UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	9,800,000.000	10,740,408.000	
		UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	15,900,000.000	19,143,759.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,185,591,000.000 (136,746,065,940)	1,258,357,690.470 (145,138,976,019)	
国債証券　合計			136,746,065,940 (136,746,065,940)	145,138,976,019 (145,138,976,019)	
合計				145,138,976,019 (145,138,976,019)	

（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	98.17	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	12,574,166,788
コール・ローン	220,583,847
株式	61,822,496,691
投資信託受益証券	367,848,910
投資証券	45,449,062
派生商品評価勘定	83,558,064
未収入金	10,996,105
未収配当金	49,204,594
差入委託証拠金	3,146,966,995
流動資産合計	78,321,271,056
資産合計	78,321,271,056
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	37,820,228
未払金	5,666
未払解約金	14,476,000
流動負債合計	52,301,894
負債合計	52,301,894
純資産の部	
元本等	
元本	53,702,663,813
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	24,566,305,349
元本等合計	78,268,969,162
純資産合計	78,268,969,162
負債純資産合計	78,321,271,056

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6月30日 至　2022年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	40,461,370,640円
同期中追加設定元本額	28,540,732,892円
同期中一部解約元本額	15,299,439,719円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	7,941,490,956円
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	327,621,048円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,767,493円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	15,082,631円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	52,936,384円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	24,371,202円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,743,299円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	14,345,625円
たわらノーロード　新興国株式	8,658,085,649円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,770,569,833円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,289,202,997円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	21,641,032円
たわらノーロード　バランス（標準型）	80,798,298円
たわらノーロード　バランス（積極型）	135,042,586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）	84,193,180円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	270,598,808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）	175,690,583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）	292,127,712円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	519,733円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	15,597,147円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,835,972円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,114,471円
たわらノーロード　全世界株式	114,420,430円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	368,600,771円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	336,477,380円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	331,932,782円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	456,146,458円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	931,498,233円
投資のソムリエ	13,971,286,877円
クルーズコントロール	554,881,112円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	830,868,300円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	360,110,426円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（堅実型）	6,837,647円
ＤＩＡＭコア資産設計ファンド（積極型）	28,669,218円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	650,595,898円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	4,630,792,209円
ワールドアセットバランス（基本コース）	833,770,619円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	2,266,971,500円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	52,354,062円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	26,094,240円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,250,273円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	149,901,405円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,411,532,562円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	322,007,086円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	41,187,802円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	22,363,651円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	19,101,035円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	855,182円
エマージング株式パッシブファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	13,402,395円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	366,216,468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）	7,760,963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）	264,535,078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）	130,772,021円
計	53,702,663,813円

２．　受益権の総数	53,702,663,813口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2021年6月30日 至　2022年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価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	2022年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△3,919,604,413
投資信託受益証券	△64,208,444
投資証券	△3,182,515
合計	△3,986,995,372

（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2022年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	134,936,100	－	134,944,992	△8,892
アメリカ・ドル	134,936,100	－	134,944,992	△8,892
合計	134,936,100	－	134,944,992	△8,892

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	15,703,062,915	－	15,748,809,643	45,746,728
合計	15,703,062,915	－	15,748,809,643	45,746,728

（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）

	2022年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4575円 (14,575円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	33,540	23.230	779,134.200	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	18,584	7.550	140,309.200	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	5.250	127,102.500	
	CREDICORP LTD	4,331	131.980	571,605.380	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	29,585	7.880	233,129.800	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,926	63.860	378,434.360	
	LUKOIL SPON ADR	29,079	89.500	2,602,570.500	
	GAZPROM PAO ADR	410,041	9.038	3,705,950.550	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	128,421	3.275	420,578.770	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	96,388	0.917	88,387.790	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	31,100	4.793	149,062.300	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	57,784	5.125	296,143.000	
	51JOB INC ADR	2,101	43.420	91,225.420	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	8,354	26.510	221,464.540	
	NOVATEK PJSC GDR	6,291	233.200	1,467,061.200	
	BAIDU INC -SPON ADR	18,735	152.360	2,854,464.600	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	28.200	373,932.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	45,925	31.280	1,436,534.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	90,405	7.938	717,634.890	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECH	127,330	1.770	225,374.100	
	SEVERSTAL GDR	18,608	20.500	381,464.000	
	TATNEFT ADR	16,642	39.650	659,855.300	
	VTB BANK OJSC GDR	152,000	1.236	187,872.000	
	MAGNIT PJSC GDR	29,277	14.350	420,124.950	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	36,039	8.890	320,386.710	

	VNET GROUP INC ADR	8,615	9.180	79,085.700	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	3.310	81,518.680	
	VK CO LTD GDR	9,858	10.140	99,960.120	
	YANDEX NV	20,883	56.060	1,170,700.980	
	NOAH HOLDINGS LTD ADR	3,513	28.500	100,120.500	
	SBERBANK ADR	189,038	15.375	2,906,459.250	
	PHOSAGRO PJSC GDR	11,773	21.060	247,939.380	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	11,331	34.610	392,165.910	
	JOYY INC-ADR	5,086	49.120	249,824.320	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	4,640	39.580	183,651.200	
	GDS HOLDINGS LTD ADR	4,965	44.740	222,134.100	
	ZAI LAB LTD ADR	5,960	58.560	349,017.600	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	8,124	77.000	625,548.000	
	360 DIGITECH INC ADR	5,813	20.060	116,608.780	
	BILIBILI INC ADR	10,696	40.890	437,359.440	
	NIO INC ADR	92,389	28.910	2,670,965.990	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	40,762	6.880	280,442.560	
	AUTOHOME INC ADR	6,296	34.910	219,793.360	
	I-MAB ADR	3,403	39.890	135,745.670	
	WEIBO CORP ADR	4,386	33.150	145,395.900	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS LTD ADR	2,911	13.720	39,938.920	
	KANZHUN LTD ADR	5,650	34.720	196,168.000	
	RLX TECHNOLOGY INC ADR	49,092	3.590	176,240.280	
	DIDI GLOBAL INC ADR	26,813	4.490	120,390.370	
	KE HOLDINGS INC ADR	23,625	21.240	501,795.000	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS LTD ADR	6,336	5.610	35,544.960	
	DADA NEXUS LTD ADR	4,179	11.320	47,306.280	
	AGORA INC ADR	3,131	14.480	45,336.880	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	3,309	42.850	141,790.650	
	LI AUTO INC ADR	36,908	27.540	1,016,446.320	
	XPENG INC ADR	26,054	42.630	1,110,682.020	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	26.510	120,275.870	
	HELLO GROUP INC ADR	12,641	9.070	114,653.870	
	PINDUODUO INC ADR	29,505	56.990	1,681,489.950	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,075	48.390	1,358,549.250	
	IQIYI INC ADR	15,440	4.610	71,178.400	
	POLYUS PJSC GDR	4,839	80.350	388,813.650	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	6,136	32.600	200,033.600	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	28,616	29.250	837,018.000	
	BEIGENE LTD ADR	3,074	239.160	735,177.840	
アメリカ・ドル　小計		2,226,986		38,503,069.610 (4,440,944,049)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	114,269	6.780	774,743.820	

	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	183,448	5.510	1,010,798.480	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	236,543	30.000	7,096,290.000	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	211,049	8.600	1,815,021.400	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	295,696	18.740	5,541,343.040	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	271,224	4.990	1,353,407.760	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	298,029	4.150	1,236,820.350	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	188,240	13.350	2,513,004.000	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	229,870	4.190	963,155.300	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		2,028,368		22,304,584.150 (701,479,172)	
イギリス・ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	24,584	11.900	292,549.600	
イギリス・ポンド　小計		24,584		292,549.600 (45,822,044)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	194,661	2,438.000	474,583,518.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	66,305	397.550	26,359,552.750	
	ASIAN PAINTS LTD	25,793	3,553.500	91,655,425.500	
	EICHER MOTORS LTD	10,528	2,815.500	29,641,584.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	15,745	1,838.850	28,952,693.250	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	57,514	841.950	48,423,912.300	
	SHREE CEMENT LTD	756	26,945.050	20,370,457.800	
	ICICI BANK LTD	348,649	810.750	282,667,176.750	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	52,605	326.550	17,178,162.750	
	STATE BANK OF INDIA LTD	118,018	503.650	59,439,765.700	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,888	645.350	12,189,370.800	
	TATA STEEL LTD	46,472	1,169.050	54,328,091.600	
	TATA MOTORS LTD	108,754	503.700	54,779,389.800	
	JSW STEEL LTD	63,943	672.100	42,976,090.300	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	36,296	731.900	26,565,042.400	
	TATA POWER CO LTD	87,416	231.750	20,258,658.000	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	8,074	3,768.300	30,425,254.200	
	NESTLE INDIA LTD	2,469	19,708.000	48,659,052.000	
	GAIL INDIA LTD	119,463	142.650	17,041,396.950	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	37,435	1,947.950	72,921,508.250	
	VEDANTA LTD	71,958	339.200	24,408,153.600	
	AXIS BANK LTD	152,895	742.800	113,570,406.000	
	TITAN COMPANY LTD	22,958	2,657.500	61,010,885.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	149,090	158.350	23,608,401.500	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	9,999	1,465.200	14,650,534.800	

BHARAT ELECTRONICS LTD	72,574	210.850	15,302,227.900	
LUPIN LTD	17,003	938.300	15,953,914.900	
MPHASIS LTD	4,820	3,200.950	15,428,579.000	
ACC LTD	5,706	2,320.150	13,238,775.900	
BAJAJ FINANCE LTD	18,327	7,731.300	141,691,535.100	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	116,998	2,659.650	311,173,730.700	
INFOSYS LTD	232,734	1,850.750	430,732,450.500	
WIPRO LTD	91,350	693.500	63,351,225.000	
MRF LTD	160	74,286.400	11,885,824.000	
INDIAN OIL CORP LTD	101,743	119.700	12,178,637.100	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	56,024	2,407.050	134,852,569.200	
TRENT LTD	14,708	1,072.000	15,766,976.000	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,523	5,065.250	33,040,625.750	
HCL TECHNOLOGIES LTD	73,318	1,288.100	94,440,915.800	
DABUR INDIA LTD	38,036	589.100	22,407,007.600	
HERO MOTOCORP LTD	9,409	2,578.100	24,257,342.900	
SRF LTD	8,351	2,530.250	21,130,117.750	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,357	2,405.650	15,292,717.050	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,576	4,699.050	35,600,002.800	
BHARTI AIRTEL LTD	166,197	704.950	117,160,575.150	
UNITED SPIRITS LTD	22,860	896.800	20,500,848.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	54,875	826.700	45,365,162.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,869	4,465.800	39,607,180.200	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9,054	8,125.600	73,569,182.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	17,272	737.300	12,734,645.600	
HAVELLS INDIA LTD	19,190	1,351.600	25,937,204.000	
INDRAPRASTHA GAS LTD	22,037	468.600	10,326,538.200	
BIOCON LTD	20,067	358.150	7,186,996.050	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	88,501	240.000	21,240,240.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	14,071	1,222.900	17,207,425.900	
PETRONET LNG LTD	52,703	223.300	11,768,579.900	
CIPLA LTD/INDIA	30,885	916.200	28,296,837.000	
LARSEN & TOUBRO LTD	45,222	1,953.100	88,323,088.200	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,618	7,585.150	50,198,522.700	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	63,456	3,879.850	246,199,761.600	
ADANI ENTERPRISES LTD	20,695	1,752.600	36,270,057.000	
NTPC LTD	307,191	131.850	40,503,133.350	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,899	2,579.250	20,373,495.750	
YES BANK LTD	714,850	14.000	10,007,900.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	39,016	399.350	15,581,039.600	
BHARAT FORGE LTD	18,024	767.500	13,833,420.000	

