【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年10月11日提出
【計算期間】	第21期 （自　2022年1月12日　至　2022年7月11日）
【ファンド名】	クルーズコントロール
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　　菅野　暁
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

●国内外の株式および公社債に、以下のマザーファンドを通じて実質的に投資します。
- 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
- 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- エマージング株式パッシブ・マザーファンド

●マザーファンドのほか、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)、短期金融資産等へ投資する場合もあります。

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

●各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直すこととします。経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、投資比率の見直しを行うことがあります。

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

●資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。

●資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。

●下値目安値は、3ヵ月毎に下値目安値の改定日(毎年1月、4月、7月、10月の各11日。休業日の場合には、翌営業日。)を設け、改定日における基準価額から−2.0%の水準とします。ただし、当該水準は、委託会社の判断により今後変更する場合があります。

●上記の運用目標は、現金等(**)を活用し、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(***)を機動的に変更することで行います。

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

(**)現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。

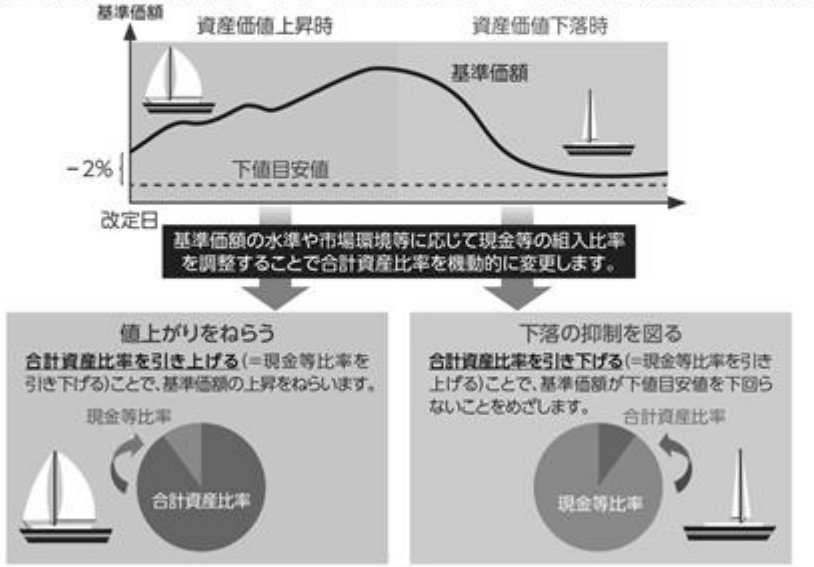
(***)合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

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

当ファンドの合計資産比率の変更(イメージ)

●資産価値上昇時は、合計資産比率*1を増加(=現金等*2比率の減少)させることで値上がり益の獲得をめざします。
●一方、資産価値下落時は、機動的に合計資産比率を減少(=現金等比率の増加)させることで基準価額下落の抑制をめざします。

*1 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く6つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。
*2 現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
※合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。



※下値目安値は、基準価額がこれを下回らないように目標とされる水準であり、基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証するものではありません。
※ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。
※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。
※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。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

■分配方針

年2回の決算時(毎年1月、7月の各11日(休業日の場合は翌営業日))に、経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を対象として、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。

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

○商品分類表

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

○商品分類定義

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

○属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （　　） 資産複合 （投資信託証券（債券、株式）、先物、ＥＴＦ、短期金融資産） 資産配分固定型 資産配分変更型	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 （　　） なし

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

○属性区分定義

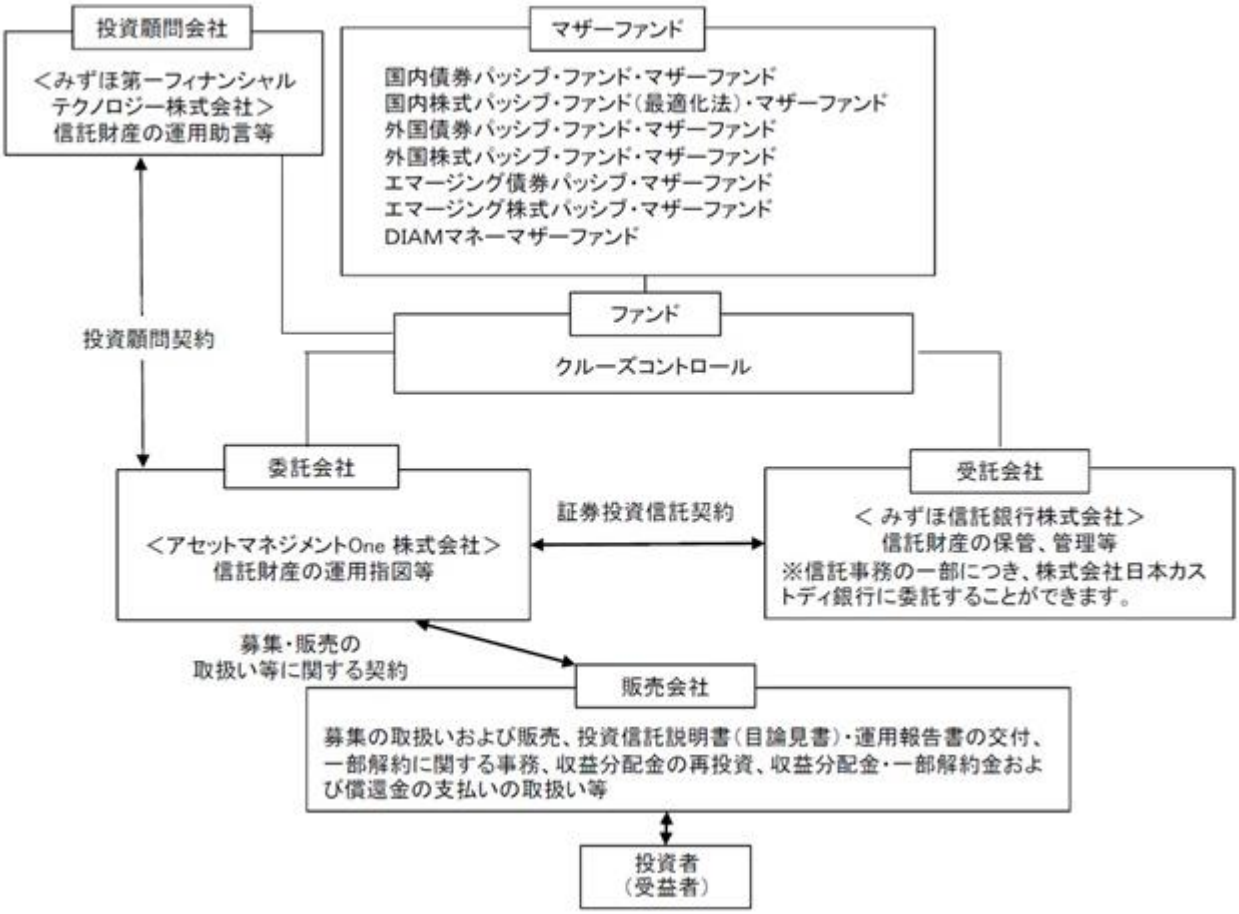
資産複合（投資信託証券（債券、株式）、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）資産配分変更型	**目論見書または投資信託約款において、複数資産（投資信託証券、先物、ＥＴＦ、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。**
年2回	**目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。**
グローバル（日本を含む）	**目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。**
ファミリーファンド	**目論見書または投資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

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

（２）【ファンドの沿革】

2012年10月26日　信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始
2013年 5月17日　投資対象、投資態度、信託期間、信託の計算期間、信託報酬率、信託財産留保額について変更

（３）【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

委託会社と受託会社との間においては、ファンドの設定時に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、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ます。

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

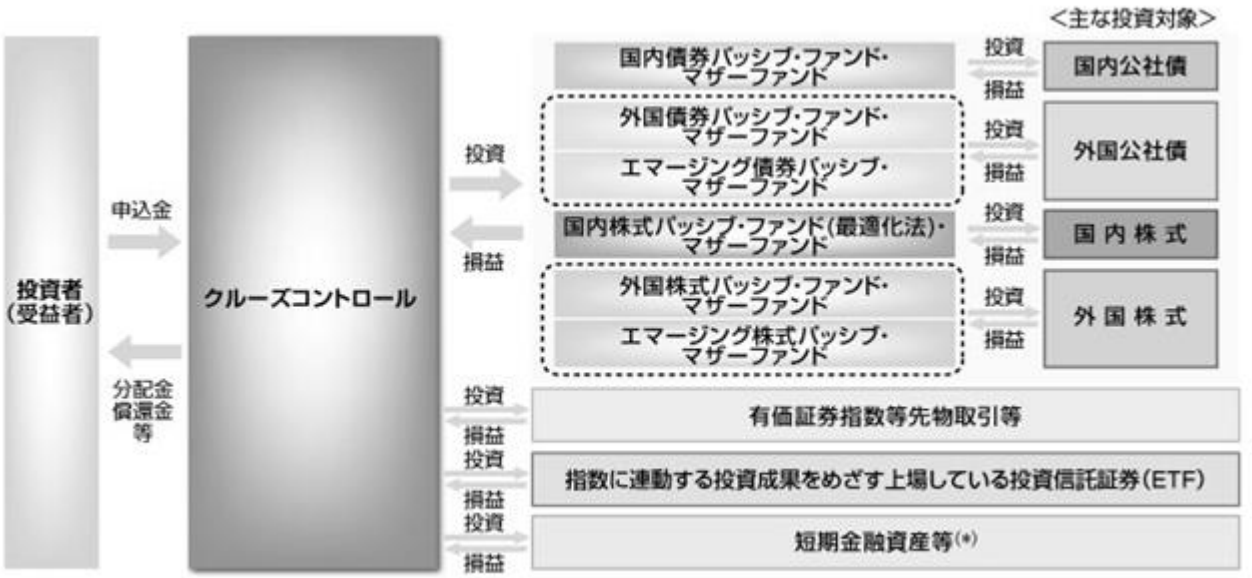
・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）との間においては、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。



(*)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。

○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、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果を目指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」受益証券や短期金融資産等に投資する場合もあります。

＜投資態度＞

①以下のマザーファンドへの投資を通じて、国内外の株式、公社債に実質的に分散投資を行います。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
エマージング債券パッシブ・マザーファンド
エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（上記それぞれおよびＤＩＡＭマネーマザーファンドを「各マザーファンド」、または総称して「マザーファンド」ということがあります。）

・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や短期金融資産等へ投資する場合もあります。

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

②各資産への投資比率は、統計的手法により、原則として年１回見直すこととします。

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

③基準価額の下落を一定水準（下値目安値(*)）までに抑えることを目標とします。

・資産価値上昇時には、値上がり益を獲得することをめざします。
・資産価値下落時でも、基準価額の下落を一定水準までに抑えることをめざします。
・下値目安値は、四半期毎に、委託会社の判断により基準価額から一定の水準に設定します。
・上記の運用目標は、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率(**)を機動的に変更することで行います。

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

(＊＊)合計資産比率とは、「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」を除く６つのマザーファンドの投資比率の合計をいいます。

・各資産への投資比率および合計資産比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社から投資助言を受けます。
・資金動向、市況動向等によっては上記のような運用が出来ない場合があります。

＜運用プロセス＞

・基本配分比率の決定

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

・下値目安値の決定

委託会社は、３ヵ月に一度、下値目安値の改定日を設け、当日の基準価額の98%の水準を翌３ヵ月間の下値目安値とします。

・リバランスの実施

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

・みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社からの助言

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

（２）【投資対象】

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。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

ｂ.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

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

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

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

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

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

11.コマーシャル・ペーパー

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

13.外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～12.の証券または証書の性質を有するもの

14.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)

15.投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

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

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

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

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

23.外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

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

③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

1.預金

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

3.コール・ローン

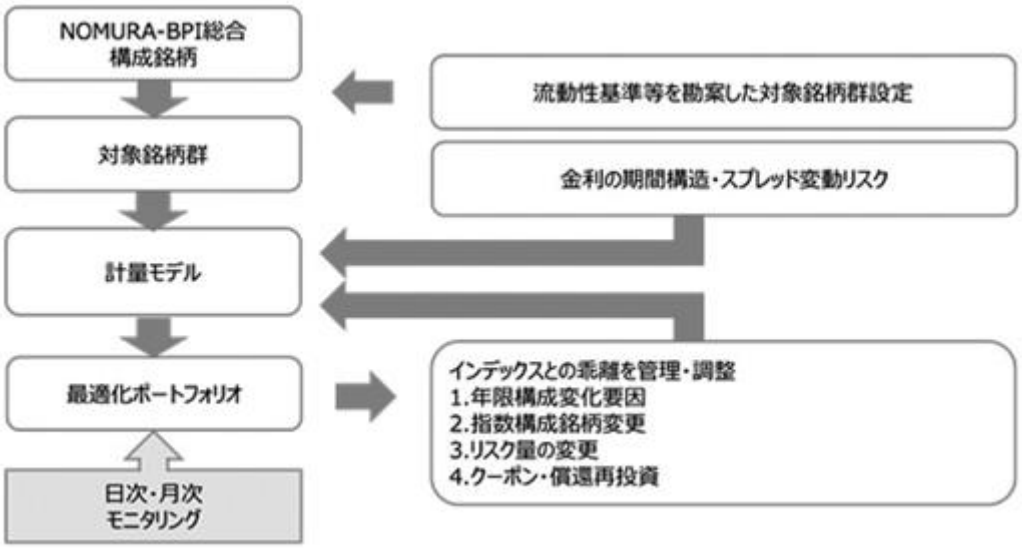
4.手形割引市場において売買される手形

5.貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6.外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

（参考）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

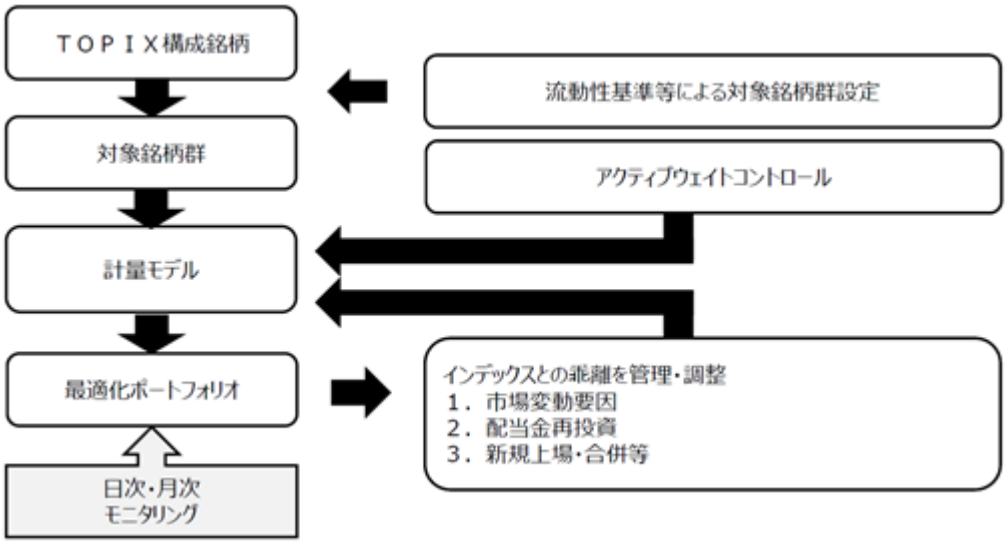
ファンド名	**国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**わが国の公社債を主要投資対象とします。**
投資態度	**1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。**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

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

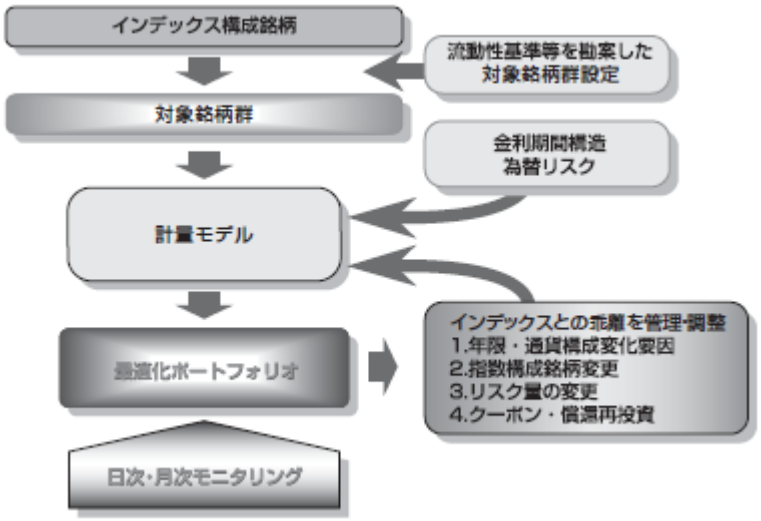
主な投資制限	1.株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 2.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3.同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4.同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約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

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	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	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3.外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 ※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	1.流動性基準等による対象銘柄群設定 FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。 2.最適化法によるポートフォリオの構築 金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。 3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理して、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・年限・通貨構成変化要因 ・指数構成銘柄変更 ・リスク量の変更 ・クーポン・償還再投資 

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

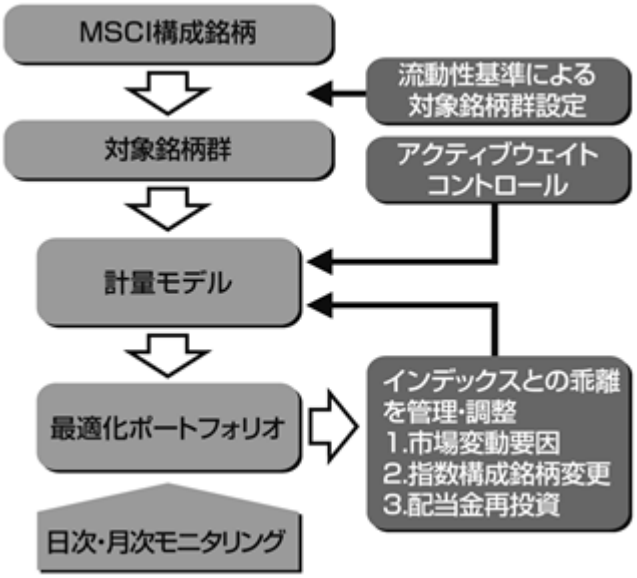
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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。

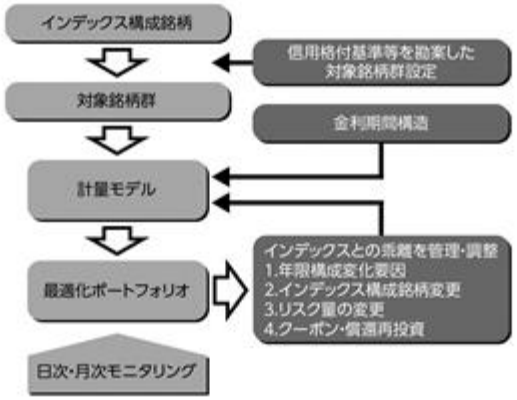
MSCIは、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入または使用するための情報を入手しますが、いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの独創性、正確性および／または完全性について保証するものではありません。いかなるMSCI関係者も、明示的か黙示的かを問わず、本ファンドの発行会社もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体が、MSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行いません。いかなるMSCI関係者も、MSCI指数またはそれに含まれるデータの、またはそれらに関連する過誤、脱漏または中断について責任を負いません。また、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	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。

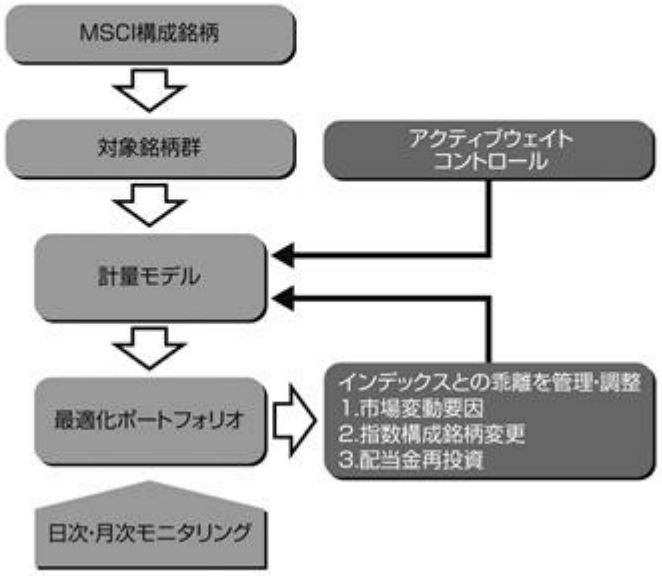
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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。**

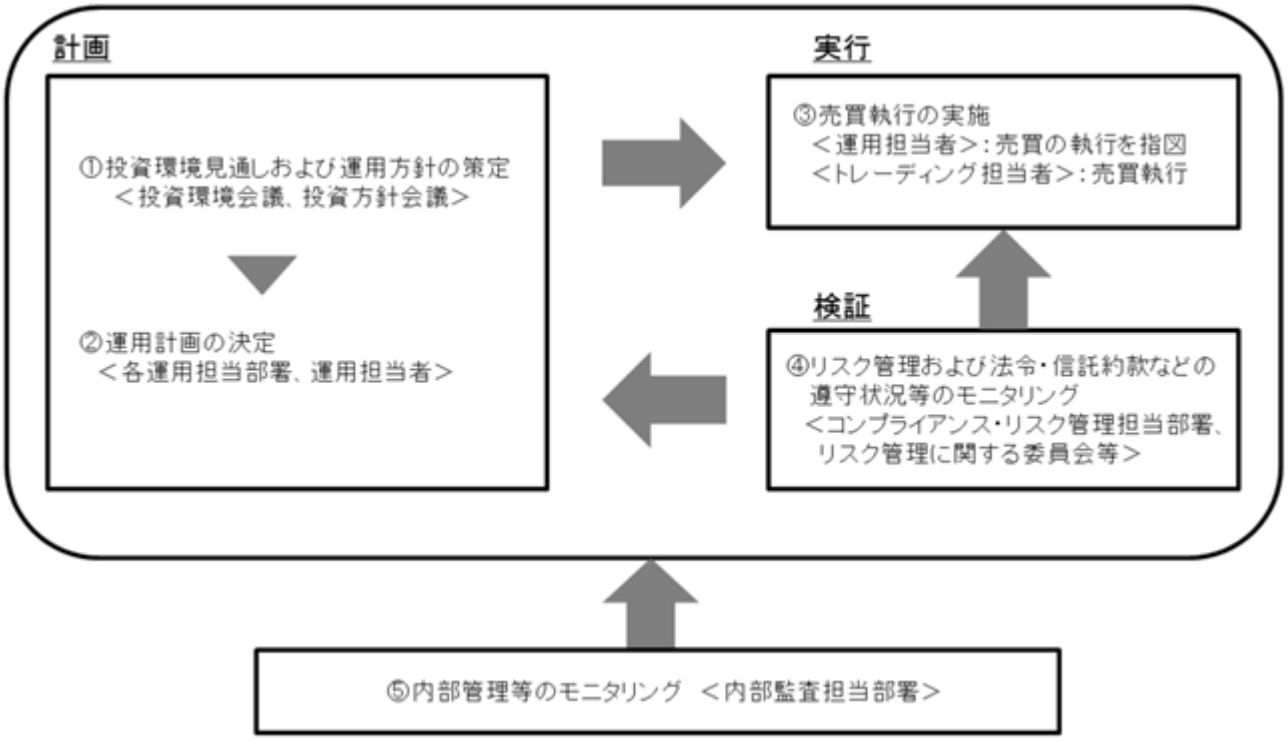
ファンド名	**ＤＩＡＭマネーマザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。**
主な投資対象	**国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。**

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、7月の各11日。休業日の場合は翌営業日。）に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1)分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

(2)分配対象額についての分配方針

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

(3)留保益の運用方針

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

②収益の分配方式

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

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

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

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

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

④外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法　(3)投資制限）

⑤非株式割合（マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）については制限を設けません。（約款「運用の基本方針」2.運用方法　(3)投資制限）

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

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑧信用取引の指図および範囲（約款第21条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑨先物取引等の運用指図（約款第22条）

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

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

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

⑩スワップ取引の運用指図（約款第23条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第24条）

1)委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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

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

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第24条の2）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第25条）

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

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

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

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

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

⑭特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第26条）

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

⑮外国為替予約取引の指図（約款第27条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

⑯資金の借入れ（約款第33条）

1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2)一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は、借入れ指図を行う日の信託財産の純資産総額の10%以内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

3)収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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

・資産配分リスク

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

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

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇（債券の価格の下落）は、基準価額の下落要因となります。

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

・為替リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

・信用リスク

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

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、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、株式・債券の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下がる要因となります。

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

○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。

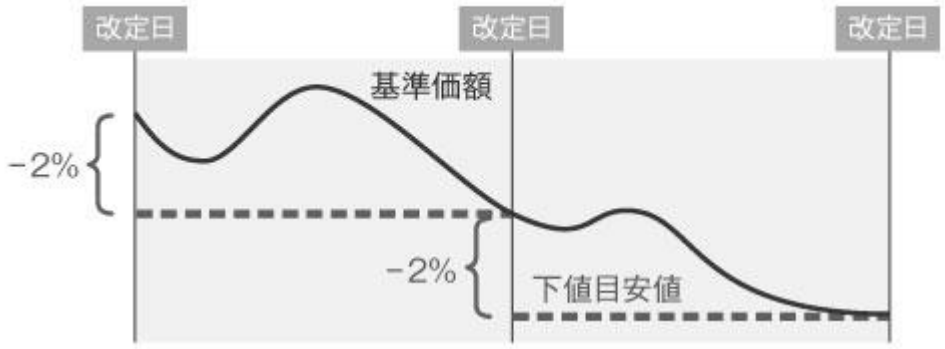
○当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等があった場合、資金変動等が起こり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響をおよぼす場合があります。

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

＜ケース①＞下値目安値の切下げについて

下値目安値は3ヵ月（四半期）毎の改定日にその時点の基準価額をもとに定められます。そのため、当ファンドの基準価額は長期的に2%以上下落する場合があります。

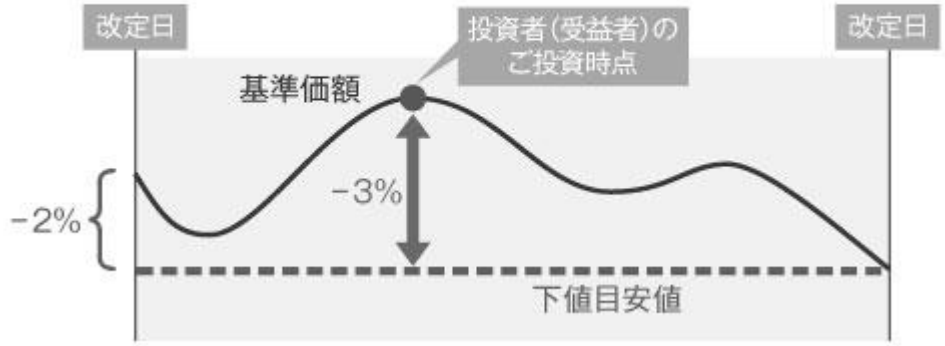
＜基準価額の推移（イメージ）＞



＜ケース②＞四半期途中の投資について

当ファンドの基準価額が直近の改定日の基準価額よりも上昇し、この時点でお客さまが当ファンドへ投資された場合、次回改定日までの基準価額の下落は2%以上となる場合があります。したがって、ご投資にあたっては、当該四半期の下値目安値にご留意いただきますようお願いいたします。

＜基準価額の推移（イメージ）＞



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

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

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

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

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

○注意事項

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

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

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

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

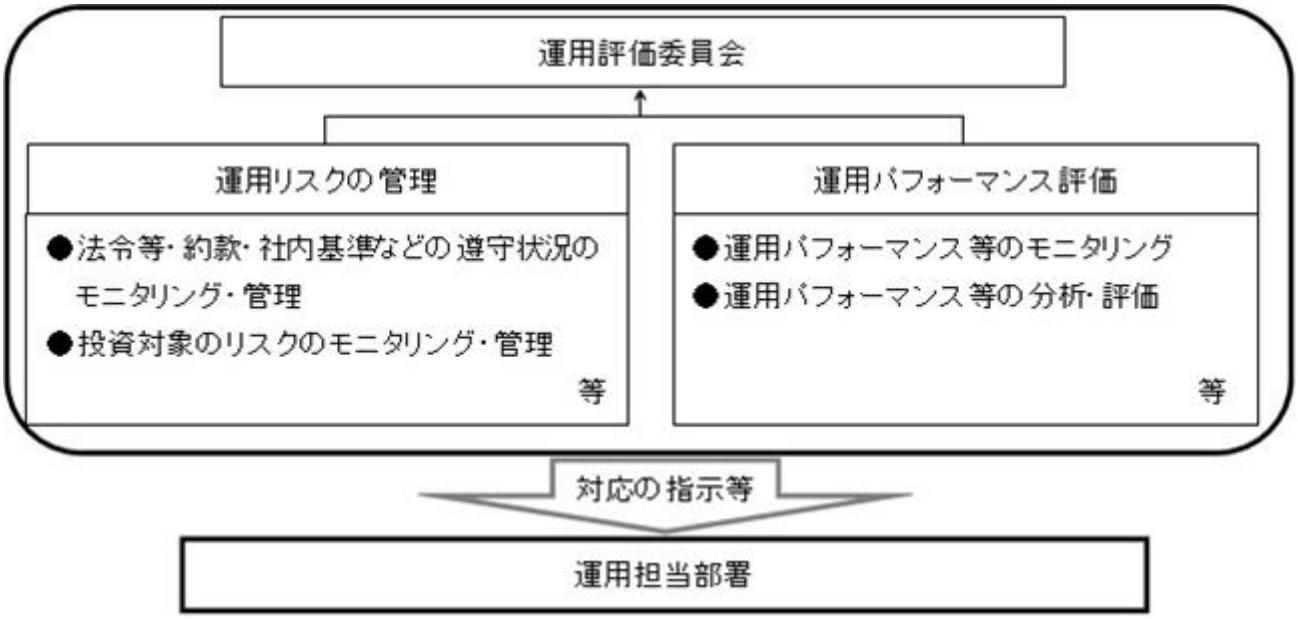
＜リスク管理体制＞

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

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

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

・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



・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。

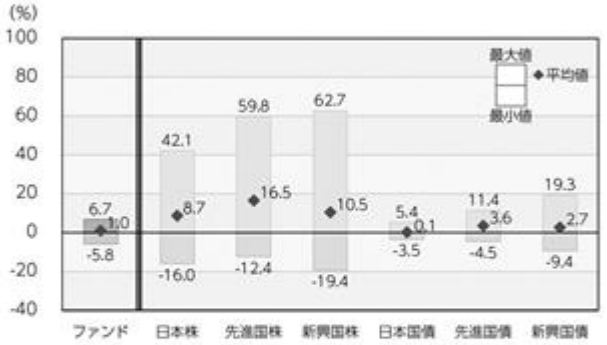
※リスク管理体制は2022年7月29日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<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

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



2017年8月~2022年7月

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数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、3.3%(税抜3.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（2）【換金（解約）手数料】

ありません。

（3）【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.54%（税抜1.40%）

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（4）【その他の手数料等】

1.信託財産留保額

ありません。

2.その他の費用

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

①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

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

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

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ならびに外貨建資産の保管等に要する費用は、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

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

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

○法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

※上記は、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「分配金自動けいぞく投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。

③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

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		7,215,464,037	64.35
	内　日本	7,215,464,037	64.35
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,996,664,994	35.65
純資産総額		11,212,129,031	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。

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		181,471,485,528	98.93
	内　アメリカ	92,302,042,620	50.32
	内　フランス	16,070,259,209	8.76
	内　イタリア	14,172,370,749	7.73
	内　ドイツ	11,992,046,367	6.54
	内　スペイン	9,594,658,001	5.23
	内　イギリス	9,269,740,220	5.05
	内　中国	3,953,699,935	2.16
	内　カナダ	3,823,151,952	2.08
	内　ベルギー	3,619,975,673	1.97
	内　オランダ	3,180,903,833	1.73
	内　オーストラリア	2,841,821,136	1.55
	内　オーストリア	2,382,652,202	1.30
	内　メキシコ	1,380,856,383	0.75
	内　アイルランド	1,222,679,647	0.67
	内　フィンランド	983,717,601	0.54
	内　マレーシア	914,922,482	0.50
	内　シンガポール	800,653,319	0.44
	内　ポーランド	738,895,094	0.40
	内　イスラエル	709,652,153	0.39
	内　デンマーク	680,096,437	0.37
	内　スウェーデン	475,257,873	0.26
	内　ノルウェー	361,432,642	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		1,966,961,077	1.07
純資産総額		183,438,446,605	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。

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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

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		900,548,000	75.51
	内　日本	900,548,000	75.51
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		292,136,108	24.49
純資産総額		1,192,684,108	100.00

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

（２）【投資資産】

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	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	879,677,740	2.1040 1,850,849,602	2.1267 1,870,810,649	－ －	16.69
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	382,290,194	3.2273 1,233,770,870	3.2592 1,245,960,200	－ －	11.11
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	969,908,575	1.2681 1,229,993,178	1.2777 1,239,252,186	－ －	11.05

4	ＤＩＡＭマネーマザーファンド 日本	親投資信託受益証券	990,000,991	1.0070 997,029,998	1.0071 997,029,998	－ －	8.89
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	104,546,634	5.9090 617,770,507	6.0392 631,378,032	－ －	5.63
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	307,244,701	2.0039 615,712,757	2.0351 625,273,691	－ －	5.58
7	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	433,242,227	1.4167 613,788,339	1.3982 605,759,281	－ －	5.40

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年7月29日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	64.35
合計	64.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率
該当事項はありません。

（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。

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 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,211,490,000	83.18 1,007,818,622	85.33 1,033,836,341	0.625 2030/8/15	0.56
2	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,044,573,600	93.65 978,284,081	88.48 924,284,418	1.125 2031/2/15	0.50
3	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,027,074,300	94.51 970,744,099	88.74 911,528,441	1.25 2031/8/15	0.50
4	US T N/B 2.75 11/15/23 アメリカ	国債証券	856,119,600	102.26 875,541,875	99.80 854,447,486	2.75 2023/11/15	0.47
5	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	849,577,500	99.28 843,482,392	99.45 844,937,107	0.75 2028/5/25	0.46
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	940,923,900	95.97 903,027,986	89.36 840,877,219	1.375 2031/11/15	0.46
7	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	893,810,400	97.86 874,695,618	91.96 822,026,252	1.625 2031/5/15	0.45
8	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	942,270,000	90.80 855,599,139	86.93 819,185,981	0.875 2030/11/15	0.45
9	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	845,350,800	93.13 787,315,974	93.25 788,355,659	1.875 2032/2/15	0.43
10	US T N/B 2.0 02/15/25 アメリカ	国債証券	798,237,300	97.65 779,510,652	97.92 781,711,288	2 2025/2/15	0.43
11	US T N/B 0.625 05/15/30 アメリカ	国債証券	895,156,500	85.36 764,161,718	85.67 766,949,803	0.625 2030/5/15	0.42
12	US T N/B 1.5 01/31/27 アメリカ	国債証券	799,583,400	98.82 790,170,749	94.81 758,105,011	1.5 2027/1/31	0.41
13	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	705,356,400	96.62 681,527,399	97.70 689,182,794	2.25 2027/8/15	0.38
14	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	686,511,000	102.14 701,214,206	99.31 681,791,236	2.5 2024/5/15	0.37
15	US T N/B 2.875 06/15/25 アメリカ	国債証券	673,050,000	99.54 670,009,160	100.10 673,733,563	2.875 2025/6/15	0.37
16	US T N/B 2.375 05/15/51 アメリカ	国債証券	748,431,600	100.88 755,031,617	86.43 646,925,564	2.375 2051/5/15	0.35
17	US T N/B 0.375 09/30/27 アメリカ	国債証券	716,125,200	89.55 641,299,054	88.67 635,029,612	0.375 2027/9/30	0.35
18	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証券	639,397,500	99.49 636,153,638	98.89 632,329,158	2.25 2024/3/31	0.34
19	US T N/B 2.0 04/30/24 アメリカ	国債証券	635,359,200	98.14 623,592,347	98.45 625,530,987	2 2024/4/30	0.34

20	US T N/B 0.125 02/15/24 アメリカ	国債証券	646,128,000	97.41 629,417,680	95.80 619,020,907	0.125 2024/2/15	0.34
21	US T N/B 1.875 02/15/41 アメリカ	国債証券	767,277,000	86.70 665,258,882	80.50 617,657,985	1.875 2041/2/15	0.34
22	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	616,513,800	102.86 634,157,536	99.96 616,321,138	2.75 2028/2/15	0.34
23	US T N/B 2.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	620,552,100	101.93 632,554,610	98.96 614,152,655	2.375 2024/8/15	0.33
24	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	609,783,300	106.13 647,189,407	100.67 613,927,916	2.875 2028/8/15	0.33
25	US T N/B 2.5 01/31/24 アメリカ	国債証券	612,475,500	101.99 624,673,105	99.37 608,623,597	2.5 2024/1/31	0.33
26	US T N/B 3.125 11/15/28 アメリカ	国債証券	589,591,800	107.87 636,044,169	102.20 602,581,242	3.125 2028/11/15	0.33
27	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	539,392,500	117.25 632,473,680	111.11 599,344,897	2.5 2030/5/25	0.33
28	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	620,552,100	98.31 610,104,013	95.74 594,130,150	1 2024/12/15	0.32
29	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証券	612,475,500	99.66 610,441,285	96.67 592,091,549	1.5 2025/2/15	0.32
30	US T N/B 2.375 05/15/27 アメリカ	国債証券	596,322,300	97.54 581,696,918	98.34 586,469,002	2.375 2027/5/15	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	98.93
合計	98.93

（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。

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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

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	４２４回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	200,000,000	100.09 200,190,000	100.12 200,246,000	0.005 2023/5/1	16.79
2	４１８回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	200,000,000	100.10 200,216,000	100.08 200,162,000	0.1 2022/11/1	16.78
3	４１６回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	200,000,000	100.07 200,154,000	100.02 200,046,000	0.1 2022/9/1	16.77
4	４１５回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	200,000,000	100.06 200,120,000	100.00 200,004,000	0.1 2022/8/1	16.77
5	４１９回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	100,000,000	100.12 100,121,000	100.09 100,090,000	0.1 2022/12/1	8.39

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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	75.51
合計	75.51

（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。

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。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド
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。

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。

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。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド
該当事項はありません。

（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特定期間末（2013年1月11日）	54	54	1.0953	1.0953
第2特定期間末（2013年7月11日）	57	57	1.1501	1.1501
第4計算期間末（2014年1月14日）	836	836	1.1801	1.1801

第5計算期間末 (2014年7月11日)	4,833	4,833	1.1888	1.1888
第6計算期間末 (2015年1月13日)	7,664	7,664	1.2660	1.2660
第7計算期間末 (2015年7月13日)	16,373	16,373	1.2816	1.2816
第8計算期間末 (2016年1月12日)	29,373	29,373	1.2200	1.2200
第9計算期間末 (2016年7月11日)	30,524	30,524	1.1796	1.1796
第10計算期間末 (2017年1月11日)	33,083	33,083	1.2331	1.2331
第11計算期間末 (2017年7月11日)	32,461	32,461	1.2524	1.2524
第12計算期間末 (2018年1月11日)	28,678	28,678	1.2864	1.2864
第13計算期間末 (2018年7月11日)	27,026	27,026	1.2537	1.2537
第14計算期間末 (2019年1月11日)	24,449	24,449	1.2062	1.2062
第15計算期間末 (2019年7月11日)	22,938	22,938	1.2287	1.2287
第16計算期間末 (2020年1月14日)	20,607	20,607	1.2590	1.2590
第17計算期間末 (2020年7月13日)	18,748	18,748	1.2562	1.2562
第18計算期間末 (2021年1月12日)	16,160	16,160	1.2941	1.2941
第19計算期間末 (2021年7月12日)	13,725	13,725	1.3111	1.3111
第20計算期間末 (2022年1月11日)	12,268	12,268	1.2898	1.2898
第21計算期間末 (2022年7月11日)	11,212	11,212	1.2429	1.2429
2021年7月末日	13,507	－	1.3046	－
8月末日	13,340	－	1.3065	－
9月末日	12,952	－	1.3021	－
10月末日	12,806	－	1.3115	－
11月末日	12,495	－	1.2911	－
12月末日	12,392	－	1.2965	－
2022年1月末日	12,028	－	1.2731	－
2月末日	11,915	－	1.2681	－
3月末日	11,678	－	1.2702	－
4月末日	11,502	－	1.2607	－
5月末日	11,443	－	1.2562	－
6月末日	11,257	－	1.2432	－
7月末日	11,212	－	1.2483	－

②【分配の推移】

	１口当たりの分配金（円）
第1特定期間	0.0000
第2特定期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000
第13計算期間	0.0000
第14計算期間	0.0000
第15計算期間	0.0000
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1特定期間	9.5
第2特定期間	5.0
第4計算期間	2.6
第5計算期間	0.7
第6計算期間	6.5
第7計算期間	1.2
第8計算期間	△4.8
第9計算期間	△3.3
第10計算期間	4.5
第11計算期間	1.6
第12計算期間	2.7
第13計算期間	△2.5
第14計算期間	△3.8
第15計算期間	1.9
第16計算期間	2.5
第17計算期間	△0.2
第18計算期間	3.0
第19計算期間	1.3
第20計算期間	△1.6
第21計算期間	△3.6

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

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1特定期間	50,000,000	0
第2特定期間	0	0
第4計算期間	719,575,072	60,468,768
第5計算期間	3,546,694,011	190,033,935
第6計算期間	3,178,106,719	1,190,093,443
第7計算期間	8,113,284,548	1,391,102,184
第8計算期間	12,475,200,872	1,174,643,755
第9計算期間	4,218,169,651	2,417,079,166
第10計算期間	3,726,999,882	2,774,409,766
第11計算期間	2,943,838,417	3,853,950,424
第12計算期間	2,426,808,751	6,053,103,346
第13計算期間	2,339,206,033	3,075,836,809
第14計算期間	967,336,189	2,254,647,937
第15計算期間	639,297,067	2,240,826,501
第16計算期間	513,000,084	2,813,656,675
第17計算期間	306,020,884	1,748,348,178
第18計算期間	306,787,422	2,744,453,780
第19計算期間	269,416,421	2,288,470,279
第20計算期間	328,483,921	1,285,084,124
第21計算期間	196,469,949	687,342,399