HINDALCO INDUSTRIES LTD	102,860	492.900	50,699,694.000	
ITC LTD	219,139	223.300	48,933,738.700	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	11,382	2,709.150	30,835,545.300	
UNITED PHOSPHORUS LTD	38,261	821.600	31,435,237.600	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	3,929	3,144.350	12,354,151.150	
SIEMENS INDIA LTD	5,950	2,314.650	13,772,167.500	
INFO EDGE INDIA LTD	5,769	5,557.150	32,059,198.350	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	22,126	931.050	20,600,412.300	
TECH MAHINDRA LTD	41,688	1,716.000	71,536,608.000	
MINDTREE LTD	3,887	4,556.250	17,710,143.750	
MARICO LTD	32,108	506.050	16,248,253.400	
PAGE INDUSTRIES LTD	378	43,635.350	16,494,162.300	
DLF LTD	48,259	407.950	19,687,259.050	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	205,284	204.000	41,877,936.000	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	38,587	738.850	28,510,004.950	
BAJAJ FINSERV LTD	2,848	17,798.800	50,690,982.400	
BAJAJ AUTO LTD	4,914	3,435.100	16,880,081.400	
JUBILANT FOODWORKS LTD	4,677	3,782.250	17,689,583.250	
MUTHOOT FINANCE LTD	8,810	1,539.400	13,562,114.000	
COAL INDIA LTD	88,391	160.700	14,204,433.700	
INDUS TOWERS LTD	54,946	261.200	14,351,895.200	
PI INDUSTRIES LTD	6,020	2,887.350	17,381,847.000	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	3,823	7,103.550	27,156,871.650	
ADANI GREEN ENERGY LTD	29,705	1,438.900	42,742,524.500	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	67,614	662.950	44,824,701.300	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4,012	2,518.250	10,103,219.000	
BANDHAN BANK LTD	37,750	274.000	10,343,500.000	
ADANI TOTAL GAS LTD	20,723	1,763.350	36,541,902.050	
GODREJ PROPERTIES LTD	9,916	1,921.500	19,053,594.000	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	23,985	561.150	13,459,182.750	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	16,624	904.550	15,037,239.200	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	20,386	873.450	17,806,151.700	
ZOMATO LTD	125,644	130.200	16,358,848.800	
BERGER PAINTS INDIA LTD	18,598	783.950	14,579,902.100	
ADANI TRANSMISSIONS LTD	20,756	1,819.700	37,769,693.200	
AVENUE SUPERMARTS LTD	10,551	4,633.550	48,888,586.050	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	13,209	1,444.800	19,084,363.200	

	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	27,604	589.700	16,278,078.800	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	7,733	2,055.100	15,892,088.300	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	28,244	1,229.100	34,714,700.400	
インド・ルピー　小計		5,895,043		5,114,732,088.350 (8,030,129,379)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	2,220.000	1,269,174,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,540,500	835.000	2,121,317,500.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	133,301	21,800.000	2,905,961,800.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	352,900	6,400.000	2,258,560,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	451,000	4,250.000	1,916,750,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,290,900	5,650.000	7,293,585,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,297,400	4,100.000	13,519,340,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	579,100	6,075.000	3,518,032,500.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	30,950.000	1,002,780,000.000	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA TBK PT	53,600	10,925.000	585,580,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	8,500.000	1,621,800,000.000	
	BANK MANDIRI	1,219,300	7,050.000	8,596,065,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,594,000	4,180.000	19,202,920,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	572,200	7,050.000	4,034,010,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,156,000	1,695.000	1,959,420,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	269,200	7,100.000	1,911,320,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	3,776,600	7,600.000	28,702,160,000.000	
	ADARO ENERGY PT	934,100	2,400.000	2,241,840,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	8,850.000	1,460,250,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	2,820.000	1,503,906,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,718,300	1,060.000	1,821,398,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	825,100	3,930.000	3,242,643,000.000	
インドネシア・ルピア　小計		25,256,701		112,688,812,800.000 (912,779,384)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,832	103.700	915,878.400	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	15.990	94,980.600	

CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	700	114.720	80,304.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	37.320	111,960.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	12.430	149,160.000	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	5,200	129.060	671,112.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	7,540	22.850	172,289.000	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD	16,300	11.950	194,785.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	12.030	229,773.000	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICATION CO LTD	4,000	24.420	97,680.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	112.860	135,432.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	3,900	37.490	146,211.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	26.400	198,000.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	269.000	564,900.000	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD	10,330	25.260	260,935.800	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	52.720	279,416.000	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY CO LTD	5,900	15.470	91,273.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	19,100	26.080	498,128.000	
GEM CO LTD	29,100	9.820	285,762.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	132.090	343,434.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	58.870	406,203.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	8.490	157,914.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	6,500	124.500	809,250.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	8,568	24.200	207,345.600	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	39.440	232,853.760	
ZHEJIANG NHU CO LTD	6,960	29.590	205,946.400	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	24.260	64,531.600	

FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	23.880	157,608.000	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC	3,400	36.850	125,290.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	37.520	191,352.000	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY CO LTD	1,500	15.150	22,725.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	15.090	39,234.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	71.080	326,968.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	3,000	44.720	134,160.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	15.680	172,480.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	27,100	59.280	1,606,488.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	7,200	117.330	844,776.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	14.030	252,540.000	
ADDSINO CO LTD	10,200	17.150	174,930.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	15.430	172,816.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	8.570	269,098.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	15.760	88,256.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	5.010	71,643.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	16.020	43,734.600	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	19.840	51,584.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	29.940	233,532.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	50,250	19.270	968,317.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	37.490	224,940.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	3,200	205.000	656,000.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	34.100	121,737.000	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	12.250	155,575.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	9.370	80,582.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	7.350	269,745.000	

AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	23,381	37.290	871,877.490	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	41.950	453,060.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	560	53.660	30,049.600	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	23.560	162,564.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	6.230	237,986.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	45.040	220,696.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	10.400	159,120.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	8.070	169,470.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	41.930	314,475.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	43.400	217,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	118,600	3.580	424,588.000	
WUHU SHUNRONG SANQI INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY	6,600	28.280	186,648.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,100	237.200	1,684,120.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	65.200	723,720.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	10.080	150,696.000	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	8.780	155,406.000	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD	15,300	37.790	578,187.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	15.080	89,575.200	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	5,320	26.880	143,001.600	
RISESUN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO LTD	16,000	4.730	75,680.000	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	130.010	273,021.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	8.000	291,840.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	11.690	167,167.000	

LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	30,654	48.600	1,489,784.400	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	6.580	180,950.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	33,100	8.400	278,040.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	18.410	366,359.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	23,900	22.630	540,857.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	7.690	29,222.000	
IFLYTEK CO LTD	13,500	50.040	675,540.000	
HESTEEL CO LTD	104,700	2.540	265,938.000	
GOERTEK INC	20,200	52.850	1,067,570.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	7.680	163,584.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	33,000	38.940	1,285,020.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	13,300	21.570	286,881.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	6.420	304,308.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	7.580	214,514.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	7.990	300,424.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	41,660	14.510	604,486.600	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	7.990	181,373.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	3,200	33.220	106,304.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	3,800	104.200	395,960.000	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	45,508	33.530	1,525,883.240	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,600	164.150	1,247,540.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	15,300	214.960	3,288,888.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	6.890	143,312.000	
SUNING.COM CO LTD	23,700	4.300	101,910.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	213,400	5.180	1,105,412.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	63,500	14.080	894,080.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	66,800	11.450	764,860.000	
PING AN BANK CO LTD	83,400	17.190	1,433,646.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	8,780	21.470	188,506.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	71,200	5.110	363,832.000	

CHINA VANKE CO LTD	41,300	22.160	915,208.000	
ZTE CORP	24,300	34.580	840,294.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	7.670	218,595.000	
WEICHAI POWER CO LTD	21,200	18.060	382,872.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	43.100	181,020.000	
GF SECURITIES CO LTD	21,800	22.300	486,140.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	15.300	322,830.000	
BYD CO LTD	7,300	246.300	1,797,990.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	7.170	244,497.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	4,830	103.440	499,615.200	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	2,900	104.940	304,326.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	28.100	309,100.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	19.790	354,241.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	12,900	32.320	416,928.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	57.570	166,953.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	31.260	250,080.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,700	288.850	779,895.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	11.060	39,816.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	10.800	369,360.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	18.450	102,397.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	3,000	228.260	684,780.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	10.800	168,480.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	56.670	374,022.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	61.350	36,810.000	
NINESTAR CORP	5,700	49.000	279,300.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	21.430	150,438.600	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.720	125,736.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	12.520	150,240.000	

WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD	6,720	69.490	466,972.800	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	76.860	122,976.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,500	350.600	525,900.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	2,300	191.990	441,577.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	8.080	122,008.000	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP INC	5,300	19.200	101,760.000	
SF HOLDING CO LTD	23,800	68.740	1,636,012.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	180.100	324,180.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	7.220	170,392.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	108.110	270,275.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	7.290	465,029.100	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	12.650	492,085.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	152.500	350,750.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	28.680	390,048.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,940	138.550	407,337.000	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	12,600	37.180	468,468.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,500	23.940	801,990.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	114.550	355,105.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	12.810	288,225.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,560	44.360	69,201.600	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	11,500	16.330	187,795.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	35.650	185,380.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	10,200	43.600	444,720.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	85.590	269,608.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	2,800	231.000	646,800.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	79.650	215,055.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	59.800	185,380.000	

OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	151.400	317,940.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	4,320	98.010	423,403.200	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.890	141,455.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	43.340	130,020.000	
C&S PAPER CO LTD	7,800	17.480	136,344.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	116.040	97,473.600	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	700	139.700	97,790.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	54.630	147,501.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	54.700	72,751.000	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	94.930	123,409.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	76.100	228,300.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	2,000	93.450	186,900.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	10.870	138,049.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	3,800	115.470	438,786.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	27,000	13.160	355,320.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	99.430	188,917.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	9.890	96,922.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	14,400	11.960	172,224.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	4,500	326.440	1,468,980.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	9.730	150,815.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	170.250	204,300.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	52.470	213,028.200	
SG MICRO CORP	900	285.150	256,635.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	9,100	538.400	4,899,440.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,416	156.500	534,604.000	
WUXI APPTEC CO LTD	10,872	112.010	1,217,772.720	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,400	49.390	513,656.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	3,900	123.280	480,792.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	1,600	314.680	503,488.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	36,300	17.160	622,908.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	3,300	128.450	423,885.000	

ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,800	118.660	450,908.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	6,400	78.700	503,680.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	99,079	5.100	505,302.900	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	273.800	1,040,440.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	1,700	151.280	257,176.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	17,100	23.230	397,233.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	129,100	3.550	458,305.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	81,700	4.400	359,480.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	42.530	455,071.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	900	188.750	169,875.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	173,700	4.960	861,552.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	1,000	329.700	329,700.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	600	527.000	316,200.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.600	603,120.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	9,000	59.550	535,950.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	65.340	398,574.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	8,500	49.700	422,450.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,200	61.470	73,764.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	3,900	124.450	485,355.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	6,200	84.850	526,070.000	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	50,600	9.780	494,868.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	1,900	209.000	397,100.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	154.000	92,400.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	10,900	47.880	521,892.000	

IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,000	482.000	482,000.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	4,300	152.000	653,600.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,447	267.310	654,107.570	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	16,400	25.450	417,380.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	455	890.050	404,972.750	
PETROCHINA CO LTD	110,900	5.300	587,770.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	211,800	4.750	1,006,050.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	274,400	2.990	820,456.000	
BANK OF CHINA LTD	84,000	3.130	262,920.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	158,500	4.340	687,890.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	30.010	300,100.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	13,400	22.780	305,252.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	81,500	49.230	4,012,245.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	41,500	53.080	2,202,820.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	100,100	20.630	2,065,063.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	102,000	8.720	889,440.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	3.970	548,654.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	24,900	20.750	516,675.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,100	1,966.000	10,026,600.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.750	600,875.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	56,500	25.830	1,459,395.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	30,700	28.110	862,977.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	6.070	232,481.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	100,200	22.400	2,244,480.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	238,100	3.410	811,921.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	230,500	5.370	1,237,785.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	27,100	12.260	332,246.000	
HUAXIA BANK CO LTD	82,900	5.740	475,846.000	

INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	30,400	41.030	1,247,312.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.540	399,066.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	30,800	4.030	124,124.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	126,400	7.600	960,640.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	14,000	43.880	614,320.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	17.360	581,560.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	7,800	7.700	60,060.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	14,100	46.900	661,290.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	16.470	742,797.000	
CRRC CORP LTD	77,000	6.240	480,480.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	22,452	51.120	1,147,746.240	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	18,900	41.950	792,855.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	28,300	17.390	492,137.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	14,100	6.350	89,535.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	14,900	40.020	596,298.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,800	30.190	839,282.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	47,200	24.860	1,173,392.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	10,300	6.120	63,036.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	48.950	386,705.000	
GEMDALE CORP	10,600	13.380	141,828.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	13,500	100.700	1,359,450.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	92,700	9.400	871,380.000	
FOUNDER SECURITIES CO LTD	68,500	8.030	550,055.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	10.270	324,532.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	30,120	37.050	1,115,946.000	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.780	142,444.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	9,200	207.110	1,905,412.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	235,900	2.830	667,597.000	

TSINGTAO BREWERY CO LTD	200	95.140	19,028.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	4.010	100,250.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	115,700	6.090	704,613.000	
AIR CHINA LTD	28,400	9.730	276,332.000	
TBEA CO LTD	26,700	19.240	513,708.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	45,700	4.130	188,741.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	84,300	8.550	720,765.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	13,700	24.920	341,404.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	49.990	164,967.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	34.130	235,497.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	17,200	22.490	386,828.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	5.160	176,988.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	28.330	235,139.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	11.250	166,500.000	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP CO LTD	4,800	13.180	63,264.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	11.800	279,660.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	14,400	55.590	800,496.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	9.350	272,085.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	15.280	116,128.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	59,970	18.090	1,084,857.300	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	57,800	5.580	322,524.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	9.440	266,208.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	9,520	19.200	182,784.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	49.800	378,480.000	
BBMG CORP	54,200	2.950	159,890.000	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD	29,400	4.260	125,244.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	18,600	23.610	439,146.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	5.360	206,896.000	

DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	19.710	296,024.490	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	11.870	91,399.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	7,896	58.980	465,706.080	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	35.400	575,250.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	21,600	21.870	472,392.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	7.120	232,824.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	3.670	216,530.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,900	48.300	526,470.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	9.380	177,282.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.980	178,688.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	71.800	330,280.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	8.760	147,168.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	5.260	207,244.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	10.190	199,724.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,100	394.980	1,224,438.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	5,180	288.400	1,493,912.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	18.160	21,792.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	10.140	253,500.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	22,600	12.270	277,302.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	4.800	125,760.000	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	29.110	157,194.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	14.830	186,858.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	30,000	6.010	180,300.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	38.500	161,700.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE CO LTD	5,600	11.550	64,680.000	

ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	23.430	136,596.900	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	13.450	158,710.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	22.820	102,690.000	
TONGWEI CO LTD	21,000	41.890	879,690.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	7,830	60.330	472,383.900	
JCET GROUP CO LTD	10,900	29.150	317,735.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	49.720	338,096.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	131.000	327,500.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	55.800	295,740.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	21.790	122,024.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	12,090	31.660	382,769.400	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	100	197.300	19,730.000	
CHINA JUSHI CO LTD	26,746	18.430	492,928.780	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	7,324	89.500	655,498.000	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	17.490	342,804.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	22.040	346,028.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	124.560	211,752.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	55.490	271,901.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	24,420	79.700	1,946,274.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	199.000	358,200.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	32,351	12.480	403,740.480	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	16,824	107.470	1,808,075.280	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	51.440	257,200.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	20.080	24,096.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	5,800	65.080	377,464.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	11.370	150,084.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	9,600	52.140	500,544.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	21,400	17.840	381,776.000	

	CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	7.380	440,586.000	
	ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	67.390	229,126.000	
	SKSHU PAINT CO LTD	3,800	134.430	510,834.000	
	BANK OF JIANGSU CO LTD	91,100	6.240	568,464.000	
	BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	13.410	316,476.000	
	SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	33.850	385,890.000	
	AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD	1,430	59.650	85,299.500	
	SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	22.040	44,080.000	
	YTO EXPRESS GROUP CO LTD	32,100	16.940	543,774.000	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD	1,200	105.150	126,180.000	
	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,500	77.000	115,500.000	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	39,200	10.880	426,496.000	
	SDIC CAPITAL CO LTD	7,416	8.210	60,885.360	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	179.570	143,656.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	4,700	106.050	498,435.000	
	TOLY BREAD CO LTD	5,040	27.470	138,448.800	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	54.520	155,927.200	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	81.200	238,728.000	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	13.400	259,960.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	14.710	235,360.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	6,000	61.630	369,780.000	
	GREENLAND HOLDINGS CORP LTD	30,660	4.650	142,569.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	33.000	353,100.000	
オフショア・人民元　小計		9,155,164		178,931,476.940 (3,234,937,958)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	307,093	20.230	6,212,491.390	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	168,576	6.820	1,149,688.320	
	OOREDOO QSC	43,816	7.049	308,858.980	
	QATAR FUEL QSC	44,848	18.100	811,748.800	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	39,892	16.900	674,174.800	

	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	51,028	9.700	494,971.600	
	INDUSTRIES QATAR QSC	116,259	16.040	1,864,794.360	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	75,644	19.380	1,465,980.720	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	145,382	3.400	494,298.800	
	MASRAF AL RAYAN	314,536	4.999	1,572,365.460	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.230	447,190.270	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	378,694	2.330	882,357.020	
カタール・リアル　小計		1,824,217		16,378,920.520 (515,608,418)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	310,076	0.846	262,324.290	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	162,480	0.599	97,325.520	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	464,096	1.028	477,090.680	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	89,203	0.963	85,902.480	
	MABANEE CO KPSC	55,241	0.813	44,910.930	
	BOUBYAN BANK KSCP	51,966	0.814	42,300.320	
クウェート・ディナール　小計		1,133,062		1,009,854.220 (385,552,243)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	39,289	21,700.000	852,571,300.000	
	ECOPETROL SA	281,230	2,651.000	745,540,730.000	
	BANCOLOMBIA SA	11,682	34,200.000	399,524,400.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	35,129	30,940.000	1,086,891,260.000	
	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA	26,255	29,120.000	764,545,600.000	
コロンビア・ペソ　小計		393,585		3,849,073,290.000 (109,198,209)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	14,790	71.300	1,054,527.000	
	JARIR MARKETING CO	3,378	197.000	665,466.000	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	4,155	78.300	325,336.500	
	ETIHAD ETISALAT CO	28,728	31.700	910,677.600	
	SAUDI BRITISH BANK	52,496	36.400	1,910,854.400	
	AL RAJHI BANK	83,526	145.600	12,161,385.600	
	ARAB NATIONAL BANK	47,191	25.100	1,184,494.100	
	BANK ALBILAD	26,757	49.700	1,329,822.900	
	BANK AL-JAZIRA	16,517	21.400	353,463.800	
	BANQUE SAUDI FRANSI	37,640	46.900	1,765,316.000	
	RIYAD BANK	87,636	28.450	2,493,244.200	
	SAUDI TELECOM CO	41,175	111.600	4,595,130.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	13,488	174.800	2,357,702.400	

	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	61,151	119.000	7,276,969.000	
	SAUDI CEMENT CO	6,477	55.000	356,235.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	53,009	25.150	1,333,176.350	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	19,455	31.850	619,641.750	
	SAVOLA GROUP	22,457	32.550	730,975.350	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	22,528	21.120	475,791.360	
	ALMARAI CO JSC	14,454	47.950	693,069.300	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	12.240	346,526.640	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	18,456	44.300	817,600.800	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	8,395	69.900	586,810.500	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	60,445	18.060	1,091,636.700	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	10.480	324,995.280	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	22,738	22.680	515,697.840	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	43,314	12.160	526,698.240	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	2,986	129.200	385,791.200	
	ALINMA BANK	75,115	26.150	1,964,257.250	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS CO	3,516	109.200	383,947.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	28,780	84.900	2,443,422.000	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	8,516	40.850	347,878.600	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,377	177.000	597,729.000	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	154,032	35.650	5,491,240.800	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	4,212	162.600	684,871.200	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	149,680	69.200	10,357,856.000	
サウジアラビア・リアル　小計		1,299,892		69,460,237.860 (2,137,291,519)	
タイ・バーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	103,700	30.750	3,188,775.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	331,200	13.800	4,570,560.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	84,000	44.500	3,738,000.000	
	SIAM COMMERCIAL BANK PCL NVDR	67,800	125.000	8,475,000.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,108,355	4.580	5,076,265.900	

ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	4,400	172.500	759,000.000	
SHIN CORP PCL	91,200	75.500	6,885,600.000	
CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	300,000	27.000	8,100,000.000	
ADVANCED INFO SERVICE PCL	75,200	219.000	16,468,800.000	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	290,620	14.300	4,155,866.000	
DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	21,000	395.000	8,295,000.000	
PTT PCL	649,700	38.500	25,013,450.000	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	140,700	20.700	2,912,490.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	67,700	61.250	4,146,625.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	363,900	8.650	3,147,735.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	58,150	382.000	22,213,300.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	269,700	60.750	16,384,275.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	145,500	53.250	7,747,875.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	634,400	22.700	14,400,880.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	39,800	135.000	5,373,000.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	248,010	29.000	7,192,290.000	
THAI OIL PCL NVDR	83,100	52.000	4,321,200.000	
CP ALL PCL NVDR	382,400	58.250	22,274,800.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	242,000	9.200	2,226,400.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	94,645	122.500	11,594,012.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	131,322	45.500	5,975,151.000	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	128,108	59.750	7,654,453.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	119,500	96.000	11,472,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	647,800	8.200	5,311,960.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	39.000	2,207,400.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	196,900	46.500	9,155,850.000	
OSOTSPA PCL NVDR	24,300	33.750	820,125.000	
BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	20.600	2,169,180.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	353,600	4.480	1,584,128.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	86,133	32.000	2,756,256.000	
SCG PACKAGING PCL NVDR	90,400	65.250	5,898,600.000	

	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	71,200	61.250	4,361,000.000	
	SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL NVDR	128,200	30.750	3,942,150.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	26.250	5,160,750.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	26,200	114.500	2,999,900.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	61,100	57.500	3,513,250.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	84.000	4,124,400.000	
タイ・バーツ　小計		8,369,543		297,767,752.400 (1,024,321,068)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	3,899	940.000	3,665,060.000	
	CEZ	9,586	810.000	7,764,660.000	
	MONETA MONEY BANK AS	26,989	93.100	2,512,675.900	
チェコ・コルナ　小計		40,474		13,942,395.900 (74,828,839)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	5,300,437	38.000	201,416,606.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,420	27,200.000	147,424,000.000	
	BANCO DE CHILE	3,758,188	76.000	285,622,288.000	
	EMPRESAS CMPC SA	107,743	1,379.900	148,674,565.700	
	EMPRESAS COPEC SA	20,844	6,200.000	129,232,800.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,581	6,705.200	70,947,721.200	
	ENEL AMERICAS SA	1,596,888	93.550	149,388,872.400	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,972	40,351.000	402,380,172.000	
	FALABELLA SA	48,873	2,512.100	122,773,863.300	
	CENCOSUD SA	81,121	1,360.000	110,324,560.000	
	ENEL CHILE SA	1,494,473	30.940	46,238,994.620	
チリ・ペソ　小計		12,434,540		1,814,424,443.220 (250,317,996)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	238,837	7.580	1,810,384.460	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	24.200	1,086,531.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	96,186	30.500	2,933,673.000	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	252.700	1,179,603.600	
	KOC HOLDING AS	53,770	32.640	1,755,052.800	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	90,000	14.900	1,341,000.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	99,281	19.540	1,939,950.740	
	TURKIYE GARANTI BANKASI AS	181,455	11.740	2,130,281.700	
	TURKIYE IS BANKASI	91,135	7.790	709,941.650	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	11,253	187.100	2,105,436.300	

	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	37,907	71.350	2,704,664.450	
トルコ・リラ　小計		949,390		19,696,520.300 (164,442,309)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	11,424	8,780.000	100,302,720.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	28,377	2,636.000	74,801,772.000	
	OTP BANK NYRT	14,487	17,310.000	250,769,970.000	
ハンガリー・フォリント　小計		54,288		425,874,462.000 (155,258,071)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	479,000	34.500	16,525,500.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	171,630	58.500	10,040,355.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	95,400	94.700	9,034,380.000	
	AYALA CORP	21,553	860.000	18,535,580.000	
	GLOBE TELECOM INC	2,570	3,240.000	8,326,800.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	73,840	199.500	14,731,080.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	199,650	57.000	11,380,050.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	33,940	222.800	7,561,832.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	153,275	55.200	8,460,780.000	
	BDO UNIBANK INC	110,323	125.000	13,790,375.000	
	PLDT INC	5,260	1,822.000	9,583,720.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	694,275	34.400	23,883,060.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	43,330	127.700	5,533,241.000	
	SM INVESTMENTS CORP	18,603	940.000	17,486,820.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	901,900	3.850	3,472,315.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	17,710	306.400	5,426,344.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	528.000	3,485,328.000	
	AC ENERGY CORP	689,400	9.640	6,645,816.000	
	MONDE NISSIN CORP	314,700	15.920	5,010,024.000	
フィリピン・ペソ　小計		4,032,960		198,913,400.000 (447,077,758)	
ブラジル・レアル	BRF SA	47,292	23.520	1,112,307.840	
	VALE SA	280,089	83.000	23,247,387.000	
	RAIA DROGASIL SA	63,900	21.060	1,345,734.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	20,750	29.440	610,880.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	19,700	29.480	580,756.000	
	BANCO DO BRASIL SA	63,900	28.780	1,839,042.000	
	ITAUSA SA	349,188	9.180	3,205,545.840	
	GERDAU SA	87,830	27.580	2,422,351.400	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	243,910	30.720	7,492,915.200	