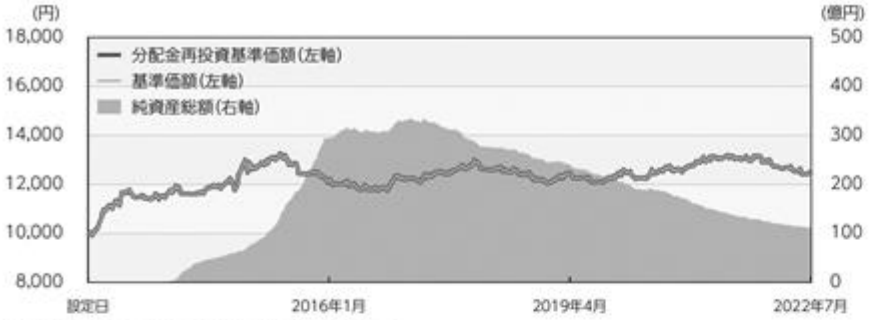
（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

（注2）第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2022年7月29日

基準価額・純資産の推移 《2012年10月26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:2012年10月26日)

分配の推移(税引前)

2020年 7月	0円
2021年 1月	0円
2021年 7月	0円
2022年 1月	0円
2022年 7月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	16.69
2	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	11.11
3	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11.05
4	DIAMマネーマザーファンド	8.89
5	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.63
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	5.58
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	5.40

■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

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	アメリカ	0.625	2030/8/15	0.56
2	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.50
3	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.50
4	US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	アメリカ	2.75	2023/11/15	0.47
5	FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	フランス	0.75	2028/5/25	0.46

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

データの基準日:2022年7月29日

■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

■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

■DIAMマネーマザーファンド

※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。

組入銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	424回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2023/5/1	16.79
2	418回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/11/1	16.78
3	416回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/9/1	16.77
4	415回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/8/1	16.77
5	419回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.1	2022/12/1	8.39

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。
※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。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

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

＜基準価額の照会方法等＞

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

※当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

・お申込手数料

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

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

２【換金（解約）手続等】

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

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

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、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を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社への問い合わせ

・委託会社への照会

ホームページ　URL　http://www.am-one.co.jp/

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、2012年10月26日（設定日）から原則として無期限です。

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

（4）【計算期間】

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

b.上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

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

（５）【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

f.委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

g.委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ．信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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

i.この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、

投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

g.上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

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

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

ハ. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、いずれの当事者からも別段の意思表示がない限り、信託終了日まで存続します。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

ニ．公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ．運用報告書

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

①収益分配金請求権

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

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

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

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

②償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため、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、解約の請求をすることができます。

④帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

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

（３）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第21期計算期間（2022年1月12日から2022年7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】

【クルーズコントロール】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第20期 2022年1月11日現在	第21期 2022年7月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,306,393,753	9,166,566,746
親投資信託受益証券	9,098,579,743	2,146,915,251
流動資産合計	12,404,973,496	11,313,481,997
資産合計	12,404,973,496	11,313,481,997
負債の部		
流動負債		
未払解約金	36,239,577	11,691,857
未払受託者報酬	3,578,741	3,181,581
未払委託者報酬	96,627,287	85,903,877
その他未払費用	254,719	226,438
流動負債合計	136,700,324	101,003,753
負債合計	136,700,324	101,003,753
純資産の部		
元本等		
元本	9,512,016,874	9,021,144,424
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,756,256,298	2,191,333,820
（分配準備積立金）	599,164,049	556,292,102
元本等合計	12,268,273,172	11,212,478,244
純資産合計	12,268,273,172	11,212,478,244
負債純資産合計	12,404,973,496	11,313,481,997

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第20期 自　2021年7月13日 至　2022年1月11日	第21期 自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
営業収益		
受取利息	17,680	31,616
有価証券売買等損益	△107,010,698	△343,664,492
営業収益合計	△106,993,018	△343,632,876
営業費用		
支払利息	581,357	749,150
受託者報酬	3,578,741	3,181,581
委託者報酬	96,627,287	85,903,877
その他費用	260,659	226,438
営業費用合計	101,048,044	90,061,046
営業利益又は営業損失（△）	△208,041,062	△433,693,922
経常利益又は経常損失（△）	△208,041,062	△433,693,922
当期純利益又は当期純損失（△）	△208,041,062	△433,693,922
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（△）	△6,637,228	△16,009,673
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,256,524,479	2,756,256,298
剰余金増加額又は欠損金減少額	100,847,086	51,799,045
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	100,847,086	51,799,045
剰余金減少額又は欠損金増加額	399,711,433	199,037,274
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	399,711,433	199,037,274
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	2,756,256,298	2,191,333,820

（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21期 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。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第20期 2022年1月11日現在	第21期 2022年7月11日現在
１．　期首元本額	10,468,617,077円	9,512,016,874円
期中追加設定元本額	328,483,921円	196,469,949円
期中一部解約元本額	1,285,084,124円	687,342,399円
２．　受益権の総数	9,512,016,874口	9,021,144,424口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第20期 自　2021年7月13日 至　2022年1月11日	第21期 自　2022年1月12日 至　2022年7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（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,389,836,230円）及び分配準備積立金（599,164,049円）より分配対象収益は2,989,000,279円（1万口当たり3,142.34円）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,278,486,419円）及び分配準備積立金（556,292,102円）より分配対象収益は2,834,778,521円（1万口当たり3,142.37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20期 自　2021年7月13日 至　2022年1月11日	第21期 自　2022年1月12日 至　2022年7月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	第20期 2022年1月11日現在	第21期 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。	同左
２． 時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
３． 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第20期 2022年1月11日現在	第21期 2022年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	△10,714,626	△10,659,721
合計	△10,714,626	△10,659,721

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第20期 2022年1月11日現在	第21期 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）	1.2898円 (12,898円)	1.2429円 (12,429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7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	71,457,276	229,770,870	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	177,481,406	224,993,178	
	ＤＩＡＭマネーマザーファンド	990,000,991	997,029,998	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	18,688,477	109,770,507	
	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	168,829,430	353,849,602	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	81,036,597	114,788,339	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	58,452,826	116,712,757	
親投資信託受益証券　合計		1,565,947,003	2,146,915,251	
合計			2,146,915,251	

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

第２　信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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、「外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「ＤＩＡＭマネーマザーファンド」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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△6,791,019,050
地方債証券	△299,624,922
特殊債券	△437,120,687
社債券	△343,548,390
合計	△7,871,313,049

（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（2022年2月15日から2022年7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7月11日現在
1口当たり純資産額	1.2677円

（1万口当たり純資産額）	(12,677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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４２９回　利付国庫債券（２年）	2,830,000,000	2,833,792,200	
	４３０回　利付国庫債券（２年）	3,340,000,000	3,344,776,200	
	４３１回　利付国庫債券（２年）	4,300,000,000	4,306,278,000	
	４３２回　利付国庫債券（２年）	3,400,000,000	3,404,998,000	
	４３３回　利付国庫債券（２年）	3,400,000,000	3,404,760,000	
	４３４回　利付国庫債券（２年）	4,600,000,000	4,606,762,000	
	４３５回　利付国庫債券（２年）	3,720,000,000	3,725,766,000	
	４３７回　利付国庫債券（２年）	2,150,000,000	2,153,655,000	
	１３７回　利付国庫債券（５年）	5,700,000,000	5,713,908,000	
	１３８回　利付国庫債券（５年）	5,000,000,000	5,014,050,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	4,050,000,000	4,062,312,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	3,490,000,000	3,502,180,100	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	3,310,000,000	3,322,710,400	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	3,230,000,000	3,243,792,100	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,114,601,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	4,000,000,000	4,020,000,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	4,850,000,000	4,874,783,500	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	3,800,000,000	3,819,646,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	4,080,000,000	4,086,772,800	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	3,990,000,000	3,994,708,200	

１４９回　利付国庫債券（５年）	4,150,000,000	4,152,573,000	
１５０回　利付国庫債券（５年）	3,840,000,000	3,840,000,000	
１５１回　利付国庫債券（５年）	3,540,000,000	3,537,486,600	
１５２回　利付国庫債券（５年）	1,330,000,000	1,334,668,300	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	140,042,100	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	770,584,500	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	663,951,600	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	884,980,800	
５回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,193,395,800	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,120,000,000	1,294,384,000	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,190,000,000	1,317,520,400	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,350,000,000	1,388,934,000	
９回　利付国庫債券（４０年）	2,130,000,000	1,611,046,800	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,780,000,000	1,579,554,200	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,280,000,000	1,094,617,600	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,360,000,000	1,039,380,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,830,000,000	1,389,390,900	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,020,000,000	1,640,442,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	300,000,000	266,325,000	
３３２回　利付国庫債券（１０年）	1,410,000,000	1,424,128,200	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	6,630,000,000	6,706,178,700	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	4,620,000,000	4,681,030,200	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	2,810,000,000	2,845,462,200	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	2,100,000,000	2,129,526,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	4,200,000,000	4,238,514,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	4,330,000,000	4,385,380,700	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	4,880,000,000	4,947,539,200	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	4,540,000,000	4,606,783,400	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	4,820,000,000	4,878,129,200	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	4,680,000,000	4,704,195,600	

３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,350,000,000	4,371,402,000	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	4,730,000,000	4,751,805,300	
３４５回　利付国庫債券（１０年）	5,190,000,000	5,211,849,900	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	4,570,000,000	4,587,091,800	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	4,010,000,000	4,022,832,000	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,290,000,000	4,301,068,200	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	4,330,000,000	4,338,183,700	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	5,660,000,000	5,666,395,800	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,501,305,000	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,690,000,000	4,687,092,200	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	3,940,000,000	3,934,956,800	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	3,660,000,000	3,652,716,600	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	4,210,000,000	4,196,949,000	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	3,940,000,000	3,921,797,200	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	3,710,000,000	3,685,476,900	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	3,550,000,000	3,523,091,000	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	4,500,000,000	4,463,055,000	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	4,840,000,000	4,797,117,600	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	4,900,000,000	4,851,245,000	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	4,640,000,000	4,588,588,800	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	4,600,000,000	4,545,582,000	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	4,000,000,000	3,953,160,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	4,540,000,000	4,489,606,000	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	3,700,000,000	3,698,224,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	130,693,200	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	116,624,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	244,394,000	

６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	240,090,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	230,618,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	286,465,000	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	273,789,700	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	177,129,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	417,557,400	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	322,953,800	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	298,761,600	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	333,601,200	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	490,288,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	343,548,800	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	414,239,100	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	381,718,500	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	365,002,700	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	441,217,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	340,877,700	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	408,078,000	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	776,928,200	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	787,294,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	979,062,700	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,082,060,600	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,094,473,600	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	884,368,800	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,206,670,300	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,408,223,800	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,469,532,000	

３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,738,465,800	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	2,107,946,100	
３７回　利付国庫債券（３０年）	2,060,000,000	2,416,112,200	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,673,213,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,280,000,000	1,500,236,800	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,120,000,000	1,291,348,800	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,337,636,200	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,427,365,800	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,220,000,000	1,381,101,000	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	1,300,914,500	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,340,000,000	1,461,457,600	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,590,000,000	1,732,193,700	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,618,921,000	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,642,055,800	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,310,000,000	1,394,927,300	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,371,246,600	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,150,000,000	956,627,500	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,510,000,000	1,314,273,800	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,360,000,000	1,208,060,800	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,345,933,500	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,320,000,000	1,222,161,600	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,228,268,300	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,261,948,100	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,670,000,000	1,534,312,500	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	920,830,300	

６０回　利付国庫債券（３０年）	1,070,000,000	1,000,043,400	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	921,741,600	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	1,063,421,800	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,210,000,000	981,939,200	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,070,000,000	865,223,400	
６５回　利付国庫債券（３０年）	910,000,000	737,627,800	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	833,620,200	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,230,615,000	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,363,412,400	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,470,000,000	1,278,885,300	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,510,000,000	1,311,087,700	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,540,000,000	1,334,471,600	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,210,706,000	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,390,991,700	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,310,000,000	1,224,496,300	
６４回　利付国庫債券（２０年）	30,000,000	30,717,600	
６５回　利付国庫債券（２０年）	60,000,000	61,726,800	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,673,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,408,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,771,600	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	481,960,400	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	399,281,200	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,127,600	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	190,542,600	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	73,722,600	

７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	42,235,200	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	264,507,500	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	53,048,500	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	95,752,800	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	426,348,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	149,669,800	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	75,187,700	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	182,012,200	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	636,627,700	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	130,369,200	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	129,926,400	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	644,091,200	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,877,400	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	513,554,900	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	120,655,700	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,267,903,200	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	404,306,400	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	735,264,700	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	611,429,500	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	132,218,400	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	733,477,800	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	176,984,000	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	832,747,500	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	929,882,200	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	260,284,100	

１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	568,235,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	180,889,600	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	123,062,500	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	718,540,800	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	564,435,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	676,146,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	768,742,800	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	391,202,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	497,631,200	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	525,306,200	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	839,966,600	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	1,170,000,000	1,331,846,100	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	820,000,000	935,603,600	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	413,395,200	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	610,713,700	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,224,850,400	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	633,321,600	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	528,975,600	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	743,599,500	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	898,237,900	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	643,501,500	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,215,091,500	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	689,364,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	701,568,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	587,637,300	

１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	617,598,000	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,571,787,300	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	865,275,200	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,040,002,600	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	895,741,500	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	942,299,000	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,178,876,200	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	1,034,388,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	843,481,600	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	960,000,000	1,085,145,600	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	880,000,000	1,003,754,400	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	1,031,531,600	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	1,300,000,000	1,470,209,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,090,000,000	2,386,424,700	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,980,000,000	2,264,070,600	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	1,010,000,000	1,165,146,100	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,620,000,000	1,837,128,600	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	950,000,000	1,067,496,000	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	2,463,599,000	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,380,000,000	2,728,955,600	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,390,000,000	2,715,637,500	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,300,000,000	2,588,259,000	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,260,000,000	2,544,737,400	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	2,550,000,000	2,841,465,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	2,760,000,000	3,009,172,800	

１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,740,000,000	2,986,627,400	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,420,000,000	2,666,622,200	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,390,000,000	2,603,474,800	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,660,000,000	2,827,500,200	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,964,300,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,030,000,000	1,934,244,900	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,390,000,000	2,366,458,500	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	2,180,000,000	2,184,338,200	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	2,100,000,000	2,129,778,000	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	2,290,000,000	2,285,282,600	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	2,030,000,000	2,020,154,500	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,170,000,000	2,153,247,600	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,530,000,000	2,465,434,400	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	1,890,000,000	1,835,794,800	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	2,040,000,000	2,037,021,600	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	1,870,000,000	1,804,213,400	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,770,000,000	1,674,384,600	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,800,000,000	1,668,222,000	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,820,000,000	1,679,914,600	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,840,000,000	1,691,420,000	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,760,000,000	1,639,475,200	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	1,920,000,000	1,781,337,600	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	1,910,000,000	1,764,840,000	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,130,000,000	1,995,234,900	
１７６回　利付国庫債券（２０年）	2,180,000,000	2,033,983,600	

	１７７回　利付国庫債券（２０年）	2,180,000,000	1,990,732,400	
	１７８回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,855,400,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年）	2,060,000,000	1,904,737,800	
	１８０回　利付国庫債券（２０年）	2,000,000,000	1,951,860,000	
国債証券　合計		446,415,000,000	454,144,467,200	
地方債証券	７２６回　東京都公募公債	400,000,000	404,156,000	
	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,853,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	110,192,500	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	196,818,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	394,880,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	296,517,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	238,318,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	118,590,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	105,614,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	106,776,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	218,582,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	328,254,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	113,119,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	113,852,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,958,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	399,256,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	98,452,000	
	２９回１号　宮城県公募公債　１０年	100,000,000	100,864,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	246,355,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	303,129,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	101,380,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	198,930,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	197,800,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	127,014,000	
	１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	112,645,000	
	１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	344,307,000	
	１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	113,777,000	
	４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,706,000	

４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	100,362,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,712,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	197,120,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	196,402,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	195,542,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	226,678,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	107,918,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	98,500,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	298,626,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	353,892,000	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	109,483,062	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	394,988,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	198,140,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	202,312,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	196,780,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	98,696,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	124,198,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	212,798,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	306,351,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	319,524,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	105,309,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	102,761,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	196,958,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	98,599,000	
令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	196,802,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,311,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,725,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	207,996,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	106,822,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	338,946,000	

２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	343,782,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	119,927,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	163,009,500	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	101,438,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	198,484,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	235,971,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	100,269,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	198,054,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	90,398,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	92,601,000	
２５年度８回　埼玉県公募公債	100,000,000	101,010,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	404,848,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	197,590,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	189,206,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	243,021,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	114,227,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	112,593,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	336,537,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	107,640,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	202,212,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	100,622,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	199,756,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	197,058,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	98,584,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	106,222,000	
令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	160,216,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	111,638,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	114,456,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	337,449,000	
２５年度５回　千葉県公募公債	200,000,000	201,864,000	
２５年度６回　千葉県公募公債	100,000,000	100,954,000	

２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	203,460,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	100,131,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	195,808,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	107,718,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	107,328,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	96,983,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	101,071,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	197,648,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	112,027,000	
１２７回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,864,000	
１２８回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,676,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,099,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,060,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,864,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	609,072,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	507,905,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,518,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,446,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,061,200	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,920,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,495,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,820,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,140,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,420,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,972,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,329,000	
１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,805,000	

１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,942,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,408,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,440,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,496,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,565,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	99,815,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	101,188,000	
２５年度２回　島根県公募公債	106,000,000	106,965,660	
令和元年度１回　島根県公募公債	200,000,000	189,330,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	197,056,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	101,176,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,798,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	199,998,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	295,983,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	225,310,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	455,715,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	196,604,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	111,907,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	108,113,000	
５回　京都市公募公債　３０年定時償還	200,000,000	185,920,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	110,170,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	230,146,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	227,172,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	101,184,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	300,897,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	170,246,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	393,576,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	123,747,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	111,765,000	
２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	112,024,000	
２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	119,634,000	

	２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	101,021,000	
	２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	295,542,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	199,692,000	
	６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	226,682,000	
	５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	119,645,000	
	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	111,476,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	111,848,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	122,848,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	197,730,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	91,464,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	101,074,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	197,696,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	300,918,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	99,270,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	298,659,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	197,298,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	197,056,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	101,118,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	101,070,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	198,946,000	
地方債証券　合計		32,445,330,000	33,087,965,922	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	212,122,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	210,510,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	301,203,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	456,550,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,936,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	84,661,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,009,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	405,678,000	
	１９回　高速道路機構債	150,000,000	196,702,500	
	２６回　高速道路機構債	200,000,000	254,804,000	
	３６回　高速道路機構債	300,000,000	399,399,000	
	７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	114,387,000	
	１１６回　高速道路機構債	100,000,000	100,838,000	
	１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,589,000	

１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,021,000	
１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	108,667,000	
１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,996,000	
１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,744,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	99,441,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	190,136,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	98,031,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,570,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	115,039,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	562,400,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,900,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,638,000	
１９５回政保日本高速道路保有・債務返済機構	430,000,000	434,218,300	
２０２回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	105,985,950	
２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,112,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,285,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,612,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	323,337,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	506,255,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,208,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,398,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	209,576,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	534,780,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,425,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,946,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,206,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	802,096,000	

３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	198,626,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,133,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	240,840,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	159,210,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	167,792,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	170,070,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	628,485,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	223,318,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	341,325,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	341,805,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	114,898,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,111,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	227,386,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	112,746,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	226,240,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,870,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	349,002,000	
５６回　政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	548,341,400	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	111,937,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	303,621,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	551,660,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,118,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	217,444,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	325,044,000	
８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	400,052,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,092,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	99,447,000	

９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	501,570,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,299,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,135,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,274,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	267,888,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	499,135,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	225,374,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,003,090	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	106,934,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	105,607,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	208,860,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	169,848,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	109,166,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	101,233,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	226,150,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,042,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	402,139,500	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,212,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	114,142,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,672,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	289,990,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,518,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,445,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,996,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,423,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,828,000	
２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	97,096,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,015,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	498,015,000	
８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	19,596,000	19,678,303	

９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	30,024,000	30,151,602	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	31,659,000	32,053,787	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,880,000	49,007,574	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,743,000	10,884,163	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,435,000	52,125,771	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,624,000	30,739,146	
１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,090,000	50,312,900	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,522,000	10,641,845	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,422,000	18,317,665	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,795,000	113,187,748	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,032,000	173,418,926	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,875,000	23,981,692	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,726,000	20,652,530	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,272,000	24,275,488	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	24,352,000	25,404,249	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	30,602,000	31,871,064	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,954,000	77,695,817	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	33,254,000	34,524,635	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,338,000	40,497,290	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,875,000	41,075,237	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,691,000	44,982,069	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,776,000	46,825,185	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	50,904,000	51,284,252	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,352,000	58,225,470	
９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,429,000	60,753,078	

１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	221,835,000	219,215,128	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,206,000	74,801,391	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,962,000	74,653,906	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,965,000	74,597,671	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	234,138,000	232,222,751	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	234,558,000	232,475,124	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	158,716,000	157,265,335	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	238,884,000	236,227,609	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	238,899,000	236,321,279	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	411,810,000	408,943,801	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,276,000	81,628,487	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,691,000	83,179,265	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	269,820,000	263,994,586	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	361,064,000	354,377,094	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,386,000	273,388,867	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,447,000	281,613,446	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	864,720,000	849,881,404	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,707,000	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	100,151,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	100,003,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	299,190,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	298,734,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	199,138,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	399,828,000	
３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	299,130,000	
７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	100,928,000	
１５回　国際協力機構債	100,000,000	113,243,000	
７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,264,000	
７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,140,000	
８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	299,850,000	

	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	399,280,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	101,166,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	103,498,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	197,396,000	
特殊債券　合計		29,956,599,000	30,973,035,370	
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	297,144,000	
	２６回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,078,000	
	２回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,605,000	
	６回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	201,080,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	98,671,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,958,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	399,584,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	101,171,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	91,194,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,921,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	198,042,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	298,998,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	199,332,000	
	５６回　中日本高速道路社債	100,000,000	101,052,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	199,274,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	497,810,000	
	２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	202,288,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	101,553,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	301,461,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	201,464,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	497,810,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	199,280,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	101,057,000	
	９回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	98,105,000	
	１２回　セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,534,000	
	１４回　セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,338,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	300,072,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	199,244,000	
	４９回　住友化学社債	100,000,000	101,386,000	
	２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	197,960,000	

４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,332,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	297,756,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	485,955,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,636,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	298,965,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	297,996,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	100,666,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	98,404,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	196,410,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	101,065,000	
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	99,132,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	201,904,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	199,420,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	97,203,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	394,728,000	
４７回　住友商事社債	100,000,000	100,907,000	
４８回　クレディセゾン社債	100,000,000	101,079,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	399,572,000	
１３回　新生銀行社債	200,000,000	199,580,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	109,994,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	108,185,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	298,698,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,884,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	202,008,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	296,955,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	298,692,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	396,904,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,263,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,756,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,716,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	195,364,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	293,331,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	98,749,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	198,372,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	199,358,000	
３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	195,882,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	299,406,000	

３回　野村ホールディングス社債	300,000,000	297,753,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	104,652,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	100,487,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	200,372,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	104,831,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	94,207,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	317,022,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	212,622,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	112,736,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,060,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	227,838,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	103,434,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,669,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,334,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,904,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	80,633,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,758,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	183,472,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	169,868,000	
１０回　西日本旅客鉄道社債	300,000,000	307,182,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	112,601,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	197,558,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,198,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	80,980,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,368,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	182,882,000	
１３回　東海旅客鉄道社債	200,000,000	205,536,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	103,520,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	110,492,000	
４回　東京地下鉄社債	120,000,000	130,380,000	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	79,780,000	
６回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	196,688,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	392,052,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	195,088,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	97,337,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	193,416,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	102,136,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	298,599,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	390,256,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	185,780,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	287,598,000	
３７７回　中国電力社債	400,000,000	404,468,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	195,984,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	96,889,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	102,671,000	
３１１回　北陸電力社債	100,000,000	101,501,000	

	４７１回　東北電力社債	400,000,000	405,860,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	99,161,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	389,616,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	196,130,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	286,515,000	
	４２４回　九州電力社債	200,000,000	202,896,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	405,652,000	
	４２８回　九州電力社債	100,000,000	101,424,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	95,959,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	94,747,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	287,538,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	90,457,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	197,912,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	265,084,650	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	299,088,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	190,990,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	210,484,000	
	３８回　電源開発社債	300,000,000	303,792,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,849,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	191,748,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	194,560,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	92,715,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	89,051,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,686,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	193,610,000	
社債券　合計		26,981,000,000	26,778,809,650	
合計			544,984,278,142	

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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△717,844,839
合計	△717,844,839

（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（2022年2月8日から2022年7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。

（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)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年7月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	7,800	3,535.00	27,573,000	
日本水産	223,000	583.00	130,009,000	

マルハニチロ	31,800	2,524.00	80,263,200	
雪国まいたけ	17,400	955.00	16,617,000	
カネコ種苗	6,800	1,594.00	10,839,200	
サカタのタネ	26,000	4,410.00	114,660,000	
ホクト	18,400	1,952.00	35,916,800	
ホクリヨウ	3,400	617.00	2,097,800	
ショーボンドホールディングス	28,100	6,010.00	168,881,000	
ミライト・ワン	77,300	1,643.00	127,003,900	
タマホーム	14,600	2,401.00	35,054,600	
サンヨーホームズ	3,000	723.00	2,169,000	
日本アクア	9,700	589.00	5,713,300	
ファーストコーポレーション	6,000	734.00	4,404,000	
ベステラ	4,900	1,142.00	5,595,800	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	40,100	184.00	7,378,400	
キャンディル	4,100	535.00	2,193,500	
住石ホールディングス	41,900	187.00	7,835,300	
日鉄鉱業	4,600	5,250.00	24,150,000	
三井松島ホールディングス	10,000	2,913.00	29,130,000	
ＩＮＰＥＸ	838,100	1,404.00	1,176,692,400	
石油資源開発	28,300	3,135.00	88,720,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	9,400	1,539.00	14,466,600	
ダイセキ環境ソリューション	4,600	836.00	3,845,600	
第一カッター興業	5,400	1,289.00	6,960,600	
明豊ファシリティワークス	7,800	644.00	5,023,200	
安藤・間	109,500	870.00	95,265,000	
東急建設	64,500	633.00	40,828,500	
コムシスホールディングス	77,400	2,609.00	201,936,600	
ビーアールホールディングス	30,500	338.00	10,309,000	
高松コンストラクショングループ	15,200	2,072.00	31,494,400	
東建コーポレーション	6,600	8,300.00	54,780,000	
ソネック	2,500	1,006.00	2,515,000	
ヤマウラ	10,600	964.00	10,218,400	
オリエンタル白石	80,900	243.00	19,658,700	
大成建設	154,400	4,290.00	662,376,000	
大林組	515,300	973.00	501,386,900	
清水建設	476,500	763.00	363,569,500	
飛島建設	14,900	1,044.00	15,555,600	
長谷工コーポレーション	148,700	1,605.00	238,663,500	
松井建設	18,500	638.00	11,803,000	
錢高組	1,800	3,185.00	5,733,000	
鹿島建設	377,600	1,508.00	569,420,800	
不動テトラ	11,800	1,622.00	19,139,600	
大末建設	5,800	1,533.00	8,891,400	
鉄建建設	11,300	1,831.00	20,690,300	
西松建設	33,700	4,045.00	136,316,500	
三井住友建設	125,200	460.00	57,592,000	
大豊建設	8,100	4,280.00	34,668,000	
佐田建設	12,500	449.00	5,612,500	
ナカノフドー建設	13,600	305.00	4,148,000	
奥村組	27,600	2,980.00	82,248,000	

東鉄工業	21,900	2,378.00	52,078,200	
イチケン	4,100	1,816.00	7,445,600	
富士ピー・エス	7,500	454.00	3,405,000	
淺沼組	6,300	5,390.00	33,957,000	
戸田建設	212,800	725.00	154,280,000	
熊谷組	27,400	2,771.00	75,925,400	
北野建設	3,300	2,128.00	7,022,400	
植木組	4,700	1,338.00	6,288,600	
矢作建設工業	22,200	798.00	17,715,600	
ピーエス三菱	18,300	618.00	11,309,400	
日本ハウスホールディングス	37,400	405.00	15,147,000	
大東建託	56,700	12,170.00	690,039,000	
新日本建設	23,700	736.00	17,443,200	
東亜道路工業	3,000	5,710.00	17,130,000	
日本道路	4,900	6,630.00	32,487,000	
東亜建設工業	12,400	2,484.00	30,801,600	
日本国土開発	43,300	527.00	22,819,100	
若築建設	8,600	2,305.00	19,823,000	
東洋建設	62,300	874.00	54,450,200	
五洋建設	204,300	703.00	143,622,900	
世紀東急工業	26,800	822.00	22,029,600	
福田組	6,000	4,820.00	28,920,000	
日本ドライケミカル	4,100	1,648.00	6,756,800	
住友林業	121,500	2,032.00	246,888,000	
日本基礎技術	13,700	613.00	8,398,100	
巴コーポレーション	20,300	450.00	9,135,000	
大和ハウス工業	439,200	3,256.00	1,430,035,200	
ライト工業	30,600	1,879.00	57,497,400	
積水ハウス	526,700	2,379.00	1,253,019,300	
日特建設	11,600	824.00	9,558,400	
北陸電気工事	10,000	768.00	7,680,000	
ユアテック	31,800	740.00	23,532,000	
日本リーテック	10,600	952.00	10,091,200	
四電工	5,400	1,758.00	9,493,200	
中電工	22,500	2,148.00	48,330,000	
関電工	90,400	855.00	77,292,000	
きんでん	112,700	1,605.00	180,883,500	
東京エネシス	16,600	1,033.00	17,147,800	
トーエネック	5,600	3,645.00	20,412,000	
住友電設	13,800	2,616.00	36,100,800	
日本電設工業	23,700	1,792.00	42,470,400	
エクシオグループ	76,900	2,124.00	163,335,600	
新日本空調	12,100	1,857.00	22,469,700	
日本工営	10,700	3,340.00	35,738,000	
九電工	35,100	2,741.00	96,209,100	
三機工業	36,200	1,582.00	57,268,400	
日揮ホールディングス	156,700	1,717.00	269,053,900	
中外炉工業	5,300	1,643.00	8,707,900	
ヤマト	13,500	773.00	10,435,500	
太平電業	10,200	2,904.00	29,620,800	

高砂熱学工業	42,600	1,653.00	70,417,800	
三晃金属工業	2,100	2,668.00	5,602,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	57,500	1,934.00	111,205,000	
朝日工業社	6,800	1,869.00	12,709,200	
明星工業	28,100	706.00	19,838,600	
大氣社	23,100	3,165.00	73,111,500	
ダイダン	10,400	2,139.00	22,245,600	
日比谷総合設備	15,100	1,933.00	29,188,300	
ニップン	43,400	1,662.00	72,130,800	
日清製粉グループ本社	167,300	1,644.00	275,041,200	
日東富士製粉	1,800	4,670.00	8,406,000	
昭和産業	14,000	2,611.00	36,554,000	
鳥越製粉	13,100	667.00	8,737,700	
中部飼料	18,400	1,094.00	20,129,600	
フィード・ワン	21,400	697.00	14,915,800	
東洋精糖	2,100	936.00	1,965,600	
日本甜菜製糖	9,400	1,717.00	16,139,800	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	14,500	1,935.00	28,057,500	
塩水港精糖	22,000	208.00	4,576,000	
日新製糖	8,600	1,776.00	15,273,600	
ＬＩＦＵＬＬ	51,700	172.00	8,892,400	
ミクシィ	38,700	2,252.00	87,152,400	
ジェイエイシーリクルートメント	13,700	1,850.00	25,345,000	
日本Ｍ＆Ａセンターホールディングス	277,400	1,637.00	454,103,800	
メンバーズ	4,400	2,651.00	11,664,400	
中広	1,200	385.00	462,000	
ＵＴグループ	24,300	2,528.00	61,430,400	
アイティメディア	8,100	1,615.00	13,081,500	
Ｅ・Ｊホールディングス	9,800	1,193.00	11,691,400	
夢真ビーネックスグループ	55,200	1,599.00	88,264,800	
コシダカホールディングス	45,100	714.00	32,201,400	
アルトナー	4,100	887.00	3,636,700	
パソナグループ	18,300	1,957.00	35,813,100	
ＣＤＳ	4,300	1,776.00	7,636,800	
リンクアンドモチベーション	37,300	501.00	18,687,300	
エス・エム・エス	57,500	2,892.00	166,290,000	
サニーサイドアップグループ	6,000	661.00	3,966,000	
パーソルホールディングス	169,000	2,700.00	456,300,000	
リニカル	9,700	799.00	7,750,300	
クックパッド	53,300	206.00	10,979,800	
エスクリ	7,600	360.00	2,736,000	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8,400	599.00	5,031,600	
森永製菓	35,700	4,405.00	157,258,500	
中村屋	3,600	3,215.00	11,574,000	
江崎グリコ	41,300	4,090.00	168,917,000	
名糖産業	6,500	1,689.00	10,978,500	
井村屋グループ	8,700	2,300.00	20,010,000	
不二家	9,900	2,443.00	24,185,700	
山崎製パン	108,900	1,738.00	189,268,200	
第一屋製パン	4,100	494.00	2,025,400	

モロゾフ	5,300	3,680.00	19,504,000	
亀田製菓	9,200	4,775.00	43,930,000	
寿スピリッツ	15,500	6,370.00	98,735,000	
カルビー	80,900	2,838.00	229,594,200	
森永乳業	30,100	5,140.00	154,714,000	
六甲バター	11,800	1,425.00	16,815,000	
ヤクルト本社	112,700	8,110.00	913,997,000	
明治ホールディングス	97,800	7,060.00	690,468,000	
雪印メグミルク	38,900	1,907.00	74,182,300	
プリマハム	22,300	2,333.00	52,025,900	
日本ハム	62,300	4,285.00	266,955,500	
林兼産業	4,400	486.00	2,138,400	
丸大食品	16,100	1,590.00	25,599,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	16,000	3,185.00	50,960,000	
柿安本店	6,300	2,434.00	15,334,200	
伊藤ハム米久ホールディングス	114,300	699.00	79,895,700	
学情	6,800	992.00	6,745,600	
スタジオアリス	7,600	2,378.00	18,072,800	
クロスキャット	9,400	999.00	9,390,600	
シミックホールディングス	8,400	1,498.00	12,583,200	
エプコ	3,600	711.00	2,559,600	
システナ	247,800	451.00	111,757,800	
ＮＪＳ	3,300	1,951.00	6,438,300	
デジタルアーツ	9,300	6,230.00	57,939,000	
日鉄ソリューションズ	30,200	3,810.00	115,062,000	
綜合警備保障	61,600	3,875.00	238,700,000	
キューブシステム	8,800	1,003.00	8,826,400	
いちご	194,500	314.00	61,073,000	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	2,400	1,055.00	2,532,000	
日本駐車場開発	172,200	172.00	29,618,400	
コア	7,300	1,479.00	10,796,700	
カカクコム	124,100	2,339.00	290,269,900	
アイロムグループ	6,100	1,890.00	11,529,000	
セントケア・ホールディング	11,000	890.00	9,790,000	
サイネックス	2,800	594.00	1,663,200	
ルネサンス	11,700	941.00	11,009,700	
ディップ	29,700	3,750.00	111,375,000	
ＳＢＳホールディングス	13,100	2,859.00	37,452,900	
デジタルホールディングス	11,700	1,246.00	14,578,200	
新日本科学	20,500	2,073.00	42,496,500	
キャリアデザインセンター	3,500	1,176.00	4,116,000	
ベネフィット・ワン	61,500	1,965.00	120,847,500	
エムスリー	298,300	4,054.00	1,209,308,200	
ツカダ・グローバルホールディング	10,900	328.00	3,575,200	
ブラス	2,200	925.00	2,035,000	
アウトソーシング	96,800	1,115.00	107,932,000	
ウェルネット	14,900	463.00	6,898,700	
ワールドホールディングス	6,700	2,287.00	15,322,900	
ディー・エヌ・エー	64,300	1,880.00	120,884,000	
博報堂ＤＹホールディングス	214,100	1,280.00	274,048,000	

ぐるなび	24,600	373.00	9,175,800	
タカミヤ	20,800	376.00	7,820,800	
ジャパンベストレスキューシステム	9,500	760.00	7,220,000	
ファンコミュニケーションズ	38,200	390.00	14,898,000	
ライク	5,600	2,290.00	12,824,000	
ビジネス・ブレークスルー	6,600	424.00	2,798,400	
エスプール	47,700	990.00	47,223,000	
ＷＤＢホールディングス	7,700	2,497.00	19,226,900	
手間いらず	2,400	5,240.00	12,576,000	
ティア	10,400	432.00	4,492,800	
ＣＤＧ	1,800	1,272.00	2,289,600	
アドウェイズ	25,400	678.00	17,221,200	
バリューコマース	13,200	3,155.00	41,646,000	
インフォマート	185,200	386.00	71,487,200	
サッポロホールディングス	52,000	2,975.00	154,700,000	
アサヒグループホールディングス	362,200	4,584.00	1,660,324,800	
キリンホールディングス	652,700	2,224.50	1,451,931,150	
宝ホールディングス	98,700	1,032.00	101,858,400	
オエノンホールディングス	47,200	313.00	14,773,600	
養命酒製造	4,900	1,805.00	8,844,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	113,400	1,552.00	175,996,800	
サントリー食品インターナショナル	118,900	5,290.00	628,981,000	
ダイドーグループホールディングス	9,100	5,140.00	46,774,000	
伊藤園	54,000	6,330.00	341,820,000	
キーコーヒー	16,200	2,123.00	34,392,600	
ユニカフェ	5,500	920.00	5,060,000	
ジャパンフーズ	1,800	1,145.00	2,061,000	
日清オイリオグループ	20,400	3,255.00	66,402,000	
不二製油グループ本社	38,400	2,314.00	88,857,600	
かどや製油	1,500	3,595.00	5,392,500	
Ｊ－オイルミルズ	16,700	1,640.00	27,388,000	
ローソン	38,500	4,580.00	176,330,000	
サンエー	11,800	4,175.00	49,265,000	
カワチ薬品	13,500	2,169.00	29,281,500	
エービーシー・マート	27,300	5,830.00	159,159,000	
ハードオフコーポレーション	7,800	924.00	7,207,200	
高千穂交易	6,300	1,968.00	12,398,400	
アスクル	37,500	1,699.00	63,712,500	
ゲオホールディングス	21,100	1,305.00	27,535,500	
アダストリア	18,800	2,064.00	38,803,200	
ジーフット	10,900	330.00	3,597,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	2,800	393.00	1,100,400	
オルバヘルスケアホールディングス	3,000	1,655.00	4,965,000	
伊藤忠食品	3,500	5,020.00	17,570,000	
くら寿司	18,200	3,320.00	60,424,000	
キャンドゥ	6,500	2,218.00	14,417,000	
エレマテック	14,000	1,247.00	17,458,000	
アイケイ	5,500	442.00	2,431,000	
パルグループホールディングス	15,200	1,763.00	26,797,600	

エディオン	80,100	1,298.00	103,969,800	
あらた	12,800	4,105.00	52,544,000	
サーラコーポレーション	35,400	705.00	24,957,000	
ワッツ	8,400	723.00	6,073,200	
トーメンデバイス	2,500	5,660.00	14,150,000	
ハローズ	7,900	3,050.00	24,095,000	
ＪＰホールディングス	43,500	254.00	11,049,000	
フジオフードグループ本社	12,900	1,347.00	17,376,300	
あみやき亭	4,200	2,981.00	12,520,200	
東京エレクトロン　デバイス	5,200	5,310.00	27,612,000	
ひらまつ	37,000	200.00	7,400,000	
フィールズ	15,200	863.00	13,117,600	
双日	178,800	1,938.00	346,514,400	
アルフレッサ　ホールディングス	180,700	1,876.00	338,993,200	
大黒天物産	5,600	4,645.00	26,012,000	
ハニーズホールディングス	13,800	1,256.00	17,332,800	
ファーマライズホールディングス	4,300	700.00	3,010,000	
キッコーマン	106,500	7,760.00	826,440,000	
味の素	354,100	3,490.00	1,235,809,000	
ブルドックソース	6,400	1,919.00	12,281,600	
キユーピー	77,800	2,319.00	180,418,200	
ハウス食品グループ本社	55,400	2,992.00	165,756,800	
カゴメ	67,300	3,430.00	230,839,000	
焼津水産化学工業	7,300	945.00	6,898,500	
アリアケジャパン	16,200	5,540.00	89,748,000	
ピエトロ	2,300	1,833.00	4,215,900	
エバラ食品工業	3,900	3,065.00	11,953,500	
やまみ	1,400	1,670.00	2,338,000	
ニチレイ	66,200	2,417.00	160,005,400	
横浜冷凍	42,400	909.00	38,541,600	
東洋水産	79,200	5,430.00	430,056,000	
イートアンドホールディングス	6,700	2,340.00	15,678,000	
大冷	2,100	1,914.00	4,019,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9,200	485.00	4,462,000	
日清食品ホールディングス	57,200	9,790.00	559,988,000	
永谷園ホールディングス	7,900	2,040.00	16,116,000	
一正蒲鉾	7,000	804.00	5,628,000	
フジッコ	16,700	2,011.00	33,583,700	
ロック・フィールド	17,700	1,482.00	26,231,400	
日本たばこ産業	952,400	2,380.00	2,266,712,000	
ケンコーマヨネーズ	9,100	1,496.00	13,613,600	
わらべや日洋ホールディングス	10,600	2,236.00	23,701,600	
なとり	10,000	2,068.00	20,680,000	
イフジ産業	3,200	963.00	3,081,600	
ピックルスコーポレーション	8,400	1,130.00	9,492,000	
ファーマフーズ	22,400	1,418.00	31,763,200	
北の達人コーポレーション	61,900	215.00	13,308,500	
ユーグレナ	91,700	926.00	84,914,200	
紀文食品	13,800	1,003.00	13,841,400	
スター・マイカ・ホールディングス	9,500	1,467.00	13,936,500	

ＳＲＥホールディングス	4,400	2,699.00	11,875,600	
ＡＤワークスグループ	30,800	150.00	4,620,000	
片倉工業	15,600	2,126.00	33,165,600	
グンゼ	10,000	3,800.00	38,000,000	
ヒューリック	379,600	1,073.00	407,310,800	
神栄	2,400	876.00	2,102,400	
ラサ商事	8,200	975.00	7,995,000	
アルペン	12,800	2,136.00	27,340,800	
ハブ	5,600	539.00	3,018,400	
ラクーンホールディングス	14,800	1,632.00	24,153,600	
クオールホールディングス	21,400	1,398.00	29,917,200	
アルコニックス	22,200	1,308.00	29,037,600	
神戸物産	120,300	3,480.00	418,644,000	
ソリトンシステムズ	8,700	1,268.00	11,031,600	
ジンズホールディングス	9,200	4,420.00	40,664,000	
ビックカメラ	103,400	1,177.00	121,701,800	
ＤＣＭホールディングス	103,500	1,019.00	105,466,500	
ペッパーフードサービス	23,800	377.00	8,972,600	
ハイパー	2,800	447.00	1,251,600	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	220,300	2,222.00	489,506,600	
東京一番フーズ	4,200	592.00	2,486,400	
ＤＤホールディングス	9,200	555.00	5,106,000	
あい　ホールディングス	24,900	1,620.00	40,338,000	
ディーブイエックス	5,700	1,066.00	6,076,200	
きちりホールディングス	4,700	372.00	1,748,400	
アークランドサービスホールディングス	12,700	2,149.00	27,292,300	
Ｊ．フロント　リテイリング	193,200	1,076.00	207,883,200	
ドトール・日レスホールディングス	27,500	1,555.00	42,762,500	
マツキヨココカラ＆カンパニー	102,100	5,220.00	532,962,000	
ブロンコビリー	9,200	2,363.00	21,739,600	
ＺＯＺＯ	119,900	2,840.00	340,516,000	
トレジャー・ファクトリー	5,200	1,218.00	6,333,600	
物語コーポレーション	8,700	5,560.00	48,372,000	
三越伊勢丹ホールディングス	261,600	1,034.00	270,494,400	
東洋紡	68,300	1,024.00	69,939,200	
ユニチカ	47,400	236.00	11,186,400	
富士紡ホールディングス	7,100	3,320.00	23,572,000	
日清紡ホールディングス	102,200	1,053.00	107,616,600	
倉敷紡績	12,100	2,052.00	24,829,200	
ダイワボウホールディングス	74,100	1,838.00	136,195,800	
シキボウ	9,300	903.00	8,397,900	
日東紡績	21,900	2,299.00	50,348,100	
トヨタ紡織	61,900	2,042.00	126,399,800	
マクニカ・富士エレホールディングス	41,600	2,614.00	108,742,400	
Ｈａｍｅｅ	6,300	1,059.00	6,671,700	
マーケットエンタープライズ	1,800	1,158.00	2,084,400	
ラクト・ジャパン	6,000	2,454.00	14,724,000	
ウエルシアホールディングス	92,100	2,988.00	275,194,800	
クリエイトＳＤホールディングス	25,700	3,145.00	80,826,500	

グリムス	7,700	1,516.00	11,673,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	27,900	709.00	19,781,100	
八洲電機	12,700	1,001.00	12,712,700	
メディアスホールディングス	10,000	980.00	9,800,000	
レスターホールディングス	16,700	1,925.00	32,147,500	
ジューテックホールディングス	3,400	1,051.00	3,573,400	
丸善ＣＨＩホールディングス	21,200	374.00	7,928,800	
大光	7,700	709.00	5,459,300	
ＯＣＨＩホールディングス	4,100	1,230.00	5,043,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	84,500	887.00	74,951,500	
黒谷	4,900	596.00	2,920,400	
ミサワ	3,400	607.00	2,063,800	
ティーライフ	2,300	1,397.00	3,213,100	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,300	717.00	2,366,100	
エー・ピーホールディングス	2,500	441.00	1,102,500	
三洋貿易	15,900	1,001.00	15,915,900	
チムニー	5,300	1,234.00	6,540,200	
シュッピン	14,500	1,342.00	19,459,000	
ビューティガレージ	2,800	2,631.00	7,366,800	
オイシックス・ラ・大地	25,100	1,795.00	45,054,500	
ウイン・パートナーズ	12,700	1,030.00	13,081,000	
ネクステージ	35,300	2,502.00	88,320,600	
ジョイフル本田	50,000	1,623.00	81,150,000	
鳥貴族ホールディングス	5,700	2,202.00	12,551,400	
ホットランド	13,100	1,325.00	17,357,500	
すかいらーくホールディングス	212,400	1,607.00	341,326,800	
ＳＦＰホールディングス	8,600	1,580.00	13,588,000	
綿半ホールディングス	12,000	1,394.00	16,728,000	
日本毛織	42,800	999.00	42,757,200	
ダイトウボウ	28,600	91.00	2,602,600	
トーア紡コーポレーション	4,900	370.00	1,813,000	
ダイドーリミテッド	23,400	163.00	3,814,200	
ヨシックスホールディングス	3,400	2,339.00	7,952,600	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50,800	1,106.00	56,184,800	
三栄建築設計	7,000	1,633.00	11,431,000	
野村不動産ホールディングス	90,400	3,245.00	293,348,000	
三重交通グループホールディングス	35,900	478.00	17,160,200	
サムティ	25,600	2,064.00	52,838,400	
ディア・ライフ	21,300	607.00	12,929,100	
コーセーアールイー	5,300	657.00	3,482,100	
地主	11,000	2,058.00	22,638,000	
プレサンスコーポレーション	19,100	1,535.00	29,318,500	
フィル・カンパニー	2,800	1,290.00	3,612,000	
ＴＨＥグローバル社	9,400	147.00	1,381,800	
ハウスコム	3,200	891.00	2,851,200	
ＪＰＭＣ	8,400	1,024.00	8,601,600	
サンセイランディック	5,300	855.00	4,531,500	
エストラスト	1,800	552.00	993,600	

フージャースホールディングス	22,400	800.00	17,920,000	
オープンハウスグループ	55,500	5,710.00	316,905,000	
東急不動産ホールディングス	474,500	706.00	334,997,000	
飯田グループホールディングス	145,600	2,143.00	312,020,800	
イーグランド	2,400	1,428.00	3,427,200	
ムゲンエステート	10,900	483.00	5,264,700	
帝国繊維	18,100	1,692.00	30,625,200	
日本コークス工業	149,600	119.00	17,802,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,100	1,354.00	12,321,400	
ミタチ産業	4,400	862.00	3,792,800	
ＢＥＥＮＯＳ	8,800	2,414.00	21,243,200	
あさひ	14,500	1,305.00	18,922,500	
日本調剤	10,500	1,350.00	14,175,000	
コスモス薬品	17,700	13,260.00	234,702,000	
シップヘルスケアホールディングス	50,200	2,585.00	129,767,000	
トーエル	7,700	921.00	7,091,700	
ソフトクリエイトホールディングス	7,600	4,125.00	31,350,000	
セブン&アイ・ホールディングス	584,500	5,482.00	3,204,229,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	116,900	918.00	107,314,200	
明治電機工業	5,300	1,099.00	5,824,700	
ツルハホールディングス	38,100	7,550.00	287,655,000	
デリカフーズホールディングス	7,100	512.00	3,635,200	
スターティアホールディングス	4,100	742.00	3,042,200	
サンマルクホールディングス	13,800	1,584.00	21,859,200	
フェリシモ	3,900	1,115.00	4,348,500	
トリドールホールディングス	43,400	2,592.00	112,492,800	
帝人	152,100	1,432.00	217,807,200	
東レ	1,075,500	709.30	762,852,150	
クラレ	233,900	1,081.00	252,845,900	
旭化成	1,072,200	1,069.00	1,146,181,800	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	15,900	330.00	5,247,000	
稲葉製作所	8,900	1,381.00	12,290,900	
宮地エンジニアリンググループ	5,000	3,340.00	16,700,000	
トーカロ	45,100	1,259.00	56,780,900	
アルファ	6,300	1,007.00	6,344,100	
ＳＵＭＣＯ	288,600	1,762.00	508,513,200	
川田テクノロジーズ	3,300	3,660.00	12,078,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,600	6,030.00	33,768,000	
ジェイテックコーポレーション	2,200	2,144.00	4,716,800	
信和	10,900	783.00	8,534,700	
ビーロット	12,000	511.00	6,132,000	
ファーストブラザーズ	4,200	830.00	3,486,000	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	8,600	827.00	7,112,200	
シーアールイー	6,600	1,675.00	11,055,000	
プロパティエージェント	2,100	1,475.00	3,097,500	
ケイアイスター不動産	7,800	4,670.00	36,426,000	
アグレ都市デザイン	2,800	1,512.00	4,233,600	
グッドコムアセット	7,600	1,274.00	9,682,400	
ジェイ・エス・ビー	3,500	3,195.00	11,182,500	

ロードスターキャピタル	4,400	1,945.00	8,558,000	
テンポイノベーション	5,000	862.00	4,310,000	
グローバル・リンク・マネジメント	3,100	925.00	2,867,500	
フェイスネットワーク	2,200	1,383.00	3,042,600	
住江織物	3,000	1,702.00	5,106,000	
日本フエルト	9,900	411.00	4,068,900	
イチカワ	1,800	1,391.00	2,503,800	
エコナックホールディングス	29,200	92.00	2,686,400	
日東製網	2,000	1,308.00	2,616,000	
芦森工業	3,400	1,025.00	3,485,000	
アツギ	12,600	496.00	6,249,600	
ウイルプラスホールディングス	3,300	864.00	2,851,200	
ＪＭホールディングス	13,200	1,670.00	22,044,000	
コメダホールディングス	38,100	2,292.00	87,325,200	
サツドラホールディングス	8,100	670.00	5,427,000	
アレンザホールディングス	11,600	1,045.00	12,122,000	
串カツ田中ホールディングス	4,600	1,877.00	8,634,200	
バロックジャパンリミテッド	12,300	820.00	10,086,000	
クスリのアオキホールディングス	15,700	5,550.00	87,135,000	
ダイニック	5,800	622.00	3,607,600	
共和レザー	9,700	573.00	5,558,100	
ピーバンドットコム	2,300	515.00	1,184,500	
力の源ホールディングス	8,900	662.00	5,891,800	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	89,300	2,742.00	244,860,600	
アセンテック	6,000	629.00	3,774,000	
セーレン	31,900	2,052.00	65,458,800	
ソトー	6,400	844.00	5,401,600	
東海染工	1,800	1,134.00	2,041,200	
小松マテーレ	26,200	1,111.00	29,108,200	
ワコールホールディングス	35,400	2,119.00	75,012,600	
ホギメディカル	21,500	3,300.00	70,950,000	
クラウディアホールディングス	2,800	255.00	714,000	
ＴＳＩホールディングス	52,500	344.00	18,060,000	
マツオカコーポレーション	5,000	942.00	4,710,000	
ワールド	22,600	1,298.00	29,334,800	
ＴＩＳ	151,800	3,645.00	553,311,000	
ＪＮＳホールディングス	7,900	413.00	3,262,700	
グリー	79,000	833.00	65,807,000	
GMOペパボ	1,900	2,000.00	3,800,000	
コーエーテクモホールディングス	55,400	4,705.00	260,657,000	
三菱総合研究所	7,200	4,195.00	30,204,000	
ボルテージ	4,600	342.00	1,573,200	
電算	1,000	2,192.00	2,192,000	
ＡＧＳ	7,100	764.00	5,424,400	
ファインデックス	14,700	672.00	9,878,400	
ブレインパッド	14,700	1,117.00	16,419,900	
ＫＬａｂ	29,800	491.00	14,631,800	
ポールトゥウィンホールディングス	25,200	947.00	23,864,400	
ネクソン	396,100	2,921.00	1,157,008,100	

アイスタイル	44,700	248.00	11,085,600	
エムアップホールディングス	20,100	1,362.00	27,376,200	
エイチーム	10,900	708.00	7,717,200	
エニグモ	18,800	522.00	9,813,600	
テクノスジャパン	13,500	485.00	6,547,500	
ｅｎｉｓｈ	12,300	394.00	4,846,200	
コロプラ	57,000	662.00	37,734,000	
オルトプラス	12,600	359.00	4,523,400	
ブロードリーフ	86,100	461.00	39,692,100	
クロス・マーケティンググループ	6,600	729.00	4,811,400	
デジタルハーツホールディングス	7,800	1,811.00	14,125,800	
システム情報	13,100	978.00	12,811,800	
メディアドゥ	5,800	2,052.00	11,901,600	
じげん	49,000	340.00	16,660,000	
ブイキューブ	17,700	1,202.00	21,275,400	
エンカレッジ・テクノロジ	4,100	507.00	2,078,700	
サイバーリンクス	5,700	1,157.00	6,594,900	
ディー・エル・イー	11,700	352.00	4,118,400	
フィックスターズ	16,700	981.00	16,382,700	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	7,100	1,939.00	13,766,900	
オプティム	12,100	805.00	9,740,500	
セレス	6,500	1,234.00	8,021,000	
ＳＨＩＦＴ	10,700	17,240.00	184,468,000	
特種東海製紙	9,100	3,115.00	28,346,500	
ティーガイア	15,500	1,640.00	25,420,000	
セック	2,500	2,510.00	6,275,000	
テクマトリックス	29,400	1,823.00	53,596,200	
プロシップ	5,700	1,596.00	9,097,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	45,100	2,477.00	111,712,700	
GMOペイメントゲートウェイ	33,700	10,690.00	360,253,000	
ザッパラス	6,300	357.00	2,249,100	
システムリサーチ	5,200	2,091.00	10,873,200	
インターネットイニシアティブ	46,200	5,120.00	236,544,000	
さくらインターネット	18,800	560.00	10,528,000	
ヴィンクス	4,900	1,305.00	6,394,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,900	5,390.00	21,021,000	
ＳＲＡホールディングス	8,400	2,900.00	24,360,000	
システムインテグレータ	5,600	477.00	2,671,200	
朝日ネット	16,000	592.00	9,472,000	
ｅＢＡＳＥ	20,800	549.00	11,419,200	
アバント	18,500	1,449.00	26,806,500	
アドソル日進	6,300	1,618.00	10,193,400	
ＯＤＫソリューションズ	3,600	584.00	2,102,400	
フリービット	9,100	835.00	7,598,500	
コムチュア	19,400	2,798.00	54,281,200	
サイバーコム	2,600	1,339.00	3,481,400	
アステリア	12,500	954.00	11,925,000	
アイル	8,300	1,572.00	13,047,600	

王子ホールディングス	668,900	571.00	381,941,900	
日本製紙	70,200	985.00	69,147,000	
三菱製紙	22,300	298.00	6,645,400	
北越コーポレーション	103,300	729.00	75,305,700	
中越パルプ工業	6,700	929.00	6,224,300	
巴川製紙所	5,200	622.00	3,234,400	
大王製紙	74,400	1,456.00	108,326,400	
阿波製紙	4,600	301.00	1,384,600	
マークラインズ	8,700	2,200.00	19,140,000	
メディカル・データ・ビジョン	22,000	1,129.00	24,838,000	
ｇｕｍｉ	24,000	691.00	16,584,000	
ショーケース	3,900	432.00	1,684,800	
モバイルファクトリー	3,900	1,097.00	4,278,300	
テラスカイ	6,400	1,524.00	9,753,600	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	1,424.00	10,964,800	
ＰＣＩホールディングス	6,800	927.00	6,303,600	
パイプドＨＤ	3,200	2,798.00	8,953,600	
アイビーシー	2,500	428.00	1,070,000	
ネオジャパン	4,900	1,136.00	5,566,400	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,600	2,121.00	7,635,600	
ラクス	79,600	1,826.00	145,349,600	
ランドコンピュータ	4,200	876.00	3,679,200	
ダブルスタンダード	5,300	2,018.00	10,695,400	
オープンドア	10,300	1,662.00	17,118,600	
マイネット	6,300	505.00	3,181,500	
アカツキ	7,700	2,671.00	20,566,700	
ベネフィットジャパン	1,000	1,988.00	1,988,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,500	2,608.00	11,736,000	
カナミックネットワーク	21,200	588.00	12,465,600	
ノムラシステムコーポレーション	17,700	123.00	2,177,100	
レンゴー	133,800	746.00	99,814,800	
トーモク	8,600	1,540.00	13,244,000	
ザ・パック	10,900	2,407.00	26,236,300	
チェンジ	36,100	2,164.00	78,120,400	
シンクロ・フード	8,800	379.00	3,335,200	
オークネット	9,200	2,137.00	19,660,400	
キャピタル・アセット・プランニング	3,200	639.00	2,044,800	
セグエグループ	4,400	537.00	2,362,800	
エイトレッド	2,400	2,027.00	4,864,800	
マクロミル	33,300	948.00	31,568,400	
ビーグリー	4,100	1,297.00	5,317,700	
オロ	5,400	1,711.00	9,239,400	
ユーザーローカル	5,300	1,589.00	8,421,700	
テモナ	3,200	359.00	1,148,800	
ニーズウェル	4,900	632.00	3,096,800	
マネーフォワード	35,300	3,665.00	129,374,500	
サインポスト	5,600	880.00	4,928,000	
昭和電工	152,300	2,253.00	343,131,900	
住友化学	1,182,300	527.00	623,072,100	

住友精化	7,000	2,908.00	20,356,000	
日産化学	78,000	6,570.00	512,460,000	
ラサ工業	6,100	1,844.00	11,248,400	
クレハ	12,600	10,350.00	130,410,000	
多木化学	5,700	4,645.00	26,476,500	
テイカ	9,900	1,242.00	12,295,800	
石原産業	31,000	1,044.00	32,364,000	
片倉コープアグリ	4,100	1,283.00	5,260,300	
日本曹達	19,000	4,270.00	81,130,000	
東ソー	214,300	1,727.00	370,096,100	
トクヤマ	51,400	1,774.00	91,183,600	
セントラル硝子	26,000	3,145.00	81,770,000	
東亞合成	82,600	1,061.00	87,638,600	
大阪ソーダ	13,200	3,300.00	43,560,000	
関東電化工業	31,600	887.00	28,029,200	
デンカ	58,300	3,355.00	195,596,500	
イビデン	85,100	3,885.00	330,613,500	
信越化学工業	274,700	16,175.00	4,443,272,500	
日本カーバイド工業	6,300	1,370.00	8,631,000	
電算システムホールディングス	7,100	2,387.00	16,947,700	
堺化学工業	11,100	1,894.00	21,023,400	
第一稀元素化学工業	14,700	1,227.00	18,036,900	
エア・ウォーター	138,700	1,722.00	238,841,400	
日本酸素ホールディングス	142,800	2,221.00	317,158,800	
日本化学工業	4,900	1,952.00	9,564,800	
東邦アセチレン	3,500	1,114.00	3,899,000	
日本パーカライジング	72,700	954.00	69,355,800	
高圧ガス工業	24,500	688.00	16,856,000	
チタン工業	2,000	1,632.00	3,264,000	
四国化成工業	20,100	1,261.00	25,346,100	
戸田工業	3,600	2,309.00	8,312,400	
ステラ　ケミファ	8,700	2,463.00	21,428,100	
保土谷化学工業	4,600	3,330.00	15,318,000	
日本触媒	24,700	5,310.00	131,157,000	
大日精化工業	12,300	1,822.00	22,410,600	
カネカ	37,300	3,410.00	127,193,000	
協和キリン	178,000	3,165.00	563,370,000	
三菱瓦斯化学	136,400	1,975.00	269,390,000	
三井化学	134,900	2,875.00	387,837,500	
ＪＳＲ	161,500	3,555.00	574,132,500	
東京応化工業	25,800	6,790.00	175,182,000	
大阪有機化学工業	12,400	2,443.00	30,293,200	
三菱ケミカルグループ	1,075,800	752.10	809,109,180	
ＫＨネオケム	26,500	2,473.00	65,534,500	
ダイセル	232,900	848.00	197,499,200	
住友ベークライト	24,500	4,165.00	102,042,500	
積水化学工業	331,000	1,910.00	632,210,000	
日本ゼオン	130,200	1,367.00	177,983,400	
アイカ工業	40,800	3,005.00	122,604,000	
ＵＢＥ	81,700	2,042.00	166,831,400	

積水樹脂	23,800	1,765.00	42,007,000	
タキロンシーアイ	37,500	551.00	20,662,500	
旭有機材	9,800	1,981.00	19,413,800	
ニチバン	9,200	1,639.00	15,078,800	
リケンテクノス	35,300	445.00	15,708,500	
大倉工業	7,500	1,727.00	12,952,500	
積水化成品工業	21,100	418.00	8,819,800	
群栄化学工業	3,400	2,615.00	8,891,000	
タイガースポリマー	8,700	428.00	3,723,600	
ミライアル	5,600	1,811.00	10,141,600	
ダイキアクシス	6,800	706.00	4,800,800	
ダイキョーニシカワ	36,600	538.00	19,690,800	
竹本容器	6,300	793.00	4,995,900	
森六ホールディングス	8,400	1,839.00	15,447,600	
恵和	4,700	3,400.00	15,980,000	
日本化薬	121,700	1,115.00	135,695,500	
カーリットホールディングス	14,600	683.00	9,971,800	
ソルクシーズ	14,700	376.00	5,527,200	
ＣＬホールディングス	3,500	924.00	3,234,000	
プレステージ・インターナショナル	63,500	698.00	44,323,000	
フェイス	4,700	591.00	2,777,700	
プロトコーポレーション	18,400	1,063.00	19,559,200	
ハイマックス	4,600	1,398.00	6,430,800	
アミューズ	9,300	2,015.00	18,739,500	
野村総合研究所	302,000	3,825.00	1,155,150,000	
ドリームインキュベータ	5,200	1,967.00	10,228,400	
サイバネットシステム	12,400	850.00	10,540,000	
クイック	10,500	1,452.00	15,246,000	
ＴＡＣ	9,100	215.00	1,956,500	
ＣＥホールディングス	8,600	459.00	3,947,400	
日本システム技術	3,100	2,464.00	7,638,400	
電通グループ	158,500	4,215.00	668,077,500	
インテージホールディングス	20,100	1,356.00	27,255,600	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,900	1,319.00	10,420,100	
東邦システムサイエンス	4,700	918.00	4,314,600	
ぴあ	5,000	3,145.00	15,725,000	
イオンファンタジー	6,500	2,496.00	16,224,000	
ソースネクスト	74,700	223.00	16,658,100	
シーティーエス	19,200	841.00	16,147,200	
ネクシィーズグループ	5,300	561.00	2,973,300	
インフォコム	19,000	2,127.00	40,413,000	
メディカルシステムネットワーク	15,500	444.00	6,882,000	
日本精化	11,100	1,977.00	21,944,700	
扶桑化学工業	13,700	3,520.00	48,224,000	
トリケミカル研究所	17,900	2,141.00	38,323,900	
シンプレクス・ホールディングス	27,500	1,804.00	49,610,000	
ＨＥＲＯＺ	5,000	832.00	4,160,000	
ラクスル	20,600	1,931.00	39,778,600	
ＩＰＳ	4,700	2,286.00	10,744,200	
ＦＩＧ	18,900	322.00	6,085,800	

システムサポート	6,400	1,266.00	8,102,400	
ＡＤＥＫＡ	68,300	2,317.00	158,251,100	
日油	50,000	5,180.00	259,000,000	
ミヨシ油脂	6,400	1,041.00	6,662,400	
新日本理化	24,600	267.00	6,568,200	
ハリマ化成グループ	11,600	760.00	8,816,000	
イーソル	10,600	618.00	6,550,800	
アルテリア・ネットワークス	16,600	1,269.00	21,065,400	
東海ソフト	2,600	931.00	2,420,600	
ウイングアーク１ｓｔ	13,200	1,636.00	21,595,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,900	1,588.00	6,193,200	
サーバーワークス	3,000	2,242.00	6,726,000	
東名	1,200	1,101.00	1,321,200	
ヴィッツ	1,500	1,073.00	1,609,500	
トビラシステムズ	3,400	961.00	3,267,400	
Ｓａｎｓａｎ	54,900	1,009.00	55,394,100	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	3,100	664.00	2,058,400	
ギフティ	14,200	1,205.00	17,111,000	
花王	365,300	5,760.00	2,104,128,000	
第一工業製薬	5,800	2,366.00	13,722,800	
石原ケミカル	8,100	1,301.00	10,538,100	
日華化学	5,800	827.00	4,796,600	
ニイタカ	3,300	2,157.00	7,118,100	
三洋化成工業	10,300	4,775.00	49,182,500	
ベース	3,000	5,500.00	16,500,000	
ＪＭＤＣ	21,700	6,360.00	138,012,000	
武田薬品工業	1,390,900	3,973.00	5,526,045,700	
アステラス製薬	1,513,100	2,164.00	3,274,348,400	
住友ファーマ	109,300	1,122.00	122,634,600	
塩野義製薬	205,400	7,215.00	1,481,961,000	
わかもと製薬	17,200	264.00	4,540,800	
日本新薬	38,600	8,460.00	326,556,000	
中外製薬	553,500	3,737.00	2,068,429,500	
科研製薬	25,200	3,995.00	100,674,000	
エーザイ	195,500	6,181.00	1,208,385,500	
理研ビタミン	12,600	1,734.00	21,848,400	
ロート製薬	84,300	4,020.00	338,886,000	
小野薬品工業	341,200	3,835.00	1,308,502,000	
久光製薬	37,400	3,465.00	129,591,000	
有機合成薬品工業	12,100	268.00	3,242,800	
持田製薬	19,800	3,400.00	67,320,000	
参天製薬	308,200	1,104.00	340,252,800	
扶桑薬品工業	5,700	2,169.00	12,363,300	
日本ケミファ	2,000	1,880.00	3,760,000	
ツムラ	50,700	3,220.00	163,254,000	
日医工	51,000	369.00	18,819,000	
テルモ	500,800	4,258.00	2,132,406,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	44,100	3,070.00	135,387,000	
キッセイ薬品工業	25,600	2,766.00	70,809,600	

生化学工業	31,200	883.00	27,549,600	
栄研化学	26,300	1,877.00	49,365,100	
日水製薬	6,500	1,713.00	11,134,500	
鳥居薬品	9,500	3,405.00	32,347,500	
ＪＣＲファーマ	49,900	2,516.00	125,548,400	
東和薬品	25,400	2,685.00	68,199,000	
富士製薬工業	9,500	1,003.00	9,528,500	
ゼリア新薬工業	26,300	2,227.00	58,570,100	
第一三共	1,283,600	3,596.00	4,615,825,600	
キョーリン製薬ホールディングス	31,900	1,851.00	59,046,900	
大幸薬品	26,700	597.00	15,939,900	
ダイト	11,000	2,868.00	31,548,000	
大塚ホールディングス	337,100	4,984.00	1,680,106,400	
大正製薬ホールディングス	32,800	5,540.00	181,712,000	
ペプチドリーム	92,800	1,556.00	144,396,800	
大日本塗料	19,800	719.00	14,236,200	
日本ペイントホールディングス	651,200	1,114.00	725,436,800	
関西ペイント	149,800	1,878.00	281,324,400	
神東塗料	11,600	149.00	1,728,400	
中国塗料	37,500	901.00	33,787,500	
日本特殊塗料	10,400	987.00	10,264,800	
藤倉化成	21,900	483.00	10,577,700	
太陽ホールディングス	25,600	2,817.00	72,115,200	
ＤＩＣ	62,700	2,448.00	153,489,600	
サカタインクス	29,800	969.00	28,876,200	
東洋インキＳＣホールディングス	32,000	1,927.00	61,664,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	13,900	845.00	11,745,500	
アルプス技研	14,300	1,820.00	26,026,000	
サニックス	29,600	233.00	6,896,800	
ダイオーズ	3,600	1,086.00	3,909,600	
日本空調サービス	18,000	793.00	14,274,000	
オリエンタルランド	179,900	18,590.00	3,344,341,000	
フォーカスシステムズ	10,700	910.00	9,737,000	
ダスキン	36,400	2,937.00	106,906,800	
パーク２４	103,300	1,765.00	182,324,500	
明光ネットワークジャパン	20,000	616.00	12,320,000	
ファルコホールディングス	7,500	1,924.00	14,430,000	
クレスコ	12,600	1,944.00	24,494,400	
フジ・メディア・ホールディングス	154,300	1,188.00	183,308,400	
秀英予備校	4,100	427.00	1,750,700	
田谷	2,100	550.00	1,155,000	
ラウンドワン	47,200	1,411.00	66,599,200	
リゾートトラスト	71,500	2,054.00	146,861,000	
オービック	54,700	21,110.00	1,154,717,000	
ジャストシステム	24,700	3,995.00	98,676,500	
ＴＤＣソフト	13,800	1,116.00	15,400,800	
Ｚホールディングス	2,504,100	437.30	1,095,042,930	
ビー・エム・エル	21,500	3,655.00	78,582,500	
トレンドマイクロ	85,100	7,330.00	623,783,000	
りらいあコミュニケーションズ	25,100	1,096.00	27,509,600	

ＩＤホールディングス	11,100	849.00	9,423,900	
リソー教育	77,200	324.00	25,012,800	
日本オラクル	28,300	8,130.00	230,079,000	
早稲田アカデミー	9,500	1,159.00	11,010,500	
アルファシステムズ	4,600	4,600.00	21,160,000	
フューチャー	36,600	1,596.00	58,413,600	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	9,100	1,386.00	12,612,600	
ＳＢテクノロジー	7,500	2,319.00	17,392,500	
トーセ	4,400	754.00	3,317,600	
ユー・エス・エス	189,300	2,457.00	465,110,100	
オービックビジネスコンサルタント	16,700	4,855.00	81,078,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	79,100	3,515.00	278,036,500	
アイティフォー	21,100	797.00	16,816,700	
東京個別指導学院	14,900	616.00	9,178,400	
東計電算	2,000	5,950.00	11,900,000	
サイバーエージェント	361,300	1,358.00	490,645,400	
楽天グループ	784,800	647.00	507,765,600	
エックスネット	2,800	1,013.00	2,836,400	
クリーク・アンド・リバー社	8,800	2,279.00	20,055,200	
モーニングスター	29,700	529.00	15,711,300	
テー・オー・ダブリュー	32,800	314.00	10,299,200	
大塚商会	93,900	4,140.00	388,746,000	
サイボウズ	23,200	1,085.00	25,172,000	
山田コンサルティンググループ	8,800	1,167.00	10,269,600	
セントラルスポーツ	6,400	2,502.00	16,012,800	
パラカ	5,300	1,826.00	9,677,800	
電通国際情報サービス	21,500	4,285.00	92,127,500	
ＡＣＣＥＳＳ	19,500	774.00	15,093,000	
デジタルガレージ	28,700	3,910.00	112,217,000	
イーエムシステムズ	28,700	1,025.00	29,417,500	
ウェザーニューズ	5,300	7,600.00	40,280,000	
ＣＩＪ	13,700	735.00	10,069,500	
ビジネスエンジニアリング	4,100	2,394.00	9,815,400	
日本エンタープライズ	16,900	154.00	2,602,600	
WOWOW	7,200	1,507.00	10,850,400	
スカラ	14,600	736.00	10,745,600	
インテリジェント　ウェイブ	8,700	814.00	7,081,800	
フルキャストホールディングス	14,500	2,427.00	35,191,500	
エン・ジャパン	30,100	1,926.00	57,972,600	
あすか製薬ホールディングス	16,800	1,062.00	17,841,600	
サワイグループホールディングス	34,000	4,330.00	147,220,000	
富士フイルムホールディングス	311,000	7,580.00	2,357,380,000	
コニカミノルタ	359,200	460.00	165,232,000	
資生堂	329,700	5,616.00	1,851,595,200	
ライオン	176,700	1,532.00	270,704,400	
高砂香料工業	10,000	2,547.00	25,470,000	
マンダム	34,400	1,695.00	58,308,000	
ミルボン	21,900	5,150.00	112,785,000	
ファンケル	71,600	2,560.00	183,296,000	
コーセー	33,200	12,600.00	418,320,000	

コタ	12,500	1,601.00	20,012,500	
シーボン	1,800	1,705.00	3,069,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	75,500	1,656.00	125,028,000	
ノエビアホールディングス	13,200	5,980.00	78,936,000	
アジュバンホールディングス	4,200	996.00	4,183,200	
新日本製薬	8,400	1,611.00	13,532,400	
エステー	11,500	1,570.00	18,055,000	
アグロ　カネショウ	6,000	1,270.00	7,620,000	
コニシ	26,800	1,597.00	42,799,600	
長谷川香料	30,500	3,010.00	91,805,000	
星光ＰＭＣ	10,200	534.00	5,446,800	
小林製薬	49,700	9,050.00	449,785,000	
荒川化学工業	12,600	995.00	12,537,000	
メック	12,100	2,276.00	27,539,600	
日本高純度化学	4,200	2,304.00	9,676,800	
タカラバイオ	46,200	1,985.00	91,707,000	
ＪＣＵ	18,200	3,525.00	64,155,000	
新田ゼラチン	10,400	610.00	6,344,000	
ＯＡＴアグリオ	7,300	1,534.00	11,198,200	
デクセリアルズ	46,100	3,535.00	162,963,500	
アース製薬	14,600	5,500.00	80,300,000	
北興化学工業	14,800	955.00	14,134,000	
大成ラミック	4,600	2,740.00	12,604,000	
クミアイ化学工業	65,800	1,075.00	70,735,000	
日本農薬	31,600	674.00	21,298,400	
富士興産	4,300	1,072.00	4,609,600	
ニチレキ	19,200	1,336.00	25,651,200	
ユシロ化学工業	8,400	915.00	7,686,000	
ビーピー・カストロール	6,400	1,124.00	7,193,600	
富士石油	38,600	313.00	12,081,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	6,000	1,221.00	7,326,000	
出光興産	180,000	3,235.00	582,300,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,662,000	506.00	1,346,972,000	
コスモエネルギーホールディングス	69,900	3,515.00	245,698,500	
テスホールディングス	15,500	1,188.00	18,414,000	
インフロニア・ホールディングス	193,200	953.00	184,119,600	
横浜ゴム	83,900	1,937.00	162,514,300	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	84,700	1,766.00	149,580,200	
ブリヂストン	470,500	5,038.00	2,370,379,000	
住友ゴム工業	144,500	1,232.00	178,024,000	
藤倉コンポジット	14,200	844.00	11,984,800	
オカモト	8,200	3,890.00	31,898,000	
アキレス	11,500	1,375.00	15,812,500	
フコク	7,800	960.00	7,488,000	
ニッタ	16,700	2,788.00	46,559,600	
クリエートメディック	5,500	989.00	5,439,500	
住友理工	34,200	595.00	20,349,000	
三ツ星ベルト	21,500	2,866.00	61,619,000	
バンドー化学	28,500	962.00	27,417,000	
ＡＧＣ	149,900	4,780.00	716,522,000	

日本板硝子	79,700	394.00	31,401,800	
石塚硝子	3,000	1,639.00	4,917,000	
有沢製作所	24,100	1,013.00	24,413,300	
日本山村硝子	6,300	710.00	4,473,000	
日本電気硝子	65,600	2,650.00	173,840,000	
オハラ	7,000	1,195.00	8,365,000	
住友大阪セメント	26,400	3,585.00	94,644,000	
太平洋セメント	100,500	2,007.00	201,703,500	
リソルホールディングス	1,800	4,600.00	8,280,000	
日本ヒューム	14,800	665.00	9,842,000	
日本コンクリート工業	32,000	271.00	8,672,000	
三谷セキサン	7,200	4,265.00	30,708,000	
アジアパイルホールディングス	25,300	479.00	12,118,700	
東海カーボン	135,900	1,044.00	141,879,600	
日本カーボン	9,100	4,060.00	36,946,000	
東洋炭素	10,400	2,933.00	30,503,200	
ノリタケカンパニーリミテド	8,900	4,200.00	37,380,000	
ＴＯＴＯ	107,000	4,585.00	490,595,000	
日本碍子	174,300	1,850.00	322,455,000	
日本特殊陶業	123,400	2,459.00	303,440,600	
ダントーホールディングス	11,400	295.00	3,363,000	
ＭＡＲＵＷＡ	6,100	15,320.00	93,452,000	
品川リフラクトリーズ	4,200	3,590.00	15,078,000	
黒崎播磨	3,100	4,410.00	13,671,000	
ヨータイ	11,300	1,502.00	16,972,600	
東京窯業	17,400	276.00	4,802,400	
ニッカトー	7,500	455.00	3,412,500	
フジミインコーポレーテッド	14,200	5,510.00	78,242,000	
クニミネ工業	5,600	935.00	5,236,000	
エーアンドエーマテリアル	3,200	858.00	2,745,600	
ニチアス	37,200	2,310.00	85,932,000	
日本製鉄	731,000	1,952.50	1,427,277,500	
神戸製鋼所	304,700	620.00	188,914,000	
中山製鋼所	24,100	430.00	10,363,000	
合同製鐵	8,400	1,383.00	11,617,200	
ＪＦＥホールディングス	405,100	1,481.00	599,953,100	
東京製鐵	51,100	1,469.00	75,065,900	
共英製鋼	17,200	1,408.00	24,217,600	
大和工業	28,600	4,435.00	126,841,000	
東京鐵鋼	7,300	1,267.00	9,249,100	
大阪製鐵	9,300	1,511.00	14,052,300	
淀川製鋼所	19,200	2,370.00	45,504,000	
丸一鋼管	50,800	2,898.00	147,218,400	
モリ工業	4,300	2,450.00	10,535,000	
大同特殊鋼	23,800	3,630.00	86,394,000	
日本高周波鋼業	4,900	322.00	1,577,800	
日本冶金工業	11,800	2,196.00	25,912,800	
山陽特殊製鋼	15,000	1,894.00	28,410,000	
愛知製鋼	9,900	2,097.00	20,760,300	
日立金属	188,500	2,059.00	388,121,500	

日本金属	4,400	1,145.00	5,038,000	
大平洋金属	10,700	2,361.00	25,262,700	
新日本電工	96,800	352.00	34,073,600	
栗本鐵工所	7,300	1,696.00	12,380,800	
虹　技	2,300	978.00	2,249,400	
日本鋳鉄管	1,800	999.00	1,798,200	
日本製鋼所	45,000	3,125.00	140,625,000	
三菱製鋼	11,300	950.00	10,735,000	
日亜鋼業	20,200	259.00	5,231,800	
日本精線	2,800	4,430.00	12,404,000	
エンビプロ・ホールディングス	11,600	778.00	9,024,800	
大紀アルミニウム工業所	21,500	1,201.00	25,821,500	
日本軽金属ホールディングス	44,100	1,528.00	67,384,800	
三井金属鉱業	47,200	3,090.00	145,848,000	
東邦亜鉛	8,900	2,179.00	19,393,100	
三菱マテリアル	101,100	1,945.00	196,639,500	
住友金属鉱山	191,700	4,065.00	779,260,500	
ＤＯＷＡホールディングス	40,800	4,560.00	186,048,000	
古河機械金属	26,800	1,218.00	32,642,400	
エス・サイエンス	81,800	27.00	2,208,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,200	3,050.00	61,610,000	
東邦チタニウム	31,300	2,325.00	72,772,500	
ＵＡＣＪ	23,800	2,089.00	49,718,200	
ＣＫサンエツ	3,300	4,270.00	14,091,000	
古河電気工業	50,300	2,284.00	114,885,200	
住友電気工業	610,700	1,486.00	907,500,200	
フジクラ	195,000	743.00	144,885,000	
昭和電線ホールディングス	15,200	1,582.00	24,046,400	
東京特殊電線	2,300	2,309.00	5,310,700	
タツタ電線	30,900	462.00	14,275,800	
カナレ電気	2,800	1,544.00	4,323,200	
平河ヒューテック	9,800	1,088.00	10,662,400	
リョービ	18,000	1,049.00	18,882,000	
アーレスティ	18,800	376.00	7,068,800	
アサヒホールディングス	70,100	2,091.00	146,579,100	
東洋製罐グループホールディングス	89,200	1,419.00	126,574,800	
ホッカンホールディングス	8,300	1,263.00	10,482,900	
コロナ	8,900	847.00	7,538,300	
横河ブリッジホールディングス	25,100	1,956.00	49,095,600	
駒井ハルテック	2,800	1,707.00	4,779,600	
高田機工	700	2,428.00	1,699,600	
三和ホールディングス	164,800	1,335.00	220,008,000	
文化シヤッター	51,700	1,017.00	52,578,900	
三協立山	21,100	551.00	11,626,100	
アルインコ	11,700	866.00	10,132,200	
東洋シヤッター	2,800	571.00	1,598,800	
ＬＩＸＩＬ	275,400	2,710.00	746,334,000	
日本フイルコン	11,400	495.00	5,643,000	
ノーリツ	27,900	1,489.00	41,543,100	
長府製作所	17,900	1,803.00	32,273,700	