	VIBRA ENERGIA SA	66,200	19.040	1,260,448.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	329,212	28.010	9,221,228.120	
	CCR SA	90,920	10.990	999,210.800	
	WEG SA	103,644	28.560	2,960,072.640	
	BANCO BRADESCO SA PREF	336,393	20.300	6,828,777.900	
	BANCO BRADESCO SA	85,357	16.970	1,448,508.290	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	34,306	24.920	854,905.520	
	SUZANO SA	49,275	59.180	2,916,094.500	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	327,347	22.840	7,476,605.480	
	AMERICANAS SA	40,871	27.140	1,109,238.940	
	BRASKEM SA	12,300	53.580	659,034.000	
	ENGIE BRASIL SA	16,587	37.740	625,993.380	
	ALPARGATAS SA	19,400	31.700	614,980.000	
	LOCALIZA RENT A CAR	37,289	48.500	1,808,516.500	
	LOJAS RENNER SA	57,920	22.740	1,317,100.800	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	55,904	12.780	714,453.120	
	COSAN SA	73,300	19.730	1,446,209.000	
	TOTVS SA	21,200	24.500	519,400.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	50,200	21.720	1,090,344.000	
	JBS SA	66,500	35.900	2,387,350.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	86,917	12.150	1,056,041.550	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	27,098	34.780	942,468.440	
	HYPERA SA	33,500	26.760	896,460.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	400,048	11.180	4,472,536.640	
	MAGAZINE LUIZA SA	226,400	5.740	1,299,536.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	31,428	46.800	1,470,830.400	
	VIA S/A	99,200	4.010	397,792.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	38,800	19.310	749,228.000	
	NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	32,500	55.530	1,804,725.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	79,800	9.400	750,120.000	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	14.060	420,394.000	
	AMBEV SA	314,695	14.650	4,610,281.750	
	NATURA &CO HOLDING SA	69,000	21.630	1,492,470.000	
	TIM SA	72,100	12.310	887,551.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	30,900	39.470	1,219,623.000	
	RUMO SA	104,900	15.650	1,641,685.000	
ブラジル・レアル　小計		4,727,870		112,227,133.050 (2,282,385,650)	

ポーランド・ズロチ	MBANK	1,410	485.400	684,414.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	11,155	138.800	1,548,314.000	
	BANK PEKAO SA	10,428	125.700	1,310,799.600	
	ORANGE POLSKA SA	20,700	8.450	174,915.000	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	16,793	77.820	1,306,831.260	
	LPP SA	86	18,210.000	1,566,060.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,881	368.400	1,061,360.400	
	CD PROJEKT RED SA	4,633	188.100	871,467.300	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	54,022	46.920	2,534,712.240	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	129,398	6.164	797,609.270	
	CYFROWY POLSAT SA	20,000	33.020	660,400.000	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	7.952	415,030.780	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	45,967	35.500	1,631,828.500	
	DINO POLSKA SA	3,464	346.300	1,199,583.200	
	ALLEGRO.EU SA	27,648	38.630	1,068,042.240	
ポーランド・ズロチ　小計		400,777		16,831,367.790 (484,428,646)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	179,000	3.350	599,650.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	414,300	5.670	2,349,081.000	
	DIGI.COM BHD	235,300	3.950	929,435.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	89,720	5.940	532,936.800	
	RHB BANK BHD	140,880	5.460	769,204.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.650	242,505.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	382,300	2.500	955,750.000	
	GENTING BHD	171,300	4.660	798,258.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	20,256	17.840	361,367.040	
	HONG LEONG BANK BHD	50,608	19.200	971,673.600	
	IOI CORP BHD	190,813	3.880	740,354.440	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	19,800	21.800	431,640.000	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	11,600	24.440	283,504.000	
	MALAYAN BANKING BHD	320,175	8.340	2,670,259.500	
	MISC BHD	100,880	6.960	702,124.800	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	132.400	542,840.000	
	PPB GROUP BHD	46,260	16.200	749,412.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	22,300	19.060	425,038.000	
	PETRONAS GAS BHD	55,400	16.620	920,748.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	219,800	2.880	633,024.000	

	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.280	314,160.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	178,050	9.080	1,616,694.000	
	QL RESOURCES BHD	25,250	4.930	124,482.500	
	DIALOG GROUP BHD	200,944	2.700	542,548.800	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	989,550	4.180	4,136,319.000	
	SIME DARBY BERHAD	139,500	2.290	319,455.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	105,800	6.100	645,380.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	170,100	3.800	646,380.000	
	MAXIS BHD	185,300	4.460	826,438.000	
	INARI AMERTRON BHD	255,500	3.750	958,125.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	178,500	8.900	1,588,650.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	106,000	6.680	708,080.000	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	22,600	3.970	89,722.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	209,500	5.880	1,231,860.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	159,200	4.020	639,984.000	
マレーシア・リンギット　小計		5,691,786		30,997,084.280 (851,272,926)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	222,300	14.280	3,174,444.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	117,600	63.330	7,447,608.000	
	GRUMA SAB DE CV	18,045	261.460	4,718,045.700	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	17,860	157.050	2,804,913.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	34,900	60.600	2,114,940.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	169,600	146.140	24,785,344.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	78,425	48.590	3,810,670.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13,110	227.900	2,987,769.000	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	136,200	31.550	4,297,110.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	16,230	433.270	7,031,972.100	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	210,652	89.250	18,800,691.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,297,878	20.720	47,612,032.160	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	172,000	24.610	4,232,920.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	20,600	127.510	2,626,706.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	347,100	72.140	25,039,794.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	23,325	285.920	6,669,084.000	
	TELESITES SAB DE CV	77,300	21.490	1,661,177.000	
	BECLE SAB DE CV	38,400	51.320	1,970,688.000	
メキシコ・ペソ　小計		4,011,525		171,785,908.710 (973,012,566)	

ユーロ	ALPHA BANK A.E.	193,358	1.157	223,715.200	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	13,507	16.400	221,514.800	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	181,940	0.986	179,392.840	
	OPAP SA	15,554	12.580	195,669.320	
	JUMBO SA	9,601	13.160	126,349.160	
	PUBLIC POWER CORP	16,000	8.910	142,560.000	
ユーロ　小計		433,090		1,089,201.320 (142,358,613)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,472	160,000.000	235,520,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,014	22,500.000	112,815,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,226	100,500.000	223,713,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,371	222,500.000	527,547,500.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,450	64,400.000	222,180,000.000	
	COWAY CO LTD	3,495	74,500.000	260,377,500.000	
	KT&G CORP	8,833	78,500.000	693,390,500.000	
	S-1 CORPORATION	187	73,200.000	13,688,400.000	
	CJ CORP	1,001	81,500.000	81,581,500.000	
	KAKAO CORP	21,011	96,600.000	2,029,662,600.000	
	CJ ENM CO LTD	761	130,800.000	99,538,800.000	
	SK TELECOM CO LTD	2,204	56,500.000	124,526,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	20,059	8,370.000	167,893,830.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,085	614,000.000	666,190,000.000	
	LG UPLUS CORP	14,606	13,650.000	199,371,900.000	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION CO LTD	22,317	20,550.000	458,614,350.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	632	956,000.000	604,192,000.000	
	LG CHEM LTD	3,122	710,000.000	2,216,620,000.000	
	LG CHEM LTD	499	314,000.000	156,686,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	102	559,000.000	57,018,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	29,007	38,550.000	1,118,219,850.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	17,291	26,200.000	453,024,200.000	
	S-OIL CORP	2,413	96,900.000	233,819,700.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,798	38,250.000	298,273,500.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	20,252	5,620.000	113,816,240.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,618	42,650.000	196,957,700.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,953	130,500.000	254,866,500.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,022	230,000.000	235,060,000.000	

HOTEL SHILLA CO LTD	2,900	74,400.000	215,760,000.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,043	102,500.000	209,407,500.000	
HYUNDAI MOBIS	4,366	262,000.000	1,143,892,000.000	
SK HYNIX INC	37,069	124,500.000	4,615,090,500.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	6,583	45,900.000	302,159,700.000	
HYUNDAI MOTOR CO	1,515	98,300.000	148,924,500.000	
HYUNDAI MOTOR CO	9,542	209,500.000	1,999,049,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	6,059	44,800.000	271,443,200.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	18,371	10,650.000	195,651,150.000	
KIA CORPORATION	17,718	83,800.000	1,484,768,400.000	
KOREA ZINC CO LTD	614	514,000.000	315,596,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	20,723	21,500.000	445,544,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	13,829	28,100.000	388,594,900.000	
CJ LOGISTICS	355	126,000.000	44,730,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	175,000.000	209,825,000.000	
DOUZONE BIZON CO LTD	2,123	68,100.000	144,576,300.000	
HLB INC	6,789	35,500.000	241,009,500.000	
LG ELECTRONICS INC	7,162	130,000.000	931,060,000.000	
LG CORP	5,592	80,800.000	451,833,600.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	11,950.000	109,497,850.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,631	44,350.000	205,384,850.000	
NAVER CORP	8,364	335,000.000	2,801,940,000.000	
L&F CO LTD	1,848	186,200.000	344,097,600.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,932	80,600.000	236,319,200.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,347	42,600.000	99,982,200.000	
KANGWON LAND INC	8,499	24,450.000	207,800,550.000	
POSCO	4,941	304,000.000	1,502,064,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	12,815	24,350.000	312,045,250.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,716	624,000.000	2,318,784,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,581	181,000.000	648,161,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	205,000.000	84,050,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	326,897	78,000.000	25,497,966,000.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	52,468	5,900.000	309,561,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	56,124	70,900.000	3,979,191,600.000	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO LTD	1,563	28,700.000	44,858,100.000	

YUHAN CORP	2,585	60,500.000	156,392,500.000	
HANON SYSTEMS	16,143	12,750.000	205,823,250.000	
GS HOLDINGS CORP	2,879	39,800.000	114,584,200.000	
LG DISPLAY CO LTD	14,095	23,800.000	335,461,000.000	
CELLTRION INC	6,614	187,000.000	1,236,818,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	19,354	45,400.000	878,671,600.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,065	181,500.000	193,297,500.000	
CELLTRION PHARM INC	1,017	107,700.000	109,530,900.000	
LOTTE SHOPPING CO	538	86,800.000	46,698,400.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,458	67,400.000	367,869,200.000	
AMOREPACIFIC CORP	2,347	152,000.000	356,744,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,361	246,000.000	826,806,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	707	385,000.000	272,195,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	20,172	5,800.000	116,997,600.000	
LG INNOTEK CO LTD	855	331,000.000	283,005,000.000	
SK INC	2,767	244,000.000	675,148,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	26,337	57,800.000	1,522,278,600.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	5,999	33,800.000	202,766,200.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	1,949	111,500.000	217,313,500.000	
HANMI PHARM CO LTD	558	262,500.000	146,475,000.000	
SEEGENE INC	1,958	58,000.000	113,564,000.000	
E-MART CO LTD	1,426	149,000.000	212,474,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,261	39,750.000	209,124,750.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDIMGS CO LTD	3,784	55,100.000	208,498,400.000	
BGF RETAIL CO LTD	216	139,000.000	30,024,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,760	107,000.000	188,320,000.000	
SK CHEMICALS CO LTD	613	145,500.000	89,191,500.000	
NETMARBLE CORP	1,478	111,500.000	164,797,000.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	30,772	13,950.000	429,269,400.000	
ECOPRO BM CO LTD	873	436,900.000	381,413,700.000	
SD BIOSENSOR INC	3,095	55,700.000	172,391,500.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,002	92,200.000	184,584,400.000	
KRAFTON INC	1,459	381,500.000	556,608,500.000	
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,190	147,000.000	174,930,000.000	
SK SQUARE CO LTD	1,425	57,500.000	81,937,500.000	
SK BIOSCIENCE CO LTD	1,672	213,000.000	356,136,000.000	
KAKAO GAMES CORP	2,515	74,200.000	186,613,000.000	
HYBE CO LTD	1,167	295,500.000	344,848,500.000	
KAKAOBANK CORP	6,133	51,100.000	313,396,300.000	
F&F CO LTD / NEW	274	866,000.000	237,284,000.000	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,872	152,000.000	436,544,000.000	
ALTEOGEN INC	2,026	69,100.000	139,996,600.000	