リンナイ	30,200	9,800.00	295,960,000	
ユニプレス	29,000	850.00	24,650,000	
ダイニチ工業	8,600	659.00	5,667,400	
日東精工	19,600	495.00	9,702,000	
三洋工業	1,800	1,788.00	3,218,400	
岡部	27,200	620.00	16,864,000	
ジーテクト	19,300	1,300.00	25,090,000	
東プレ	26,700	1,046.00	27,928,200	
高周波熱錬	27,000	672.00	18,144,000	
東京製綱	10,700	941.00	10,068,700	
サンコール	15,000	616.00	9,240,000	
モリテックスチール	13,500	281.00	3,793,500	
パイオラックス	23,000	1,984.00	45,632,000	
エイチワン	15,800	612.00	9,669,600	
日本発条	147,500	879.00	129,652,500	
中央発條	8,400	706.00	5,930,400	
アドバネクス	2,200	1,167.00	2,567,400	
三浦工業	68,900	3,150.00	217,035,000	
タクマ	50,200	1,322.00	66,364,400	
テクノプロ・ホールディングス	101,200	3,095.00	313,214,000	
アトラグループ	4,100	191.00	783,100	
インターワークス	5,200	366.00	1,903,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	7,800	2,160.00	16,848,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	10,900	3,395.00	37,005,500	
ファーストロジック	2,600	779.00	2,025,400	
三機サービス	3,000	1,000.00	3,000,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	9,300	729.00	6,779,700	
デザインワン・ジャパン	4,300	180.00	774,000	
イー・ガーディアン	5,700	2,930.00	16,701,000	
リブセンス	9,800	179.00	1,754,200	
ジャパンマテリアル	52,000	1,845.00	95,940,000	
ベクトル	23,700	1,003.00	23,771,100	
ウチヤマホールディングス	8,400	295.00	2,478,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	12,600	1,021.00	12,864,600	
キャリアリンク	6,300	1,975.00	12,442,500	
ＩＢＪ	13,800	755.00	10,419,000	
アサンテ	7,600	1,531.00	11,635,600	
バリューＨＲ	14,700	1,350.00	19,845,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	13,900	3,505.00	48,719,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,600	1,240.00	8,184,000	
ＥＲＩホールディングス	4,700	1,208.00	5,677,600	
アビスト	2,500	2,744.00	6,860,000	
シグマクシス・ホールディングス	20,400	1,184.00	24,153,600	
ウィルグループ	12,600	1,203.00	15,157,800	
エスクロー・エージェント・ジャパン	17,700	162.00	2,867,400	
メドピア	11,800	2,056.00	24,260,800	
レアジョブ	3,100	556.00	1,723,600	
リクルートホールディングス	1,211,300	4,330.00	5,244,929,000	

エラン	23,400	1,094.00	25,599,600	
ツガミ	35,700	1,144.00	40,840,800	
オークマ	16,700	5,170.00	86,339,000	
芝浦機械	19,800	2,710.00	53,658,000	
アマダ	276,200	1,018.00	281,171,600	
アイダエンジニアリング	38,200	927.00	35,411,400	
滝澤鉄工所	5,300	1,198.00	6,349,400	
ＦＵＪＩ	69,900	2,034.00	142,176,600	
牧野フライス製作所	17,800	4,340.00	77,252,000	
オーエスジー	76,300	1,639.00	125,055,700	
ダイジェット工業	2,000	908.00	1,816,000	
旭ダイヤモンド工業	42,800	624.00	26,707,200	
ＤＭＧ森精機	96,800	1,682.00	162,817,600	
ソディック	38,200	821.00	31,362,200	
ディスコ	25,800	30,650.00	790,770,000	
日東工器	8,400	1,559.00	13,095,600	
日進工具	13,800	1,287.00	17,760,600	
パンチ工業	14,800	451.00	6,674,800	
冨士ダイス	9,200	657.00	6,044,400	
土木管理総合試験所	7,700	328.00	2,525,600	
ネットマーケティング	8,300	562.00	4,664,600	
日本郵政	1,847,500	981.50	1,813,321,250	
ベルシステム２４ホールディングス	24,300	1,414.00	34,360,200	
鎌倉新書	19,200	564.00	10,828,800	
ＳＭＮ	3,900	586.00	2,285,400	
一蔵	2,300	469.00	1,078,700	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	2,500	702.00	1,755,000	
エアトリ	9,800	2,318.00	22,716,400	
アトラエ	11,800	1,712.00	20,201,600	
ストライク	7,500	3,615.00	27,112,500	
ソラスト	41,600	751.00	31,241,600	
セラク	5,400	1,285.00	6,939,000	
インソース	18,800	2,425.00	45,590,000	
豊田自動織機	125,400	8,210.00	1,029,534,000	
豊和工業	9,100	914.00	8,317,400	
ニデックオーケーケー	6,600	1,180.00	7,788,000	
石川製作所	4,500	1,550.00	6,975,000	
東洋機械金属	11,600	569.00	6,600,400	
津田駒工業	3,300	502.00	1,656,600	
エンシュウ	3,900	917.00	3,576,300	
島精機製作所	25,600	2,170.00	55,552,000	
オプトラン	21,900	1,885.00	41,281,500	
ＮＣホールディングス	4,900	2,137.00	10,471,300	
イワキ	11,300	976.00	11,028,800	
フリュー	15,600	1,132.00	17,659,200	
ヤマシンフィルタ	27,400	329.00	9,014,600	
日阪製作所	18,100	847.00	15,330,700	
やまびこ	29,100	1,168.00	33,988,800	
野村マイクロ・サイエンス	5,600	3,480.00	19,488,000	
平田機工	7,700	4,445.00	34,226,500	

ペガサスミシン製造	17,800	601.00	10,697,800	
マルマエ	7,200	1,916.00	13,795,200	
タツモ	8,900	1,246.00	11,089,400	
ナブテスコ	93,000	3,265.00	303,645,000	
三井海洋開発	18,800	1,164.00	21,883,200	
レオン自動機	18,800	1,316.00	24,740,800	
ＳＭＣ	51,900	62,400.00	3,238,560,000	
ホソカワミクロン	11,400	2,742.00	31,258,800	
ユニオンツール	6,600	3,245.00	21,417,000	
オイレス工業	22,600	1,585.00	35,821,000	
日精エー・エス・ビー機械	6,700	3,560.00	23,852,000	
サトーホールディングス	23,000	1,935.00	44,505,000	
技研製作所	15,600	3,165.00	49,374,000	
日本エアーテック	8,100	1,027.00	8,318,700	
カワタ	5,200	976.00	5,075,200	
日精樹脂工業	11,100	914.00	10,145,400	
オカダアイヨン	5,500	1,485.00	8,167,500	
ワイエイシイホールディングス	7,000	1,496.00	10,472,000	
小松製作所	802,000	2,963.00	2,376,326,000	
住友重機械工業	94,500	2,951.00	278,869,500	
日立建機	71,000	2,877.00	204,267,000	
日工	22,300	639.00	14,249,700	
巴工業	6,400	2,365.00	15,136,000	
井関農機	13,800	1,204.00	16,615,200	
ＴＯＷＡ	15,000	1,731.00	25,965,000	
丸山製作所	2,800	1,563.00	4,376,400	
北川鉄工所	7,000	1,433.00	10,031,000	
シンニッタン	21,500	224.00	4,816,000	
ローツェ	8,700	8,630.00	75,081,000	
タカキタ	5,500	512.00	2,816,000	
クボタ	857,300	2,140.00	1,834,622,000	
荏原実業	8,200	2,292.00	18,794,400	
東洋エンジニアリング	23,400	649.00	15,186,600	
三菱化工機	5,300	2,070.00	10,971,000	
月島機械	27,600	888.00	24,508,800	
帝国電機製作所	11,300	1,675.00	18,927,500	
東京機械製作所	7,200	873.00	6,285,600	
新東工業	33,000	705.00	23,265,000	
澁谷工業	13,900	2,444.00	33,971,600	
アイチコーポレーション	25,400	844.00	21,437,600	
小森コーポレーション	40,700	817.00	33,251,900	
鶴見製作所	12,500	1,945.00	24,312,500	
住友精密工業	2,600	2,832.00	7,363,200	
日本ギア工業	6,500	302.00	1,963,000	
酒井重工業	3,000	2,906.00	8,718,000	
荏原製作所	70,700	5,100.00	360,570,000	
石井鐵工所	1,200	2,942.00	3,530,400	
酉島製作所	14,500	1,314.00	19,053,000	
北越工業	14,900	900.00	13,410,000	
ダイキン工業	193,200	22,095.00	4,268,754,000	

オルガノ	5,200	8,650.00	44,980,000	
トーヨーカネツ	6,100	2,706.00	16,506,600	
栗田工業	89,400	5,040.00	450,576,000	
椿本チエイン	23,100	3,085.00	71,263,500	
大同工業	7,300	816.00	5,956,800	
日機装	44,900	817.00	36,683,300	
木村化工機	13,700	746.00	10,220,200	
レイズネクスト	24,000	1,184.00	28,416,000	
アネスト岩田	27,600	911.00	25,143,600	
ダイフク	83,600	8,240.00	688,864,000	
サムコ	4,900	2,725.00	13,352,500	
加藤製作所	8,400	806.00	6,770,400	
油研工業	2,100	1,774.00	3,725,400	
タダノ	85,300	954.00	81,376,200	
フジテック	54,300	3,030.00	164,529,000	
ＣＫＤ	44,700	1,753.00	78,359,100	
キトー	13,900	2,629.00	36,543,100	
平和	49,400	2,061.00	101,813,400	
理想科学工業	14,900	2,312.00	34,448,800	
ＳＡＮＫＹＯ	36,400	4,205.00	153,062,000	
日本金銭機械	18,000	685.00	12,330,000	
マースグループホールディングス	11,300	1,636.00	18,486,800	
フクシマガリレイ	10,900	3,585.00	39,076,500	
オーイズミ	6,300	407.00	2,564,100	
ダイコク電機	8,200	1,261.00	10,340,200	
竹内製作所	26,900	2,344.00	63,053,600	
アマノ	46,400	2,478.00	114,979,200	
ＪＵＫＩ	24,600	716.00	17,613,600	
サンデン	24,500	252.00	6,174,000	
ジャノメ	15,000	720.00	10,800,000	
ブラザー工業	201,800	2,413.00	486,943,400	
マックス	20,900	1,657.00	34,631,300	
モリタホールディングス	28,400	1,346.00	38,226,400	
グローリー	41,900	2,150.00	90,085,000	
新晃工業	16,600	1,683.00	27,937,800	
大和冷機工業	25,600	1,117.00	28,595,200	
セガサミーホールディングス	159,000	2,256.00	358,704,000	
日本ピストンリング	6,500	1,273.00	8,274,500	
リケン	6,500	2,371.00	15,411,500	
ＴＰＲ	19,200	1,224.00	23,500,800	
ツバキ・ナカシマ	38,700	910.00	35,217,000	
ホシザキ	101,500	4,030.00	409,045,000	
大豊工業	14,500	675.00	9,787,500	
日本精工	302,800	734.00	222,255,200	
ＮＴＮ	321,500	256.00	82,304,000	
ジェイテクト	150,800	1,020.00	153,816,000	
不二越	12,400	3,635.00	45,074,000	
ミネベアミツミ	281,500	2,330.00	655,895,000	
日本トムソン	40,400	520.00	21,008,000	
ＴＨＫ	99,900	2,695.00	269,230,500	

ユーシン精機	13,900	712.00	9,896,800	
前澤給装工業	11,500	923.00	10,614,500	
イーグル工業	19,200	1,001.00	19,219,200	
前澤工業	10,700	616.00	6,591,200	
日本ピラー工業	15,100	2,631.00	39,728,100	
キッツ	49,700	674.00	33,497,800	
日立製作所	851,200	6,565.00	5,588,128,000	
東芝	309,400	5,470.00	1,692,418,000	
三菱電機	1,651,600	1,469.00	2,426,200,400	
富士電機	98,500	5,500.00	541,750,000	
東洋電機製造	6,100	900.00	5,490,000	
安川電機	175,800	4,290.00	754,182,000	
シンフォニア　テクノロジー	18,000	1,382.00	24,876,000	
明電舎	24,900	2,052.00	51,094,800	
オリジン	4,200	1,198.00	5,031,600	
山洋電気	6,400	5,250.00	33,600,000	
デンヨー	12,600	1,643.00	20,701,800	
ＰＨＣホールディングス	27,300	1,446.00	39,475,800	
ベイカレント・コンサルティング	12,000	38,150.00	457,800,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	3,200	2,534.00	8,108,800	
アイモバイル	8,400	1,381.00	11,600,400	
キャリアインデックス	5,600	538.00	3,012,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	6,800	906.00	6,160,800	
船場	1,800	673.00	1,211,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	53,600	1,580.00	84,688,000	
フルテック	2,300	1,300.00	2,990,000	
グリーンズ	6,400	565.00	3,616,000	
ツナググループ・ホールディングス	4,600	315.00	1,449,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	5,000	527.00	2,635,000	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2,400	646.00	1,550,400	
ウェルビー	11,000	703.00	7,733,000	
エル・ティー・エス	2,200	3,510.00	7,722,000	
ミダックホールディングス	7,600	2,837.00	21,561,200	
日総工産	12,900	583.00	7,520,700	
キュービーネットホールディングス	7,800	1,347.00	10,506,600	
ＲＰＡホールディングス	23,700	331.00	7,844,700	
三櫻工業	24,500	694.00	17,003,000	
マキタ	199,900	3,440.00	687,656,000	
東芝テック	19,100	4,450.00	84,995,000	
芝浦メカトロニクス	3,200	9,280.00	29,696,000	
マブチモーター	40,600	3,685.00	149,611,000	
日本電産	393,100	9,112.00	3,581,927,200	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,300	446.00	2,809,800	
トレックス・セミコンダクター	7,600	2,454.00	18,650,400	
東光高岳	9,800	1,793.00	17,571,400	
ダブル・スコープ	50,900	1,610.00	81,949,000	
宮越ホールディングス	6,600	944.00	6,230,400	
ダイヘン	16,300	4,010.00	65,363,000	

ヤーマン	28,800	1,698.00	48,902,400	
ＪＶＣケンウッド	144,100	180.00	25,938,000	
ミマキエンジニアリング	15,900	557.00	8,856,300	
Ｉ－ＰＥＸ	8,200	1,343.00	11,012,600	
日新電機	41,500	1,471.00	61,046,500	
大崎電気工業	29,900	506.00	15,129,400	
オムロン	147,300	7,027.00	1,035,077,100	
日東工業	22,300	2,351.00	52,427,300	
ＩＤＥＣ	21,900	2,805.00	61,429,500	
正興電機製作所	4,900	1,130.00	5,537,000	
不二電機工業	3,400	1,156.00	3,930,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	53,100	2,208.00	117,244,800	
サクサホールディングス	3,300	1,243.00	4,101,900	
メルコホールディングス	4,900	3,580.00	17,542,000	
テクノメディカ	4,100	1,585.00	6,498,500	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,900	1,685.00	8,256,500	
日本電気	209,800	5,500.00	1,153,900,000	
富士通	159,200	18,145.00	2,888,684,000	
沖電気工業	67,200	755.00	50,736,000	
岩崎通信機	7,600	805.00	6,118,000	
電気興業	8,600	2,507.00	21,560,200	
サンケン電気	15,100	4,695.00	70,894,500	
ナカヨ	2,500	1,130.00	2,825,000	
アイホン	8,100	1,822.00	14,758,200	
ルネサスエレクトロニクス	963,600	1,235.00	1,190,046,000	
セイコーエプソン	197,600	1,978.00	390,852,800	
ワコム	135,600	851.00	115,395,600	
アルバック	35,200	4,730.00	166,496,000	
アクセル	6,800	797.00	5,419,600	
ＥＩＺＯ	12,100	3,835.00	46,403,500	
ジャパンディスプレイ	604,300	69.00	41,696,700	
日本信号	37,500	996.00	37,350,000	
京三製作所	34,800	445.00	15,486,000	
能美防災	20,100	1,873.00	37,647,300	
ホーチキ	11,100	1,306.00	14,496,600	
星和電機	7,500	462.00	3,465,000	
エレコム	40,600	1,624.00	65,934,400	
パナソニック　ホールディングス	1,887,500	1,140.00	2,151,750,000	
シャープ	168,100	1,072.00	180,203,200	
アンリツ	114,000	1,534.00	174,876,000	
富士通ゼネラル	48,000	2,765.00	132,720,000	
ソニーグループ	1,108,600	11,380.00	12,615,868,000	
ＴＤＫ	256,300	4,085.00	1,046,985,500	
帝国通信工業	7,800	1,419.00	11,068,200	
タムラ製作所	63,600	582.00	37,015,200	
アルプスアルパイン	144,500	1,316.00	190,162,000	
池上通信機	5,300	600.00	3,180,000	
日本電波工業	17,800	1,101.00	19,597,800	
鈴木	8,800	787.00	6,925,600	

メイコー	19,200	3,110.00	59,712,000	
日本トリム	3,300	2,505.00	8,266,500	
ローランド　ディー．ジー．	10,400	3,150.00	32,760,000	
フォスター電機	16,600	764.00	12,682,400	
ＳＭＫ	4,200	2,147.00	9,017,400	
ヨコオ	11,700	1,999.00	23,388,300	
ティアック	26,700	124.00	3,310,800	
ホシデン	39,200	1,255.00	49,196,000	
ヒロセ電機	24,600	18,690.00	459,774,000	
日本航空電子工業	35,400	2,086.00	73,844,400	
ＴＯＡ	19,100	782.00	14,936,200	
マクセル	32,100	1,347.00	43,238,700	
古野電気	21,200	1,067.00	22,620,400	
ユニデンホールディングス	3,900	4,100.00	15,990,000	
スミダコーポレーション	16,600	799.00	13,263,400	
アイコム	5,700	2,540.00	14,478,000	
リオン	6,100	2,447.00	14,926,700	
本多通信工業	13,700	531.00	7,274,700	
横河電機	162,400	2,244.00	364,425,600	
新電元工業	6,300	3,435.00	21,640,500	
アズビル	102,600	3,775.00	387,315,000	
東亜ディーケーケー	8,900	907.00	8,072,300	
日本光電工業	68,200	3,025.00	206,305,000	
チノー	5,600	1,688.00	9,452,800	
共和電業	17,000	317.00	5,389,000	
日本電子材料	8,300	1,626.00	13,495,800	
堀場製作所	30,400	6,100.00	185,440,000	
アドバンテスト	131,600	7,260.00	955,416,000	
小野測器	7,200	424.00	3,052,800	
エスペック	13,100	1,826.00	23,920,600	
キーエンス	160,300	50,260.00	8,056,678,000	
日置電機	8,400	6,570.00	55,188,000	
シスメックス	126,700	9,063.00	1,148,282,100	
日本マイクロニクス	26,400	1,238.00	32,683,200	
メガチップス	15,700	3,085.00	48,434,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	7,000	3,030.00	21,210,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	12,400	827.00	10,254,800	
澤藤電機	2,100	1,454.00	3,053,400	
デンソー	346,200	7,410.00	2,565,342,000	
原田工業	8,600	896.00	7,705,600	
コーセル	19,600	843.00	16,522,800	
イリソ電子工業	14,900	3,250.00	48,425,000	
オプテックスグループ	29,000	2,074.00	60,146,000	
千代田インテグレ	6,700	2,015.00	13,500,500	
レーザーテック	72,500	16,885.00	1,224,162,500	
スタンレー電気	114,000	2,338.00	266,532,000	
岩崎電気	5,600	2,631.00	14,733,600	
ウシオ電機	83,800	1,709.00	143,214,200	
岡谷電機産業	12,800	252.00	3,225,600	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	15,100	321.00	4,847,100	

エノモト	4,900	1,465.00	7,178,500	
日本セラミック	16,300	2,044.00	33,317,200	
遠藤照明	8,200	775.00	6,355,000	
古河電池	12,600	1,225.00	15,435,000	
双信電機	8,400	506.00	4,250,400	
山一電機	11,500	1,646.00	18,929,000	
図研	11,500	3,255.00	37,432,500	
日本電子	34,000	5,430.00	184,620,000	
カシオ計算機	109,500	1,264.00	138,408,000	
ファナック	155,300	21,915.00	3,403,399,500	
日本シイエムケイ	31,200	436.00	13,603,200	
エンプラス	4,400	3,100.00	13,640,000	
大真空	21,900	887.00	19,425,300	
ローム	73,600	9,430.00	694,048,000	
浜松ホトニクス	117,900	5,710.00	673,209,000	
三井ハイテック	15,100	8,390.00	126,689,000	
新光電気工業	52,000	3,425.00	178,100,000	
京セラ	249,000	7,060.00	1,757,940,000	
協栄産業	1,900	1,320.00	2,508,000	
太陽誘電	78,700	4,560.00	358,872,000	
村田製作所	482,800	7,638.00	3,687,626,400	
双葉電子工業	30,400	690.00	20,976,000	
日東電工	107,000	8,720.00	933,040,000	
北陸電気工業	6,600	1,109.00	7,319,400	
東海理化電機製作所	46,600	1,486.00	69,247,600	
ニチコン	47,100	1,214.00	57,179,400	
日本ケミコン	16,800	1,690.00	28,392,000	
ＫＯＡ	24,500	1,606.00	39,347,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	64,900	340.00	22,066,000	
日立造船	140,300	834.00	117,010,200	
三菱重工業	259,500	5,053.00	1,311,253,500	
川崎重工業	120,000	2,510.00	301,200,000	
ＩＨＩ	110,600	3,605.00	398,713,000	
名村造船所	45,500	433.00	19,701,500	
サノヤスホールディングス	21,100	125.00	2,637,500	
スプリックス	5,700	993.00	5,660,100	
マネジメントソリューションズ	8,300	2,728.00	22,642,400	
プロレド・パートナーズ	3,500	488.00	1,708,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	4,700	399.00	1,875,300	
テノ．ホールディングス	2,000	674.00	1,348,000	
フロンティア・マネジメント	4,400	1,298.00	5,711,200	
ピアラ	2,600	703.00	1,827,800	
コプロ・ホールディングス	3,300	858.00	2,831,400	
ギークス	3,000	1,022.00	3,066,000	
カーブスホールディングス	46,500	685.00	31,852,500	
フォーラムエンジニアリング	10,400	924.00	9,609,600	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	3,100	1,388.00	4,302,800	
日本車輌製造	5,700	2,097.00	11,952,900	
三菱ロジスネクスト	23,500	880.00	20,680,000	

近畿車輌	1,800	1,108.00	1,994,400	
一家ホールディングス	3,100	570.00	1,767,000	
フルサト・マルカホールディングス	15,500	2,692.00	41,726,000	
ヤマエグループホールディングス	9,900	1,400.00	13,860,000	
藤久ホールディングス	5,500	663.00	3,646,500	
ＦＰＧ	58,700	933.00	54,767,100	
島根銀行	5,200	499.00	2,594,800	
じもとホールディングス	11,500	580.00	6,670,000	
全国保証	41,600	4,365.00	181,584,000	
めぶきフィナンシャルグループ	717,800	269.00	193,088,200	
ジャパンインベストメントアドバイザー	13,500	1,276.00	17,226,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20,200	2,277.00	45,995,400	
九州フィナンシャルグループ	305,200	392.00	119,638,400	
かんぽ生命保険	175,700	2,198.00	386,188,600	
ゆうちょ銀行	412,200	1,072.00	441,878,400	
あんしん保証	6,800	265.00	1,802,000	
富山第一銀行	39,000	426.00	16,614,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	864,000	462.00	399,168,000	
ジェイリース	5,800	2,084.00	12,087,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	91,600	757.00	69,341,200	
イントラスト	7,300	571.00	4,168,300	
日本モーゲージサービス	9,800	988.00	9,682,400	
ＣＡＳＡ	6,100	885.00	5,398,500	
アルヒ	25,800	1,023.00	26,393,400	
プレミアグループ	8,800	4,370.00	38,456,000	
日産自動車	2,086,900	517.40	1,079,762,060	
いすゞ自動車	512,600	1,478.00	757,622,800	
トヨタ自動車	8,067,500	2,152.00	17,361,260,000	
日野自動車	221,000	713.00	157,573,000	
三菱自動車工業	654,800	436.00	285,492,800	
エフテック	11,400	506.00	5,768,400	
レシップホールディングス	6,400	531.00	3,398,400	
ＧＭＢ	3,200	703.00	2,249,600	
ファルテック	3,100	603.00	1,869,300	
武蔵精密工業	39,400	1,398.00	55,081,200	
日産車体	26,000	594.00	15,444,000	
新明和工業	46,100	1,070.00	49,327,000	
極東開発工業	28,100	1,436.00	40,351,600	
トピー工業	13,200	1,322.00	17,450,400	
ティラド	4,700	2,577.00	12,111,900	
曙ブレーキ工業	97,200	159.00	15,454,800	
タチエス	29,000	1,100.00	31,900,000	
ＮＯＫ	66,600	1,162.00	77,389,200	
フタバ産業	39,500	388.00	15,326,000	
ＫＹＢ	15,600	3,080.00	48,048,000	
市光工業	21,200	375.00	7,950,000	
大同メタル工業	34,100	534.00	18,209,400	

プレス工業	79,200	403.00	31,917,600	
ミクニ	20,900	362.00	7,565,800	
太平洋工業	33,700	1,081.00	36,429,700	
河西工業	21,600	269.00	5,810,400	
アイシン	129,500	4,225.00	547,137,500	
マツダ	520,600	1,042.00	542,465,200	
今仙電機製作所	11,700	601.00	7,031,700	
本田技研工業	1,293,800	3,313.00	4,286,359,400	
スズキ	350,800	4,290.00	1,504,932,000	
ＳＵＢＡＲＵ	464,900	2,304.50	1,071,362,050	
安永	7,100	724.00	5,140,400	
ヤマハ発動機	230,900	2,547.00	588,102,300	
小糸製作所	88,300	4,530.00	399,999,000	
ＴＢＫ	18,800	339.00	6,373,200	
エクセディ	26,800	1,745.00	46,766,000	
ミツバ	27,500	413.00	11,357,500	
豊田合成	50,000	2,159.00	107,950,000	
愛三工業	27,700	715.00	19,805,500	
盟和産業	1,800	1,003.00	1,805,400	
日本プラスト	12,900	461.00	5,946,900	
ヨロズ	13,800	901.00	12,433,800	
エフ・シー・シー	28,800	1,362.00	39,225,600	
新家工業	3,600	1,460.00	5,256,000	
シマノ	65,000	23,380.00	1,519,700,000	
テイ・エス　テック	74,700	1,460.00	109,062,000	
三十三フィナンシャルグループ	14,000	1,423.00	19,922,000	
第四北越フィナンシャルグループ	24,600	2,575.00	63,345,000	
ひろぎんホールディングス	223,100	629.00	140,329,900	
マーキュリアホールディングス	9,400	612.00	5,752,800	
おきなわフィナンシャルグループ	14,800	2,177.00	32,219,600	
ダイレクトマーケティングミックス	17,100	1,835.00	31,378,500	
ポピンズ	3,900	1,888.00	7,363,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	13,700	2,305.00	31,578,500	
十六フィナンシャルグループ	20,300	2,403.00	48,780,900	
北國フィナンシャルホールディングス	14,500	4,705.00	68,222,500	
ネットプロテクションズホールディングス	53,000	553.00	29,309,000	
プロクレアホールディングス	17,700	2,034.00	36,001,800	
ジャムコ	10,300	1,130.00	11,639,000	
小野建	15,600	1,410.00	21,996,000	
はるやまホールディングス	8,600	447.00	3,844,200	
南陽	3,300	1,782.00	5,880,600	
ノジマ	28,300	2,912.00	82,409,600	
佐鳥電機	10,900	1,084.00	11,815,600	
カッパ・クリエイト	24,500	1,466.00	35,917,000	
エコートレーディング	3,300	574.00	1,894,200	
伯東	10,200	2,541.00	25,918,200	
コンドーテック	13,200	1,013.00	13,371,600	
中山福	9,200	316.00	2,907,200	
ライトオン	13,100	745.00	9,759,500	

ナガイレーベン	21,100	2,000.00	42,200,000	
三菱食品	16,800	3,715.00	62,412,000	
良品計画	200,500	1,269.00	254,434,500	
パリミキホールディングス	21,300	271.00	5,772,300	
松田産業	12,700	2,073.00	26,327,100	
第一興商	33,100	3,780.00	125,118,000	
メディパルホールディングス	161,300	1,994.00	321,632,200	
アドヴァングループ	14,800	807.00	11,943,600	
ＳＰＫ	7,000	1,416.00	9,912,000	
萩原電気ホールディングス	6,000	1,993.00	11,958,000	
アルビス	5,200	2,260.00	11,752,000	
アズワン	25,100	6,140.00	154,114,000	
スズデン	5,500	1,955.00	10,752,500	
尾家産業	3,500	834.00	2,919,000	
シモジマ	10,700	989.00	10,582,300	
ドウシシャ	16,300	1,578.00	25,721,400	
小津産業	3,900	1,898.00	7,402,200	
コナカ	19,300	342.00	6,600,600	
高速	9,300	1,540.00	14,322,000	
ハウス　オブ　ローゼ	2,300	1,659.00	3,815,700	
Ｇ－７ホールディングス	19,400	1,474.00	28,595,600	
たけびし	6,000	1,499.00	8,994,000	
イオン北海道	23,000	1,091.00	25,093,000	
コジマ	29,900	667.00	19,943,300	
ヒマラヤ	5,400	987.00	5,329,800	
コーナン商事	24,800	3,685.00	91,388,000	
ネットワンシステムズ	64,100	3,210.00	205,761,000	
エコス	5,700	2,355.00	13,423,500	
ワタミ	21,200	912.00	19,334,400	
マルシェ	5,700	454.00	2,587,800	
リックス	3,600	2,049.00	7,376,400	
システムソフト	51,100	106.00	5,416,600	
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	348,400	2,176.00	758,118,400	
丸文	13,900	735.00	10,216,500	
西松屋チェーン	34,300	1,512.00	51,861,600	
ゼンショーホールディングス	85,100	3,380.00	287,638,000	
ハピネット	13,200	1,588.00	20,961,600	
幸楽苑ホールディングス	10,000	1,284.00	12,840,000	
ハークスレイ	7,300	566.00	4,131,800	
橋本総業ホールディングス	3,200	2,004.00	6,412,800	
日本ライフライン	51,700	941.00	48,649,700	
サイゼリヤ	25,800	2,631.00	67,879,800	
タカショー	13,500	741.00	10,003,500	
ＶＴホールディングス	65,700	491.00	32,258,700	
アルゴグラフィックス	13,600	3,270.00	44,472,000	
魚力	4,900	2,484.00	12,171,600	
ＩＤＯＭ	52,900	773.00	40,891,700	
日本エム・ディ・エム	10,200	1,608.00	16,401,600	
ポプラ	4,700	146.00	686,200	

フジ・コーポレーション	9,300	1,286.00	11,959,800	
ユナイテッドアローズ	18,200	1,872.00	34,070,400	
進和	10,400	2,203.00	22,911,200	
エスケイジャパン	4,200	461.00	1,936,200	
ダイトロン	6,700	1,815.00	12,160,500	
ハイデイ日高	25,200	2,110.00	53,172,000	
シークス	22,200	948.00	21,045,600	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	10,400	209.00	2,173,600	
コロワイド	71,500	1,865.00	133,347,500	
ピーシーデポコーポレーション	20,400	313.00	6,385,200	
田中商事	4,100	588.00	2,410,800	
オーハシテクニカ	8,700	1,373.00	11,945,100	
壱番屋	12,400	4,790.00	59,396,000	
白銅	5,600	2,390.00	13,384,000	
トップカルチャー	6,300	232.00	1,461,600	
ＰＬＡＮＴ	4,100	644.00	2,640,400	
スギホールディングス	34,900	6,160.00	214,984,000	
ダイコー通産	1,800	1,115.00	2,007,000	
薬王堂ホールディングス	8,700	2,108.00	18,339,600	
島津製作所	211,500	4,475.00	946,462,500	
ＪＭＳ	13,700	553.00	7,576,100	
クボテック	4,100	254.00	1,041,400	
長野計器	11,700	1,126.00	13,174,200	
ブイ・テクノロジー	7,700	2,874.00	22,129,800	
スター精密	23,800	1,641.00	39,055,800	
東京計器	11,300	1,308.00	14,780,400	
愛知時計電機	6,400	1,421.00	9,094,400	
インターアクション	8,800	1,822.00	16,033,600	
オーバル	16,000	350.00	5,600,000	
東京精密	27,600	4,440.00	122,544,000	
マニー	64,700	1,600.00	103,520,000	
ニコン	249,400	1,448.00	361,131,200	
トプコン	83,100	1,812.00	150,577,200	
オリンパス	856,700	2,745.50	2,352,069,850	
理研計器	11,700	3,850.00	45,045,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	27,900	8,950.00	249,705,000	
キヤノン電子	16,200	1,556.00	25,207,200	
タムロン	12,400	2,594.00	32,165,600	
ＨＯＹＡ	341,600	12,695.00	4,336,612,000	
シード	8,400	517.00	4,342,800	
ノーリツ鋼機	15,900	2,322.00	36,919,800	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	19,800	900.00	17,820,000	
朝日インテック	194,000	2,357.00	457,258,000	
キヤノン	879,500	3,173.00	2,790,653,500	
リコー	421,100	1,067.00	449,313,700	
シチズン時計	172,600	547.00	94,412,200	
リズム	5,500	1,710.00	9,405,000	
大研医器	14,200	482.00	6,844,400	
メニコン	54,500	3,215.00	175,217,500	

シンシア	1,800	419.00	754,200	
中本パックス	5,000	1,606.00	8,030,000	
スノーピーク	23,000	2,660.00	61,180,000	
パラマウントベッドホールディングス	33,900	2,347.00	79,563,300	
トランザクション	11,400	1,158.00	13,201,200	
粧美堂	5,300	398.00	2,109,400	
ニホンフラッシュ	13,800	946.00	13,054,800	
前田工繊	15,900	2,956.00	47,000,400	
永大産業	20,000	264.00	5,280,000	
アートネイチャー	15,500	751.00	11,640,500	
バンダイナムコホールディングス	146,400	10,040.00	1,469,856,000	
アイフィスジャパン	4,900	628.00	3,077,200	
共立印刷	24,800	147.00	3,645,600	
ＳＨＯＥＩ	15,600	5,380.00	83,928,000	
フランスベッドホールディングス	22,800	915.00	20,862,000	
マーベラス	27,400	689.00	18,878,600	
パイロットコーポレーション	25,300	4,905.00	124,096,500	
萩原工業	10,700	1,129.00	12,080,300	
エイベックス	29,900	1,455.00	43,504,500	
フジシールインターナショナル	36,300	1,481.00	53,760,300	
タカラトミー	73,000	1,439.00	105,047,000	
広済堂ホールディングス	11,000	1,064.00	11,704,000	
エステールホールディングス	4,300	631.00	2,713,300	
レック	20,900	687.00	14,358,300	
タカノ	6,300	830.00	5,229,000	
三光合成	20,300	339.00	6,881,700	
プロネクサス	13,800	1,108.00	15,290,400	
ホクシン	12,100	146.00	1,766,600	
ウッドワン	5,400	1,168.00	6,307,200	
大建工業	8,900	1,907.00	16,972,300	
きもと	27,400	226.00	6,192,400	
凸版印刷	230,600	2,218.00	511,470,800	
大日本印刷	191,700	2,852.00	546,728,400	
共同印刷	4,600	2,625.00	12,075,000	
ＮＩＳＳＨＡ	30,700	1,512.00	46,418,400	
光村印刷	700	1,243.00	870,100	
藤森工業	13,700	3,550.00	48,635,000	
ヴィア・ホールディングス	23,000	146.00	3,358,000	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	10,200	1,846.00	18,829,200	
前澤化成工業	10,500	1,309.00	13,744,500	
未来工業	6,500	1,518.00	9,867,000	
アシックス	135,600	2,528.00	342,796,800	
ツツミ	4,500	2,052.00	9,234,000	
ウェーブロックホールディングス	6,600	639.00	4,217,400	
ＪＳＰ	10,400	1,454.00	15,121,600	
ニチハ	22,500	2,671.00	60,097,500	
ローランド	12,400	4,055.00	50,282,000	
エフピコ	32,600	2,869.00	93,529,400	
小松ウオール工業	5,300	2,002.00	10,610,600	
ヤマハ	103,000	5,630.00	579,890,000	

河合楽器製作所	4,400	2,686.00	11,818,400	
クリナップ	16,700	601.00	10,036,700	
ピジョン	107,000	1,970.00	210,790,000	
天馬	13,900	2,311.00	32,122,900	
兼松サステック	700	1,617.00	1,131,900	
キングジム	13,200	910.00	12,012,000	
象印マホービン	43,900	1,515.00	66,508,500	
リンテック	33,800	2,331.00	78,787,800	
信越ポリマー	31,800	1,216.00	38,668,800	
東リ	41,200	206.00	8,487,200	
イトーキ	33,000	379.00	12,507,000	
任天堂	99,900	59,100.00	5,904,090,000	
三菱鉛筆	23,800	1,464.00	34,843,200	
松風	5,800	1,711.00	9,923,800	
タカラスタンダード	28,500	1,312.00	37,392,000	
コクヨ	77,800	1,768.00	137,550,400	
ナカバヤシ	14,700	503.00	7,394,100	
ニフコ	59,000	3,285.00	193,815,000	
立川ブラインド工業	7,000	1,080.00	7,560,000	
グローブライド	13,200	2,151.00	28,393,200	
オカムラ	49,700	1,250.00	62,125,000	
バルカー	14,500	2,600.00	37,700,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,200	2,025.00	2,430,000	
伊藤忠商事	1,045,000	3,865.00	4,038,925,000	
丸紅	1,509,900	1,205.00	1,819,429,500	
スクロール	26,800	929.00	24,897,200	
高島	2,400	2,635.00	6,324,000	
ヨンドシーホールディングス	14,700	1,761.00	25,886,700	
三陽商会	7,600	864.00	6,566,400	
長瀬産業	79,700	1,922.00	153,183,400	
ナイガイ	4,700	280.00	1,316,000	
蝶理	9,800	1,972.00	19,325,600	
豊田通商	155,600	4,435.00	690,086,000	
オンワードホールディングス	95,300	252.00	24,015,600	
三共生興	22,600	519.00	11,729,400	
兼松	60,300	1,371.00	82,671,300	
美津濃	14,600	2,409.00	35,171,400	
ツカモトコーポレーション	2,100	1,095.00	2,299,500	
ルックホールディングス	5,500	1,641.00	9,025,500	
三井物産	1,263,300	2,902.00	3,666,096,600	
日本紙パルプ商事	8,300	4,000.00	33,200,000	
東京エレクトロン	112,200	42,950.00	4,818,990,000	
カメイ	18,500	1,081.00	19,998,500	
東都水産	700	4,480.00	3,136,000	
ＯＵＧホールディングス	2,400	2,799.00	6,717,600	
スターゼン	11,800	2,070.00	24,426,000	
セイコーホールディングス	25,100	2,881.00	72,313,100	
山善	62,700	1,003.00	62,888,100	
椿本興業	3,000	3,670.00	11,010,000	
住友商事	1,031,300	1,877.50	1,936,265,750	

ＢＩＰＲＯＧＹ	54,200	2,773.00	150,296,600	
内田洋行	6,800	5,150.00	35,020,000	
三菱商事	1,142,800	3,905.00	4,462,634,000	
第一実業	6,700	3,410.00	22,847,000	
キヤノンマーケティングジャパン	43,300	2,896.00	125,396,800	
西華産業	7,600	1,653.00	12,562,800	
佐藤商事	12,000	1,114.00	13,368,000	
菱洋エレクトロ	10,300	2,298.00	23,669,400	
東京産業	14,300	722.00	10,324,600	
ユアサ商事	13,900	3,550.00	49,345,000	
神鋼商事	3,900	3,825.00	14,917,500	
トルク	6,800	197.00	1,339,600	
阪和興業	30,200	2,837.00	85,677,400	
正栄食品工業	11,300	3,885.00	43,900,500	
カナデン	14,200	1,045.00	14,839,000	
菱電商事	13,800	1,632.00	22,521,600	
ニプロ	122,400	1,117.00	136,720,800	
岩谷産業	38,600	5,340.00	206,124,000	
ナイス	5,400	1,709.00	9,228,600	
ニチモウ	2,100	2,367.00	4,970,700	
極東貿易	5,000	2,653.00	13,265,000	
アステナホールディングス	22,400	460.00	10,304,000	
兼松エレクトロニクス	9,500	4,110.00	39,045,000	
三愛オブリ	39,000	1,041.00	40,599,000	
稲畑産業	34,900	2,317.00	80,863,300	
ＧＳＩクレオス	8,300	1,398.00	11,603,400	
明和産業	16,100	731.00	11,769,100	
クワザワホールディングス	6,500	445.00	2,892,500	
キムラタン	95,300	21.00	2,001,300	
ゴールドウイン	28,600	8,000.00	228,800,000	
ユニ・チャーム	341,200	4,878.00	1,664,373,600	
デサント	29,600	3,180.00	94,128,000	
キング	8,200	510.00	4,182,000	
ワキタ	31,500	1,111.00	34,996,500	
ヤマトインターナショナル	13,500	283.00	3,820,500	
東邦ホールディングス	47,400	2,122.00	100,582,800	
サンゲツ	42,300	1,600.00	67,680,000	
ミツウロコグループホールディングス	20,100	932.00	18,733,200	
シナネンホールディングス	5,700	3,555.00	20,263,500	
伊藤忠エネクス	38,600	1,055.00	40,723,000	
サンリオ	48,900	3,025.00	147,922,500	
サンワ　テクノス	8,800	1,311.00	11,536,800	
リョーサン	17,900	2,178.00	38,986,200	
新光商事	23,100	900.00	20,790,000	
トーホー	6,700	1,341.00	8,984,700	
三信電気	7,200	1,553.00	11,181,600	
東陽テクニカ	17,100	1,138.00	19,459,800	
モスフードサービス	22,800	3,245.00	73,986,000	
加賀電子	14,200	3,060.00	43,452,000	
三益半導体工業	13,700	2,056.00	28,167,200	

都築電気	7,800	1,317.00	10,272,600	
ソーダニッカ	13,900	579.00	8,048,100	
立花エレテック	11,400	1,536.00	17,510,400	
木曽路	23,100	2,205.00	50,935,500	
ＳＲＳホールディングス	25,100	871.00	21,862,100	
千趣会	31,700	384.00	12,172,800	
タカキュー	13,500	89.00	1,201,500	
リテールパートナーズ	23,100	1,185.00	27,373,500	
ケーヨー	32,200	910.00	29,302,000	
上新電機	16,900	1,971.00	33,309,900	
日本瓦斯	83,200	1,932.00	160,742,400	
ロイヤルホールディングス	26,900	2,154.00	57,942,600	
東天紅	700	915.00	640,500	
いなげや	17,200	1,305.00	22,446,000	
チヨダ	14,800	803.00	11,884,400	
ライフコーポレーション	13,600	2,686.00	36,529,600	
リンガーハット	20,100	2,410.00	48,441,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	21,900	630.00	13,797,000	
テンアライド	17,400	307.00	5,341,800	
ＡＯＫＩホールディングス	33,700	681.00	22,949,700	
オークワ	25,100	877.00	22,012,700	
コメリ	26,900	2,650.00	71,285,000	
青山商事	33,100	861.00	28,499,100	
しまむら	20,300	12,420.00	252,126,000	
はせがわ	8,900	252.00	2,242,800	
高島屋	117,100	1,381.00	161,715,100	
松屋	29,200	856.00	24,995,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	75,700	1,001.00	75,775,700	
近鉄百貨店	5,000	2,382.00	11,910,000	
丸井グループ	126,000	2,309.00	290,934,000	
クレディセゾン	101,900	1,581.00	161,103,900	
アクシアル　リテイリング	11,600	3,315.00	38,454,000	
井筒屋	8,200	347.00	2,845,400	
イオン	574,800	2,665.00	1,531,842,000	
イズミ	27,500	3,080.00	84,700,000	
フォーバル	6,300	862.00	5,430,600	
平和堂	26,000	1,995.00	51,870,000	
フジ	38,200	2,245.00	85,759,000	
ヤオコー	19,800	6,330.00	125,334,000	
ゼビオホールディングス	23,600	913.00	21,546,800	
ケーズホールディングス	148,300	1,401.00	207,768,300	
ＰＡＬＴＡＣ	24,500	4,390.00	107,555,000	
三谷産業	27,400	321.00	8,795,400	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7,700	639.00	4,920,300	
日産東京販売ホールディングス	25,700	272.00	6,990,400	
新生銀行	113,800	2,037.00	231,810,600	
あおぞら銀行	97,500	2,721.00	265,297,500	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,216,800	739.50	7,555,323,600	
りそなホールディングス	1,847,300	513.40	948,403,820	
三井住友トラスト・ホールディングス	288,700	4,279.00	1,235,347,300	

三井住友フィナンシャルグループ	1,132,600	4,128.00	4,675,372,800	
千葉銀行	492,900	752.00	370,660,800	
群馬銀行	280,700	386.00	108,350,200	
武蔵野銀行	22,300	1,796.00	40,050,800	
千葉興業銀行	38,100	256.00	9,753,600	
筑波銀行	68,000	194.00	13,192,000	
七十七銀行	46,400	1,773.00	82,267,200	
秋田銀行	10,500	1,674.00	17,577,000	
山形銀行	16,000	922.00	14,752,000	
岩手銀行	10,600	1,995.00	21,147,000	
東邦銀行	124,700	209.00	26,062,300	
東北銀行	7,900	976.00	7,710,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	126,000	2,428.00	305,928,000	
静岡銀行	359,600	820.00	294,872,000	
スルガ銀行	153,000	376.00	57,528,000	
八十二銀行	323,900	508.00	164,541,200	
山梨中央銀行	17,700	1,185.00	20,974,500	
大垣共立銀行	29,800	1,751.00	52,179,800	
福井銀行	14,000	1,388.00	19,432,000	
清水銀行	6,400	1,492.00	9,548,800	
富山銀行	2,600	1,859.00	4,833,400	
滋賀銀行	28,500	2,713.00	77,320,500	
南都銀行	23,600	2,035.00	48,026,000	
百五銀行	146,500	330.00	48,345,000	
京都銀行	54,200	5,770.00	312,734,000	
紀陽銀行	51,900	1,406.00	72,971,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	99,100	851.00	84,334,100	
山陰合同銀行	97,100	669.00	64,959,900	
中国銀行	122,700	987.00	121,104,900	
鳥取銀行	5,600	1,176.00	6,585,600	
伊予銀行	195,700	663.00	129,749,100	
百十四銀行	16,000	1,692.00	27,072,000	
四国銀行	23,100	854.00	19,727,400	
阿波銀行	23,100	2,054.00	47,447,400	
大分銀行	9,300	1,881.00	17,493,300	
宮崎銀行	9,400	2,089.00	19,636,600	
佐賀銀行	9,300	1,510.00	14,043,000	
琉球銀行	37,900	803.00	30,433,700	
セブン銀行	518,000	262.00	135,716,000	
みずほフィナンシャルグループ	2,092,700	1,582.50	3,311,697,750	
高知銀行	5,600	704.00	3,942,400	
山口フィナンシャルグループ	174,300	762.00	132,816,600	
芙蓉総合リース	14,900	7,920.00	118,008,000	
みずほリース	21,500	3,240.00	69,660,000	
東京センチュリー	27,000	4,645.00	125,415,000	
ＳＢＩホールディングス	215,600	2,714.00	585,138,400	
日本証券金融	68,700	870.00	59,769,000	
アイフル	292,700	369.00	108,006,300	
日本アジア投資	13,600	243.00	3,304,800	
長野銀行	5,400	1,321.00	7,133,400	

名古屋銀行	10,600	3,105.00	32,913,000	
北洋銀行	219,000	231.00	50,589,000	
愛知銀行	5,400	5,350.00	28,890,000	
中京銀行	5,400	1,731.00	9,347,400	
大光銀行	5,300	1,400.00	7,420,000	
愛媛銀行	22,800	908.00	20,702,400	
トマト銀行	5,500	1,010.00	5,555,000	
京葉銀行	72,700	470.00	34,169,000	
栃木銀行	78,700	264.00	20,776,800	
北日本銀行	5,200	1,675.00	8,710,000	
東和銀行	28,600	524.00	14,986,400	
福島銀行	18,200	218.00	3,967,600	
大東銀行	7,700	653.00	5,028,100	
リコーリース	15,500	3,615.00	56,032,500	
イオンフィナンシャルサービス	95,000	1,308.00	124,260,000	
アコム	344,300	328.00	112,930,400	
ジャックス	17,300	3,445.00	59,598,500	
オリエントコーポレーション	472,100	128.00	60,428,800	
オリックス	1,037,100	2,318.50	2,404,516,350	
三菱ＨＣキャピタル	564,300	629.00	354,944,700	
ジャフコ　グループ	60,400	1,726.00	104,250,400	
九州リースサービス	7,800	569.00	4,438,200	
トモニホールディングス	125,800	318.00	40,004,400	
大和証券グループ本社	1,120,900	622.00	697,199,800	
野村ホールディングス	2,664,800	511.80	1,363,844,640	
岡三証券グループ	125,800	349.00	43,904,200	
丸三証券	51,900	495.00	25,690,500	
東洋証券	53,200	213.00	11,331,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	171,500	381.00	65,341,500	
光世証券	3,300	450.00	1,485,000	
水戸証券	43,000	264.00	11,352,000	
いちよし証券	28,800	646.00	18,604,800	
松井証券	85,400	813.00	69,430,200	
ＳＯＭＰＯホールディングス	248,300	6,069.00	1,506,932,700	
日本取引所グループ	406,600	2,117.50	860,975,500	
マネックスグループ	146,900	455.00	66,839,500	
極東証券	20,000	705.00	14,100,000	
岩井コスモホールディングス	16,600	1,279.00	21,231,400	
アイザワ証券グループ	23,500	725.00	17,037,500	
フィデアホールディングス	15,900	1,319.00	20,972,100	
池田泉州ホールディングス	185,600	202.00	37,491,200	
アニコム　ホールディングス	53,500	666.00	35,631,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	358,700	4,341.00	1,557,116,700	
マネーパートナーズグループ	18,500	254.00	4,699,000	
スパークス・グループ	80,700	281.00	22,676,700	
小林洋行	3,500	217.00	759,500	
第一生命ホールディングス	850,000	2,442.50	2,076,125,000	
東京海上ホールディングス	485,600	8,188.00	3,976,092,800	

アドバンテッジリスクマネジメント	8,300	447.00	3,710,100	
イー・ギャランティ	25,900	2,247.00	58,197,300	
アサックス	9,400	613.00	5,762,200	
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,100	2,067.00	14,675,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	388,200	1,596.00	619,567,200	
アドバンスクリエイト	8,400	977.00	8,206,800	
三井不動産	681,100	2,902.00	1,976,552,200	
三菱地所	993,900	1,981.50	1,969,412,850	
平和不動産	27,700	3,985.00	110,384,500	
東京建物	149,300	1,963.00	293,075,900	
京阪神ビルディング	22,800	1,314.00	29,959,200	
住友不動産	313,900	3,567.00	1,119,681,300	
太平洋興発	6,600	619.00	4,085,400	
テーオーシー	26,300	782.00	20,566,600	
東京楽天地	2,500	3,980.00	9,950,000	
レオパレス２１	181,000	248.00	44,888,000	
スターツコーポレーション	23,700	2,833.00	67,142,100	
フジ住宅	20,400	665.00	13,566,000	
空港施設	17,800	549.00	9,772,200	
明和地所	8,300	626.00	5,195,800	
ゴールドクレスト	13,800	1,743.00	24,053,400	
リログループ	92,500	2,062.00	190,735,000	
エスリード	6,800	1,693.00	11,512,400	
日神グループホールディングス	28,500	433.00	12,340,500	
日本エスコン	32,600	779.00	25,395,400	
タカラレーベン	73,400	357.00	26,203,800	
ＡＶＡＮＴＩＡ	8,400	808.00	6,787,200	
イオンモール	87,400	1,682.00	147,006,800	
毎日コムネット	6,100	630.00	3,843,000	
ファースト住建	6,600	1,118.00	7,378,800	
ランド	950,100	10.00	9,501,000	
カチタス	43,200	3,210.00	138,672,000	
東祥	12,600	1,302.00	16,405,200	
トーセイ	24,100	1,220.00	29,402,000	
穴吹興産	3,900	2,101.00	8,193,900	
サンフロンティア不動産	24,000	1,105.00	26,520,000	
ＦＪネクストホールディングス	17,200	1,075.00	18,490,000	
インテリックス	4,100	580.00	2,378,000	
ランドビジネス	6,300	228.00	1,436,400	
サンネクスタグループ	5,600	1,047.00	5,863,200	
グランディハウス	12,000	538.00	6,456,000	
東武鉄道	161,400	3,060.00	493,884,000	
相鉄ホールディングス	52,500	2,332.00	122,430,000	
東急	412,100	1,588.00	654,414,800	
京浜急行電鉄	197,000	1,438.00	283,286,000	
小田急電鉄	222,600	1,845.00	410,697,000	
京王電鉄	77,600	4,945.00	383,732,000	
京成電鉄	104,200	3,515.00	366,263,000	
富士急行	18,100	3,960.00	71,676,000	
新京成電鉄	4,200	2,867.00	12,041,400	

東日本旅客鉄道	270,000	6,693.00	1,807,110,000	
西日本旅客鉄道	187,700	4,791.00	899,270,700	
東海旅客鉄道	124,500	15,175.00	1,889,287,500	
西武ホールディングス	213,200	1,322.00	281,850,400	
鴻池運輸	25,100	1,287.00	32,303,700	
西日本鉄道	42,600	2,857.00	121,708,200	
ハマキョウレックス	11,500	3,055.00	35,132,500	
サカイ引越センター	8,200	4,725.00	38,745,000	
近鉄グループホールディングス	157,200	4,175.00	656,310,000	
阪急阪神ホールディングス	195,700	3,690.00	722,133,000	
南海電気鉄道	70,100	2,554.00	179,035,400	
京阪ホールディングス	65,300	3,250.00	212,225,000	
神戸電鉄	4,100	3,255.00	13,345,500	
名古屋鉄道	162,100	2,076.00	336,519,600	
山陽電気鉄道	12,000	2,147.00	25,764,000	
アルプス物流	11,700	1,159.00	13,560,300	
トランコム	4,600	7,450.00	34,270,000	
ヤマトホールディングス	234,900	2,274.00	534,162,600	
山九	40,700	4,030.00	164,021,000	
日新	12,400	1,615.00	20,026,000	
丸運	8,600	233.00	2,003,800	
丸全昭和運輸	11,400	3,170.00	36,138,000	
センコーグループホールディングス	77,600	907.00	70,383,200	
トナミホールディングス	3,200	3,670.00	11,744,000	
ニッコンホールディングス	50,600	2,234.00	113,040,400	
日本石油輸送	1,000	2,440.00	2,440,000	
福山通運	21,400	3,140.00	67,196,000	
セイノーホールディングス	91,200	1,117.00	101,870,400	
エスライン	4,700	849.00	3,990,300	
神奈川中央交通	4,100	3,450.00	14,145,000	
日立物流	32,400	8,550.00	277,020,000	
丸和運輸機関	28,400	1,417.00	40,242,800	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	14,000	1,125.00	15,750,000	
日本郵船	140,200	9,300.00	1,303,860,000	
商船三井	258,500	3,100.00	801,350,000	
川崎汽船	51,700	7,860.00	406,362,000	
ＮＳユナイテッド海運	7,900	3,735.00	29,506,500	
明治海運	15,800	897.00	14,172,600	
飯野海運	65,900	686.00	45,207,400	
共栄タンカー	3,100	956.00	2,963,600	
九州旅客鉄道	112,400	2,741.00	308,088,400	
ＳＧホールディングス	281,500	2,511.00	706,846,500	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	49,800	7,550.00	375,990,000	
日本航空	360,300	2,283.00	822,564,900	
ＡＮＡホールディングス	399,100	2,461.50	982,384,650	
ビーウィズ	4,500	1,408.00	6,336,000	
パスコ	3,300	1,335.00	4,405,500	
ＴＲＥホールディングス	31,800	1,667.00	53,010,600	
人・夢・技術グループ	6,700	2,471.00	16,555,700	

西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,900	4,000.00	15,600,000	
シルバーライフ	3,500	1,350.00	4,725,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,500	1,788.00	2,682,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	7,700	3,375.00	25,987,500	
コーア商事ホールディングス	10,900	712.00	7,760,800	
国際紙パルプ商事	32,100	483.00	15,504,300	
ナルミヤ・インターナショナル	3,900	879.00	3,428,100	
ブックオフグループホールディングス	10,300	1,040.00	10,712,000	
ギフトホールディングス	2,600	2,191.00	5,696,600	
三菱倉庫	40,600	3,360.00	136,416,000	
三井倉庫ホールディングス	16,300	2,995.00	48,818,500	
住友倉庫	49,200	2,044.00	100,564,800	
澁澤倉庫	8,400	2,164.00	18,177,600	
ヤマタネ	7,600	1,602.00	12,175,200	
東陽倉庫	24,300	291.00	7,071,300	
乾汽船	10,000	1,773.00	17,730,000	
日本トランスシティ	29,600	497.00	14,711,200	
ケイヒン	3,000	1,348.00	4,044,000	
中央倉庫	8,800	985.00	8,668,000	
川西倉庫	3,100	1,055.00	3,270,500	
安田倉庫	11,400	935.00	10,659,000	
ファイズホールディングス	3,600	731.00	2,631,600	
東洋埠頭	4,700	1,315.00	6,180,500	
上組	79,600	2,710.00	215,716,000	
サンリツ	4,400	701.00	3,084,400	
キムラユニティー	8,800	781.00	6,872,800	
キユーソー流通システム	8,400	1,157.00	9,718,800	
東海運	9,700	283.00	2,745,100	
エーアイテイー	10,500	1,542.00	16,191,000	
内外トランスライン	6,500	1,848.00	12,012,000	
ショーエイコーポレーション	4,700	586.00	2,754,200	
日本コンセプト	5,400	1,434.00	7,743,600	
ＴＢＳホールディングス	84,800	1,727.00	146,449,600	
日本テレビホールディングス	144,900	1,262.00	182,863,800	
朝日放送グループホールディングス	13,700	658.00	9,014,600	
テレビ朝日ホールディングス	41,700	1,517.00	63,258,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	147,100	546.00	80,316,600	
テレビ東京ホールディングス	10,700	1,978.00	21,164,600	
日本ＢＳ放送	6,000	1,065.00	6,390,000	
ビジョン	27,600	1,097.00	30,277,200	
スマートバリュー	4,100	476.00	1,951,600	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	13,200	2,193.00	28,947,600	
ワイヤレスゲート	7,000	288.00	2,016,000	
コネクシオ	12,400	1,350.00	16,740,000	
日本通信	144,300	229.00	33,044,700	
クロップス	3,100	914.00	2,833,400	
日本電信電話	1,946,400	3,914.00	7,618,209,600	
ＫＤＤＩ	1,266,000	4,433.00	5,612,178,000	

ソフトバンク	2,630,300	1,553.00	4,084,855,900	
光通信	20,100	14,270.00	286,827,000	
エムティーアイ	13,500	501.00	6,763,500	
GMOインターネット	60,800	2,608.00	158,566,400	
ファイバーゲート	7,800	923.00	7,199,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	4,100	296.00	1,213,600	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	93,600	3,175.00	297,180,000	
学研ホールディングス	24,500	941.00	23,054,500	
ゼンリン	28,300	946.00	26,771,800	
昭文社ホールディングス	7,300	363.00	2,649,900	
インプレスホールディングス	14,200	214.00	3,038,800	
東京電力ホールディングス	1,324,300	619.00	819,741,700	
中部電力	499,800	1,398.00	698,720,400	
関西電力	619,000	1,375.00	851,125,000	
中国電力	255,200	902.00	230,190,400	
北陸電力	150,400	549.00	82,569,600	
東北電力	386,600	746.00	288,403,600	
四国電力	147,000	800.00	117,600,000	
九州電力	338,500	886.00	299,911,000	
北海道電力	154,000	518.00	79,772,000	
沖縄電力	37,500	1,319.00	49,462,500	
電源開発	130,700	2,279.00	297,865,300	
エフオン	10,700	579.00	6,195,300	
イーレックス	22,700	2,396.00	54,389,200	
レノバ	34,800	2,622.00	91,245,600	
東京瓦斯	315,000	2,525.00	795,375,000	
大阪瓦斯	297,700	2,411.00	717,754,700	
東邦瓦斯	69,300	2,995.00	207,553,500	
北海道瓦斯	8,900	1,601.00	14,248,900	
広島ガス	31,600	324.00	10,238,400	
西部ガスホールディングス	16,900	1,866.00	31,535,400	
静岡ガス	41,800	931.00	38,915,800	
メタウォーター	18,400	2,038.00	37,499,200	
アイネット	8,200	1,266.00	10,381,200	
松竹	9,900	12,390.00	122,661,000	
東宝	102,400	5,050.00	517,120,000	
エイチ・アイ・エス	35,100	2,036.00	71,463,600	
東映	4,900	18,990.00	93,051,000	
ラックランド	5,200	2,946.00	15,319,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	462,400	1,936.00	895,206,400	
共立メンテナンス	30,200	4,760.00	143,752,000	
イチネンホールディングス	17,400	1,253.00	21,802,200	
建設技術研究所	8,600	2,671.00	22,970,600	
スペース	11,100	906.00	10,056,600	
アインホールディングス	21,400	7,720.00	165,208,000	
燦ホールディングス	7,300	1,878.00	13,709,400	
ピー・シー・エー	10,200	1,243.00	12,678,600	
スバル興業	700	8,660.00	6,062,000	
東京テアトル	6,400	1,227.00	7,852,800	

タナベ経営	5,400	666.00	3,596,400	
ビジネスブレイン太田昭和	5,700	1,477.00	8,418,900	
ナガワ	4,700	8,190.00	38,493,000	
東京都競馬	12,600	4,015.00	50,589,000	
常磐興産	5,800	1,284.00	7,447,200	
カナモト	27,600	1,976.00	54,537,600	
ＤＴＳ	32,400	3,350.00	108,540,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	80,800	6,210.00	501,768,000	
シーイーシー	18,500	1,226.00	22,681,000	
カプコン	163,700	3,605.00	590,138,500	
西尾レントオール	14,000	2,835.00	39,690,000	
アイ・エス・ビー	8,100	1,015.00	8,221,500	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	91,900	22.00	2,021,800	
日本空港ビルデング	56,300	5,120.00	288,256,000	
トランス・コスモス	21,400	3,565.00	76,291,000	
乃村工藝社	72,400	898.00	65,015,200	
ジャステック	10,200	1,184.00	12,076,800	
ＳＣＳＫ	120,200	2,404.00	288,960,800	
藤田観光	7,300	2,714.00	19,812,200	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	10,500	1,443.00	15,151,500	
日本管財	18,100	2,621.00	47,440,100	
トーカイ	13,500	1,688.00	22,788,000	
白洋舎	1,900	1,300.00	2,470,000	
セコム	166,700	8,752.00	1,458,958,400	
日本システムウエア	6,600	2,397.00	15,820,200	
セントラル警備保障	8,100	2,681.00	21,716,100	
アイネス	15,000	1,636.00	24,540,000	
丹青社	32,000	814.00	26,048,000	
メイテック	59,000	2,345.00	138,355,000	
ＴＫＣ	26,400	3,430.00	90,552,000	
富士ソフト	16,700	8,180.00	136,606,000	
応用地質	16,100	1,707.00	27,482,700	
船井総研ホールディングス	31,700	2,296.00	72,783,200	
ＮＳＤ	54,400	2,551.00	138,774,400	
進学会ホールディングス	5,600	320.00	1,792,000	
丸紅建材リース	1,000	1,911.00	1,911,000	
オオバ	10,700	754.00	8,067,800	
コナミグループ	63,100	7,440.00	469,464,000	
いであ	4,200	1,737.00	7,295,400	
学究社	5,500	1,587.00	8,728,500	
ベネッセホールディングス	56,400	2,281.00	128,648,400	
イオンディライト	19,500	2,845.00	55,477,500	
ナック	8,400	987.00	8,290,800	
福井コンピュータホールディングス	7,900	3,565.00	28,163,500	
ダイセキ	30,800	3,805.00	117,194,000	
ステップ	6,300	1,726.00	10,873,800	
日鉄物産	10,600	5,030.00	53,318,000	
泉州電業	4,300	5,060.00	21,758,000	

元気寿司	4,900	2,550.00	12,495,000	
トラスコ中山	36,200	1,862.00	67,404,400	
ヤマダホールディングス	616,300	496.00	305,684,800	
オートバックスセブン	54,100	1,424.00	77,038,400	
モリト	12,800	782.00	10,009,600	
アークランドサカモト	27,300	1,594.00	43,516,200	
ニトリホールディングス	69,200	13,765.00	952,538,000	
グルメ杵屋	13,900	1,025.00	14,247,500	
愛眼	9,100	181.00	1,647,100	
ケーユーホールディングス	9,200	1,049.00	9,650,800	
吉野家ホールディングス	60,800	2,444.00	148,595,200	
加藤産業	18,900	3,320.00	62,748,000	
北恵	4,400	830.00	3,652,000	
イノテック	10,600	1,324.00	14,034,400	
イエローハット	27,400	1,736.00	47,566,400	
松屋フーズホールディングス	8,400	4,070.00	34,188,000	
ＪＢＣＣホールディングス	11,700	1,631.00	19,082,700	
ＪＫホールディングス	12,400	984.00	12,201,600	
サガミホールディングス	24,900	1,142.00	28,435,800	
日伝	11,800	1,945.00	22,951,000	
関西フードマーケット	14,000	1,232.00	17,248,000	
ミロク情報サービス	15,200	1,322.00	20,094,400	
北沢産業	8,600	203.00	1,745,800	
杉本商事	8,200	2,093.00	17,162,600	
因幡電機産業	43,400	2,761.00	119,827,400	
王将フードサービス	11,500	6,850.00	78,775,000	
プレナス	19,500	2,020.00	39,390,000	
ミニストップ	13,100	1,500.00	19,650,000	
アークス	30,800	2,124.00	65,419,200	
バローホールディングス	35,500	1,933.00	68,621,500	
東テク	5,300	3,150.00	16,695,000	
ミスミグループ本社	218,800	3,115.00	681,562,000	
アルテック	10,700	273.00	2,921,100	
ベルク	7,700	5,250.00	40,425,000	
大　庄	9,400	1,187.00	11,157,800	
タキヒヨー	4,700	933.00	4,385,100	
ファーストリテイリング	23,400	68,900.00	1,612,260,000	
ソフトバンクグループ	1,041,400	5,446.00	5,671,464,400	
蔵王産業	2,500	1,846.00	4,615,000	
スズケン	62,500	3,915.00	244,687,500	
サンドラッグ	65,600	3,140.00	205,984,000	
サックスバー　ホールディングス	16,600	632.00	10,491,200	
ジェコス	12,300	848.00	10,430,400	
ヤマザワ	3,300	1,495.00	4,933,500	
やまや	3,500	2,566.00	8,981,000	
グローセル	19,300	404.00	7,797,200	
ベルーナ	37,400	775.00	28,985,000	
合計	182,481,000		435,590,889,830	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2022年7月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	667,048,779
コール・ローン	343,951,194
国債証券	171,245,332,814
派生商品評価勘定	65,759
未収利息	892,838,259
前払費用	153,293,083
流動資産合計	173,302,529,888
資産合計	173,302,529,888
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	227,101
未払金	1,413,365,603
未払解約金	62,693,000
流動負債合計	1,476,285,704
負債合計	1,476,285,704
純資産の部	
元本等	
元本	81,983,703,364
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	89,842,540,820
元本等合計	171,826,244,184
純資産合計	171,826,244,184
負債純資産合計	173,302,529,888

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	72,664,346,452円
同期中追加設定元本額	33,903,850,968円
同期中一部解約元本額	24,584,494,056円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国債券パッシブ・ファンド	7,877,837,335円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	11,135,806円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	38,968,060円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	150,689,387円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	53,440,037円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	27,595,169円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	35,303,274円
たわらノーロード　先進国債券	14,533,401,969円
たわらノーロード　先進国債券＜ラップ向け＞	240,742,538円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,888,142,499円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	51,548,649円
たわらノーロード　バランス（標準型）	254,186,182円
たわらノーロード　バランス（積極型）	52,896,039円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	6,973,742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）	319,956,479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）	388,446,155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）	75,675,054円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（積極型）	2,643,196円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	965,839円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	6,580,091円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	73,154,309円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,180,153円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,198,710円
ＤＩＡＭ外国債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	6,355,162,172円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国債券インデックスファンド	651,315,240円

Ｏｎｅグローバルバランス	7,991,147円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	693,436,695円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	2,208,003,128円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	2,409,977,028円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	399,320,363円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	824,165,742円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	699,976,057円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,352,119円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	497,700,169円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	36,330,259円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	142,143,683円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	143,031,960円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	215,251,242円
クルーズコントロール	168,829,430円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	164,557,744円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	459,192,871円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	518,786,814円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	163,802,451円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	195,467,306円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	1,152,570,913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）	170,990,239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）	175,096,160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）	93,799,258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）	106,253,098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）	168,005,667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）	213,170,513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）	340,882,580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）	151,664,982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）	353,976,201円
ＤＩＡＭ為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド（適格機関投資家向け）	5,092,881,327円
ＤＩＡＭ外国債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	2,633,423,569円
外国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	2,559,788,215円
先進国債券パッシブファンド（適格機関投資家限定）	5,288,395,466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）	114,477,427円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	50,257,857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）	290,151,123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）	368,590,608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）	234,926,260円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	14,679,876円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	37,996,120円

ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	8,240,877円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	329,214円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,693,355円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	43,584,529円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,786,632,044円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,445,920,101円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,575,302,153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）	76,994,523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）	134,991,812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）	1,620,819,860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）	361,605,201円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,101,261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）	318,436,209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）	308,988,317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）	437,234,548円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	51,631,670円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	35,673,526円
コア資産形成ファンド	23,537,671円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド（ファンドラップ）	1,391,649,774円
ＭＨＡＭ外国債券インデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	274,846,157円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	4,840,305,496円
ＭＨＡＭ外国債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	3,540,753,315円
計	81,983,703,364円
２．　受益権の総数	81,983,703,364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　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△13,978,922,466
合計	△13,978,922,466

（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（2022年2月22日から2022年7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	44,192,588	－	44,419,689	△227,101
マレーシア・リンギット	44,192,588	－	44,419,689	△227,101
買建	1,260,000,000	－	1,260,065,759	65,759
アメリカ・ドル	640,119,000	－	640,133,542	14,542
イギリス・ポンド	64,039,000	－	64,043,690	4,690
ユーロ	555,842,000	－	555,888,527	46,527
合計	1,304,192,588	－	1,304,485,448	△161,342

（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）	2.0959円 (20,959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7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	1,660,000.000	1,586,985.920	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,577,250.000	
		US T N/B 0.125 07/15/23	1,600,000.000	1,553,937.480	
		US T N/B 0.125 07/31/23	2,640,000.000	2,560,284.340	
		US T N/B 0.125 08/15/23	2,900,000.000	2,808,695.290	
		US T N/B 0.125 08/31/23	530,000.000	512,340.230	
		US T N/B 0.125 09/15/23	2,000,000.000	1,931,406.240	
		US T N/B 0.125 10/15/23	230,000.000	221,518.750	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,160,000.000	2,070,056.230	
		US T N/B 0.25 03/15/24	3,910,000.000	3,726,107.800	
		US T N/B 0.25 05/15/24	2,500,000.000	2,371,484.370	
		US T N/B 0.25 05/31/25	1,890,000.000	1,738,504.680	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,577,563.260	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,211,113.250	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,476,703.100	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,276,155.450	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,416,015.620	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,387,670.300	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,000,000.000	1,816,562.500	
		US T N/B 0.25 11/15/23	800,000.000	770,500.000	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,351,968.750	
		US T N/B 0.375 04/15/24	4,140,000.000	3,944,158.560	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,368,700.000	

		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,786,718.720	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,292,143.750	
		US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,870,656.250	
		US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,883,437.500	
		US T N/B 0.375 09/30/27	1,870,000.000	1,620,033.570	
		US T N/B 0.375 10/31/23	890,000.000	859,475.770	
		US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,903,398.430	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,723,671.860	
		US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	3,059,854.680	
		US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,661,699.200	
		US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,090,136.320	
		US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,742,090.620	
		US T N/B 0.5 06/30/27	4,280,000.000	3,757,706.240	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,182,770.290	
		US T N/B 0.5 11/30/23	3,000,000.000	2,894,414.040	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,956,882.810	
		US T N/B 0.625 05/15/30	6,650,000.000	5,509,109.370	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,522,796.860	
		US T N/B 0.625 08/15/30	5,690,000.000	4,688,471.060	
		US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,780,312.480	
		US T N/B 0.625 11/30/27	2,700,000.000	2,361,656.250	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,895,921.850	
		US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,843,107.780	
		US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,946,551.530	
		US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,378,851.540	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,230,000.000	2,944,094.510	
		US T N/B 0.75 08/31/26	2,950,000.000	2,673,667.950	
		US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,468,081.250	
		US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,922,060.140	
		US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	193,148.430	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	3,027,357.000	
		US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,829,128.120	
		US T N/B 0.875 11/15/30	7,000,000.000	5,868,515.580	
		US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,316,863.640	
		US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,376,978.870	
		US T N/B 1.125 01/15/25	1,880,000.000	1,787,175.000	
		US T N/B 1.125 02/15/31	7,760,000.000	6,625,100.000	
		US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,827,740.620	
		US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	1,003,707.030	
		US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,454,700.000	
		US T N/B 1.125 05/15/40	1,600,000.000	1,097,124.990	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	2,148,059.350	
		US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,301,632.810	
		US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	3,112,708.570	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,246,179.680	
		US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,599,444.890	
		US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,715,886.730	
		US T N/B 1.25 05/31/28	4,900,000.000	4,391,816.390	
		US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,319,725.360	

		US T N/B 1.25 07/31/23	350,000.000	343,546.870	
		US T N/B 1.25 08/15/31	7,630,000.000	6,517,092.920	
		US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,757,442.180	
		US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,545,153.870	
		US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,412,960.910	
		US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,583,358.560	
		US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	717,246.080	
		US T N/B 1.375 06/30/23	3,830,000.000	3,769,857.010	
		US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	3,130,877.290	
		US T N/B 1.375 08/31/23	370,000.000	363,235.930	
		US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	1,023,515.620	
		US T N/B 1.375 09/30/23	1,830,000.000	1,792,542.180	
		US T N/B 1.375 10/31/28	3,210,000.000	2,880,097.250	
		US T N/B 1.375 11/15/31	6,990,000.000	6,014,130.430	
		US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,259,417.170	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	3,136,738.250	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,940,000.000	5,524,200.000	
		US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,360,535.130	
		US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,327,276.560	
		US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,896,562.480	
		US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,489,881.250	
		US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,659,303.100	
		US T N/B 1.5 11/30/24	2,300,000.000	2,213,031.250	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,613,125.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,735,791.390	
		US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,464,422.630	
		US T N/B 1.625 05/15/31	6,640,000.000	5,888,850.000	
		US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,582,871.840	
		US T N/B 1.625 09/30/26	2,150,000.000	2,019,992.180	
		US T N/B 1.625 10/31/23	2,800,000.000	2,745,093.730	
		US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,604,060.140	
		US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	3,286,996.860	
		US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,696,167.950	
		US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,750,039.040	
		US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,854,375.000	
		US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,304,877.340	
		US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,935,896.870	
		US T N/B 1.75 08/15/41	4,430,000.000	3,310,386.680	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,869,023.430	
		US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,923,692.550	
		US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,986,367.180	
		US T N/B 1.875 02/15/32	6,280,000.000	5,642,432.790	
		US T N/B 1.875 02/15/41	2,830,000.000	2,184,406.250	
		US T N/B 1.875 02/15/51	4,720,000.000	3,464,406.210	
		US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,412,296.070	
		US T N/B 1.875 02/28/29	2,000,000.000	1,848,437.500	
		US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,790,700.000	
		US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	798,154.680	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,724,865.620	

		US T N/B 2.0 02/15/25	5,930,000.000	5,755,342.930	
		US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,821,968.720	
		US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,627,443.720	
		US T N/B 2.0 05/31/24	3,970,000.000	3,889,514.440	
		US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	283,837.500	
		US T N/B 2.0 08/15/25	3,380,000.000	3,263,548.410	
		US T N/B 2.0 08/15/51	5,110,000.000	3,866,832.790	
		US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,695,132.800	
		US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	3,315,000.000	
		US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,623,832.010	
		US T N/B 2.125 03/31/24	3,340,000.000	3,283,376.540	
		US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,837,363.250	
		US T N/B 2.125 05/31/26	2,350,000.000	2,260,039.050	
		US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	372,370.310	
		US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	577,324.210	
		US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	1,972,187.500	
		US T N/B 2.125 11/30/24	280,000.000	273,459.370	
		US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	700,459.370	
		US T N/B 2.25 02/15/27	1,580,000.000	1,517,293.750	
		US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	3,466,203.120	
		US T N/B 2.25 03/31/24	4,750,000.000	4,678,007.810	
		US T N/B 2.25 03/31/26	2,690,000.000	2,601,314.050	
		US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,249,597.640	
		US T N/B 2.25 05/15/41	3,520,000.000	2,887,499.990	
		US T N/B 2.25 08/15/27	3,810,000.000	3,643,312.500	
		US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,635,300.000	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,442,924.990	
		US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,304,101.560	
		US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	3,017,918.740	
		US T N/B 2.25 11/15/25	2,920,000.000	2,833,084.350	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	3,120,039.820	
		US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	276,543.750	
		US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,935,546.860	
		US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	3,007,017.180	
		US T N/B 2.375 03/31/29	3,000,000.000	2,855,273.430	
		US T N/B 2.375 04/30/26	2,060,000.000	2,001,418.750	
		US T N/B 2.375 05/15/27	1,840,000.000	1,774,018.730	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,305,988.250	
		US T N/B 2.375 05/15/51	5,560,000.000	4,596,121.840	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,537,248.430	
		US T N/B 2.375 11/15/49	2,760,000.000	2,283,468.740	
		US T N/B 2.5 01/31/24	4,550,000.000	4,505,744.100	
		US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,922,353.120	
		US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,472,003.890	
		US T N/B 2.5 02/28/26	580,000.000	566,451.550	
		US T N/B 2.5 03/31/27	2,650,000.000	2,574,123.020	
		US T N/B 2.5 04/30/24	4,010,000.000	3,964,417.560	
		US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	5,040,632.770	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,130,000.000	1,770,063.260	

		US T N/B 2.5 05/31/24	4,180,000.000	4,130,525.770	
		US T N/B 2.5 08/15/23	4,080,000.000	4,054,181.220	
		US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,413,106.250	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,830,000.000	4,676,798.430	
		US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,764,967.950	
		US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,956,523.430	
		US T N/B 2.625 05/31/27	1,000,000.000	976,992.180	
		US T N/B 2.625 06/30/23	2,350,000.000	2,341,554.680	
		US T N/B 2.625 12/31/23	3,530,000.000	3,505,731.250	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,247,778.120	
		US T N/B 2.75 02/15/24	2,090,000.000	2,077,672.250	
		US T N/B 2.75 02/15/28	4,580,000.000	4,478,202.290	
		US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,941,318.740	
		US T N/B 2.75 04/30/27	3,000,000.000	2,947,148.430	
		US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,954,843.720	
		US T N/B 2.75 05/31/29	2,500,000.000	2,436,132.800	
		US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	1,027,690.610	
		US T N/B 2.75 07/31/23	3,270,000.000	3,259,014.820	
		US T N/B 2.75 08/15/42	240,000.000	211,518.740	
		US T N/B 2.75 08/15/47	2,240,000.000	1,962,449.990	
		US T N/B 2.75 08/31/23	2,170,000.000	2,161,269.130	
		US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,806,124.200	
		US T N/B 2.75 11/15/23	6,360,000.000	6,331,181.250	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,368,793.750	
		US T N/B 2.75 11/15/47	2,360,000.000	2,070,715.590	
		US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,983,828.120	
		US T N/B 2.875 04/30/29	2,500,000.000	2,455,859.370	
		US T N/B 2.875 05/15/28	3,090,000.000	3,037,735.520	
		US T N/B 2.875 05/15/32	2,070,000.000	2,030,864.060	
		US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	2,050,355.060	
		US T N/B 2.875 05/15/49	2,890,000.000	2,641,640.620	
		US T N/B 2.875 05/31/25	570,000.000	565,301.940	
		US T N/B 2.875 06/15/25	2,000,000.000	1,984,218.740	
		US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,180,234.360	
		US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,450,725.000	
		US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,578,342.180	
		US T N/B 2.875 09/30/23	1,220,000.000	1,217,045.300	
		US T N/B 2.875 10/31/23	3,990,000.000	3,976,284.370	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	965,671.850	
		US T N/B 2.875 11/30/25	2,360,000.000	2,334,556.250	
		US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,793,553.090	
		US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,446,281.250	
		US T N/B 3.0 02/15/49	1,990,000.000	1,857,540.620	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	995,793.740	
		US T N/B 3.0 05/15/45	720,000.000	655,706.240	
		US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,484,578.120	
		US T N/B 3.0 08/15/48	3,520,000.000	3,258,474.960	
		US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,739,062.500	
		US T N/B 3.0 10/31/25	2,270,000.000	2,255,457.810	

		US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,418,868.740	
		US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	784,817.170	
		US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	810,953.120	
		US T N/B 3.125 02/15/43	390,000.000	363,979.680	
		US T N/B 3.125 05/15/48	2,330,000.000	2,210,041.390	
		US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,943,536.700	
		US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,365,114.820	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	965,732.800	
		US T N/B 3.25 05/15/42	2,070,000.000	1,985,906.250	
		US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,386,317.950	
		US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	3,188,000.000	
		US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	517,578.120	
		US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,643,243.750	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,481,484.370	
		US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	851,518.740	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,397,559.360	
		US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,375,462.500	
		US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	1,073,500.000	
		US T N/B 4.25 11/15/40	700,000.000	782,304.680	
		US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	692,250.000	
		US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	1,038,253.120	
		US T N/B 4.375 05/15/41	1,150,000.000	1,303,812.500	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,143,125.000	
		US T N/B 4.5 02/15/36	900,000.000	1,049,343.750	
		US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	701,343.740	
		US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,140,704.680	
		US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	1,049,157.010	
		US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	989,645.310	
		US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	680,135.150	
		US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	951,535.150	
		US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	1,005,864.040	
		US T N/B 6.0 02/15/26	1,100,000.000	1,204,585.930	
		US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	1,028,671.870	
		US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	923,667.410	
		US T N/B 6.25 08/15/23	1,000,000.000	1,034,843.750	
アメリカ・ドル　小計			696,500,000.000 (95,051,355,000)	641,602,450.700 (87,559,486,445)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.125 01/30/26	950,000.000	894,710.000	
		UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,745,910.000	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	720,000.000	651,996.000	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	800,000.000	764,584.000	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,380,000.000	1,159,489.800	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,390,000.000	1,300,331.100	

		UK TREASURY 0.375 10/22/30	790,000.000	688,129.500	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	615,367.660	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,130,000.000	570,334.490	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	860,000.000	830,911.010	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,050,000.000	825,031.200	
		UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	272,811.600	
		UK TREASURY 0.75 07/22/23	960,000.000	947,835.260	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	870,000.000	601,344.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	700,000.000	598,864.000	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	830,000.000	765,412.210	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	900,000.000	801,098.750	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,250,000.000	1,230,375.000	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	610,000.000	487,231.400	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	520,000.000	324,978.160	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,000,000.000	968,866.000	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	730,000.000	527,140.300	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	980,000.000	773,122.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	800,000.000	788,608.000	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,180,000.000	931,877.140	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	268,096.500	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	914,692.560	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	685,925.400	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	630,000.000	482,802.130	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	524,960.100	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,310,000.000	1,061,650.200	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	1,241,061.500	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	890,000.000	892,670.000	
		UK TREASURY 2.25 09/07/23	1,380,000.000	1,382,704.800	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,100,000.000	1,102,783.000	

		UK TREASURY 2.75 09/07/24	480,000.000	488,272.510	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,250,000.000	1,366,825.000	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,350,000.000	1,534,788.000	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	840,000.000	1,069,010.880	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	870,000.000	1,071,883.500	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	1,217,844.000	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,100,000.000	1,314,144.700	
		UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,170,000.000	1,380,319.200	
		UK TREASURY 4.25 09/07/39	800,000.000	975,720.000	
		UK TREASURY 4.25 12/07/27	680,000.000	758,568.820	
		UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	1,315,714.800	
		UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	1,382,612.540	
		UK TREASURY 4.25 12/07/49	727,000.000	947,552.170	
		UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,654,719.360	
		UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	1,093,435.920	
		UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,195,000.000	1,535,312.100	
		UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,322,666.470	
		UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,080,000.000	1,387,735.200	
		UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,095,000.000	1,181,892.630	
		UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	844,158.800	
	イギリス・ポンド　小計		52,384,000.000 (8,585,213,760)	52,466,881.370 (8,598,797,188)	
	イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	110,000.000	105,576.460	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	260,000.000	243,254.440	
		ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,802,447.640	
		ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,544,393.280	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	850,000.000	695,736.900	
		ISRAEL FIXED BOND 1.5 11/30/23	160,000.000	159,392.640	
		ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,263,055.100	