	SAMSUNG C&T CORP	5,349	115,000.000	615,135,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,127	836,000.000	942,172,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	116,100.000	241,488,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,418	42,600.000	103,006,800.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5,701	76,000.000	433,276,000.000	
韓国・ウォン　小計		1,089,098		80,327,684,020.000 (7,759,654,276)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	12.540	840,180.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	8.270	744,300.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	180,000	4.940	889,200.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	113.500	726,400.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	98,500	41.700	4,107,450.000	
	BEIJING ENTERPRISES	45,000	28.500	1,282,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	342,000	4.210	1,439,820.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	242,000	6.960	1,684,320.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	108,000	16.100	1,738,800.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	51,590	16.460	849,171.400	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	35,500	41.700	1,480,350.000	
	BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	3.650	518,300.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	585,600	9.320	5,457,792.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	291,120	22.100	6,433,752.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	216,888	37.000	8,024,856.000	
	CITIC LTD	440,000	8.270	3,638,800.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	44,000	5.000	220,000.000	
	LENOVO GROUP LTD	470,000	8.980	4,220,600.000	
	PETRO CHINA CO LTD	1,356,000	3.720	5,044,320.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	110,590	11.420	1,262,937.800	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,595,200	3.860	6,157,472.000	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	85,000	13.780	1,171,300.000	
	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	163,000	23.350	3,806,050.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	52,600	139.000	7,311,400.000	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	276,000	7.380	2,036,880.000	

COSCO SHIPPING PORTS LTD	164,000	6.570	1,077,480.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	35,200	7.310	257,312.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	120,000	14.540	1,744,800.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	244,000	4.540	1,107,760.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	85,000	23.900	2,031,500.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	96,500	8.610	830,865.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	193,200	15.600	3,013,920.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	44,500	36.850	1,639,825.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	394,000	19.600	7,722,400.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	58,000	43.900	2,546,200.000	
BYD CO LTD	53,500	245.600	13,139,600.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	7.090	836,620.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,030,000	0.820	844,600.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	281,592	6.110	1,720,527.120	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	208,000	8.940	1,859,520.000	
MMG LTD	184,000	2.410	443,440.000	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD	70,000	5.510	385,700.000	
CHINA YOUZAN LTD	1,000,000	0.475	475,000.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	521,788	7.000	3,652,516.000	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	5.320	718,200.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	149,200	20.000	2,984,000.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	200,000	25.300	5,060,000.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	509,000	13.240	6,739,160.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	433,000	9.100	3,940,300.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	204,000	10.340	2,109,360.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	15.720	2,003,356.800	
TINGYI HOLDING CORP	140,000	16.600	2,324,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	38,000	68.100	2,587,800.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	174,000	10.040	1,746,960.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	238,000	5.640	1,342,320.000	

CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	95,333	58.350	5,562,680.550	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	40,000	6.970	278,800.000	
HUABAO INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	71,000	14.000	994,000.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	670,250	6.210	4,162,252.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	209,000	47.550	9,937,950.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	395,500	453.200	179,240,600.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	433,500	61.900	26,833,650.000	
LI NING CO LTD	150,000	76.800	11,520,000.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	128,000	3.150	403,200.000	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	689,240	0.660	454,898.400	
CHINA POWER INTERNATIONAL	360,000	4.210	1,515,600.000	
AIR CHINA / HONG KONG	46,000	5.610	258,060.000	
ZTE CORP	44,288	23.100	1,023,052.800	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	245,500	18.780	4,610,490.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	203,250	14.860	3,020,295.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	597,205	4.950	2,956,164.750	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	110,250	9.980	1,100,295.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	60,000	33.300	1,998,000.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,638,530	5.750	38,171,547.500	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	55,000	144.300	7,936,500.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	206,000	6.950	1,431,700.000	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	98,000	4.390	430,220.000	
MINTH GROUP LTD	54,000	36.800	1,987,200.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	138,000	8.620	1,189,560.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	300,000	10.620	3,186,000.000	
BANK OF CHINA LTD	5,619,200	2.990	16,801,408.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	13.040	782,400.000	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES CO LTD	99,200	3.420	339,264.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	267,470	62.700	16,770,369.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,919,235	4.640	18,185,250.400	

KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	13.260	709,410.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.720	623,472.000	
CHINA COAL ENERGY CO	206,000	4.880	1,005,280.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	55,000	21.750	1,196,250.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	44,600	41.450	1,848,670.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	502,142	7.320	3,675,679.440	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	237,000	3.930	931,410.000	
CHINA CITIC BANK-H	579,800	3.550	2,058,290.000	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	29,000	5.020	145,580.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	47,500	220.600	10,478,500.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	71,800	111.000	7,969,800.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	20.550	411,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	169,028	8.550	1,445,189.400	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	272,000	2.800	761,600.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	264,000	4.380	1,156,320.000	
KINGSOFT CORP LTD	79,400	34.850	2,767,090.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	35,000	13.000	455,000.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	350,000	4.400	1,540,000.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	111,000	7.600	843,600.000	
DONGYUE GROUP	125,000	10.840	1,355,000.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	47,500	27.150	1,289,625.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	277,000	8.240	2,282,480.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	168,000	22.300	3,746,400.000	
CRRC CORP LTD - H	405,000	3.490	1,413,450.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	92,000	13.460	1,238,320.000	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	226,500	3.240	733,860.000	
SINOPHARM GROUP CO	112,400	18.080	2,032,192.000	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	169,000	5.680	959,920.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	216,000	6.430	1,388,880.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	260,527	7.520	1,959,163.040	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	8.740	1,315,370.000	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDINGS LTD	108,000	4.200	453,600.000	

CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	255,000	16.200	4,131,000.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	84,100	15.320	1,288,412.000	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	186,000	12.020	2,235,720.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	45,200	5.400	244,080.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	90,000	7.600	684,000.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	122,500	40.850	5,004,125.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	65,000	22.300	1,449,500.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	340,156	3.100	1,054,483.600	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	68,800	13.920	957,696.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	81,000	15.120	1,224,720.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.920	730,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,902,000	2.830	5,382,660.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	37,000	59.450	2,199,650.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	7.030	724,090.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	44,600	26.600	1,186,360.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	143,500	20.050	2,877,175.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	206,000	5.490	1,130,940.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	194,000	6.950	1,348,300.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	675,000	2.440	1,647,000.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	34,500	33.300	1,148,850.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	244,000	5.300	1,293,200.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	216,500	4.470	967,755.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	136,000	7.700	1,047,200.000	

POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	530,000	6.200	3,286,000.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	36,000	35.450	1,276,200.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	82,000	32.100	2,632,200.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	118,000	43.750	5,162,500.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	33,000	28.850	952,050.000	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD	52,000	12.440	646,880.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	12.780	479,250.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	44,250	13.520	598,260.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,346,000	0.920	3,078,320.000	
XIAOMI CORP	968,800	18.520	17,942,176.000	
WUXI APPTEC CO LTD	22,812	120.900	2,757,970.800	
WEIMOB INC	166,000	7.530	1,249,980.000	
MEITUAN	278,500	206.600	57,538,100.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	71,200	14.160	1,008,192.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	87,000	17.680	1,538,160.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	314,000	12.520	3,931,280.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	76,500	42.800	3,274,200.000	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	82,000	12.220	1,002,040.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	665,000	1.470	977,550.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	40,000	33.050	1,322,000.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	6.410	660,230.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	37.900	3,884,750.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	63,000	8.600	541,800.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	177.800	1,102,360.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	116,000	7.750	899,000.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	86,000	18.740	1,611,640.000	
CHINA FEIHE LTD	219,000	11.040	2,417,760.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,042,068	127.600	132,967,876.800	
PHARMARON BEIJING CO LTD	7,400	110.500	817,700.000	
JD.COM INC	118,000	270.200	31,883,600.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	120,000	34.600	4,152,000.000	

	VENUS MEDTECH HANGZHOU INC	15,500	28.650	444,075.000	
	JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	14.280	714,000.000	
	SEAZEN GROUP LTD-RTS	9,809	0.197	1,932.370	
	KUAISHOU TECHNOLOGY	30,100	77.900	2,344,790.000	
	HAIER SMART HOME CO LTD	148,200	33.000	4,890,600.000	
	AKESO INC	20,000	29.000	580,000.000	
	SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	77,000	8.250	635,250.000	
	NETEASE INC	135,900	158.300	21,512,970.000	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	25,000	18.740	468,500.000	
	NONGFU SPRING CO LTD	116,800	45.100	5,267,680.000	
	CHINA BOHAI BANK CO LTD	294,500	2.410	709,745.000	
	JD HEALTH INTERNATIONAL INC	29,100	63.800	1,856,580.000	
	HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	29,800	46.150	1,375,270.000	
	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	46,200	38.000	1,755,600.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	9,600	85.550	821,280.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	111,661	21.000	2,344,881.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	37,000	39.200	1,450,400.000	
	CGN POWER CO LTD	610,000	2.220	1,354,200.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	14.620	997,084.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	47,600	41.900	1,994,440.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	92,400	12.920	1,193,808.000	
	3SBIO INC	90,500	6.570	594,585.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	49.900	1,417,160.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	34,000	34.600	1,176,400.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.360	638,740.000	
	CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD	192,000	2.530	485,760.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	65,000	8.150	529,750.000	
	BOC AVIATION LTD	8,400	65.650	551,460.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	34,000	28.800	979,200.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	90,000	13.500	1,215,000.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	112,800	21.350	2,408,280.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	244,500	82.700	20,220,150.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	16,400	115.900	1,900,760.000	
香港・ドル　小計		60,931,112		987,623,074.470 (14,606,945,265)	

台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	40,000	262.500	10,500,000.000	
	ACER INC	202,532	30.250	6,126,593.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	46,554	378.500	17,620,689.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	29,616	557.000	16,496,112.000	
	ASIA CEMENT CORP	145,928	44.300	6,464,610.400	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	57,000	143.000	8,151,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	49,000	160.500	7,864,500.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	80,000	209.500	16,760,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	176,858	92.500	16,359,365.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	55,760	160.500	8,949,480.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	248,208	17.800	4,418,102.400	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	137,169	35.300	4,842,065.700	
	CHINA STEEL CORP	795,058	34.900	27,747,524.200	
	ADVANTECH CO LTD	23,675	394.000	9,327,950.000	
	COMPAL ELECTRONICS INC	335,304	24.850	8,332,304.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	131,663	283.500	37,326,460.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	90,000	74.900	6,741,000.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	274,427	116.500	31,970,745.500	
	AU OPTRONICS CORP	534,194	22.500	12,019,365.000	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	103,800	99.800	10,359,240.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	170,820	136.500	23,316,930.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	139,824	29.100	4,068,878.400	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	31,768	226.000	7,179,568.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	15,322	618.000	9,468,996.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	38,285	510.000	19,525,350.000	
	FORMOSA PLASTICS CORP	255,633	105.500	26,969,281.500	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	234,594	80.900	18,978,654.600	
	GIANT MANUFACTURING	21,151	343.000	7,254,793.000	
	MEDIATEK INC	103,507	1,095.000	113,340,165.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	508,942	76.400	38,883,168.800	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	564,752	22.000	12,424,544.000	
	HOTAI MOTOR CO LTD	20,000	620.000	12,400,000.000	
	FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	122,000	64.400	7,856,800.000	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	745,146	25.500	19,001,223.000	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	532,941	62.100	33,095,636.100	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	967,011	17.350	16,777,640.850	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	810,798	28.950	23,472,602.100	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	853,225	104.500	89,162,012.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	750,495	36.150	27,130,394.250	
LARGAN PRECISION CO LTD	7,220	2,475.000	17,869,500.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	645,132	19.050	12,289,764.600	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	798,345	10.950	8,741,877.750	
INVENTEC CO LTD	225,005	25.450	5,726,377.250	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	127,845	63.500	8,118,157.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	623,443	16.350	10,193,293.050	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,354,048	26.400	35,746,867.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	773,806	25.100	19,422,530.600	
NAN YA PLASTICS CORP	345,828	86.900	30,052,453.200	
WISTRON CORP	230,916	29.100	6,719,655.600	
POU CHEN CORP	157,990	32.350	5,110,976.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	319,297	68.700	21,935,703.900	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	44,392	274.000	12,163,408.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	86,480	97.800	8,457,744.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	66,224	63.900	4,231,713.600	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	73,588	64.000	4,709,632.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	101,899	66.200	6,745,713.800	
TAIWAN CEMENT CORP	386,171	47.300	18,265,888.300	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,685,083	643.000	1,083,508,369.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	798,525	62.100	49,588,402.500	
WAN HAI LINES LTD	51,500	179.500	9,244,250.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	249,000	30.650	7,631,850.000	
YAGEO CORP	24,160	519.000	12,539,040.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	117,000	111.500	13,045,500.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	161,000	29.200	4,701,200.000	
INNOLUX CORPORATION	720,345	19.050	13,722,572.250	