	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,110,000.000	2,073,298.660	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,437,577.320	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	2,930,000.000	3,014,993.440	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,540,000.000	1,645,671.720	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,190,000.000	1,599,418.310	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	254,378.740	
イスラエル・シュケル　小計		17,880,000.000 (703,105,968)	17,839,194.650 (701,501,355)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,540,000.000	1,451,580.800	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,450,000.000	1,320,807.180	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,310,000.000	1,175,748.390	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,700,000.000	1,366,642.520	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,373,336.220	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,360,000.000	1,108,926.460	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,369,180.350	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	920,000.000	587,512.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,590,000.000	1,349,686.130	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	754,360.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,698,948.930	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,160,000.000	1,163,705.040	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	780,675.130	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	592,886.290	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,230,000.000	1,200,541.500	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	270,000.000	261,686.520	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,550,000.000	1,480,870.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	920,000.000	809,710.300	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	910,000.000	864,803.000	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	980,000.000	987,564.020	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,200,000.000	1,194,689.720	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	620,000.000	585,001.590	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	930,000.000	939,715.050	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	870,000.000	905,666.250	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,030,000.000	1,121,685.540	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,490,000.000	1,594,822.240	
オーストラリア・ドル　小計		30,470,000.000 (2,844,374,500)	28,040,751.170 (2,617,604,122)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,434,220.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	23,500,000.000	23,386,284.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	11,997,362.640	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,328,334.070	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	11,500,000.000	11,415,474.880	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	17,000,000.000	17,084,607.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,493,066.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,668,572.140	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	19,797,500.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	10,981,685.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,103,873.680	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,690,556.440	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,010,390.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,604,830.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	18,550,000.000	19,129,594.750	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,237,270.490	
オフショア・人民元　小計			196,840,000.000 (4,013,921,912)	197,363,623.490 (4,024,599,537)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	1,010,000.000	908,225.330	
		CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,425,223.500	
		CANADA 0.25 08/01/23	700,000.000	678,094.900	
		CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,755,863.000	
		CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	598,217.540	
		CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,432,508.400	
		CANADA 0.75 02/01/24	1,200,000.000	1,154,490.000	
		CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	767,196.360	
		CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	496,008.700	
		CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,162,279.870	
		CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	664,858.600	
		CANADA 1.25 03/01/27	970,000.000	888,829.430	
		CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,590,187.850	
		CANADA 1.5 04/01/25	500,000.000	477,250.500	
		CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	910,985.020	
		CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	657,029.100	
		CANADA 1.5 06/01/31	1,870,000.000	1,611,263.060	
		CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	424,283.200	
		CANADA 1.5 12/01/31	2,440,000.000	2,087,402.920	
		CANADA 1.75 12/01/53	1,510,000.000	1,082,047.880	
		CANADA 2.0 06/01/28	100,000.000	93,560.800	

	CANADA 2.0 06/01/32	880,000.000	784,053.600	
	CANADA 2.0 09/01/23	880,000.000	867,437.120	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,850,000.000	2,204,127.300	
	CANADA 2.25 03/01/24	900,000.000	885,675.600	
	CANADA 2.25 06/01/25	800,000.000	778,527.200	
	CANADA 2.25 06/01/29	430,000.000	404,177.210	
	CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	956,852.620	
	CANADA 2.75 09/01/27	570,000.000	557,120.850	
	CANADA 2.75 12/01/48	680,000.000	624,270.600	
	CANADA 2.75 12/01/64	310,000.000	277,214.090	
	CANADA 3.5 12/01/45	740,000.000	770,130.580	
	CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	627,211.470	
	CANADA 5.0 06/01/37	290,000.000	347,113.760	
	CANADA 5.75 06/01/29	1,090,000.000	1,258,566.320	
	CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	742,615.830	
カナダ・ドル　小計		35,960,000.000 (3,788,386,000)	32,950,900.110 (3,471,377,327)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	250,000.000	233,200.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	410,000.000	386,302.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	317,054.860	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	384,160.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	190,000.000	149,945.150	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	277,219.810	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	362,785.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	542,437.150	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	440,000.000	437,032.530	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	10,000.000	9,183.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	418,530.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	471,500.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	460,000.000	438,828.500	
	SINGAPORE 2.75 07/01/23	700,000.000	700,158.620	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	554,290.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	490,000.000	492,597.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	660,000.000	665,583.600	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	150,000.000	156,975.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	827,888.000	
シンガポール・ドル　小計		8,110,000.000 (790,643,900)	7,825,670.220 (762,924,590)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,040,000.000	2,705,628.980	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,772,934.550	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	2,110,000.000	2,003,105.290	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	5,510,000.000	5,390,116.990	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,780,000.000	5,786,215.230	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,200,000.000	3,437,264.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	8,540,000.000	8,745,771.300	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,900,000.000	5,053,062.300	
スウェーデン・クローナ　小計		34,970,000.000	35,894,098.640	

		(451,812,400)	(463,751,754)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,910,000.000	2,852,731.200	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,586,565.910	
	DENMARK 0.25 11/15/52	3,320,000.000	2,035,193.200	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	6,093,094.230	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	5,350,202.500	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,674,260.780	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,010,000.000	9,654,496.550	
デンマーク・クローネ　小計		35,060,000.000 (652,817,200)	35,246,544.370 (656,290,656)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,312,413.850	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,857,975.820	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,400,000.000	4,219,921.200	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,298,620.160	
	NORWAY 1.75 03/13/25	3,900,000.000	3,806,977.200	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,420,000.000	3,183,840.100	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,989,787.500	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,700,000.000	1,591,880.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,770,000.000	2,789,816.020	
ノルウェー・クローネ　小計		27,620,000.000 (373,146,200)	26,051,231.850 (351,952,142)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,426,262.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	2,570,000.000	2,164,839.500	
	POLAND 07/25/24	810,000.000	700,190.320	
	POLAND 1.25 10/25/30	2,980,000.000	1,996,004.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	2,040,000.000	1,334,568.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,620,000.000	2,349,157.500	
	POLAND 2.5 04/25/24	780,000.000	718,161.600	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,349,459.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	1,924,462.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,390,000.000	2,756,917.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	710,000.000	553,338.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,780,000.000	2,492,339.500	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,740,000.000	2,632,592.000	
	POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,378,224.000	
ポーランド・ズロチ　小計		29,890,000.000 (868,391,181)	24,776,515.420 (719,829,625)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	885,357.060	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	1,004,382.000	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,335,403.490	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,966,845.200	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,300,000.000	1,153,284.760	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,200,000.000	1,121,701.920	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,579,944.560	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	303,004.350	

	MALAYSIA 3.885 08/15/29	400,000.000	394,014.540	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	598,565.280	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,422,970.850	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	740,000.000	741,754.240	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,700,000.000	2,729,380.590	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	913,999.320	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,730,000.000	1,760,543.840	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	480,000.000	479,245.960	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,750,000.000	1,788,940.820	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,223,625.000	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	507,874.450	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	294,670.430	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,741,960.420	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	120,000.000	123,349.280	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	2,590,000.000	2,588,112.780	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,629,428.800	
マレーシア・リンギット　小計		28,600,000.000 (881,743,720)	28,288,359.940 (872,135,795)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,085,000.000	5,488,910.190	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	17,802,000.000	18,010,634.090	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	34,652,000.000	30,884,149.080	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	21,546,000.000	20,172,508.200	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	24,518,000.000	22,647,276.600	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	15,977,000.000	13,942,169.280	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,435,000.000	4,014,029.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	19,800,000.000	19,244,610.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	15,491,000.000	13,826,316.980	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	15,151,000.000	14,844,973.270	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	19,613,737.740	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	14,813,584.490	
メキシコ・ペソ　小計		210,258,000.000 (1,402,441,886)	197,502,899.720 (1,317,364,091)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	752,332.450	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	610,000.000	524,377.620	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	460,000.000	449,956.820	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	110,000.000	100,206.260	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	410,000.000	270,682.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	580,000.000	442,308.000	

		AUSTRIA 0.5 02/20/29	920,000.000	863,712.560	
		AUSTRIA 0.5 04/20/27	890,000.000	862,208.860	
		AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	111,940.310	
		AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	807,233.740	
		AUSTRIA 0.75 03/20/51	280,000.000	191,099.160	
		AUSTRIA 0.75 10/20/26	970,000.000	957,631.530	
		AUSTRIA 0.85 06/30/20	300,000.000	137,109.710	
		AUSTRIA 07/15/23	750,000.000	746,025.000	
		AUSTRIA 07/15/24	860,000.000	851,538.460	
		AUSTRIA 1.2 10/20/25	820,000.000	828,845.340	
		AUSTRIA 1.5 02/20/47	540,000.000	466,214.940	
		AUSTRIA 1.5 11/02/86	180,000.000	125,262.000	
		AUSTRIA 1.65 10/21/24	420,000.000	430,220.520	
		AUSTRIA 1.75 10/20/23	900,000.000	916,129.800	
		AUSTRIA 1.85 05/23/49	270,000.000	247,121.820	
		AUSTRIA 2.1 09/20/17	400,000.000	341,642.400	
		AUSTRIA 2.4 05/23/34	620,000.000	647,782.200	
		AUSTRIA 3.15 06/20/44	490,000.000	570,668.210	
		AUSTRIA 3.8 01/26/62	280,000.000	381,733.240	
		AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,040,000.000	1,298,960.000	
		AUSTRIA 4.85 03/15/26	710,000.000	811,340.280	
		AUSTRIA 6.25 07/15/27	455,000.000	568,295.000	
		BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	542,648.000	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	793,863.840	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	710,160.000	
		BELGIUM 0.2 10/22/23	810,000.000	807,934.500	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	480,000.000	335,365.920	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	850,000.000	847,757.700	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	670,000.000	312,342.610	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	1,340,000.000	1,337,031.610	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,210,000.000	1,184,239.100	
		BELGIUM 0.8 06/22/28	890,000.000	863,834.000	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	1,180,000.000	1,132,431.840	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	1,027,679.410	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	970,000.000	908,253.680	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	756,584.550	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	320,000.000	234,760.960	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	530,000.000	468,648.260	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	800,000.000	651,840.800	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	800,000.000	652,906.400	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	170,000.000	159,024.120	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	398,070.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	356,564.910	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	1,020,000.000	1,059,554.580	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,380,000.000	1,503,994.380	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	640,000.000	767,443.200	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	751,295.790	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,100,000.000	1,375,665.500	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	900,000.000	1,014,705.900	

		BELGIUM 5.0 03/28/35	1,320,000.000	1,730,955.600	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,050,000.000	1,295,386.050	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	1,800,000.000	1,749,330.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,230,000.000	1,209,203.160	
		BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,360,000.000	1,303,634.800	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,360,000.000	1,311,856.000	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,712,112.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	650,000.000	636,759.500	
		BUNDESOBL 04/05/24	1,260,000.000	1,251,668.880	
		BUNDESOBL 10/13/23	1,540,000.000	1,536,550.400	
		BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,569,733.860	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,490,340.000	
		BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	60,000.000	59,795.400	
		BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	800,000.000	795,064.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,820,000.000	1,673,799.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,240,000.000	1,120,017.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,620,000.000	2,317,683.440	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,560,000.000	1,290,822.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,580,000.000	1,283,481.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,130,000.000	1,942,347.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	538,681.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,390,000.000	1,243,813.700	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	500,000.000	448,231.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,120,000.000	1,366,524.440	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	640,000.000	413,222.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	930,000.000	576,851.100	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,320,000.000	1,254,831.600	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,933,258.500	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	2,063,629.200	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,976,848.640	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,730,000.000	1,652,340.300	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,894,566.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,010,000.000	1,993,598.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,640,000.000	1,597,474.800	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,910,000.000	1,870,522.210	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,918,536.840	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	1,490,000.000	1,381,840.900	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,540,000.000	1,555,059.660	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	960,000.000	968,966.400	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	1,940,000.000	1,801,156.140	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,549,448.480	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,430,000.000	1,461,877.560	
		DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	2,620,000.000	2,669,675.200	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,810,000.000	2,123,274.800	

		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	1,990,000.000	2,363,200.620	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,715,128.100	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,418,718.320	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,430,000.000	2,002,042.900	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	160,000.000	195,027.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,630,000.000	2,236,425.200	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	2,105,835.000	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	2,050,738.400	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,637,486.900	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	910,000.000	991,472.300	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	1,068,124.200	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,079,950.500	
		FINLAND 0.0 09/15/24	220,000.000	216,983.860	
		FINLAND 0.0 09/15/26	210,000.000	200,602.500	
		FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	183,600.900	
		FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	222,998.980	
		FINLAND 0.125 04/15/52	250,000.000	138,284.750	
		FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	259,135.200	
		FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	205,148.030	
		FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	450,702.480	
		FINLAND 0.5 04/15/43	280,000.000	197,335.880	
		FINLAND 0.5 09/15/27	420,000.000	404,783.400	
		FINLAND 0.5 09/15/28	660,000.000	625,290.600	
		FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	279,615.300	
		FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	185,088.400	
		FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	329,551.860	
		FINLAND 09/15/23	100,000.000	99,438.100	
		FINLAND 1.125 04/15/34	590,000.000	538,196.230	
		FINLAND 1.375 04/15/47	240,000.000	202,788.960	
		FINLAND 2.0 04/15/24	430,000.000	441,538.190	
		FINLAND 2.625 07/04/42	340,000.000	358,756.100	
		FINLAND 2.75 07/04/28	490,000.000	529,957.540	
		FINLAND 4.0 07/04/25	480,000.000	525,302.880	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,620,000.000	1,607,811.120	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,000,000.000	977,429.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,610,000.000	2,514,267.810	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,316,269.200	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	1,400,000.000	1,165,920.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,577,241.310	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,480,000.000	3,022,004.160	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,767,966.710	

		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,516,454.980	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	2,990,000.000	2,956,682.430	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,260,000.000	3,186,672.820	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,359,109.150	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,550,000.000	1,130,812.100	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	660,000.000	291,958.920	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	900,000.000	608,048.100	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,110,000.000	2,998,382.100	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,360,000.000	1,497,363.360	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,300,000.000	804,390.600	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,600,000.000	3,448,857.600	
		FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,995,658.800	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,243,663.240	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,360,000.000	2,332,614.560	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,742,981.120	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,760,000.000	2,519,987.640	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,450,000.000	2,185,645.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,480,000.000	3,423,944.160	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,130,000.000	1,714,057.860	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	786,993.570	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,070,000.000	1,921,788.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	1,920,000.000	1,966,080.000	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,776,411.000	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,577,590.000	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,930,000.000	4,202,199.660	
		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,490,000.000	3,748,867.260	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,030,000.000	2,323,468.980	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,080,000.000	3,363,514.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	900,000.000	1,180,080.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,561,028.040	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,393,414.860	
		FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,375,000.000	3,543,361.870	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,464,464.080	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,565,798.840	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,660,000.000	3,350,650.380	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,417,741.500	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,525,155.220	
		IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	651,865.830	
		IRISH 0.2 05/15/27	500,000.000	475,522.790	
		IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	487,257.650	
		IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	314,589.210	
		IRISH 0.55 04/22/41	240,000.000	174,570.960	
		IRISH 0.9 05/15/28	700,000.000	680,002.400	
		IRISH 1.0 05/15/26	750,000.000	748,924.500	
		IRISH 1.1 05/15/29	600,000.000	584,698.800	
		IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	364,589.160	
		IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	350,517.960	
		IRISH 1.5 05/15/50	440,000.000	353,176.120	
		IRISH 1.7 05/15/37	560,000.000	525,604.240	

		IRISH 2.0 02/18/45	630,000.000	586,193.580	
		IRISH 2.4 05/15/30	590,000.000	626,664.960	
		IRISH 3.4 03/18/24	390,000.000	408,793.540	
		IRISH 5.4 03/13/25	780,000.000	873,979.080	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	984,760.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	990,000.000	919,512.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,369,746.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,149,125.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	890,000.000	866,415.000	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,310,564.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,282,902.000	
		ITALY BTPS 0.3 08/15/23	1,300,000.000	1,294,787.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,600,000.000	1,552,713.600	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	1,034,100.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,531,335.400	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	972,840.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	1,810,000.000	1,448,600.920	
		ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,380,000.000	1,377,372.480	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,232,906.500	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,400,000.000	1,165,059.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	770,904.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,113,246.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,152,765.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,180,000.000	1,099,052.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	1,065,750.400	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	1,039,830.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,472,906.520	
		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,562,310.750	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	879,872.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,370,000.000	1,360,012.700	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,039,442.560	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	555,903.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,370,000.000	1,362,352.660	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,330,020.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,490,000.000	1,303,721.690	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,561,185.420	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	673,391.760	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,210,485.600	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,240,000.000	943,020.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	999,682.200	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,040,000.000	1,042,392.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,350,000.000	1,317,870.000	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,200,000.000	1,205,539.200	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,740,000.000	1,714,211.460	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	890,000.000	891,350.130	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	233,280.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	440,000.000	315,920.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,290,000.000	1,283,163.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	743,986.000	

		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,221,720.710	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	903,670.000	
		ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	948,242.880	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,377,210.600	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,675,328.710	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	170,000.000	157,459.100	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,330,000.000	1,136,751.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	543,760.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,140,000.000	2,162,012.040	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,100,000.000	1,027,730.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,632,810.480	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	810,000.000	761,124.600	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	577,500.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	1,117,519.000	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	1,011,659.460	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	1,153,294.450	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,670,000.000	1,748,209.440	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,701,813.240	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	873,680.150	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,830,000.000	1,943,460.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,805,997.690	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	2,083,237.000	
		ITALY BTPS 4.75 08/01/23	2,290,000.000	2,386,271.600	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,880,444.160	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,301,941.200	
		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	60,000.000	65,344.680	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,930,248.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	390,000.000	462,813.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,550,000.000	1,846,670.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,440,000.000	2,843,332.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	1,870,272.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	1,780,000.000	2,186,374.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,210,000.000	1,463,253.000	
		ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	425,215.000	
		ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,401,521.200	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	630,000.000	609,401.810	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,123,796.600	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	370,000.000	338,721.310	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	410,270.850	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	950,000.000	546,067.600	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	622,590.500	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	700,000.000	609,723.100	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	1,320,000.000	1,298,068.400	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	910,000.000	841,057.490	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	650,000.000	513,115.850	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,360,000.000	1,335,384.000	

		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,138,033.760	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,510,000.000	1,465,326.650	
		NETHERLANDS 01/15/24	1,440,000.000	1,431,239.040	
		NETHERLANDS 1.75 07/15/23	560,000.000	567,222.880	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,380,000.000	1,419,669.480	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,196,786.460	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,520,000.000	1,777,787.440	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,290,000.000	1,671,465.900	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,290,000.000	1,637,913.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	410,000.000	504,259.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,362,970.000	
		SPAIN 0.0 01/31/26	1,570,000.000	1,495,412.440	
		SPAIN 0.0 01/31/27	230,000.000	213,923.000	
		SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	1,051,714.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,242,056.340	
		SPAIN 0.0 05/31/25	440,000.000	425,409.950	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,840,000.000	1,524,440.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,067,554.080	
		SPAIN 0.35 07/30/23	1,350,000.000	1,345,356.000	
		SPAIN 0.5 04/30/30	1,500,000.000	1,335,237.000	
		SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,391,700.720	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,030,000.000	935,125.670	
		SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,321,220.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,550,000.000	1,484,822.500	
		SPAIN 0.8 07/30/29	700,000.000	645,960.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	730,000.000	554,193.370	
		SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	385,398.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,240,000.000	756,016.840	
		SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	955,922.940	
		SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,632,400.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,718,528.370	
		SPAIN 1.4 04/30/28	1,640,000.000	1,608,643.200	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,570,000.000	1,532,084.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	1,500,000.000	1,457,512.500	
		SPAIN 1.45 10/31/27	1,560,000.000	1,542,117.720	
		SPAIN 1.45 10/31/71	360,000.000	199,684.800	
		SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,201,049.500	
		SPAIN 1.6 04/30/25	1,240,000.000	1,258,136.240	
		SPAIN 1.85 07/30/35	1,440,000.000	1,314,051.840	
		SPAIN 1.9 10/31/52	530,000.000	396,761.180	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,357,541.640	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,752,349.560	
		SPAIN 2.15 10/31/25	1,710,000.000	1,763,427.570	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,447,215.000	

		SPAIN 2.7 10/31/48	1,070,000.000	1,005,272.490	
		SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,607,420.120	
		SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,160,439.140	
		SPAIN 3.45 07/30/66	880,000.000	907,617.920	
		SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,549,760.280	
		SPAIN 4.2 01/31/37	1,300,000.000	1,536,195.700	
		SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,163,496.450	
		SPAIN 4.65 07/30/25	1,635,000.000	1,807,567.710	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,480,000.000	1,884,953.160	
		SPAIN 4.8 01/31/24	1,300,000.000	1,381,940.300	
		SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,669,260.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	890,000.000	1,063,194.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	900,000.000	1,228,135.500	
		SPAIN 5.75 07/30/32	1,615,000.000	2,107,891.540	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,919,369.010	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,680,000.000	2,114,196.000	
	ユーロ　小計		430,042,000.000 (59,599,520,780)	426,637,695.270 (59,127,718,187)	
国債証券　合計			180,006,874,406.800 (180,006,874,407)	171,245,332,814 (171,245,332,814)	
合計				171,245,332,814 (171,245,332,814)	

（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　254銘柄	50.96	51.13
イギリス・ポンド	国債証券　55銘柄	5.00	5.02
イスラエル・シュケル	国債証券　13銘柄	0.41	0.41
オーストラリア・ドル	国債証券　26銘柄	1.52	1.53
オフショア・人民元	国債証券　16銘柄	2.34	2.35
カナダ・ドル	国債証券　36銘柄	2.02	2.03
シンガポール・ドル	国債証券　19銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券　8銘柄	0.27	0.27
デンマーク・クローネ	国債証券　7銘柄	0.38	0.38
ノルウェー・クローネ	国債証券　9銘柄	0.20	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券　14銘柄	0.42	0.42
マレーシア・リンギット	国債証券　24銘柄	0.51	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券　12銘柄	0.77	0.77
ユーロ	国債証券　344銘柄	34.41	34.53

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△81,620,617,808
投資信託受益証券	△100,001,306
投資証券	△1,382,907,251
合計	△83,103,526,365

（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（2022年2月16日から2022年7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）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
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。

（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)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

2022年7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	1,021,148	115.540	117,983,439.920	
	ABBOTT LABORATORIES	196,598	109.260	21,480,297.480	
	AES CORP	69,518	21.500	1,494,637.000	
	ABIOMED INC	5,283	267.000	1,410,561.000	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	100,198	140.470	14,074,813.060	
	ADVANCED MICRO DEVICES	182,710	79.350	14,498,038.500	
	ADOBE INC	52,717	389.440	20,530,108.480	
	CHUBB LTD	46,916	193.070	9,058,072.120	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,780	232.210	5,754,163.800	
	ALLEGHANY CORP	1,594	834.570	1,330,304.580	
	ALLSTATE CORP	31,078	130.870	4,067,177.860	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	76,308	173.340	13,227,228.720	
AMGEN INC	62,062	248.480	15,421,165.760	
HESS CORP	31,366	100.180	3,142,245.880	
AMERICAN EXPRESS CO	72,215	141.760	10,237,198.400	
AMERICAN ELECTRIC POWER	56,195	94.340	5,301,436.300	
AFLAC INC	68,561	56.250	3,856,556.250	
AMERICAN INTL GROUP	91,731	51.470	4,721,394.570	
AMERCO	980	473.580	464,108.400	
ANALOG DEVICES	58,263	149.940	8,735,954.220	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	79,236	47.270	3,745,485.720	
VALERO ENERGY CORP	46,059	107.030	4,929,694.770	
ANSYS INC	9,857	249.650	2,460,800.050	
APPLE INC	1,818,926	147.040	267,454,879.040	
APPLIED MATERIALS INC	98,906	91.190	9,019,238.140	
ALBEMARLE CORP	13,133	205.930	2,704,478.690	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	63,215	73.340	4,636,188.100	
AMEREN CORP	28,729	87.750	2,520,969.750	
ARROW ELECTRONICS INC	6,673	111.910	746,775.430	
AUTODESK INC	24,822	179.830	4,463,740.260	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	46,793	217.270	10,166,715.110	
AUTOZONE INC	2,306	2,182.370	5,032,545.220	
AVERY DENNISON CORP	9,514	164.950	1,569,334.300	
BALL CORP	36,411	68.620	2,498,522.820	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	143,802	280.830	40,383,915.660	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	84,892	41.890	3,556,125.880	
BAXTER INTERNATIONAL INC	54,179	65.180	3,531,387.220	
BECTON DICKINSON & CO	31,670	245.660	7,780,052.200	
AMETEK INC	24,982	112.350	2,806,727.700	
VERIZON COMM INC	467,890	50.490	23,623,766.100	
WR BERKLEY CORP	24,066	67.310	1,619,882.460	
BEST BUY CO INC	24,645	71.170	1,753,984.650	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	517.120	1,271,598.080	
YUM! BRANDS INC	32,015	117.280	3,754,719.200	
FIRSTENERGY CORP	61,472	37.130	2,282,455.360	
BOEING CO	62,111	139.070	8,637,776.770	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	78.520	934,152.440	
BORGWARNER INC	27,800	34.450	957,710.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	159,248	37.840	6,025,944.320	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	100.260	1,453,168.440	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	17,656	124.930	2,205,764.080	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,582	1,221.280	3,153,344.960	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	243,109	75.380	18,325,556.420	
ONEOK INC	48,247	56.820	2,741,394.540	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	137.950	1,088,563.450	
UNITED RENTALS INC	8,287	248.860	2,062,302.820	
SEMPRA ENERGY	35,320	147.270	5,201,576.400	
FEDEX CORP	28,131	230.490	6,483,914.190	
VERISIGN INC	10,834	178.630	1,935,277.420	
AMPHENOL CORP	66,628	65.880	4,389,452.640	
BROWN-FORMAN CORP	35,058	70.160	2,459,669.280	
QUANTA SERVICES INC	15,516	131.950	2,047,336.200	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.310	642,137.150	
CSX CORP	243,796	28.990	7,067,646.040	
COTERRA ENERGY INC	91,495	26.310	2,407,233.450	
CAMPBELL SOUP CO	21,404	48.580	1,039,806.320	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,254	242.170	4,420,571.180	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	52.920	1,685,872.440	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	102,945	9.010	927,534.450	
CATERPILLAR INC	59,855	179.100	10,720,030.500	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	127.160	1,379,050.200	
CITRIX SYSTEMS INC	14,230	99.220	1,411,900.600	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	10.810	1,049,359.130	
JPMORGAN CHASE & CO	329,013	114.360	37,625,926.680	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,423	94.710	2,597,232.330	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,259	118.640	2,047,607.760	
CINTAS CORP	10,142	381.070	3,864,811.940	
CISCO SYSTEMS INC	463,636	43.390	20,117,166.040	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	15.470	871,951.080	
CLOROX COMPANY	14,322	141.360	2,024,557.920	
COCA-COLA CO/THE	458,965	63.140	28,979,050.100	
COPART INC	23,125	114.490	2,647,581.250	
COGNEX CORP	20,432	44.740	914,127.680	
COLGATE-PALMOLIVE CO	88,480	78.350	6,932,408.000	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31,293	137.800	4,312,175.400	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,695	285.210	1,909,480.950	
NRG ENERGY, INC.	23,951	37.830	906,066.330	
COMCAST CORP-CL A	503,094	39.960	20,103,636.240	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	35.310	1,971,816.330	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,375	91.970	3,529,348.750	
CMS ENERGY CORP	32,591	66.020	2,151,657.820	
COOPER COS INC	5,638	311.570	1,756,631.660	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	55.500	1,181,095.500	
CORNING INC	88,055	32.610	2,871,473.550	

SEALED AIR CORP	17,610	56.290	991,266.900	
HEICO CORP-CL A	7,767	107.630	835,962.210	
CUMMINS INC	15,824	200.530	3,173,186.720	
DR HORTON INC	36,330	73.360	2,665,168.800	
DANAHER CORP	75,918	263.760	20,024,131.680	
MOODY'S CORP	18,678	284.130	5,306,980.140	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	58,780	67.020	3,939,435.600	
TARGET CORP	53,706	147.990	7,947,950.940	
DEERE & CO	32,585	304.640	9,926,694.400	
MORGAN STANLEY	149,133	76.730	11,442,975.090	
REPUBLIC SERVICES INC	24,966	129.860	3,242,084.760	
COSTAR GROUP INC	42,672	61.800	2,637,129.600	
THE WALT DISNEY CO	202,848	95.860	19,445,009.280	
DOLLAR TREE INC	25,247	167.360	4,225,337.920	
DOVER CORP	16,217	121.780	1,974,906.260	
OMNICOM GROUP	23,275	64.460	1,500,306.500	
DTE ENERGY CO	21,579	124.850	2,694,138.150	
DUKE ENERGY CORP	84,877	105.910	8,989,323.070	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	116.780	1,627,796.420	
EBAY INC	66,344	43.140	2,862,080.160	
BANK OF AMERICA CORP	809,408	31.790	25,731,080.320	
CITIGROUP INC	221,607	46.820	10,375,639.740	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	90.190	1,272,671.090	
EATON CORP PLC	44,313	127.820	5,664,087.660	
CADENCE DESIGN SYS INC	31,336	160.420	5,026,921.120	
DISH NETWORK CORP	24,416	18.340	447,789.440	
ECOLAB INC	28,945	155.610	4,504,131.450	
PERKINELMER INC	13,622	146.010	1,988,948.220	
ELECTRONIC ARTS INC	31,306	125.630	3,932,972.780	
SALESFORCE INC	110,102	175.500	19,322,901.000	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	195.760	475,892.560	
EMERSON ELECTRIC CO	66,014	80.670	5,325,349.380	
ATMOS ENERGY CORP	15,146	112.050	1,697,109.300	
ENTERGY CORP	22,173	110.090	2,441,025.570	
EOG RESOURCES INC	65,536	105.520	6,915,358.720	
EQUIFAX INC	13,970	190.450	2,660,586.500	
EQT CORP	36,492	34.200	1,248,026.400	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	26,040	251.480	6,548,539.200	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,678	97.240	1,913,488.720	
EXXON MOBIL CORP	472,048	86.080	40,633,891.840	
FMC CORP	12,931	104.930	1,356,849.830	
NEXTERA ENERGY INC	219,204	80.250	17,591,121.000	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	401.630	1,647,084.630	
FAIR ISAAC CORP	2,962	418.850	1,240,633.700	
ASSURANT INC	5,823	175.090	1,019,549.070	
FASTENAL CO	61,876	50.640	3,133,400.640	
FIFTH THIRD BANCORP	77,462	33.860	2,622,863.320	

M&T BANK CORP	19,455	158.920	3,091,788.600	
FISERV INC	69,266	93.060	6,445,893.960	
FORD MOTOR CO	440,878	11.620	5,123,002.360	
FRANKLIN RESOURCES INC	29,162	23.870	696,096.940	
FREEPORT-MCMORAN INC	163,569	28.000	4,579,932.000	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	681.950	866,076.500	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23,283	166.760	3,882,673.080	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	35.210	901,340.790	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,286	221.110	5,812,097.460	
GENERAL MILLS INC	65,734	75.540	4,965,546.360	
GENUINE PARTS CO	16,139	137.140	2,213,302.460	
GILEAD SCIENCES INC	139,845	62.840	8,787,859.800	
GARTNER INC	9,036	242.630	2,192,404.680	
MCKESSON CORP	16,468	331.200	5,454,201.600	
NVIDIA CORP	278,944	158.380	44,179,150.720	
GENERAL ELECTRIC CO	123,171	63.250	7,790,565.750	
WW GRAINGER INC	4,926	475.130	2,340,490.380	
HALLIBURTON CO	95,448	29.840	2,848,168.320	
MONSTER BEVERAGE CORP	44,230	97.480	4,311,540.400	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	37,699	296.470	11,176,622.530	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,738	238.170	5,177,339.460	
HASBRO INC	15,437	83.790	1,293,466.230	
HENRY SCHEIN INC	15,048	76.880	1,156,890.240	
HEICO CORP	5,185	133.340	691,367.900	
HERSHEY FOODS CORP	16,042	219.790	3,525,871.180	
HP INC	118,420	32.110	3,802,466.200	
F5 INC	6,924	157.860	1,093,022.640	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,766	88.840	1,134,131.440	
JUNIPER NETWORKS INC	34,097	28.790	981,652.630	
HOLOGIC INC	28,090	71.380	2,005,064.200	
HOME DEPOT INC	116,374	286.470	33,337,659.780	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	89.020	1,781,468.240	
HORMEL FOODS CORP	34,578	47.550	1,644,183.900	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,052	29.370	2,086,797.240	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	214.490	772,592.980	
HUMANA INC	14,178	483.380	6,853,361.640	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	165.700	1,519,634.700	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	163,228	12.270	2,002,807.560	
BIOGEN INC	16,547	218.800	3,620,483.600	
IDEX CORP	7,766	185.690	1,442,068.540	
ILLINOIS TOOL WORKS	34,694	182.270	6,323,675.380	
INTUIT INC	30,138	406.810	12,260,439.780	
IDEXX LABORATORIES INC	9,143	378.450	3,460,168.350	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,475	131.080	3,470,343.000	

INTEL CORP	454,079	37.990	17,250,461.210	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27,577	116.580	3,214,926.660	
INTERNATIONAL PAPER CO	37,464	42.710	1,600,087.440	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	28.180	1,287,234.220	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,561	126.090	1,835,996.490	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	185.570	1,512,766.640	
INCYTE CORP	21,658	80.480	1,743,035.840	
JOHNSON & JOHNSON	292,763	178.280	52,193,787.640	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,131	65.670	2,307,052.770	
KLA CORPORATION	16,870	316.840	5,345,090.800	
DEVON ENERGY CORP	70,979	54.480	3,866,935.920	
KELLOGG CO	29,514	72.520	2,140,355.280	
KEYCORP	106,247	17.490	1,858,260.030	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,556	134.200	5,040,015.200	
BLACKROCK INC/NEW YORK	16,988	619.560	10,525,085.280	
KROGER CO	77,870	48.020	3,739,317.400	
LAM RESEARCH CORP	15,636	415.120	6,490,816.320	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,380	384.160	2,066,780.800	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	139.810	1,541,964.490	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,689	92.150	1,630,041.350	
PLUG POWER INC	56,149	19.770	1,110,065.730	
LENNAR CORP	29,937	78.390	2,346,761.430	
ELI LILLY & CO	90,317	330.470	29,847,058.990	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	27.620	777,668.720	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	47.360	849,496.320	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	81,676	185.400	15,142,730.400	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	33,941	122.510	4,158,111.910	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,367	420.350	11,503,718.450	
LOEWS CORP	23,530	57.930	1,363,092.900	
LOWE'S COS INC	74,692	181.630	13,566,307.960	
DOMINION ENERGY INC	90,172	79.380	7,157,853.360	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	29.340	1,185,365.340	
MCCORMICK & CO INC	27,278	82.070	2,238,705.460	
MCDONALD'S CORPORATION	82,673	253.240	20,936,110.520	
S&P GLOBAL INC	39,533	352.480	13,934,591.840	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	280.720	1,250,326.880	
MARKEL CORPORATION	1,512	1,296.510	1,960,323.120	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	69,970	98.390	6,884,348.300	
MARSH & MCLENNAN COS	55,963	155.590	8,707,283.170	

MASCO CORP	24,668	52.560	1,296,550.080	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,058	307.440	2,169,911.520	
METLIFE INC	76,607	62.630	4,797,896.410	
MEDTRONIC PLC	149,609	89.480	13,387,013.320	
ACTIVISION BLIZZARD INC	86,864	78.130	6,786,684.320	
CVS HEALTH CORP	146,541	94.180	13,801,231.380	
MERCK & CO.INC.	281,868	92.780	26,151,713.040	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	46,268	53.470	2,473,949.960	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	243.940	2,584,056.420	
MICROSOFT CORP	793,902	267.660	212,495,809.320	
MICRON TECH INC	123,700	59.140	7,315,618.000	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62,574	59.450	3,720,024.300	
3M CO	63,525	128.720	8,176,938.000	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	123.920	782,059.120	
ENTEGRIS INC	14,422	91.490	1,319,468.780	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	231.420	1,290,860.760	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,762	214.650	4,027,263.300	
ILLUMINA INC	17,754	197.040	3,498,248.160	
XCEL ENERGY INC	60,629	69.600	4,219,778.400	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	95.570	961,529.770	
NETAPP INC	24,953	65.040	1,622,943.120	
NEWELL BRANDS INC	41,984	19.320	811,130.880	
NEWMONT CORP	86,585	59.360	5,139,685.600	
NVR INC	365	4,370.800	1,595,342.000	
NIKE INC-CL B	142,364	107.930	15,365,346.520	
NORDSON CORP	5,664	207.430	1,174,883.520	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,070	226.200	5,897,034.000	
EVERSOURCE ENERGY	37,606	83.320	3,133,331.920	
NISOURCE INC	44,573	28.470	1,268,993.310	
NORTHERN TRUST CORP	22,556	96.610	2,179,135.160	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,617	480.430	7,983,305.310	
WELLS FARGO & CO	425,259	40.180	17,086,906.620	
NUCOR CORP	29,413	109.010	3,206,311.130	
CHENIERE ENERGY INC	25,946	127.860	3,317,455.560	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,937	108.610	5,097,827.570	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,365	60.670	6,271,154.550	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,008	273.020	3,005,404.160	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,296	657.880	4,799,892.480	
ORACLE CORP	178,958	71.870	12,861,711.460	
PACCAR INC	38,135	81.070	3,091,604.450	
PTC INC	11,726	106.900	1,253,509.400	