	WPG HOLDINGS CO LTD	118,203	51.800	6,122,915.400	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	15,000	517.000	7,755,000.000	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	15,969	296.500	4,734,808.500	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	5,000	1,960.000	9,800,000.000	
	PEGATRON CORP	138,554	68.800	9,532,515.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	11,371	977.000	11,109,467.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	354.500	7,444,500.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	86,593	261.500	22,644,069.500	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	18,000	265.000	4,770,000.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,000	1,950.000	9,750,000.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,590.000	3,180,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	52,385	101.500	5,317,077.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	697,393	26.300	18,341,435.900	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	225,993	48.250	10,904,162.250	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	5,000	1,450.000	7,250,000.000	
	WIWYNN CORP	5,000	1,110.000	5,550,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	214,903	106.000	22,779,718.000	
	SILERGY CORP	6,000	4,220.000	25,320,000.000	
	MOMO.COM INC	3,000	1,720.000	5,160,000.000	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING CORP	114,618	9.280	1,063,655.040	
	GLOBALWAFERS CO LTD	14,000	838.000	11,732,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	11,000	402.500	4,427,500.000	
台湾・ドル　小計		22,403,184		2,423,855,010.090 (10,106,021,079)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	243.000	1,740,609.000	
	BIDVEST GROUP LTD	15,192	190.080	2,887,695.360	
	CLICKS GROUP LTD	16,080	312.850	5,030,628.000	
	DISCOVERY LTD	30,465	147.550	4,495,110.750	
	GOLD FIELDS LTD	57,452	160.410	9,215,875.320	
	REMGRO LTD	28,949	132.000	3,821,268.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	51,798	55.290	2,863,911.420	
	EXXARO RESOURCES LTD	19,869	161.610	3,211,029.090	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	6,061	2,149.000	13,025,089.000	
	MTN GROUP LTD	112,829	166.970	18,839,058.130	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	27,098	298.170	8,079,810.660	
	FIRSTRAND LTD	336,348	63.430	21,334,553.640	
	NASPERS LTD	14,757	2,374.140	35,035,183.980	

	NEDBANK GROUP LTD	32,060	188.760	6,051,645.600	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,537	1,799.080	6,363,345.960	
	SASOL LTD	42,391	270.670	11,473,971.970	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	38,000	208.560	7,925,280.000	
	MR PRICE GROUP LTD	14,601	195.220	2,850,407.220	
	STANDARD BANK GROUP LTD	83,701	147.000	12,304,047.000	
	SPAR GROUP LTD/THE	16,546	170.050	2,813,647.300	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	72,648	51.090	3,711,586.320	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	29,619	220.600	6,533,951.400	
	ABSA GROUP LTD	47,851	165.010	7,895,893.510	
	TIGER BRANDS LTD	12,981	181.690	2,358,517.890	
	SANLAM LTD	113,774	61.530	7,000,514.220	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	54,946	222.350	12,217,243.100	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,497	454.780	2,045,145.660	
	RMI HOLDINGS	62,995	45.760	2,882,651.200	
	VODACOM GROUP PTY LTD	48,278	133.140	6,427,732.920	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	33,357	106.600	3,555,856.200	
	OLD MUTUAL LTD	367,072	13.900	5,102,300.800	
	REINET INVESTMENTS SCA	7,218	308.440	2,226,319.920	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	100,374	23.160	2,324,661.840	
	MULTICHOICE GROUP LTD	27,072	119.760	3,242,142.720	
	SIBANYE STILLWATER LTD	184,207	51.860	9,552,975.020	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	28,727	214.960	6,175,155.920	
	BID CORP LTD	20,786	332.640	6,914,255.040	
南アフリカ・ランド　小計		2,171,299		269,529,071.080 (1,986,429,254)	
合計		176,978,538		61,822,496,691 (61,822,496,691)	

（２）株式以外の有価証券

2022年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	89,400.000	1,672,674.000	
		BANCO INTER SA	23,700.000	579,228.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	32,300.000	1,022,941.000	
		ENERGISA SA	15,800.000	619,360.000	
		KLABIN SA	50,500.000	1,273,610.000	
	ブラジル・レアル　小計		211,700.000	5,167,813.000 (105,098,847)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	965,475.000	12,609,103.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	35,200.000	3,865,664.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	126,400.000	20,692,944.000	

		GRUPO TELEVISA SAB	188,300.000	7,580,958.000	
		MEGACABLE HOLDINGS SAB DE CV	25,000.000	1,640,000.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,340,375.000	46,388,669.500 (262,750,063)	
投資信託受益証券　合計			1,552,075	367,848,910 (367,848,910)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	235,400.000	4,736,248.000	
	メキシコ・ペソ　小計		235,400.000	4,736,248.000 (26,826,583)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	168,453.000	2,526,795.000	
	南アフリカ・ランド　小計		168,453.000	2,526,795.000 (18,622,479)	
投資証券　合計			403,853	45,449,062 (45,449,062)	
合計				413,297,972 (413,297,972)	

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

（注）

1．各種通貨毎の小計の欄における（　）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3．外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式　65銘柄	5.67	－	－	7.14
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式　9銘柄	0.90	－	－	1.13
イギリス・ポンド	株式　1銘柄	0.06	－	－	0.07
インド・ルピー	株式　106銘柄	10.26	－	－	12.90
インドネシア・ルピア	株式　22銘柄	1.17	－	－	1.47
オフショア・人民元	株式　376銘柄	4.13	－	－	5.20
カタール・リアル	株式　12銘柄	0.66	－	－	0.83
クウェート・ディナール	株式　6銘柄	0.49	－	－	0.62
コロンビア・ペソ	株式　5銘柄	0.14	－	－	0.18
サウジアラビア・リアル	株式　36銘柄	2.73	－	－	3.43
タイ・バーツ	株式　42銘柄	1.31	－	－	1.65
チェコ・コルナ	株式　3銘柄	0.10	－	－	0.12
チリ・ペソ	株式　11銘柄	0.32	－	－	0.40
トルコ・リラ	株式　11銘柄	0.21	－	－	0.26
ハンガリー・フォリント	株式　3銘柄	0.20	－	－	0.25
フィリピン・ペソ	株式　19銘柄	0.57	－	－	0.72
ブラジル・レアル	株式　45銘柄	2.92	－	－	3.84

	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.13	－	
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.62	－	－	0.78
マレーシア・リンギット	株式	35銘柄	1.09	－	－	1.37
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.24	－	－	2.03
	投資信託受益証券	5銘柄	－	0.34	－	
	投資証券	1銘柄	－	－	0.03	
ユーロ	株式	7銘柄	0.18	－	－	0.23
韓国・ウォン	株式	110銘柄	9.91	－	－	12.47
香港・ドル	株式	206銘柄	18.66	－	－	23.47
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.91	－	－	16.24
南アフリカ・ランド	株式	37銘柄	2.54	－	－	3.22
	投資証券	1銘柄	－	－	0.02	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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

（２）当ファンドは当中間計算期間より中間財務諸表を作成しているため、中間損益及び剰余金計算書に係る比較情報は記載しておりません。

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期中間計算期間（2022年1月12日から2022年7月11日まで）の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 2022年1月11日現在	第2期中間計算期間末 2022年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	322,644	2,943,516
親投資信託受益証券	14,047,799	80,578,818
派生商品評価勘定	5,322	39,638
流動資産合計	14,375,765	83,561,972
資産合計	14,375,765	83,561,972
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,249	335,301
未払受託者報酬	164	6,716
未払委託者報酬	4,513	180,243
その他未払費用	13	735
流動負債合計	8,939	522,995
負債合計	8,939	522,995
純資産の部		
元本等		
元本	14,104,594	87,498,953
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	262,232	△4,459,976
（分配準備積立金）	29,670	17,842
元本等合計	14,366,826	83,038,977
純資産合計	14,366,826	83,038,977
負債純資産合計	14,375,765	83,561,972

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
営業収益	
受取利息	7
有価証券売買等損益	△2,084,814
為替差損益	△340,316
営業収益合計	△2,425,123
営業費用	
支払利息	88
受託者報酬	6,716
委託者報酬	180,243
その他費用	735
営業費用合計	187,782
営業利益又は営業損失（△）	△2,612,905
経常利益又は経常損失（△）	△2,612,905
中間純利益又は中間純損失（△）	△2,612,905
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（△）	△466,171
期首剰余金又は期首欠損金（△）	262,232
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,187
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	31,187
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	－
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,606,661
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,606,661
分配金	－
中間剰余金又は中間欠損金（△）	△4,459,976

（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2期中間計算期間 自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 2022年1月11日現在	第2期中間計算期間末 2022年7月11日現在
１．　期首元本額	2,000,000円	14,104,594円
期中追加設定元本額	12,595,154円	89,463,083円
期中一部解約元本額	490,560円	16,068,724円
２．　受益権の総数	14,104,594口	87,498,953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4,459,976円であります。

（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1期 2022年1月11日現在	第2期中間計算期間末 2022年7月11日現在
１．　中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左

３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価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	第1期 2022年1月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち １年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	515,039	－	516,980	△1,941
アメリカ・ドル	151,016	－	149,887	1,129
イギリス・ポンド	76,194	－	78,287	△2,093
オーストラリア・ドル	82,849	－	82,895	△46
カナダ・ドル	126,787	－	127,466	△679
ユーロ	78,193	－	78,445	△252
買建	289,476	－	292,490	3,014
イギリス・ポンド	78,618	－	78,288	△330
オーストラリア・ドル	8,078	－	8,289	211
カナダ・ドル	124,090	－	127,467	3,377
ユーロ	78,690	－	78,446	△244
合計	804,515	－	809,470	1,073

種類	第2期中間計算期間末 2022年7月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち １年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	12,573,449	－	12,869,929	△296,480
アメリカ・ドル	372,530	－	394,777	△22,247
イギリス・ポンド	5,295,145	－	5,447,589	△152,444
オーストラリア・ドル	3,994,844	－	4,051,996	△57,152
カナダ・ドル	845,896	－	882,673	△36,777
ユーロ	2,065,034	－	2,092,894	△27,860
買建	4,890,635	－	4,891,452	817
アメリカ・ドル	393,165	－	394,777	1,612
イギリス・ポンド	2,637,993	－	2,650,178	12,185

オーストラリア・ドル	839,923	－	847,658	7,735
カナダ・ドル	83,235	－	84,064	829
ユーロ	936,319	－	914,775	△21,544
合計	17,464,084	－	17,761,381	△295,663

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第1期 2022年1月11日現在	第2期中間計算期間末 2022年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0186円 (10,186円)	0.9490円 (9,490円)

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,372,535,579
国債証券	454,144,467,200
地方債証券	33,087,965,922
特殊債券	30,973,035,370
社債券	26,778,809,650
未収利息	655,856,826
前払費用	97,860,070
流動資産合計	548,110,530,617
資産合計	548,110,530,617
負債の部	
流動負債	
未払金	1,023,970,000
未払解約金	393,594,000
流動負債合計	1,417,564,000
負債合計	1,417,564,000
純資産の部	
元本等	
元本	431,250,768,086
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	115,442,198,531
元本等合計	546,692,966,617
純資産合計	546,692,966,617
負債純資産合計	548,110,530,617

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	369,783,791,323円
同期中追加設定元本額	493,309,167,217円
同期中一部解約元本額	431,842,190,454円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,264,432,904円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	144,506,421円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	171,180,466円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	168,666,978円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	693,499,823円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	121,711,577円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	39,150,352円
たわらノーロード　国内債券	16,516,684,943円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,014,989,472円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,018,092,960円
たわらノーロード　バランス（標準型）	1,752,354,814円
たわらノーロード　バランス（積極型）	221,488,318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）	85,577,098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）	1,383,542,862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）	1,336,534,110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）	357,609,924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）	24,662,096円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	21,803,103円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	16,817,181円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	125,823,985円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,523,423円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	923,956円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	14,032,383,543円
Ｏｎｅグローバルバランス	17,808,635円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,227,290,367円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	12,888,421,041円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,388,646,153円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,264,399,775円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,375,705,239円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	396,917,591円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	99,738,983円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,458,241,431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）	4,395,796,576円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,839,412,609円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	357,921,860円
投資のソムリエ	76,807,333,513円
クルーズコントロール	177,481,406円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	4,916,929,409円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,201,632,701円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,047,038,736円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	5,234,220,205円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	26,136,123,900円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	115,666,757円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	57,037,054円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	33,906,292円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	827,207,272円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	2,977,383,603円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,496,976,258円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,121,296,882円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	186,641,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	59,560,755円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	38,467,682円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	802,042,844円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	7,132,408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）	1,959,324,767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）	2,008,176,617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）	1,515,112,654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）	1,220,625,001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）	1,927,972,644円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	4,984,372,557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）	1,904,695,012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）	1,739,423,266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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	1,952,801,514円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,129,705,040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）	2,249,449,034円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	1,262,641,605円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	578,473,582円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	275,698,020円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	4,870,266,482円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	4,881,603,781円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	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）	3,329,872,504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）	58,570,237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）	355,417,457円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	41,466,695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）	153,696,897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）	97,973,989円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	24,506,692円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,245,916円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,402,964円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,199,802円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,198,419円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	109,158,817円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,411,976,440円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,230,124,821円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,303,160,988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）	77,111,106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）	160,951,134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）	2,024,349,779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）	164,327,606円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,678,058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）	2,125,697,035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）	48,691,504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）	332,284,574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）	515,826,747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）	912,489,078円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	283,326,751円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	98,033,272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＞	467,056,693円
コア資産形成ファンド	309,125,535円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	39,869,562,667円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	63,455,521,258円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	13,209,256,957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］	2,190,769,908円
計	431,250,768,086円
２．　受益権の総数	431,250,768,086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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2677円 (12,677円)

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,930,858,741
株式	435,590,889,830
派生商品評価勘定	74,970,950
未収入金	106,045,000
未収配当金	536,474,159
前払金	263,780,000
差入委託証拠金	571,605,000
流動資産合計	450,074,623,680
資産合計	450,074,623,680
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	258,483,450
未払解約金	587,698,000
流動負債合計	846,181,450
負債合計	846,181,450
純資産の部	
元本等	
元本	139,705,613,956
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	309,522,828,274
元本等合計	449,228,442,230
純資産合計	449,228,442,230
負債純資産合計	450,074,623,680

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	140,692,906,135円
同期中追加設定元本額	106,841,504,984円
同期中一部解約元本額	107,828,797,163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	2,659,409,813円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	6,957,173,870円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	22,210,267,920円
ＤＩＡＭ国内株式パッシブ・ファンド	4,809,635,550円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,435,386円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	24,679,595円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	102,754,930円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,084,933円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	17,669,431円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	24,101,980円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,486,350,150円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,268,161,902円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	46,604,271円
たわらノーロード　バランス（標準型）	301,730,608円
たわらノーロード　バランス（積極型）	466,620,741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）	4,028,000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）	176,520,070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）	458,166,657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）	305,971,882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）	438,584,671円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	651,634円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,768,549円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	40,050,065円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	5,355,907円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	16,443,612円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	34,076,242,527円
Ｏｎｅグローバルバランス	3,247,029円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,083,199,007円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,602,824,724円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,922,277,614円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	348,554,050円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,111,886,633円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,141,134,215円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	32,407,197円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,124,324,214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）	353,939,195円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	572,826,935円
投資のソムリエ	22,853,714,171円
クルーズコントロール	71,457,276円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,463,149,876円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	363,843,028円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	764,081,030円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,747,258,747円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	8,705,209,065円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	68,885,176円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	33,968,159円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	11,304,075円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	232,383,465円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	465,532,749円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	746,062,166円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	274,918,680円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	83,979,433円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	35,473,900円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	22,908,967円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	263,134,542円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,245,423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）	1,633,209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）	1,849,695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）	18,324,166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）	957,717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）	1,603,280円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	3,412,877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）	26,024,170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）	75,659,911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）	42,989,467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）	30,101,921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）	1,577,966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）	29,918,418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）	43,153,368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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	71,915,215円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	563,092,043円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	5,396,850円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	33,880,137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）	222,232,094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）	2,983,707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）	26,190,448円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	22,874,004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）	51,726,382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）	98,913,740円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,236,708円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	25,652,559円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,552,069円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	665,531円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,047,448円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,361,126円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	516,768,088円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	600,618,725円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,738,629,025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）	20,699,902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）	25,918,872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）	272,440,705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）	66,257,228円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	493,053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）	321,823,413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）	19,671,103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）	67,087,779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）	156,081,636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）	220,856,342円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,286,045円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	16,966,224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）	276,735,242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）	952,517,403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）	1,259,648,156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）	50,256,155円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	5,566,254円
コア資産形成ファンド	3,694,426円
ＭＨＡＭトピックスファンド	748,993,610円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	59,948,461円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	773,101,621円
ＭＨＡＭ日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,721,215,291円
計	139,705,613,956円
２．　受益権の総数	139,705,613,956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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	14,478,265,000	－	14,295,000,000	△183,265,000
合計	14,478,265,000	－	14,295,000,000	△183,265,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	3.2155円 (32,155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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,539,122,811
コール・ローン	2,351,213,668
国債証券	375,356,171,561
派生商品評価勘定	3,513,588,025
未収入金	684,320
未収利息	1,500,141,196
前払費用	795,262,726
流動資産合計	385,056,184,307
資産合計	385,056,184,307
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,033,309,167
未払金	36,081,715
未払解約金	1,032,836,000
流動負債合計	2,102,226,882
負債合計	2,102,226,882
純資産の部	
元本等	
元本	300,821,408,398
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	82,132,549,027
元本等合計	382,953,957,425
純資産合計	382,953,957,425
負債純資産合計	385,056,184,307

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	354,922,285,046円
同期中追加設定元本額	564,956,657,380円
同期中一部解約元本額	619,057,534,028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＞	8,035,222,519円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	938,575,631円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,428,973,991円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,146,908,436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）	53,281,292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）	1,506,801,548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）	1,866,367,222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）	590,188,531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）	296,245,513円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	5,822,877円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	17,883,326円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	152,829,150円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	9,590,225円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,116,515円
投資のソムリエ	152,338,139,721円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	9,716,685,830円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	10,613,720,350円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	52,862,612,111円
ワールドアセットバランス（基本コース）	2,297,070,590円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,473,306,935円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	517,540,128円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	255,210,755円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	68,674,024円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,250,668,526円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,409,058,155円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,076,386,054円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	560,655,038円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	266,516,902円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	172,124,562円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	31,889,281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）	19,894,655,442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）	8,035,644,277円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	3,747,733,114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）	173,068,185円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	122,640,166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）	531,321,962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）	48,738,549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）	332,618,472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）	644,790,999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）	912,530,898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）	698,032,316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）	2,403,879,369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）	3,179,279,422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）	126,409,489円
計	300,821,408,398円
２．　受益権の総数	300,821,408,398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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	382,921,639,520	－	380,441,360,662	2,480,278,858
アメリカ・ドル	194,649,642,761	－	195,594,482,577	△944,839,816
イギリス・ポンド	19,269,229,088	－	19,148,398,799	120,830,289
イスラエル・シュケル	1,481,964,874	－	1,502,114,378	△20,149,504
オーストラリア・ドル	5,770,315,756	－	5,769,167,359	1,148,397
オフショア・人民元	8,712,880,620	－	8,773,507,026	△60,626,406
カナダ・ドル	7,825,101,272	－	7,830,064,267	△4,962,995
シンガポール・ドル	1,661,203,328	－	1,659,261,766	1,941,562
スウェーデン・クローナ	989,010,534	－	964,001,210	25,009,324
デンマーク・クローネ	1,404,306,336	－	1,369,350,667	34,955,669
ノルウェー・クローネ	771,830,703	－	758,410,883	13,419,820
ポーランド・ズロチ	1,574,656,215	－	1,515,040,883	59,615,332
マレーシア・リンギット	1,904,591,472	－	1,901,286,777	3,304,695
メキシコ・ペソ	2,980,679,418	－	2,955,871,297	24,808,121
ユーロ	133,926,227,143	－	130,700,402,773	3,225,824,370
合計	382,921,639,520	－	380,441,360,662	2,480,278,858

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2730円
（1万口当たり純資産額）	(12,730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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	8,970,062,600
コール・ローン	617,398,847
株式	699,468,086,811
投資信託受益証券	1,280,678,307
投資証券	16,408,504,439
派生商品評価勘定	299,752,109
未収入金	6,731,745
未収配当金	665,782,043
差入委託証拠金	4,437,753,881
流動資産合計	732,154,750,782
資産合計	732,154,750,782
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,657,893
未払解約金	181,483,000
流動負債合計	203,140,893
負債合計	203,140,893
純資産の部	
元本等	
元本	124,615,191,377
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	607,336,418,512
元本等合計	731,951,609,889
純資産合計	731,951,609,889
負債純資産合計	732,154,750,782

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	110,505,806,204円
同期中追加設定元本額	45,697,656,427円
同期中一部解約元本額	31,588,271,254円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	3,348,569,370円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	4,574,535円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	16,231,630円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	82,918,863円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	21,952,399円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	11,618,839円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	19,447,915円
たわらノーロード　先進国株式	34,314,869,892円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	307,127,414円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	2,601,926,026円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	691,379,667円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	74,463,522円
たわらノーロード　バランス（標準型）	626,101,421円
たわらノーロード　バランス（積極型）	775,948,253円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	1,025,842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）	143,943,839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）	450,444,105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）	345,903,561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）	518,839,000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）	1,195,675円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	23,297,314円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,696,526円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,516,222円
たわらノーロード　全世界株式	330,610,652円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	53,695,461,176円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,500,098,707円
Ｏｎｅグローバルバランス	1,779,055円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	159,345,618円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	807,702,208円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,032,598,070円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	95,884,773円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	259,739,340円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	247,420,344円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,659,398円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	611,330,918円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	124,424,959円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	169,931,264円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	193,025,141円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	312,120,532円
投資のソムリエ	4,959,364,508円
クルーズコントロール	18,688,477円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	316,290,046円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	198,490,190円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	197,431,786円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	234,889,871円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,172,881,350円
ワールドアセットバランス（基本コース）	169,383,556円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	108,008,871円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	8,802,294円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	4,361,726円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	1,521,617円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	21,895,614円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	126,465,748円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	120,545,314円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	149,989,893円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	7,800,298円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	4,537,875円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	2,937,468円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	71,574,230円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	531,747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
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Ⅱ　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）	1,447,832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
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）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	2,027,331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）	389,467,874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）	62,459,645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）	1,173,132,137円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,584,482円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,083,071,021円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	122,028,800円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	1,102,339円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,828,694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）	5,714,497円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	3,059,437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）	27,951,231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）	53,391,962円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,286,931円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,773,039円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,496,555円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	239,359円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,804,206円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,785,435円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	185,903,360円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	283,660,486円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	938,500,073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）	56,232,735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）	42,244,946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）	294,285,316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）	11,923,755円

ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,206,968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）	115,777,074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）	10,619,537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）	36,231,901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）	56,144,206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）	119,227,676円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	2,370,462円
コア資産形成ファンド	1,611,410円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,207,688,062円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	141,943,214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）	12,155,326円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	311,176,078円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,739,061,717円
計	124,615,191,377円
２．　受益権の総数	124,615,191,377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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	748,184,798	－	749,033,571	848,773
アメリカ・ドル	602,493,650	－	603,274,370	780,720
イギリス・ポンド	11,633,279	－	11,635,657	2,378

オーストラリア・ドル	19,596,038	－	19,601,710	5,672
カナダ・ドル	13,865,297	－	13,905,118	39,821
ユーロ	100,596,534	－	100,616,716	20,182
合計	748,184,798	－	749,033,571	848,773

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年7月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち１年超		
市場取引				
先物取引				
買建	14,880,454,922	－	15,157,700,365	277,245,443
合計	14,880,454,922	－	15,157,700,365	277,245,443

（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7月11日現在
1口当たり純資産額	5.8737円
（1万口当たり純資産額）	(58,737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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,559,681,555
投資証券	193,580,279,300
未収配当金	1,247,393,124
前払金	141,505,350
差入委託証拠金	266,418,000
流動資産合計	198,795,277,329
資産合計	198,795,277,329
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	92,685,420
未払金	322,544,502
未払解約金	126,192,000
流動負債合計	541,421,922
負債合計	541,421,922
純資産の部	
元本等	
元本	82,785,656,911
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	115,468,198,496
元本等合計	198,253,855,407
純資産合計	198,253,855,407
負債純資産合計	198,795,277,329