EXELON CORP	109,446	44.290	4,847,363.340	
PARKER HANNIFIN CORP	13,839	248.040	3,432,625.560	
PAYCHEX INC	36,225	116.800	4,231,080.000	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	261.520	2,248,025.920	
PPL CORPORATION	77,299	27.180	2,100,986.820	
PEPSICO INC	153,973	171.880	26,464,879.240	
PENTAIR PLC	17,214	46.500	800,451.000	
PFIZER INC	627,475	53.170	33,362,845.750	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,796	46.450	1,291,124.200	
CONOCOPHILLIPS	145,289	86.460	12,561,686.940	
PG&E CORP	161,265	10.270	1,656,191.550	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25,800	217.500	5,611,500.000	
ALTRIA GROUP INC	203,217	41.520	8,437,569.840	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,237	161.380	7,461,727.060	
BROWN & BROWN INC	27,138	60.080	1,630,451.040	
GARMIN LTD	17,835	102.980	1,836,648.300	
PPG INDUSTRIES INC	26,678	117.870	3,144,535.860	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,475	501.540	24,813,691.500	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,937	115.960	3,007,654.520	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	135.740	1,771,135.520	
PROCTER & GAMBLE CO	266,983	145.020	38,717,874.660	
PROGRESSIVE CORP	65,224	120.380	7,851,665.120	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,485	62.460	3,528,053.100	
PULTE GROUP INC	29,050	44.200	1,284,010.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	31,571	113.280	3,576,362.880	
QUALCOMM INC	125,771	136.010	17,106,113.710	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,036	90.680	1,907,544.480	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	46.580	878,778.280	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,830	621.570	7,353,173.100	
RESMED INC	15,880	217.670	3,456,599.600	
US BANCORP	157,194	46.530	7,314,236.820	
SEAGEN INC	15,022	177.450	2,665,653.900	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	39,388	44.470	1,751,584.360	
ROSS STORES INC	40,011	75.460	3,019,230.060	
ROLLINS INC	25,920	36.710	951,523.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,800	402.020	4,743,836.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,975	200.130	2,596,686.750	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	34.440	946,307.880	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	79.980	1,095,006.180	
ACCENTURE PLC-CL A	70,512	279.070	19,677,783.840	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	154,768	62.440	9,663,713.920	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,092	201.270	2,635,026.840	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	26,823	169.000	4,533,087.000	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	68,272	94.380	6,443,511.360	
BOOKING HOLDINGS INC	4,576	1,769.480	8,097,140.480	
SCHLUMBERGER LTD	159,299	34.320	5,467,141.680	
SCHWAB (CHARLES) CORP	162,011	64.360	10,427,027.960	
POOL CORP	4,660	378.210	1,762,458.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,769	105.340	2,398,486.460	
BUNGE LTD	16,302	87.700	1,429,685.400	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	54.640	791,023.280	
ELEVANCE HEALTH INC	25,855	484.290	12,521,317.950	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,525	142.550	2,498,188.750	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	66.920	1,971,998.560	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	27,710	238.290	6,603,015.900	
CENTENE CORP	65,525	88.010	5,766,855.250	
SVB FINANCIAL GROUP	6,419	418.630	2,687,185.970	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	56.970	846,346.320	
SNAP-ON INC	6,118	198.020	1,211,486.360	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,080	96.310	4,052,724.800	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	182.900	1,310,478.500	
EDISON INTERNATIONAL	41,269	62.470	2,578,074.430	
SOUTHERN CO	117,314	71.190	8,351,583.660	
TRUIST FINANCIAL CORP	148,016	47.700	7,060,363.200	
SOUTHWEST AIRLINES	14,171	36.700	520,075.700	
AT&T INC	796,493	20.800	16,567,054.400	
CHEVRON CORP	217,032	142.770	30,985,658.640	
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,672	110.280	2,059,148.160	
STATE STREET CORP	39,935	63.030	2,517,103.050	
STARBUCKS CORP	128,608	79.280	10,196,042.240	
STEEL DYNAMICS INC	20,170	66.160	1,334,447.200	
STRYKER CORP	37,873	200.880	7,607,928.240	
NETFLIX INC	49,736	186.975	9,299,388.600	
NORTONLIFELOCK INC	62,570	23.070	1,443,489.900	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	48.210	806,553.300	
SYNOPSYS INC	17,236	317.540	5,473,119.440	
SYSCO CORP	56,522	86.150	4,869,370.300	
INTUITIVE SURGICAL INC	40,189	208.810	8,391,865.090	
TELEFLEX INC	5,532	254.660	1,408,779.120	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	7.440	828,436.560	
TERADYNE INC	18,512	92.080	1,704,584.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	102,764	155.530	15,982,884.920	
TEXTRON INC	24,814	61.060	1,515,142.840	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43,686	553.710	24,189,375.060	
GLOBE LIFE INC	9,737	99.270	966,591.990	
DAVITA INC	6,813	83.120	566,296.560	
TRACTOR SUPPLY CO	12,713	203.960	2,592,943.480	
BIO-TECHNE CORP	4,403	369.930	1,628,801.790	
TRIMBLE INC	28,676	59.760	1,713,677.760	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,516	346.490	1,564,748.840	
TYSON FOODS INC	32,395	84.110	2,724,743.450	
UGI CORP	24,160	39.260	948,521.600	
MARATHON OIL CORP	77,325	21.720	1,679,499.000	
UNION PACIFIC CORP	70,839	209.700	14,854,938.300	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	166,773	95.120	15,863,447.760	
UNITEDHEALTH GROUP INC	104,932	518.630	54,420,883.160	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	103.440	837,450.240	
VF CORP	37,887	45.830	1,736,361.210	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	25.560	1,724,456.520	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,507	294.290	8,389,325.030	
VULCAN MATERIALS CO	15,328	146.410	2,244,172.480	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	79,192	37.550	2,973,659.600	
WALMART INC	170,141	125.400	21,335,681.400	
WASTE MANAGEMENT INC	46,309	152.760	7,074,162.840	
WATERS CORP	6,836	346.250	2,366,965.000	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	43.340	965,831.900	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,081	318.480	2,573,636.880	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	131.950	1,672,994.050	
VAIL RESORTS INC	4,389	216.120	948,550.680	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	45.240	1,602,446.040	
WABTEC CORP	20,273	83.020	1,683,064.460	
WHIRLPOOL CORP	6,832	160.810	1,098,653.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	97.870	1,843,185.710	
WYNN RESORTS LTD	12,757	56.460	720,260.220	
NASDAQ INC	12,917	156.560	2,022,285.520	
CME GROUP INC	40,109	208.900	8,378,770.100	
WILLIAMS COS INC	135,860	31.320	4,255,135.200	
LKQ CORP	31,863	51.220	1,632,022.860	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	57.340	1,666,644.440	
WEC ENERGY GROUP INC	35,483	99.510	3,530,913.330	
CARMAX INC	18,673	92.660	1,730,240.180	
TJX COMPANIES INC	133,163	58.940	7,848,627.220	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	299.520	1,784,540.160	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	5.010	572,888.490	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	21,528	51.880	1,116,872.640	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,928	152.490	1,971,390.720	
SIGNATURE BANK	6,557	193.460	1,268,517.220	
CBRE GROUP INC	37,573	75.850	2,849,912.050	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	21.150	333,725.850	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	19.020	2,037,022.980	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	401.350	1,651,555.250	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,852	395.480	1,918,868.960	
WESTLAKE CORP	4,187	97.020	406,222.740	
T-MOBILE US INC	69,907	135.720	9,487,778.040	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	34.380	1,318,473.000	
MOSAIC CO/THE	42,561	45.220	1,924,608.420	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	266.110	1,115,799.230	
CELANESE CORP	11,567	112.990	1,306,955.330	
DEXCOM INC	44,066	81.240	3,579,921.840	
EXPEDIA GROUP INC	15,713	94.870	1,490,692.310	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	86.000	2,066,322.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,462	236.530	2,947,636.860	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	22.170	798,873.780	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	62,831	95.870	6,023,607.970	
LIVE NATION	18,129	84.360	1,529,362.440	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,157	1,339.280	4,228,106.960	
TRANSDIGM GROUP INC	5,694	536.660	3,055,742.040	
MASTERCARD INC	97,315	323.060	31,438,583.900	
WESTERN UNION CO	46,712	16.550	773,083.600	
OWENS CORNING	10,366	79.500	824,097.000	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	101.630	1,535,426.040	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	39.280	531,144.160	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,312	149.300	1,838,181.600	
DELTA AIR LINES INC	15,786	29.720	469,159.920	
INSULET CORP	8,015	235.510	1,887,612.650	
DISCOVER FINANCIAL	32,568	100.210	3,263,639.280	
TE CONNECTIVITY LTD	36,520	115.040	4,201,260.800	
MASIMO CORP	5,688	136.500	776,412.000	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,211	293.390	3,875,975.290	
VMWARE INC	22,568	113.600	2,563,724.800	
MERCADOLIBRE INC	5,154	708.630	3,652,279.020	
ULTA BEAUTY INC	6,073	381.440	2,316,485.120	
INVESCO LTD	38,530	16.210	624,571.300	
MSCI INC	8,933	433.950	3,876,475.350	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	172,887	93.890	16,232,360.430	
VISA INC	184,882	203.570	37,636,428.740	
KEURIG DR PEPPER INC	85,519	36.200	3,095,787.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,811	150.860	2,988,687.460	
MARATHON PETROLEUM CORP	63,587	83.270	5,294,889.490	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	16,182	61.840	1,000,694.880	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,919	16.970	3,901,725.430	
XYLEM INC	20,869	78.760	1,643,642.440	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,975	87.480	2,622,213.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	215.680	1,016,499.840	
SPLUNK INC	18,478	99.710	1,842,441.380	
EPAM SYSTEMS INC	6,493	321.020	2,084,382.860	
HCA HEALTHCARE INC	27,031	172.600	4,665,550.600	
VERISK ANALYTICS INC	17,368	178.070	3,092,719.760	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	158.300	1,037,498.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	218.450	1,931,971.800	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	19,974	150.940	3,014,875.560	
NXP SEMICONDUCTOR NV	29,467	154.280	4,546,168.760	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	92.540	1,336,740.300	
TARGA RESOURCES CORP	22,659	59.720	1,353,195.480	
LEAR CORP	6,911	128.200	885,990.200	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11,131	118.510	1,319,134.810	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	59.970	1,579,309.950	
DOLLAR GENERAL CORP	25,915	252.880	6,553,385.200	
FORTINET INC	77,005	62.700	4,828,213.500	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	83.610	2,066,086.710	
TESLA INC	97,954	752.290	73,689,814.660	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	230.560	1,594,091.840	
ENPHASE ENERGY INC	14,394	216.450	3,115,581.300	
GENERAL MOTORS CO	154,598	32.310	4,995,061.380	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	34.740	1,362,850.200	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,608	181.840	1,565,278.720	
APTIV PLC	29,920	92.460	2,766,403.200	
PHILLIPS 66	53,977	82.010	4,426,653.770	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	75.450	690,971.100	
META PLATFORMS INC	257,467	170.880	43,995,960.960	
IQVIA HOLDINGS INC	21,481	219.340	4,711,642.540	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,801	116.330	2,187,120.330	

SERVICENOW INC	22,486	494.150	11,111,456.900	
PALO ALTO NETWORKS INC	11,073	524.220	5,804,688.060	
WORKDAY INC	22,324	148.010	3,304,175.240	
ABBVIE INC	197,294	152.850	30,156,387.900	
ZOETIS INC	52,861	177.980	9,408,200.780	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	15.750	635,433.750	
CDW CORP	15,145	161.530	2,446,371.850	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	32.740	1,388,601.620	
TWILIO INC	21,268	92.710	1,971,756.280	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	63.610	520,075.360	
SNAP INC	127,318	14.960	1,904,677.280	
TRADE DESK INC A	47,521	45.630	2,168,383.230	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,466	61.050	1,371,549.300	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	36.730	324,876.850	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	36.630	727,874.730	
OKTA INC	17,828	103.900	1,852,329.200	
BLACK KNIGHT INC	17,653	65.190	1,150,799.070	
BAKER HUGHES CO	108,170	28.470	3,079,599.900	
BROADCOM INC	45,661	498.690	22,770,684.090	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,939	56.920	565,727.880	
MONGODB INC	7,891	314.160	2,479,036.560	
BURLINGTON STORES INC	7,274	152.200	1,107,102.800	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	20.450	872,785.550	
VEEVA SYSTEMS INC	15,824	210.050	3,323,831.200	
TWITTER INC	90,830	36.810	3,343,452.300	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	41.570	699,041.120	
EVERGY INC	23,678	64.400	1,524,863.200	
ALLEGION PLC	9,404	98.540	926,670.160	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,074	52.200	734,662.800	
STERIS PLC	10,912	209.400	2,284,972.800	
DOCUSIGN INC	21,673	66.450	1,440,170.850	
WIX.COM LTD	5,855	70.500	412,777.500	
DROPBOX INC	30,479	22.740	693,092.460	
KKR & CO INC	63,201	47.550	3,005,207.550	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	51.420	259,671.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	23,682	119.800	2,837,103.600	
MODERNA INC	38,522	176.230	6,788,732.060	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	30,527	111.590	3,406,507.930	
ARAMARK	22,573	30.540	689,379.420	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	14.660	877,958.080	
CIGNA CORP	35,933	279.190	10,032,134.270	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	42.920	1,406,488.400	
DOW INC	80,015	51.380	4,111,170.700	
AMCOR PLC	172,505	12.440	2,145,962.200	

PINTEREST INC	62,041	20.240	1,255,709.840	
PELOTON INTERACTIVE INC	27,064	10.210	276,323.440	
FOX CORP-A	36,501	33.240	1,213,293.240	
FOX CORP-B	15,511	30.630	475,101.930	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	14.190	604,295.340	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	22,440	190.380	4,272,127.200	
CHEWY INC	9,648	44.130	425,766.240	
AVANTOR INC	65,960	31.410	2,071,803.600	
LYFT INC	36,887	13.400	494,285.800	
DYNATRACE INC	20,512	42.010	861,709.120	
CLOUDFLARE INC	29,770	52.080	1,550,421.600	
TRADEWEB MARKETS INC	10,585	70.610	747,406.850	
CARRIER GLOBAL CORP	96,568	36.070	3,483,207.760	
OTIS WORLDWIDE CORP	47,395	69.890	3,312,436.550	
UBER TECHNOLOGIES INC	165,469	22.340	3,696,577.460	
CORTEVA INC	78,536	52.730	4,141,203.280	
MATCH GROUP INC	31,784	75.240	2,391,428.160	
BILL.COM HOLDINGS INC	10,180	129.890	1,322,280.200	
BLACKSTONE INC	78,473	96.140	7,544,394.220	
CARLYLE GROUP INC	24,530	31.990	784,714.700	
DATADOG INC	24,280	108.290	2,629,281.200	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	74.870	1,670,199.960	
UPSTART HOLDINGS INC	4,442	27.090	120,333.780	
INGERSOLL RAND INC	46,398	42.450	1,969,595.100	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,733	323.290	1,853,421.570	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	18,691	31.990	597,925.090	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	44.550	412,844.850	
UNITY SOFTWARE INC	21,046	45.230	951,910.580	
AON PLC	23,670	274.370	6,494,337.900	
WARNER BROS DISCOVERY INC	250,207	13.990	3,500,395.930	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	36.000	812,376.000	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	60.290	789,437.260	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	23.340	432,443.520	
IAC/INTERACTIVECORP	9,152	78.800	721,177.600	
AIRBNB INC	37,760	97.350	3,675,936.000	
ZENDESK INC	12,612	74.610	940,981.320	
CONSTELLATION ENERGY CORP	37,045	59.650	2,209,734.250	
APPLOVIN CORP	13,206	37.390	493,772.340	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	42.960	1,611,085.920	
ROBLOX CORP	38,445	41.250	1,585,856.250	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	36.650	1,086,892.400	
VIATRIS INC	132,223	10.350	1,368,508.050	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	39.590	916,350.140	

SNOWFLAKE INC	24,605	159.680	3,928,926.400	
DOORDASH INC	20,697	74.960	1,551,447.120	
ARISTA NETWORKS INC	27,865	103.000	2,870,095.000	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	43,099	51.560	2,222,184.440	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	10.170	1,846,505.880	
FNF GROUP	31,004	37.120	1,150,868.480	
MARVELL TECHNOLOGY INC	95,103	46.990	4,468,889.970	
APA CORP	37,156	34.850	1,294,886.600	
LUCID GROUP INC	44,910	19.990	897,750.900	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.500	282,790.000	
CATALENT INC	18,217	111.810	2,036,842.770	
SYNCHRONY FINANCIAL	55,391	29.680	1,644,004.880	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	36.310	2,067,600.330	
CYBERARK SOFTWARE LTD	3,756	139.630	524,450.280	
WAYFAIR INC	7,350	55.310	406,528.500	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20,584	142.660	2,936,513.440	
HUBSPOT INC	4,932	305.800	1,508,205.600	
QORVO INC	11,596	99.410	1,152,758.360	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	116.640	1,788,674.400	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5,852	295.110	1,726,983.720	
GODADDY INC	19,722	73.000	1,439,706.000	
KORNIT DIGITAL LTD	5,217	26.140	136,372.380	
ETSY INC	13,841	88.750	1,228,388.750	
TRANSUNION	22,126	82.770	1,831,369.020	
ALCOA CORP	19,669	44.830	881,761.270	
BLOCK INC	59,110	67.020	3,961,552.200	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,674	55.440	3,197,446.560	
CARVANA CO	8,245	25.090	206,867.050	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	51.800	1,160,786.200	
TELADOC HEALTH INC	20,256	41.810	846,903.360	
WESTROCK CO	27,826	40.350	1,122,779.100	
KRAFT HEINZ CO	79,678	38.370	3,057,244.860	
NOVOCURE LTD	10,423	74.420	775,679.660	
FORTIVE CORP	38,946	56.010	2,181,365.460	
WASTE CONNECTIONS INC	28,997	125.510	3,639,413.470	
ALPHABET INC-CL A	33,515	2,387.070	80,002,651.050	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	144,397	13.190	1,904,596.430	
PAYPAL HOLDINGS INC	124,255	73.430	9,124,044.650	
SEA LTD ADR	40,917	77.520	3,171,885.840	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	25.970	1,166,676.280	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	35.140	573,519.940	

	ALPHABET INC-CL C	31,669	2,403.370	76,112,324.530	
	ZSCALER INC	9,242	166.890	1,542,397.380	
	CABLE ONE INC	570	1,337.770	762,528.900	
	LINDE PLC	57,136	273.680	15,636,980.480	
	ROKU INC	12,563	94.410	1,186,072.830	
	AVALARA INC	11,113	87.660	974,165.580	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,495	463.550	6,255,607.250	
	VISTRA CORP	50,407	22.080	1,112,986.560	
アメリカ・ドル　小計		36,641,984		3,777,653,048.380 (515,536,311,515)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	11.130	511,568.190	
	ASHTEAD GROUP	50,699	38.280	1,940,757.720	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.370	804,595.890	
	BARCLAYS PLC	1,890,510	1.519	2,871,684.690	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.565	566,954.740	
	BT GROUP PLC	756,852	1.934	1,463,751.760	
	BUNZL PLC	38,593	28.570	1,102,602.010	
	AVIVA PLC	303,762	4.013	1,218,996.900	
	CRODA INTERNATIONAL	14,503	68.940	999,836.820	
	DIAGEO PLC	258,585	35.375	9,147,444.370	
	SCHRODERS PLC	12,178	27.300	332,459.400	
	DCC PLC	11,135	52.660	586,369.100	
	NATIONAL GRID PLC	409,380	10.685	4,374,225.300	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.507	565,057.740	
	BAE SYSTEMS PLC	350,927	8.098	2,841,806.840	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	243,703	33.830	8,244,472.490	
	HALMA PLC	41,997	21.440	900,415.680	
	NEXT PLC	13,982	62.820	878,349.240	
	IMPERIAL BRANDS PLC	96,595	18.155	1,753,682.220	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	19.255	384,637.880	
	ANGLO AMERICAN PLC	142,815	28.245	4,033,809.670	
	COMPASS GROUP PLC	200,991	17.600	3,537,441.600	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,261,992	5.258	11,893,553.930	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	643,354	2.443	1,571,713.820	
	UNILEVER PLC	286,248	38.360	10,980,473.280	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.130	725,470.080	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	15.905	673,592.650	
	PEARSON PLC	86,953	7.766	675,276.990	
	PERSIMMON PLC	35,252	17.765	626,251.780	
	PRUDENTIAL PLC	309,558	10.165	3,146,657.070	
	RIO TINTO PLC	125,934	48.350	6,088,908.900	
	VODAFONE GROUP PLC	3,044,329	1.284	3,908,918.430	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	80,050	62.460	4,999,923.000	
RELX PLC	216,002	22.420	4,842,764.840	
RENTOKIL INITIAL PLC	204,183	4.970	1,014,789.510	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.871	737,777.930	
NATWEST GROUP PLC	606,899	2.188	1,327,895.010	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	11.440	771,605.120	
SSE PLC	117,097	16.935	1,983,037.690	
BP PLC	2,175,067	3.865	8,406,633.950	
SAGE GROUP PLC(THE)	99,190	6.632	657,828.080	
SMITHS GROUP PLC	37,796	14.210	537,081.160	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	107.250	958,386.000	
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	5.794	1,708,621.630	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,991,045	0.422	3,372,220.990	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.129	405,891.300	
TESCO PLC	846,543	2.618	2,216,249.570	
3I GROUP PLC	107,283	11.580	1,242,337.140	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	11.355	1,056,764.430	
GSK PLC	567,403	17.548	9,956,787.840	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,657	76.120	2,790,330.840	
WPP PLC	120,328	8.006	963,345.960	
ASTRAZENECA PLC	173,026	110.440	19,108,991.440	
WHITBREAD PLC	25,470	25.440	647,956.800	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	42.550	728,200.700	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	16.395	673,178.700	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	45.130	981,667.760	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.169	416,658.390	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	23.350	497,938.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	38.250	434,520.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	16.970	313,181.350	
AVEVA GROUP PLC	10,907	23.580	257,187.060	
ABRDN PLC	213,433	1.637	349,389.820	
EXPERIAN PLC	100,148	26.030	2,606,852.440	
MONDI PLC	58,887	14.800	871,527.600	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.146	300,929.530	
OCADO GROUP PLC	69,766	8.670	604,871.220	
INFORMA PLC	157,970	5.432	858,093.040	
GLENCORE PLC	1,111,091	4.313	4,792,135.480	
ENTAIN PLC	61,865	10.970	678,659.050	
COCA-COLA HBC AG	21,338	18.465	394,006.170	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	5.960	513,889.080	
FERGUSON PLC	24,704	92.800	2,292,531.200	
M&G PLC	270,401	1.943	525,389.140	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.249	314,972.820	

	SHELL PLC	848,263	20.435	17,334,254.400	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.920	656,131.360	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.558	759,068.500	
イギリス・ポンド　小計		31,509,984		197,214,190.970 (32,321,433,758)	
イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	30.650	4,496,446.950	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	32.000	5,770,976.000	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	765.000	1,953,045.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	161.800	2,034,473.200	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.620	3,034,017.280	
	ICL GROUP LTD	72,257	31.930	2,307,166.010	
	NICE LTD	6,507	713.500	4,642,744.500	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	120.200	2,096,288.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	252.700	1,180,614.400	
イスラエル・シュケル　小計		605,993		27,515,771.340 (1,082,019,186)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	70.500	1,533,657.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	303,672	22.700	6,893,354.400	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	392,465	19.950	7,829,676.750	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	194,047	17.300	3,357,013.100	
	TELSTRA CORP LTD	482,855	3.860	1,863,820.300	
	ASX LTD	20,036	85.140	1,705,865.040	
	BHP GROUP LTD	567,022	39.220	22,238,602.840	
	AMPOL LTD	22,528	33.640	757,841.920	
	COMPUTERSHARE LT	55,283	24.400	1,348,905.200	
	CSL LIMITED	53,962	287.350	15,505,980.700	
	REA GROUP LTD	6,134	122.500	751,415.000	
	TRANSURBAN GROUP	338,249	14.290	4,833,578.210	
	COCHLEAR LTD	7,836	202.160	1,584,125.760	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	5.700	1,215,405.300	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	190,552	92.590	17,643,209.680	
	RIO TINTO LIMITED	42,295	97.430	4,120,801.850	
	APA GROUP	125,299	11.660	1,460,986.340	
	ARISTOCRAT LEISU	65,513	36.570	2,395,810.410	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.360	1,228,055.040	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	35.120	1,722,109.200	
	ORICA LTD	43,659	15.550	678,897.450	
	LEND LEASE CORP LTD	65,475	9.500	622,012.500	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	15.750	792,618.750	
	MACQUARIE GROUP LTD	41,229	170.690	7,037,378.010	
	SUNCORP GROUP LTD	127,921	11.050	1,413,527.050	

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	362,624	28.110	10,193,360.640	
	NEWCREST MINING LTD	98,073	19.760	1,937,922.480	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	4.440	500,205.960	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	11.790	2,033,621.730	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	7.000	949,046.000	
	REECE LTD	31,558	14.610	461,062.380	
	SANTOS LTD	359,516	7.060	2,538,182.960	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	33.300	1,757,374.200	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	24.250	630,136.250	
	WESFARMERS LTD	123,983	44.760	5,549,479.080	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	211,841	30.800	6,524,702.800	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,728	36.830	5,035,692.240	
	SEEK LTD	38,405	22.380	859,503.900	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	75.510	474,504.840	
	MINERAL RESOURCES LTD	16,953	46.880	794,756.640	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.060	1,890,474.740	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	2.450	550,451.300	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.770	840,140.730	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	11.430	905,633.190	
	XERO LTD	14,590	87.040	1,269,913.600	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	25.800	613,549.800	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.540	1,032,668.400	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	7.840	1,258,084.800	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.300	985,300.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	489,406	3.730	1,825,484.380	
	COLES GROUP LTD	151,233	18.330	2,772,100.890	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	41.970	622,121.310	
オーストラリア・ドル　小計		7,725,511		165,340,123.840 (15,434,500,560)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	58.530	3,055,266.000	
	BARRICK GOLD CORP	200,288	22.270	4,460,413.760	
	BANK OF MONTREAL	72,300	126.310	9,132,213.000	
	BANK OF NOVA SCOTIA	133,706	75.650	10,114,858.900	
	NATIONAL BANK OF CANADA	38,087	87.670	3,339,087.290	
	BCE INC	7,697	63.530	488,990.410	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	156,360	58.910	9,211,167.600	
	BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	11.360	343,640.000	
	SAPUTO INC	26,668	29.760	793,639.680	
	BLACKBERRY LTD	49,855	7.690	383,384.950	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	83,181	17.480	1,454,003.880	
CGI INC	25,261	106.320	2,685,749.520	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	63.190	1,033,977.970	
CAE INC	32,283	31.950	1,031,441.850	
CAMECO CORP	45,781	28.860	1,321,239.660	
ROGERS COMM-CL B	40,412	61.540	2,486,954.480	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	101,154	63.540	6,427,325.160	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	132,635	63.940	8,480,681.900	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	170.130	1,041,876.120	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	38.540	629,358.200	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,497	146.060	9,712,551.820	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	36.380	789,918.940	
OPEN TEXT CORP	33,217	51.200	1,700,710.400	
EMPIRE CO LTD	16,169	40.430	653,712.670	
KINROSS GOLD CORP	123,889	4.350	538,917.150	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	85.190	1,131,834.340	
FORTIS INC	54,416	59.690	3,248,091.040	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,491	25.000	1,612,275.000	
TELUS CORP	31,890	28.790	918,113.100	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	31.730	1,085,419.840	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	57.490	1,566,372.540	
ENBRIDGE INC	226,742	54.670	12,395,985.140	
IGM FINANCIAL INC	12,478	35.370	441,346.860	
MANULIFE FINANCIAL CORP	219,912	22.760	5,005,197.120	
LOBLAW CO LTD	18,620	119.110	2,217,828.200	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	95,432	52.850	5,043,581.200	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	72.880	2,356,064.640	
SUN LIFE FINANCIAL INC	63,898	58.920	3,764,870.160	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,914	707.910	2,062,849.740	
METRO INC	28,316	71.160	2,014,966.560	
EMERA INC	30,947	60.160	1,861,771.520	
ONEX CORP	10,157	64.490	655,024.930	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	24.490	473,220.270	
POWER CORP OF CANADA	65,500	33.840	2,216,520.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	28.150	484,039.250	
ROYAL BANK OF CANADA	157,468	127.560	20,086,618.080	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	104,137	93.550	9,742,016.350	
SHAW COMM INC-B	52,487	36.210	1,900,554.270	
SUNCOR ENERGY INC	158,211	42.430	6,712,892.730	
LUNDIN MINING CORP	68,762	7.920	544,595.040	
TECK RESOURCES LTD-CL B	52,091	35.760	1,862,774.160	

	THOMSON REUTERS CORP	19,979	137.970	2,756,502.630	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	104.300	1,008,059.500	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	202,729	83.220	16,871,107.380	
	TC ENERGY CORP	110,440	67.040	7,403,897.600	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,862	104.790	614,278.980	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,379	154.410	1,293,801.390	
	INTACT FINANCIAL CORP	20,070	188.230	3,777,776.100	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	45.590	2,435,144.260	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,211	1,993.180	4,406,920.980	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,662	172.110	3,728,246.820	
	TOURMALINE OIL CORP	33,964	66.370	2,254,190.680	
	KEYERA CORP	24,571	29.980	736,638.580	
	PARKLAND CORP	15,665	35.260	552,347.900	
	ALTAGAS LTD	33,833	27.440	928,377.520	
	PEMBINA PIPELINE CORP	60,655	46.250	2,805,293.750	
	DOLLARAMA INC	32,535	78.290	2,547,165.150	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	158,757	23.340	3,705,388.380	
	ARC RESOURCES LTD	74,961	15.500	1,161,895.500	
	NORTHLAND POWER INC	25,030	39.530	989,435.900	
	TMX GROUP LTD	7,040	130.160	916,326.400	
	BRP INC	4,307	86.150	371,048.050	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	7.580	485,324.660	
	NUTRIEN LTD	62,480	98.830	6,174,898.400	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	110.300	1,036,709.700	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	27.440	333,396.000	
	WSP GLOBAL INC	13,275	145.760	1,934,964.000	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	64.170	770,745.870	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	33.460	577,318.840	
	NUVEI CORP	7,929	44.060	349,351.740	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	47.050	757,646.150	
	AIR CANADA	18,814	16.810	316,263.340	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,443	67.440	2,187,955.920	
	SHOPIFY INC	123,820	46.080	5,705,625.600	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	166.420	871,541.540	
	HYDRO ONE LTD	37,626	34.050	1,281,165.300	
カナダ・ドル　小計		4,549,172		256,762,653.900 (27,049,945,588)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	4.110	592,662.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	203,210	30.030	6,102,396.300	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.880	310,472.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.600	958,080.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.730	555,670.890	

	KEPPEL CORP LTD	144,600	6.550	947,130.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	368,898	11.450	4,223,882.100	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.660	2,509,257.800	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.190	844,413.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,766	26.410	3,427,120.060	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	7.360	320,896.000	
	VENTURE CORP LTD	22,300	16.830	375,309.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	4.130	802,872.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.850	1,180,371.500	
シンガポール・ドル　小計		3,563,987		23,150,532.650 (2,256,945,428)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	287,785	5.542	1,594,904.470	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	53.360	1,012,932.880	
	NESTLE SA-REGISTERED	313,579	114.640	35,948,696.560	
	CIE FINANC RICHEMONT	58,546	102.250	5,986,328.500	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	78,751	321.900	25,349,946.900	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	183.700	773,009.600	
	SIKA INHABER	16,475	225.700	3,718,407.500	
	SGS SA-REG	650	2,232.000	1,450,800.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	244,020	82.760	20,195,095.200	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	157.400	893,245.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	344	2,182.000	750,608.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	17.930	377,820.960	
	SWISSCOM AG-REG	2,942	533.400	1,569,262.800	
	ABB LTD	178,308	26.500	4,725,162.000	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	33.500	664,707.000	
	GEBERIT AG	4,146	478.000	1,981,788.000	
	LONZA GROUP AG-REG	8,438	566.000	4,775,908.000	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,960.000	1,165,320.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	101,100.000	1,314,300.000	
	GIVAUDAN-REG	1,043	3,446.000	3,594,178.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,632	422.100	7,020,367.200	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,595	379.200	984,024.000	
	HOLCIM LTD	59,521	41.530	2,471,907.130	
	TEMENOS GROUP	7,082	83.300	589,930.600	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	70.100	184,363.000	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	323.600	1,985,286.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	236.500	1,409,303.500	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	120.350	1,560,819.150	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	229.500	718,335.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	42.620	214,208.120	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	180.400	490,688.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	476.500	1,720,165.000	

	EMS-CHEMIE HOLDING	810	740.000	599,400.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	85.800	718,317.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,623	900.600	2,362,273.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	44.190	1,150,309.890	
	SWISS RE LTD	32,886	74.000	2,433,564.000	
	ALCON INC	53,961	70.100	3,782,666.100	
	VIFOR PHARMA AG	5,556	169.850	943,686.600	
	UBS GROUP AG	393,795	15.645	6,160,922.770	
	VAT GROUP AG	3,325	227.800	757,435.000	
スイス・フラン　小計		1,920,305		156,100,393.830 (21,771,321,927)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	313,452	102.400	32,097,484.800	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	168,168	91.310	15,355,420.080	
	ERICSSON LM-B SHS	330,309	80.370	26,546,934.330	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	245.600	6,325,428.000	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	196.900	11,506,245.300	
	LUNDBERGS B	7,859	442.100	3,474,463.900	
	SKF AB-B SHS	46,594	165.650	7,718,296.100	
	SANDVIK AB	114,819	175.850	20,190,921.150	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	179,371	106.550	19,111,980.050	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	161.600	7,100,219.200	
	SWEDBANK AB	94,382	133.800	12,628,311.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	157.750	11,075,785.250	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	92.480	14,985,089.280	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	174.900	4,232,230.200	
	VOLVO AB-B SHS	168,857	169.260	28,580,735.820	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	421.700	4,276,881.400	
	SWEDISH MATCH AB	167,443	105.900	17,732,213.700	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	121.400	7,820,102.400	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	244.000	3,731,248.000	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	240.800	5,135,060.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	146.520	3,942,413.640	
	SECURITAS AB-B SHS	44,038	92.960	4,093,772.480	
	INVESTOR AB-B SHS	204,473	179.940	36,792,871.620	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	131.400	10,812,511.800	
	ASSA ABLOY AB-B	109,539	231.400	25,347,324.600	
	TELIA CO AB	283,582	40.370	11,448,205.340	
	BOLIDEN AB	29,779	326.650	9,727,310.350	
	ALFA LAVAL AB	35,313	266.800	9,421,508.400	
	KINNEVIK AB-B	22,633	158.550	3,588,462.150	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	50.980	3,718,583.160	
	INDUTRADE AB	29,769	205.500	6,117,529.500	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	81.860	3,910,370.340	
	NIBE INDUSTRIER AB	160,889	83.960	13,508,240.440	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	232.800	4,278,864.000	
	HEXAGON AB-B SHS	223,124	112.700	25,146,074.800	
	SAGAX AB	19,038	207.200	3,944,673.600	
	EPIROC AB-A	71,353	169.800	12,115,739.400	
	EPIROC AB-B	41,205	150.250	6,191,051.250	
	ESSITY AB-B	66,425	274.400	18,227,020.000	
	EQT AB	31,718	224.400	7,117,519.200	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	82.890	6,613,875.990	
	VOLVO CAR AB	63,710	77.650	4,947,081.500	
	LIFCO AB	26,835	174.100	4,671,973.500	
	EVOLUTION AB	19,664	927.900	18,246,225.600	
	NORDEA BANK ABP	369,557	94.950	35,089,437.150	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	222.000	3,449,658.000	
	SINCH AB	59,403	36.200	2,150,388.600	
スウェーデン・クローナ　小計		4,342,665		554,243,736.970 (7,160,829,082)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	938.200	10,233,885.600	
	A P MOLLER A/S	557	17,710.000	9,864,470.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	17,630.000	6,329,170.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	102.000	7,434,474.000	
	GENMAB A/S	7,409	2,494.000	18,478,046.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	438.800	10,469,329.200	
	ROCKWOOL AS	873	1,649.500	1,440,013.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	188,256	799.000	150,416,544.000	
	GN STORE NORD A/S	15,343	253.200	3,884,847.600	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	114,856	170.860	19,624,296.160	
	COLOPLAST-B	12,609	827.400	10,432,686.600	
	DSV A/S	21,906	1,047.500	22,946,535.000	
	DEMANT A/S	11,367	276.100	3,138,428.700	
	TRYG A/S	37,118	161.700	6,001,980.600	
	PANDORA A/S	9,912	476.900	4,727,032.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	477.000	5,980,626.000	
	ORSTED A/S	20,956	804.700	16,863,293.200	
デンマーク・クローネ　小計		561,713		308,265,658.960 (5,739,906,570)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.360	1,209,549.760	
	FISHER & PAYKEL	60,887	21.410	1,303,590.670	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	4.930	1,079,857.340	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.940	373,233.960	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.750	627,745.750	
ニュージーランド・ドル　小計		639,257		4,593,977.480 (387,318,241)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	234.800	10,684,339.200	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	55.020	8,966,664.420	

	TELENOR ASA	71,764	133.650	9,591,258.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	351.200	3,928,172.000	
	ORKLA ASA	72,906	81.640	5,952,045.840	
	EQUINOR ASA	110,053	334.750	36,840,241.750	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	409.700	8,125,989.800	
	AKER BP ASA	33,719	331.900	11,191,336.100	
	SALMAR ASA	7,248	706.500	5,120,712.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	205.000	5,272,805.000	
	ADEVINTA ASA	24,382	75.750	1,846,936.500	
	DNB BANK ASA	105,251	180.200	18,966,230.200	
ノルウェー・クローネ　小計		690,538		126,486,731.410 (1,708,835,741)	
ユーロ	CRH PLC	85,408	34.415	2,939,316.320	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17,911	96.220	1,723,396.420	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	96.680	1,766,150.240	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	58.760	1,025,420.760	
	UMICORE	24,290	33.800	821,002.000	
	AIR LIQUIDE	58,167	128.460	7,472,132.820	
	AIRBUS SE	66,175	96.040	6,355,447.000	
	AXA SA	216,226	21.605	4,671,562.730	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,439	23.370	1,692,899.430	
	ADIDAS AG	19,278	168.460	3,247,571.880	
	ASSICURAZIONI GENERALI	118,133	15.370	1,815,704.210	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	146.300	456,456.000	
	DANONE	70,858	53.590	3,797,280.220	
	SAFRAN SA	38,630	99.420	3,840,594.600	
	INTESA SANPAOLO	1,851,944	1.762	3,263,125.320	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,364	76.040	2,613,038.560	
	ACCOR SA	18,305	27.210	498,079.050	
	BOUYGUES	21,922	28.580	626,530.760	
	BNP PARIBAS	124,442	45.460	5,657,133.320	
	THALES SA	11,069	119.900	1,327,173.100	
	CAPGEMINI SA	18,395	167.500	3,081,162.500	
	UNICREDIT SPA	241,149	9.492	2,288,986.300	
	D'IETEREN TRDG	2,736	146.200	400,003.200	
	KONINKLIJKE DSM NV	18,896	144.000	2,721,024.000	
	COMMERZBANK AG	112,781	6.406	722,475.080	
	EIFFAGE	8,993	88.120	792,463.160	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	28.910	1,415,086.680	
	UNITED INTERNET	10,010	27.600	276,276.000	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	44.250	1,171,386.000	
	IBERDROLA SA	649,973	9.912	6,442,532.370	
	ENI SPA	278,442	11.226	3,125,789.890	
	JERONIMO MARTINS	34,644	21.060	729,602.640	
	KESKO OYJ-B	35,252	23.330	822,429.160	
	KBC GROUPE	28,279	52.920	1,496,524.680	

HANNOVER RUECK SE	7,105	139.000	987,595.000	
WARTSILA OYJ	50,956	7.918	403,469.600	
L'OREAL	26,930	330.450	8,899,018.500	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,972	606.900	18,796,906.800	
GEA GROUP AG	17,490	33.690	589,238.100	
BOLLORE	114,808	4.608	529,035.260	
MEDIOBANCA SPA	60,688	8.428	511,478.460	
MICHELIN(CGDE)-B	77,776	27.055	2,104,229.680	
CONTINENTAL AG	12,921	67.800	876,043.800	
DEUTSCHE POST AG-REG	111,656	36.355	4,059,253.880	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	17.920	399,454.720	
OMV AG	17,258	41.270	712,237.660	
VERBUND AG	7,320	102.600	751,032.000	
PERNOD-RICARD	23,542	177.850	4,186,944.700	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	16,854	67.740	1,141,689.960	
RENAULT SA	19,671	24.620	484,300.020	
REPSOL SA	161,783	12.980	2,099,943.340	
REMY COINTREAU	2,866	178.000	510,148.000	
MERCK KGAA	13,847	175.100	2,424,609.700	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	56,977	42.985	2,449,156.340	
RWE AG	69,945	35.820	2,505,429.900	
SEB SA	2,596	95.500	247,918.000	
SOCIETE GENERALE-A	90,814	20.825	1,891,201.550	
VINCI S.A.	58,131	88.180	5,125,991.580	
SODEXO	9,822	73.540	722,309.880	
SOFINA	1,449	212.800	308,347.200	
SOLVAY SA	9,070	80.680	731,767.600	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	60,461	117.240	7,088,447.640	
VIVENDI SE	76,073	9.718	739,277.410	
SAP SE	116,604	89.600	10,447,718.400	
TELEFONICA S.A	614,947	4.720	2,902,549.840	
TOTALENERGIES SE	275,608	49.270	13,579,206.160	
VALEO	26,570	18.880	501,641.600	
E.ON SE	256,515	8.184	2,099,318.760	
VOEST-ALPINE AG	10,593	21.160	224,147.880	
HENKEL AG & CO KGAA	10,815	60.750	657,011.250	
SIEMENS AG-REG	85,594	99.840	8,545,704.960	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	29.630	1,843,963.790	
ING GROEP NV-CVA	438,532	9.423	4,132,287.030	
PUMA AG	10,980	65.980	724,460.400	
BAYER AG	110,053	57.830	6,364,364.990	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	15.500	907,292.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	61.880	1,215,570.720	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	89,877	55.870	5,021,427.990	

BASF SE	104,334	42.915	4,477,493.610	
BEIERSDORF AG	10,944	98.940	1,082,799.360	
HEIDELBERGCEMENT AG	14,634	47.330	692,627.220	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	47.600	1,135,498.000	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	219.450	1,138,506.600	
ORANGE	228,746	10.596	2,423,792.610	
SAMPO OYJ-A SHS	52,583	42.440	2,231,622.520	
RANDSTAD NV	11,897	48.620	578,432.140	
ALLIANZ SE	45,614	180.280	8,223,291.920	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.639	1,474,997.880	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	112,674	26.390	2,973,466.860	
HERMES INTL	3,559	1,070.000	3,808,130.000	
ENDESA S.A.	37,701	18.075	681,445.570	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	5.801	419,655.940	
ERSTE GROUP BANK AG	38,446	24.500	941,927.000	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15,818	224.200	3,546,395.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	67,059	21.860	1,465,909.740	
DASSAULT SYSTEMES SA	75,193	37.260	2,801,691.180	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	21.690	511,254.990	
RHEINMETALL STAMM	4,693	195.000	915,135.000	
HEINEKEN NV	29,630	93.020	2,756,182.600	
AKZO NOBEL	19,812	63.380	1,255,684.560	
ASML HOLDING NV	45,397	446.150	20,253,871.550	
AEGON NV	196,332	4.166	817,919.110	
VOLKSWAGEN AG	3,315	188.700	625,540.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,739	134.460	2,788,565.940	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	720,570	4.397	3,168,346.290	
KERING	8,379	501.000	4,197,879.000	
ACCIONA S.A.	2,642	189.800	501,451.600	
FORTUM OYJ	54,194	13.020	705,605.880	
AGEAS	18,136	42.680	774,044.480	
UCB SA	13,322	85.940	1,144,892.680	
NEMETSCHEK SE	5,104	61.060	311,650.240	
CARREFOUR SA	64,831	17.170	1,113,148.270	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	28.050	495,839.850	
NOKIA OYJ	577,711	4.602	2,658,626.020	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	101,426	21.215	2,151,752.590	
WOLTERS KLUWER-CVA	28,129	95.880	2,697,008.520	
SANOFI	126,926	99.330	12,607,559.580	
STMICROELECTRONICS NV	74,365	30.830	2,292,672.950	
ELISA OYJ	14,618	54.320	794,049.760	
BANCO SANTANDER SA	1,937,631	2.613	5,063,029.800	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	18.125	888,324.370	

QIAGEN N.V.	27,412	47.430	1,300,151.160	
DEUTSCHE BANK AG-REG	226,269	8.200	1,855,405.800	
BMW VORZUG	7,821	70.550	551,771.550	
ENEL SPA	910,090	5.252	4,779,792.680	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	363,502	19.216	6,985,054.430	
SARTORIUS AG	2,847	379.200	1,079,582.400	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	41.940	462,682.080	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	148,000	23.250	3,441,000.000	
RATIONAL AG	516	619.000	319,404.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	127.350	619,685.100	
BECHTLE AG	8,139	40.050	325,966.950	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	3.383	1,213,647.860	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	77.680	1,148,032.720	
TELEPERFORMANCE	6,746	310.000	2,091,260.000	
DEUTSCHE BOERSE AG	21,263	159.950	3,401,016.850	
EURAZEO	5,673	62.100	352,293.300	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	82.280	931,245.040	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	73.400	796,610.200	
INDITEX	116,799	23.330	2,724,920.670	
ESSILORLUXOTTICA	32,135	143.650	4,616,192.750	
SNAM SPA	210,122	4.995	1,049,559.390	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	8.741	1,256,256.520	
ENAGAS	24,864	19.655	488,701.920	
WENDEL	2,354	82.850	195,028.900	
TENARIS SA	55,855	12.680	708,241.400	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.258	234,337.780	
ATLANTIA SPA	55,336	22.340	1,236,206.240	
PROXIMUS	14,640	14.390	210,669.600	
TERNA SPA	166,064	7.362	1,222,563.160	
BIOMERIEUX	4,870	104.700	509,889.000	
GRIFOLS SA	31,982	16.900	540,495.800	
FERROVIAL SA	55,374	26.000	1,439,724.000	
NESTE OYJ	45,715	44.200	2,020,603.000	
RECORDATI SPA	10,908	43.520	474,716.160	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	10.305	595,371.370	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	175.500	1,054,404.000	
KONE OYJ	39,178	47.180	1,848,418.040	
ELIA GROUP	4,078	142.800	582,338.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	336.100	1,044,934.900	
ENGIE	206,708	10.834	2,239,474.470	
ALSTOM	37,007	24.320	900,010.240	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	9.560	621,514.720	
IPSEN SA	3,873	93.150	360,769.950	
ARKEMA SA	6,392	93.580	598,163.360	
LEGRAND SA	30,081	72.780	2,189,295.180	
AMPLIFON SPA	12,300	31.150	383,145.000	
ADP	3,975	122.550	487,136.250	