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2022年7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	83,254,722,505円
同期中追加設定元本額	55,703,769,744円
同期中一部解約元本額	56,172,835,338円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	424,714円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,528,511円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	7,873,682円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,037,929円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,082,540円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	1,844,607円
たわらノーロード　国内リート	4,945,376,482円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	784,038,579円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,669,813,551円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	30,531,529円
たわらノーロード　バランス（標準型）	566,159,829円
たわらノーロード　バランス（積極型）	612,615,373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）	77,164,285円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	386,263,987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）	222,907,990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）	287,421,402円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,172,838円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	32,312,496円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,901,999円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	10,779,610円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,475,526円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	432,565,572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）	190,178,863円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	341,968,253円
投資のソムリエ	9,662,065,869円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	617,721,389円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	145,860,446円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	656,050,838円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,268,196,189円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	25,239,430円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	12,457,609円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	4,243,940円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	92,211,503円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	156,798,397円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	108,360,798円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	33,353,607円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	12,975,486円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,390,593円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,518,096円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	53,165,836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）	79,635,595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）	716,769,375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）	176,788,116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）	20,567,727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）	190,209,302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）	80,120,076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）	145,541,812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Ⅱ　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）	212,223,084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）	349,545,932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）	244,020,096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）	81,279,290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）	243,359,188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）	351,032,046円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,958,882,583円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	237,869,253円
ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	26,780,630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）	614,705,854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）	11,016,698円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	8,455,262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）	1,433,418,668円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,751,188,079円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	37,486,739,434円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,642,131,585円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	103,401,163円
計	82,785,656,911円
２．　受益権の総数	82,785,656,911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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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）

不動産投信関連

種類	2022年7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				

先物取引				
買建	4,642,567,350	－	4,550,139,000	△92,428,350
合計	4,642,567,350	－	4,550,139,000	△92,428,350

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額	2.3948円
（1万口当たり純資産額）	(23,948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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	157,337,103
コール・ローン	178,417,988
投資信託受益証券	7,127,398,066
投資証券	62,985,944,128
派生商品評価勘定	24,350
未収配当金	239,132,524
流動資産合計	70,688,254,159
資産合計	70,688,254,159
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	241
未払金	92,742,540
未払解約金	76,371,000
流動負債合計	169,113,781
負債合計	169,113,781
純資産の部	
元本等	
元本	41,139,882,079
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	29,379,258,299
元本等合計	70,519,140,378
純資産合計	70,519,140,378
負債純資産合計	70,688,254,159

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,542,419,917円
同期中追加設定元本額	66,909,115,908円
同期中一部解約元本額	72,311,653,746円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	81,852,515円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	41,533,175円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	7,131,079円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	25,314,759円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	129,401,509円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	34,220,840円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	18,121,691円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	30,350,139円
たわらノーロード　先進国リート	13,311,430,329円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,108,077,222円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	297,819,841円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,332,859,834円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	21,585,836円

たわらノーロード　バランス（標準型）	395,125,099円
たわらノーロード　バランス（積極型）	790,220,069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）	93,508,624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）	218,973,699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）	16,921,443円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,270,927円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	13,698,573円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,297,849,973円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	499,933,151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）	179,983,530円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	261,555,203円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	473,877,608円
投資のソムリエ	10,022,551,513円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	640,725,176円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	200,321,449円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	566,074,904円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,823,905,878円
ワールドアセットバランス（基本コース）	355,965,633円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	243,707,293円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	18,542,730円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	9,189,986円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,661,560円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	61,255,475円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	287,838,763円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	151,515,045円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	21,760,898円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	9,560,137円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	6,192,217円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,119,065円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	276,893,448円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	251,356,424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）	53,121,417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
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）	56,379,915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Ⅱ　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）	246,753,566円

ＡＭＯｎｅ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）（適格機関投資家限定）	3,917,008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）	11,551,622円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	7,470,624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）	80,878,427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）	196,263,640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）	2,339,054,710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）	436,325,289円
計	41,139,882,079円
２．　受益権の総数	41,139,882,079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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	2,632,974	－	2,633,215	△241
ユーロ	2,632,974	－	2,633,215	△241
買建	48,120,495	－	48,144,845	24,350
アメリカ・ドル	34,114,175	－	34,115,400	1,225
イギリス・ポンド	3,277,388	－	3,277,650	262
オーストラリア・ドル	4,666,550	－	4,667,000	450
カナダ・ドル	3,160,212	－	3,160,293	81
シンガポール・ドル	2,902,170	－	2,924,502	22,332

合計	50,753,469	－	50,778,060	24,109

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.7141円 (17,141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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	13,272,685,869
コール・ローン	4,416,790,074
国債証券	136,852,495,185
派生商品評価勘定	12,849,960
未収入金	2,514,912,830
未収利息	631,106,126
前払費用	1,234,608,117
流動資産合計	158,935,448,161
資産合計	158,935,448,161
負債の部	
流動負債	
未払金	18,718,608,681
未払解約金	207,141,000
流動負債合計	18,925,749,681
負債合計	18,925,749,681
純資産の部	
元本等	
元本	70,118,981,084
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	69,890,717,396
元本等合計	140,009,698,480
純資産合計	140,009,698,480
負債純資産合計	158,935,448,161

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,295,763,529円
同期中追加設定元本額	122,266,039,745円
同期中一部解約元本額	119,442,822,190円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	131,087,402円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,000,390,968円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	146,824,403円
たわらノーロード　バランス（標準型）	406,871,944円
たわらノーロード　バランス（積極型）	169,306,399円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	827,132円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	3,486,312円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	34,173,431円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,361,417円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	4,742,321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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	247,220,954円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	378,978,482円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	682,627,449円
投資のソムリエ	20,498,469,123円
クルーズコントロール	58,452,826円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,310,869,154円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	291,081,635円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,383,431,937円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	6,895,622,254円
ワールドアセットバランス（基本コース）	509,349,876円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	325,064,388円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	53,791,922円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	26,528,257円

リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	8,949,450円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	173,063,432円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	707,875,975円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	217,340,122円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	62,578,741円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	27,702,631円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	17,891,303円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	3,317,416円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	25,314,461,916円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	504,474,892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）	2,250,092,369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）	428,383,260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）	23,194,881円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	18,173,723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）	9,050,826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）	170,037,066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）	82,417,986円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	4,479,158,560円
計	70,118,981,084円
２．　受益権の総数	70,118,981,084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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
買建	4,050,000,000	－	4,062,849,960	12,849,960
アメリカ・ドル	4,050,000,000	－	4,062,849,960	12,849,960
合計	4,050,000,000	－	4,062,849,960	12,849,960

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年7月11日現在
1口当たり純資産額	1.9967円
（1万口当たり純資産額）	(19,967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7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,991,925,573
コール・ローン	243,447,124
株式	58,942,010,212
投資信託受益証券	322,229,480
投資証券	58,941,958
派生商品評価勘定	8,150,152
未収入金	18,459,585
未収配当金	411,927,200
差入委託証拠金	1,855,138,109
流動資産合計	64,852,229,393
資産合計	64,852,229,393
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	22,863,442
未払金	2,885
未払解約金	62,044,000
流動負債合計	84,910,327
負債合計	84,910,327
純資産の部	
元本等	
元本	45,722,371,191
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	19,044,947,875
元本等合計	64,767,319,066
純資産合計	64,767,319,066
負債純資産合計	64,852,229,393

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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7月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,702,663,813円
同期中追加設定元本額	27,600,618,554円
同期中一部解約元本額	35,580,911,176円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	8,414,266,805円
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	249,308,647円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	5,577,987円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	19,768,014円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	100,937,102円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,774,998円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	14,149,987円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	23,676,113円
たわらノーロード　新興国株式	9,783,186,729円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	3,101,480,645円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,881,375,585円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	25,957,775円
たわらノーロード　バランス（標準型）	96,255,390円
たわらノーロード　バランス（積極型）	161,718,540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）	129,016,535円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	215,353,289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）	186,462,808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）	262,228,230円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	589,547円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	13,488,479円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	1,955,155円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,553,530円
たわらノーロード　全世界株式	186,898,793円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	487,596,612円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	395,350,094円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	357,147,590円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	528,851,051円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	967,495,787円
投資のソムリエ	10,185,800,391円
クルーズコントロール	81,036,597円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	637,923,633円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	406,484,871円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	538,253,057円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,743,206,892円
ワールドアセットバランス（基本コース）	688,931,951円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	415,453,317円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	23,368,060円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	11,544,008円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,520,517円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	76,037,639円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	264,669,857円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	309,327,556円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	27,408,196円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	12,012,253円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	7,772,856円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,404,817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）	12,602,484円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	264,421,242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）	11,634,922円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	6,349,174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）	235,467,385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）	114,224,608円
計	45,722,371,191円

２．　受益権の総数	45,722,371,191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7月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,275,226	－	1,299,731	△24,505
ブラジル・レアル	1,275,226	－	1,299,731	△24,505
買建	464,277,696	－	464,558,988	281,292
アメリカ・ドル	464,277,696	－	464,558,988	281,292
合計	465,552,922	－	465,858,719	256,787

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年7月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	5,813,449,365	－	5,798,479,288	△14,970,077
合計	5,813,449,365	－	5,798,479,288	△14,970,077

（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7月11日現在
1口当たり純資産額	1.4165円
（1万口当たり純資産額）	(14,165円)

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	87,190,774円
Ⅱ　負債総額	1,405,067円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	85,785,707円
Ⅳ　発行済数量	88,656,756口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9676円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	541,912,526,211円
Ⅱ　負債総額	2,223,733,020円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	539,688,793,191円
Ⅳ　発行済数量	422,400,470,886口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2777円

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7月29日現在

Ⅰ　資産総額	459,720,738,327円
Ⅱ　負債総額	410,310,029円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	459,310,428,298円
Ⅳ　発行済数量	140,926,231,738口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.2592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7月29日現在

Ⅰ　資産総額	390,131,806,179円
Ⅱ　負債総額	111,033,392円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	390,020,772,787円
Ⅳ　発行済数量	298,988,412,205口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3045円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	762,122,751,903円
Ⅱ　負債総額	178,779,846円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	761,943,972,057円
Ⅳ　発行済数量	126,165,821,378口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	6.0392円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	206,642,478,378円
Ⅱ　負債総額	1,834,182,267円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	204,808,296,111円
Ⅳ　発行済数量	82,874,570,918口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4713円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	**76,107,415,575円**
Ⅱ　負債総額	**801,289,789円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**75,306,125,786円**
Ⅳ　発行済数量	**41,731,449,442口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.8045円**

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	**142,558,125,092円**
Ⅱ　負債総額	**5,146,156,000円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**137,411,969,092円**
Ⅳ　発行済数量	**67,521,902,937口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.0351円**

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	**65,022,310,097円**
Ⅱ　負債総額	**761,877,127円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**64,260,432,970円**
Ⅳ　発行済数量	**45,958,126,057口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.3982円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2022年7月29日現在）

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

※種類株式の発行が可能

直近５カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2022年7月29日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年7月29日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,448,099,465,563
追加型株式投資信託	810	14,656,448,211,575
単位型公社債投資信託	25	51,328,900,179
単位型株式投資信託	221	1,098,492,267,151
合計	1,082	17,254,368,844,468

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
ソフトウエア		2,878		3,107
ソフトウエア仮勘定		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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000	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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 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
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 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 (2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウエアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。
4．外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5．引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6. 収益及び費用の計上基準	**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。** **(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。** **(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。** **(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。** **(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。**
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おります。

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

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			
その他有価証券	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			
その他有価証券	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				
その他有価証券(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				
その他有価証券(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			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計	―	―	―
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	1	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			
①株式	―	―	―
②投資信託	―	―	―
小計	―	―	―
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
①株式	―	―	―
②投資信託	1	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 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
繰延税金資産	（百万円）	（百万円）
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

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

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

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
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.発生したのれんの金額	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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

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

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

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

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社（以下「PPAM」といいます。）の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(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（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の通りです。

名　　称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2022年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(3) 投資顧問会社

名称	Asset Management One USA Inc.
資本金の額	400万米ドル（2021年12月末日現在)
事業の内容	米国において投資顧問業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

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

３【資本関係】

委託会社は、Asset Management One USA Inc.の株式を100%保有しています。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【その他】

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

・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨

・委託会社の金融商品取引業者登録番号

・詳細情報の入手方法

①委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など

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

・目論見書の使用開始日

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

①届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

②届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日

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

・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨

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

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

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

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

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

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

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

独立監査人の監査報告書

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

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）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

２０２２年2月１８日

アセットマネジメントOne株式会社

取 締 役 会　 御 中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　長 谷 川　　敬

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）の２０２１年6月３０日から２０２２年1月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）の２０２２年1月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- **不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。**
- **財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注１）上記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）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9月9日

アセットマネジメントOne株式会社
取 締 役 会　御 中

EY新日本有限責任監査法人
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　丘 本　正 彦

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」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）の２０２２年1月１２日から２０２２年7月１１日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）の２０２２年7月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（２０２２年1月１２日から２０２２年7月１１日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- **不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。**
- **中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。**
- **経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。**
- **経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。**
- **中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。**

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注１）上記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。