ORION OYJ	13,559	44.010	596,731.590	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.245	608,614.470	
SYMRISE AG	15,064	107.950	1,626,158.800	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	32.880	840,149.760	
PRYSMIAN SPA	30,728	27.190	835,494.320	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	135.800	329,858.200	
CAIXABANK	498,058	3.001	1,494,672.050	
BUREAU VERITAS SA	31,295	24.520	767,353.400	
GETLINK	44,292	17.890	792,383.880	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	24.250	716,854.250	
AMADEUS IT GROUP SA	51,056	53.520	2,732,517.120	
BRENNTAG SE	17,934	62.680	1,124,103.120	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	20.420	504,108.540	
EDENRED	26,160	45.240	1,183,478.400	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.860	301,655.640	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	79.340	651,302.060	
KION GROUP AG	7,874	43.040	338,896.960	
VONOVIA SE	78,397	28.460	2,231,178.620	
KNORR-BREMSE AG	7,195	56.780	408,532.100	
OCI NV	12,329	29.560	364,445.240	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	49.230	1,482,807.600	
FERRARI NV	14,074	190.700	2,683,911.800	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	11.455	1,287,393.080	
AROUNDTOWN SA	113,225	3.046	344,883.350	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	31.500	279,027.000	
MONCLER SPA	25,014	41.480	1,037,580.720	
NEXI SPA	58,847	8.280	487,253.160	
PROSUS NV	93,541	67.600	6,323,371.600	
IBERDROLA SA-RTS	649,973	0.277	180,042.520	
JDE PEET'S BV	7,893	27.000	213,111.000	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	14.840	690,178.720	
EURONEXT NV	10,081	76.620	772,406.220	
IMCD NV	6,823	136.850	933,727.550	
WORLDLINE SA	24,912	35.190	876,653.280	
NN GROUP NV	31,214	44.470	1,388,086.580	
FINECOBANK SPA	75,180	12.155	913,812.900	
ARGENX SE	5,297	348.400	1,845,474.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	20.945	1,728,653.680	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	25.305	1,191,561.840	
ZALANDO SE	24,405	27.120	661,863.600	
STELLANTIS NV	245,839	12.458	3,062,662.260	
AENA SME SA	8,494	122.000	1,036,268.000	
CELLNEX TELECOM SAU	59,261	38.600	2,287,474.600	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	15.902	360,498.340	
ABN AMRO BANK NV	52,835	10.610	560,579.350	
EXOR NV	10,514	62.760	659,858.640	

	SCOUT24 SE	10,048	54.880	551,434.240	
	COVESTRO AG	20,258	33.440	677,427.520	
	HELLOFRESH SE	17,856	34.040	607,818.240	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	97,316	54.630	5,316,373.080	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	8.688	511,627.630	
	AMUNDI SA	6,292	51.500	324,038.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.980	417,952.420	
	ADYEN NV	2,458	1,469.600	3,612,276.800	
	UNIPER SE	11,072	10.920	120,906.240	
	DELIVERY HERO SE	17,246	38.820	669,489.720	
ユーロ　小計		20,953,800		452,161,277.720 (62,665,031,479)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	14.580	3,747,060.000	
	CLP HOLDINGS LTD	171,296	66.300	11,356,924.800	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	48.750	2,794,057.500	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	135,391	375.800	50,879,937.800	
	MTR CORP	192,441	41.400	7,967,057.400	
	HANG SENG BANK LTD	79,896	133.300	10,650,136.800	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	28.800	4,923,993.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	49.900	7,550,868.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	8.550	10,648,221.300	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	47.650	12,432,075.600	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	29.100	12,221,854.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	27.350	4,733,355.100	
	SINO LAND CO	411,200	11.380	4,679,456.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,065	93.900	15,124,003.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	46.300	2,454,826.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	88.950	14,156,926.200	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	18.340	3,264,520.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	15.020	3,499,660.000	
	AIA GROUP LTD	1,353,916	85.150	115,285,947.400	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	10.880	5,038,919.680	
	SANDS CHINA LTD	260,600	18.660	4,862,796.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	23.400	3,276,000.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	19.080	2,182,752.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	36.700	7,198,154.500	
	ESR GROUP LTD	216,400	20.800	4,501,120.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	7.250	1,787,125.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	23.100	3,726,030.000	
	WH GROUP LTD	931,500	5.870	5,467,905.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	53.200	16,515,674.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	221,695	56.100	12,437,089.500	
香港・ドル　小計		9,126,469		365,364,447.180 (6,353,687,736)	
合計		122,831,378		699,468,086,811 (699,468,086,811)	

（２）株式以外の有価証券

2022年7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	108,264.000	1,003,607.280	
		GOODMAN GROUP	184,374.000	3,497,574.780	
		GPT GROUP	219,223.000	993,080.190	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	913,212.220	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,760,375.840	
		STOCKLAND	259,328.000	980,259.840	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	724,807.500	
	オーストラリア・ドル　小計		2,237,752.000	9,872,917.650 (921,636,863)	
	シンガポール・ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVT	440,678.000	1,282,372.980	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,194,545.100	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	206,400.000	371,520.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	834,416.000	
	シンガポール・ドル　小計		1,690,009.000	3,682,854.080 (359,041,444)	
投資信託受益証券　合計			3,927,761	1,280,678,307 (1,280,678,307)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,597.000	2,428,970.950	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,348.000	1,230,688.840	
		AMERICAN TOWER CORP	50,890.000	12,977,458.900	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	181,793.000	1,112,573.160	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,391.000	2,932,908.960	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,660.000	1,396,089.000	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,279.000	1,497,174.460	

	CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	48,326.000	8,283,076.400	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	32,050.000	4,048,876.500	
	DUKE REALTY TRUST	42,490.000	2,433,402.300	
	EQUINIX INC	10,180.000	6,622,293.600	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,483,800.980	
	EQUITY RESIDENTIAL	38,369.000	2,738,395.530	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,316.000	1,923,522.720	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,919.000	2,582,329.710	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,640,480.520	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,255,504.250	
	INVITATION HOMES INC	69,205.000	2,523,906.350	
	IRON MOUNTAIN INC	30,120.000	1,466,844.000	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,417,466.940	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	1,127,577.930	
	MID AMERICA	12,263.000	2,082,625.290	
	PROLOGIS INC	82,861.000	10,074,240.380	
	PUBLIC STORAGE	17,682.000	5,584,506.060	
	REALTY INCOME CORP	65,893.000	4,545,299.140	
	REGENCY CENTERS CORP	15,613.000	931,003.190	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,240.000	3,968,330.400	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,061.000	3,620,489.090	
	SUN COMMUNITIES INC	13,260.000	2,126,638.800	
	UDR INC	34,650.000	1,552,666.500	
	VENTAS INC	42,297.000	2,147,418.690	
	VICI PROPERTIES INC	105,573.000	3,306,546.360	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	475,496.130	
	WELLTOWER INC	50,106.000	4,114,203.660	
	WEYERHAEUSER CO	83,741.000	2,931,772.410	
	WP CAREY INC	21,266.000	1,736,368.900	
アメリカ・ドル　小計		1,535,273.000	112,320,947.000 (15,328,439,637)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	556,605.700	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	528,080.200	
	SEGRO PLC	139,569.000	1,402,668.450	
イギリス・ポンド　小計		335,772.000	2,487,354.350 (407,652,504)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	386,820.700	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	291,076.320	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	677,897.020 (71,416,451)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	275,590.400	
	GECINA SA	5,045.000	453,293.250	

		KLEPIERRE	25,279.000	501,156.170	
		UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	681,622.600	
		WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	523,848.000	
	ユーロ　小計		65,715.000	2,435,510.420 (337,537,389)	
	香港・ドル	LINK REIT	233,616.000	15,149,997.600	
	香港・ドル　小計		233,616.000	15,149,997.600 (263,458,458)	
投資証券　合計			2,193,522	16,408,504,439 (16,408,504,439)	
合計				17,689,182,746 (17,689,182,746)	

（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	603銘柄	70.43	－	－	74.02
	投資証券	36銘柄	－	－	2.09	
イギリス・ポンド	株式	78銘柄	4.42	－	－	4.56
	投資証券	3銘柄	－	－	0.06	
イスラエル・シュケル	株式	9銘柄	0.15	－	－	0.15
オーストラリア・ドル	株式	52銘柄	2.11	－	－	2.28
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.13	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.70	－	－	3.78
	投資証券	2銘柄	－	－	0.01	
シンガポール・ドル	株式	14銘柄	0.31	－	－	0.36
	投資信託受益証券	4銘柄	－	0.05	－	
スイス・フラン	株式	41銘柄	2.97	－	－	3.04
スウェーデン・クローナ	株式	47銘柄	0.98	－	－	1.00
デンマーク・クローネ	株式	17銘柄	0.78	－	－	0.80
ニュージーランド・ドル	株式	5銘柄	0.05	－	－	0.05
ノルウェー・クローネ	株式	12銘柄	0.23	－	－	0.24
ユーロ	株式	224銘柄	8.56	－	－	8.79
	投資証券	5銘柄	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	30銘柄	0.87	－	－	0.92
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△5,283,518,104
合計	△5,283,518,104

（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（2022年4月19日から2022年7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。

（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）	1.9967円 (19,967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7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	ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	3,000,000.000	2,912,283.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	5,000,000.000	4,498,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	5,000,000.000	4,287,495.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	6,000,000.000	5,210,472.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	6,000,000.000	5,834,622.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	8,000,000.000	7,811,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	6,000,000.000	5,600,958.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	2,000,000.000	1,371,578.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	8,000,000.000	7,732,840.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	10,000,000.000	7,933,010.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27	11,000,000.000	10,895,060.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	10,000,000.000	9,077,250.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.125 10/11/47	6,000,000.000	5,715,000.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	7,000,000.000	6,632,817.170	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	6,000,000.000	4,954,298.220	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	12,000,000.000	10,174,661.040	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	10,000,000.000	9,067,000.000	
		BRAZIL 4.625 01/13/28	12,000,000.000	11,266,114.200	

		BRAZIL 4.75 01/14/50	10,000,000.000	6,853,192.100	
		BRAZIL 5.0 01/27/45	4,800,000.000	3,476,679.930	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	6,100,000.000	4,934,451.460	
		BRAZIL 5.625 02/21/47	4,600,000.000	3,592,215.440	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	4,993,259.760	
		BRAZIL 8.25 01/20/34	5,200,000.000	5,682,040.000	
		BRAZIL 8.75 02/04/25	2,000,000.000	2,238,700.000	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,713,954.840	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,694,655.600	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	5,401,377.030	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	12,000,000.000	9,025,891.800	
		COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	6,635,007.450	
		COLOMBIA 3.875 02/15/61	2,000,000.000	1,173,980.500	
		COLOMBIA 4.125 02/22/42	4,000,000.000	2,561,210.520	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	3,064,960.500	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	7,000,000.000	6,610,618.910	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	10,000,000.000	8,739,726.700	
		COLOMBIA 5.0 06/15/45	9,000,000.000	6,131,541.510	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	9,000,000.000	6,192,900.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	6,000,000.000	4,379,999.460	
		CROATIA 5.5 04/04/23	6,400,000.000	6,490,624.000	
		CROATIA 6.0 01/26/24	5,400,000.000	5,590,366.200	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	15,000,000.000	13,225,302.450	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	17,000,000.000	11,766,355.690	
		DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	20,200,000.000	16,923,666.850	
		HUNGARY 2.125 09/22/31	10,000,000.000	7,830,510.000	
		HUNGARY 3.125 09/21/51	6,000,000.000	4,006,464.000	
		HUNGARY 5.25 06/16/29	7,000,000.000	7,043,664.950	
		HUNGARY 5.375 02/21/23	1,358,000.000	1,375,321.290	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	4,380,000.000	4,477,446.240	
		HUNGARY 5.75 11/22/23	4,000,000.000	4,095,840.000	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	5,400,000.000	6,311,881.800	
		INDONESIA 1.85 03/12/31	4,200,000.000	3,437,408.350	
		INDONESIA 2.85 02/14/30	4,000,000.000	3,593,903.560	
		INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,849,401.050	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	4,200,000.000	3,920,664.590	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	3,072,000.000	
		INDONESIA 3.7 10/30/49	2,000,000.000	1,614,756.260	
		INDONESIA 3.85 10/15/30	7,400,000.000	7,103,589.520	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	4,000,000.000	3,960,000.000	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	4,200,000.000	4,220,905.240	
		INDONESIA 4.2 10/15/50	5,000,000.000	4,324,389.150	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	3,600,000.000	3,610,800.000	
		INDONESIA 4.35 01/11/48	5,600,000.000	4,895,275.840	

		INDONESIA 4.45 04/15/70	1,200,000.000	1,030,027.620	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	5,000,000.000	5,081,655.350	
		INDONESIA 4.75 02/11/29	3,200,000.000	3,247,998.460	
		INDONESIA 5.125 01/15/45	3,400,000.000	3,257,624.660	
		INDONESIA 5.25 01/17/42	4,500,000.000	4,406,787.850	
		INDONESIA 5.35 02/11/49	2,000,000.000	1,971,724.440	
		INDONESIA 5.875 01/15/24	3,200,000.000	3,301,549.660	
		INDONESIA 5.95 01/08/46	3,200,000.000	3,351,502.650	
		INDONESIA 6.75 01/15/44	4,100,000.000	4,729,660.780	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	4,190,627.000	
		PANAMA 2.252 09/29/32	10,000,000.000	7,828,980.900	
		PANAMA 3.16 01/23/30	9,000,000.000	8,066,700.000	
		PANAMA 3.75 03/16/25	800,000.000	789,693.620	
		PANAMA 3.87 07/23/60	10,000,000.000	7,124,313.900	
		PANAMA 3.875 03/17/28	3,700,000.000	3,544,839.830	
		PANAMA 4.5 01/19/63	6,000,000.000	4,645,336.980	
		PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	8,786,018.340	
		PANAMA 4.5 04/16/50	12,300,000.000	10,025,983.380	
		PANAMA 6.7 01/26/36	4,900,000.000	5,284,650.000	
		PANAMA 7.125 01/29/26	3,800,000.000	4,127,623.800	
		PERU 1.862 12/01/32	6,000,000.000	4,592,580.900	
		PERU 2.392 01/23/26	4,600,000.000	4,306,203.240	
		PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	5,020,026.720	
		PERU 2.783 01/23/31	16,000,000.000	13,632,752.160	
		PERU 2.844 06/20/30	3,000,000.000	2,622,952.350	
		PERU 3.0 01/15/34	7,000,000.000	5,800,081.490	
		PERU 3.3 03/11/41	4,000,000.000	3,076,482.920	
		PERU 3.55 03/10/51	7,000,000.000	5,314,787.800	
		PERU 5.625 11/18/50	6,000,000.000	6,302,001.840	
		PHILIPPINES 1.648 06/10/31	5,600,000.000	4,535,516.550	
		PHILIPPINES 2.457 05/05/30	5,800,000.000	5,080,579.890	
		PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	4,204,859.040	
		PHILIPPINES 2.95 05/05/45	3,000,000.000	2,185,272.510	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	9,000,000.000	8,549,955.000	
		PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	4,550,218.500	
		PHILIPPINES 3.7 02/02/42	5,000,000.000	4,211,748.400	
		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	7,200,000.000	7,055,961.040	
		PHILIPPINES 3.95 01/20/40	6,000,000.000	5,279,067.180	
		PHILIPPINES 4.2 01/21/24	3,000,000.000	3,037,451.160	
		PHILIPPINES 6.375 10/23/34	5,000,000.000	5,630,643.100	
		PHILIPPINES 7.75 01/14/31	3,100,000.000	3,773,992.350	

		PHILIPPINES 9.5 02/02/30	4,800,000.000	6,220,663.720	
		REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	8,200,000.000	6,999,344.110	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	6,120,863.130	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	9,000,000.000	7,353,256.230	
		REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	4,200,000.000	3,929,991.150	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	5,000,000.000	3,383,626.700	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	9,000,000.000	6,819,469.830	
		REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	6,600,000.000	6,221,983.280	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	7,000,000.000	5,386,487.260	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,502,692.320	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	3,025,234.840	
		REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	7,000,000.000	6,245,365.000	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	13,000,000.000	13,277,751.760	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	12,000,000.000	11,881,537.560	
		ROMANIA 3.0 02/14/31	5,000,000.000	3,927,300.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	11,000,000.000	7,351,410.000	
		ROMANIA 4.875 01/22/24	2,800,000.000	2,809,805.600	
		ROMANIA 5.125 06/15/48	5,600,000.000	4,441,388.000	
		ROMANIA 6.125 01/22/44	7,600,000.000	6,787,795.600	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	7,000,000.000	5,985,000.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.875 03/04/23	2,000,000.000	1,995,400.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	8,000,000.000	7,865,600.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	5,200,000.000	4,975,276.800	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	3,030,904.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28	11,000,000.000	10,964,800.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,643,508.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	9,000,000.000	9,116,100.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	8,000,000.000	8,229,144.000	

		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	7,000,000.000	7,254,975.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	6,000,000.000	5,563,824.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.625 10/04/47	7,000,000.000	6,549,011.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	7,000,000.000	6,933,045.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	6,000,000.000	6,157,632.000	
		SOUTH AFRICA 4.3 10/12/28	7,800,000.000	6,681,714.000	
		SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	11,000,000.000	9,420,400.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	4,400,000.000	4,187,040.000	
		SOUTH AFRICA 5.65 09/27/47	8,200,000.000	5,603,142.000	
		SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	14,000,000.000	9,481,220.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	7,000,000.000	6,325,025.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 09/16/25	3,200,000.000	3,176,518.400	
		SOUTH AFRICA 6.3 06/22/48	3,200,000.000	2,380,608.000	
		SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	6,000,000.000	4,797,900.000	
		STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	8,000,000.000	7,984,000.000	
		STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,971,300.000	
		STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	10,000,000.000	10,038,300.000	
		STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	13,000,000.000	13,253,045.000	
		STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	10,000,000.000	9,641,000.000	
		STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	11,000,000.000	11,534,050.000	
		STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	15,000,000.000	15,243,300.000	
		STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	13,000,000.000	13,704,600.000	
		UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	4,000,000.000	3,077,200.000	
		UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	9,000,000.000	7,409,959.560	
		UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,292,339.900	

		UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	9,000,000.000	7,491,626.100	
		UNITED MEXICAN STATES 3.6 01/30/25	2,200,000.000	2,192,214.220	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	4,200,000.000	4,036,090.120	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,479,536.880	
		UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	8,000,000.000	5,227,022.320	
		UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,602,175.940	
		UNITED MEXICAN STATES 4.125 01/21/26	4,000,000.000	4,014,480.480	
		UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	4,400,000.000	4,352,869.400	
		UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	6,000,000.000	4,765,584.660	
		UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	5,000,000.000	3,783,621.150	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	5,000,000.000	3,957,500.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	8,000,000.000	7,779,969.840	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	5,000,000.000	4,022,920.000	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	4,400,000.000	3,505,646.140	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	8,000,000.000	7,711,369.920	
		UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	5,002,701.480	
		UNITED MEXICAN STATES 5.75 10/12/2110	1,800,000.000	1,518,934.480	
		UNITED MEXICAN STATES 6.05 01/11/40	5,900,000.000	5,837,675.110	
	アメリカ・ドル　小計		1,136,238,000.000 (155,062,399,860)	1,002,802,778.520 (136,852,495,185)	
国債証券　合計			155,062,399,860 (155,062,399,860)	136,852,495,185 (136,852,495,185)	
合計				136,852,495,185 (136,852,495,185)	

（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	174銘柄	97.75	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）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△4,257,557,657
投資信託受益証券	△59,653,722
投資証券	△3,793,142
合計	△4,321,004,521

（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（2022年4月19日から2022年7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。

（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）	1.4165円 (14,165円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2022年7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	36,666	26.160	959,182.560	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	12,755	6.260	79,846.300	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	4,944	122.880	607,518.720	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	5,892	51.140	301,316.880	
	LUKOIL SPON ADR	33,845	0.000	0.000	
	GAZPROM PAO ADR	483,471	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	128,421	1.766	226,791.480	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	67,100	1.635	109,708.500	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.886	76,628.360	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	23,800	4.199	99,936.200	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	10,735	1.600	17,176.000	
	SURGUTNEFTEGAZ ADR	71,084	0.000	0.000	
	X5 RETAIL GROUP NV GDR	16,003	0.000	0.000	
	NOVATEK PJSC GDR	7,413	0.000	0.000	
	NOVOLIPETSK STEEL GDR	13,260	0.000	0.000	
	MMC NORILSK NICKEL ADR	53,953	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO GDR	107,951	0.000	0.000	
	SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000	
	TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000	
	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	

	MAGNIT PJSC GDR	37,870	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	30,924	10.130	313,260.120	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,628	4.690	115,505.320	
	VK CO LTD GDR	9,858	0.000	0.000	
	SBERBANK OF RUSSIA PJSC	897,112	0.000	0.000	
	YANDEX NV	25,601	0.000	0.000	
	PHOSAGRO PJSC GDR	18,163	0.000	0.000	
	HUAZHU GROUP LTD ADR	13,179	39.650	522,547.350	
	JOYY INC-ADR	4,368	28.050	122,522.400	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	4,112	73.830	303,588.960	
	ZAI LAB LTD ADR	6,331	38.500	243,743.500	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	360 DIGITECH INC ADR	5,813	15.550	90,392.150	
	NIO INC ADR	87,940	22.600	1,987,444.000	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	50,131	4.810	241,130.110	
	AUTOHOME INC ADR	5,337	37.830	201,898.710	
	WEIBO CORP ADR	4,386	22.840	100,176.240	
	KANZHUN LTD ADR	5,650	26.340	148,821.000	
	RLX TECHNOLOGY INC ADR	30,011	1.940	58,221.340	
	KE HOLDINGS INC ADR	20,023	16.710	334,584.330	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	2,864	56.050	160,527.200	
	LI AUTO INC ADR	36,778	38.900	1,430,664.200	
	XPENG INC ADR	28,404	32.130	912,620.520	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	58,560	5.680	332,620.800	
	PINDUODUO INC ADR	29,368	60.800	1,785,574.400	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	28,036	48.310	1,354,419.160	
	IQIYI INC ADR	27,254	4.210	114,739.340	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	6,136	15.520	95,230.720	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	28,295	26.890	760,852.550	
	BEIGENE LTD ADR	3,171	188.740	598,494.540	
アメリカ・ドル　小計		306,820,007		14,807,683.960 (2,020,804,630)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	88,305	8.000	706,440.000	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	197,234	5.430	1,070,980.620	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	231,448	25.720	5,952,842.560	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	191,403	8.210	1,571,418.630	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	294,659	18.340	5,404,046.060	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	268,691	5.140	1,381,071.740	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	273,432	4.360	1,192,163.520	

	EMIRATES NBD BANK PJSC	124,639	11.850	1,476,972.150	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	188,136	4.250	799,578.000	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		1,857,947		19,555,513.280 (727,856,204)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	202,640	2,391.400	484,593,296.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	61,205	325.300	19,909,986.500	
	ASIAN PAINTS LTD	25,667	2,879.800	73,915,826.600	
	EICHER MOTORS LTD	9,376	2,931.600	27,486,681.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	17,291	1,391.350	24,057,832.850	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	58,364	1,133.600	66,161,430.400	
	SHREE CEMENT LTD	709	19,932.800	14,132,355.200	
	ICICI BANK LTD	340,870	755.700	257,595,459.000	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	50,310	241.300	12,139,803.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	117,731	488.550	57,517,480.050	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	18,416	656.600	12,091,945.600	
	TATA STEEL LTD	49,675	885.900	44,007,082.500	
	TATA MOTORS LTD	110,235	441.550	48,674,264.250	
	JSW STEEL LTD	45,446	566.200	25,731,525.200	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	34,551	761.400	26,307,131.400	
	TATA POWER CO LTD	98,347	220.050	21,641,257.350	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	7,269	3,816.950	27,745,409.550	
	NESTLE INDIA LTD	2,172	18,419.150	40,006,393.800	
	GAIL INDIA LTD	113,561	137.250	15,586,247.250	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	37,549	1,744.750	65,513,617.750	
	VEDANTA LTD	48,784	224.000	10,927,616.000	
	AXIS BANK LTD	151,951	669.150	101,678,011.650	
	TITAN COMPANY LTD	23,196	2,144.350	49,740,342.600	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	179,820	121.500	21,848,130.000	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	8,871	1,566.700	13,898,195.700	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	87,255	236.000	20,592,180.000	
	LUPIN LTD	14,624	635.000	9,286,240.000	
	MPHASIS LTD	5,719	2,232.800	12,769,383.200	
	ACC LTD	5,137	2,169.350	11,143,950.950	
	BAJAJ FINANCE LTD	17,871	5,873.200	104,959,957.200	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	115,081	2,239.750	257,752,669.750	
	INFOSYS LTD	223,517	1,514.450	338,505,320.650	
	WIPRO LTD	88,836	419.100	37,231,167.600	
	TATA ELXSI LTD	2,267	7,993.150	18,120,471.050	
	MRF LTD	115	76,044.950	8,745,169.250	
	INDIAN OIL CORP LTD	211,284	72.700	15,360,346.800	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	54,568	2,496.850	136,248,110.800	

TRENT LTD	12,243	1,204.250	14,743,632.750	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	6,771	3,936.150	26,651,671.650	
HCL TECHNOLOGIES LTD	72,090	983.550	70,904,119.500	
DABUR INDIA LTD	40,095	543.900	21,807,670.500	
HERO MOTOCORP LTD	8,031	2,849.300	22,882,728.300	
SRF LTD	9,583	2,175.500	20,847,816.500	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	5,256	2,289.150	12,031,772.400	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	7,895	4,406.200	34,786,949.000	
BHARTI AIRTEL LTD	146,609	695.150	101,915,246.350	
UNITED SPIRITS LTD	21,413	814.050	17,431,252.650	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	63,967	857.700	54,864,495.900	
DIVI'S LABORATORIES LTD	8,733	3,671.300	32,061,462.900	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8,232	8,475.950	69,774,020.400	
AUROBINDO PHARMA LTD	14,788	546.550	8,082,381.400	
HAVELLS INDIA LTD	16,463	1,218.600	20,061,811.800	
INDRAPRASTHA GAS LTD	22,037	370.900	8,173,523.300	
JINDAL STEEL & POWER LTD	24,858	343.400	8,536,237.200	
BIOCON LTD	25,792	322.800	8,325,657.600	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	85,979	119.000	10,231,501.000	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	12,529	1,280.450	16,042,758.050	
PETRONET LNG LTD	51,266	225.350	11,552,793.100	
CIPLA LTD/INDIA	32,755	935.450	30,640,664.750	
LARSEN & TOUBRO LTD	45,966	1,687.450	77,565,326.700	
ULTRATECH CEMENT LTD	6,679	5,839.100	38,999,348.900	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	61,234	3,265.450	199,956,565.300	
ADANI ENTERPRISES LTD	17,751	2,293.050	40,703,930.550	
NTPC LTD	270,554	143.700	38,878,609.800	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,899	1,709.700	13,504,920.300	
YES BANK LTD	714,850	12.800	9,150,080.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	39,375	368.450	14,507,718.750	
BHARAT FORGE LTD	17,411	668.650	11,641,865.150	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	94,436	357.550	33,765,591.800	
ITC LTD	200,535	293.050	58,766,781.750	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	9,845	2,250.850	22,159,618.250	
UNITED PHOSPHORUS LTD	34,882	690.250	24,077,300.500	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	7,046	1,466.700	10,334,368.200	
SIEMENS INDIA LTD	4,533	2,681.350	12,154,559.550	
INFO EDGE INDIA LTD	4,591	3,978.650	18,265,982.150	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	29,658	850.250	25,216,714.500	
TECH MAHINDRA LTD	38,994	1,026.500	40,027,341.000	

	MINDTREE LTD	4,147	2,889.750	11,983,793.250	
	MARICO LTD	33,449	503.750	16,849,933.750	
	PAGE INDUSTRIES LTD	406	43,575.700	17,691,734.200	
	DLF LTD	46,735	340.400	15,908,594.000	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	217,531	218.800	47,595,782.800	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	32,222	715.700	23,061,285.400	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,483	12,003.100	29,803,697.300	
	BAJAJ AUTO LTD	4,501	3,825.000	17,216,325.000	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	27,088	575.200	15,581,017.600	
	ADANI POWER LTD	47,501	271.550	12,898,896.550	
	MUTHOOT FINANCE LTD	8,518	1,035.600	8,821,240.800	
	COAL INDIA LTD	99,415	189.800	18,868,967.000	
	INDUS TOWERS LTD	47,485	209.400	9,943,359.000	
	PI INDUSTRIES LTD	4,860	2,752.350	13,376,421.000	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	3,401	4,067.850	13,834,757.850	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	21,144	1,921.000	40,617,624.000	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	64,690	545.350	35,278,691.500	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	10,214	582.050	5,945,058.700	
	BANDHAN BANK LTD	37,750	271.900	10,264,225.000	
	ADANI TOTAL GAS LTD	18,226	2,540.800	46,308,620.800	
	GODREJ PROPERTIES LTD	9,674	1,302.550	12,600,868.700	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	27,892	630.950	17,598,457.400	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	15,935	851.150	13,563,075.250	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	16,598	589.000	9,776,222.000	
	ZOMATO LTD	113,629	54.800	6,226,869.200	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	16,178	585.250	9,468,174.500	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	18,255	2,545.900	46,475,404.500	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	10,877	3,941.700	42,873,870.900	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	16,327	1,276.200	20,836,517.400	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	24,128	518.250	12,504,336.000	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	6,469	1,677.900	10,854,335.100	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	30,238	1,146.900	34,679,962.200	
インド・ルピー　小計		5,981,870		4,494,957,197.850 (7,776,275,952)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	571,700	1,715.000	980,465,500.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,989,200	785.000	1,561,522,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	122,201	27,450.000	3,354,417,450.000	

	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	304,400	7,025.000	2,138,410,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	485,400	4,890.000	2,373,606,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,375,400	5,975.000	8,218,015,000.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	3,384,800	4,010.000	13,573,048,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	473,200	5,750.000	2,720,900,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	31,675.000	1,026,270,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	190,800	7,275.000	1,388,070,000.000	
	BANK MANDIRI	1,238,400	7,475.000	9,257,040,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	4,480,700	4,200.000	18,818,940,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	535,300	7,600.000	4,068,280,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,478,000	1,670.000	2,468,260,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	164,300	6,675.000	1,096,702,500.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	3,660,600	7,150.000	26,173,290,000.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	168,900	5,300.000	895,170,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	934,100	2,830.000	2,643,503,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	165,000	9,425.000	1,555,125,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	533,300	2,980.000	1,589,234,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	991,300	1,900.000	1,883,470,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	1,656,400	1,180.000	1,954,552,000.000	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK PT	490,100	1,760.000	862,576,000.000	
	BANK JAGO TBK PT	270,200	9,150.000	2,472,330,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	868,982	3,890.000	3,380,339,980.000	
インドネシア・ルピア　小計		26,565,083		116,453,536,430.000 (1,059,727,182)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	8,232	103.000	847,896.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	13.230	78,586.200	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	134.200	402,600.000	
	BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	26.100	78,300.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	9.120	109,440.000	

JIANGXI GANFENG LITHIUM CO LTD	7,280	108.480	789,734.400	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	5,200	9.870	51,324.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	7,540	19.520	147,180.800	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.920	227,672.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	119.900	143,880.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	3,900	30.890	120,471.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	22.410	168,075.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	222.910	468,111.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	31.790	168,487.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	21.760	302,464.000	
GEM CO LTD	29,100	9.180	267,138.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	127.290	330,954.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	47.800	329,820.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	4.600	85,560.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	6,500	104.500	679,250.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	12.710	152,456.450	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	33.200	196,012.800	
ZHEJIANG NHU CO LTD	10,612	21.390	226,990.680	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	25.110	66,792.600	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	19.010	125,466.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	32.470	165,597.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	9.910	25,766.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	4,600	61.730	283,958.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	44.720	465,088.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	11,000	12.060	132,660.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	19,600	62.840	1,231,664.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	7,200	112.160	807,552.000	

SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	12.970	233,460.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	13.120	236,160.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	10.200	114,240.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.940	100,394.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	6.000	188,400.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	13.940	78,064.000	
JINKE PROPERTIES GROUP CO LTD	14,300	2.710	38,753.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	8.810	24,051.300	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	2,600	19.740	51,324.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	22.760	177,528.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	40,650	14.560	591,864.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	43.250	259,500.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	2,600	206.210	536,146.000	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	25.540	91,177.800	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	9.050	114,935.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	6.420	55,212.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	5.410	198,547.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	21,681	43.240	937,486.440	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	27.950	301,860.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	784	30.500	23,912.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	18.330	126,477.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	5.430	207,426.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	37.990	186,151.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	8.890	136,017.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	5.860	123,060.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	45.700	342,750.000	

YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	37.900	189,500.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	6,200	3.240	20,088.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	19.800	130,680.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	28.850	282,730.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	6,600	240.970	1,590,402.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	11,100	64.430	715,173.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	7.810	116,759.500	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	6.720	118,944.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	14,200	59.800	849,160.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	13.680	81,259.200	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	14.270	106,282.960	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	91.310	191,751.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.650	242,592.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.690	124,267.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	27,154	34.640	940,614.560	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.450	149,875.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.640	473,432.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	17.440	347,056.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	15.830	302,353.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	6.070	23,066.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	42.600	502,680.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.470	230,698.000	
GOERTEK INC	13,300	33.070	439,831.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.000	127,800.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	31,200	34.060	1,062,672.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	12,400	11.500	142,600.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	47,400	4.750	225,150.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.600	158,480.000	

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	5.870	220,712.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	38,688	17.830	689,807.040	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.390	145,053.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	12,100	28.400	343,640.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	5,320	59.160	314,731.200	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	59,649	23.630	1,409,505.870	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	5,400	178.640	964,656.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	16,400	192.700	3,160,280.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	20,800	6.050	125,840.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	125,800	3.920	493,136.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	25,300	12.800	323,840.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	10,100	33.400	337,340.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.260	391,698.000	
PING AN BANK CO LTD	88,700	14.540	1,289,698.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	34,080	25.000	852,000.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	71,200	4.170	296,904.000	
CHINA VANKE CO LTD	31,900	19.280	615,032.000	
ZTE CORP	19,700	24.670	485,999.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	6.020	171,570.000	
WEICHAI POWER CO LTD	16,000	12.920	206,720.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	35.110	147,462.000	
GF SECURITIES CO LTD	21,900	17.440	381,936.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	14.580	307,638.000	
BYD CO LTD	7,700	338.000	2,602,600.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.990	170,159.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	62.510	603,846.600	

SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	51.200	267,264.000	
LB GROUP CO LTD	11,000	21.230	233,530.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	16.770	300,183.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	65.560	137,676.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	27.180	318,006.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	51.500	149,350.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	20.890	167,120.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,300	305.000	701,500.000	
JIANGXI ZHENGBANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	7.570	27,252.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	10.080	303,408.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	8.150	278,730.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	5.110	292,803.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.540	75,147.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,000	238.330	476,660.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	9.860	153,816.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	69.860	461,076.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	54.200	32,520.000	
NINESTAR CORP	5,700	52.700	300,390.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	7,020	17.370	121,937.400	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.810	128,778.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	8.600	103,200.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	58.400	93,440.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,300	302.510	393,263.000	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	171.030	307,854.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	5.410	81,691.000	
SF HOLDING CO LTD	17,200	54.380	935,336.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	112.800	203,040.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	6.170	145,612.000	

BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	104.540	418,160.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	92.910	232,275.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	63,790	6.090	388,481.100	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	8.130	316,257.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	109.000	250,700.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	13,600	27.670	376,312.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	5,880	84.290	495,625.200	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	7,000	28.450	199,150.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	20,200	21.260	429,452.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	87.380	270,878.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.830	243,675.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,872	31.110	58,237.920	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	11,500	11.960	137,540.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	69.380	256,706.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	31.610	164,372.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	10,913	25.060	273,479.780	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	72.420	228,123.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,200	241.920	774,144.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	73.490	198,423.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	52.340	162,254.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	135.290	284,109.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	91.180	831,196.880	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.230	135,185.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	30.010	90,030.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	840	92.270	77,506.800	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	1,800	154.280	277,704.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	53.430	144,261.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	1,330	49.290	65,555.700	

BGI GENOMICS CO LTD	1,300	69.500	90,350.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	60.270	180,810.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	43.810	140,192.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.590	96,393.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	114.900	275,760.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	16.350	348,255.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	82.020	155,838.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	8.110	79,478.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	9.740	546,414.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	5,300	316.660	1,678,298.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.530	116,715.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	1,200	98.200	117,840.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	54.500	221,270.000	
SG MICRO CORP	1,350	184.010	248,413.500	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	9,600	541.000	5,193,600.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC	3,016	135.280	408,004.480	
WUXI APPTEC CO LTD	11,872	110.200	1,308,294.400	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	36.730	378,319.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	76.510	558,523.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	130.200	333,312.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	14.220	422,334.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	105.500	522,225.000	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	399.230	239,538.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	93.430	102,773.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	89.450	348,855.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	99.500	179,100.000	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	125.510	376,530.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	56.190	303,426.000	

NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	700	143.190	100,233.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	3,800	161.250	612,750.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	167.000	397,460.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	31.770	406,656.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	3.260	372,618.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	5.520	390,264.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	29.490	315,543.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	9.660	239,568.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	156.000	196,560.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	77.000	223,300.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	168,100	4.860	816,966.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	392.220	313,776.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	477.000	457,920.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	107,700	5.300	570,810.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	72.280	166,244.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	215.820	302,148.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	52.380	319,518.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	55.310	88,496.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,440	24.400	35,136.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	170.490	375,078.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	8,680	76.500	664,020.000	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	7.330	260,948.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	2,755	159.540	439,532.700	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	600	153.170	91,902.000	

CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	43.730	327,975.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	800	581.000	464,800.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	83.180	266,176.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,047	182.180	372,922.460	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	11,000	22.360	245,960.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	637	382.980	243,958.260	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	66,000	2.340	154,440.000	
PETROCHINA CO LTD	100,600	5.190	522,114.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	218,800	4.770	1,043,676.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	289,900	3.030	878,397.000	
BANK OF CHINA LTD	114,800	3.300	378,840.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	143,200	4.080	584,256.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	10,000	30.250	302,500.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	25,400	33.450	849,630.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	86,600	39.810	3,447,546.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	46,900	45.820	2,148,958.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	91,100	19.310	1,759,141.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	102,000	7.880	803,760.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	138,200	3.680	508,576.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	25,700	18.560	476,992.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	5,100	1,999.000	10,194,900.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	126,500	4.980	629,970.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	50,100	20.670	1,035,567.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	22,300	22.880	510,224.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.750	220,225.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	97,500	24.200	2,359,500.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.060	500,556.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	2.960	636,696.000	

CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	159,200	5.390	858,088.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.620	533,910.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.120	361,984.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	21,800	36.340	792,212.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.510	396,429.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	87,800	3.420	300,276.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	83,000	6.190	513,770.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	12,500	35.000	437,500.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	33,500	13.940	466,990.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	22,500	8.080	181,800.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	35.950	420,615.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	45,100	16.220	731,522.000	
CRRC CORP LTD	77,000	5.230	402,710.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	30,652	38.450	1,178,569.400	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	16,800	34.020	571,536.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	22,600	13.700	309,620.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	92,100	6.280	578,388.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	4,600	31.170	143,382.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	27,700	26.180	725,186.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	28,700	19.010	545,587.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.160	421,408.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	5.710	320,902.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,900	50.610	399,819.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	9.650	254,760.000	
GEMDALE CORP	10,600	12.720	134,832.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	12,400	94.300	1,169,320.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.310	339,197.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	86,400	9.070	783,648.000	

FOUNDER SECURITIES CO LTD	18,300	6.610	120,963.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	11.580	365,928.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	24,144	28.570	689,794.080	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.110	122,478.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	8,700	211.970	1,844,139.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	13,800	16.670	230,046.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.360	525,100.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	1,600	98.720	157,952.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.260	81,500.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	26,100	4.670	121,887.000	
AIR CHINA LTD	28,400	10.110	287,124.000	
TBEA CO LTD	18,600	28.430	528,798.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	45,700	3.490	159,493.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	71,300	7.570	539,741.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	17,700	18.760	332,052.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	51.520	170,016.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	30.810	212,589.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	17.310	257,919.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.860	132,398.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	8,300	23.030	191,149.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	8.700	128,760.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	13.810	327,297.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.200	207,480.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	12,600	52.300	658,980.000	
BANK OF NANJING CO LTD	29,100	10.060	292,746.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	11.810	89,756.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	53,570	14.840	794,978.800	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	64,100	5.510	353,191.000	

INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	28,200	6.770	190,914.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	18.010	362,361.200	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	36.640	278,464.000	
BBMG CORP	54,200	2.610	141,462.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	7,500	37.730	282,975.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	5.080	196,088.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	16.550	248,564.450	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	14.040	108,108.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	7,896	43.700	345,055.200	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	20.620	335,075.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	22.760	75,108.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	32,700	6.690	218,763.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.990	176,410.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	42.150	429,930.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	11.620	219,618.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.760	173,056.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	45.510	209,346.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.710	112,728.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.610	181,634.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	7.570	148,372.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	2,900	338.490	981,621.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	4,680	300.770	1,407,603.600	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	14.530	17,436.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	8.670	216,750.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	13.650	277,095.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	12.830	248,902.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.520	92,224.000	

BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	5,400	25.120	135,648.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	24.600	309,960.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	8.880	231,768.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	32.490	136,458.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE CO LTD	33,900	10.720	363,408.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	22.520	131,291.600	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.390	146,202.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	4,500	16.570	74,565.000	
TONGWEI CO LTD	18,500	63.730	1,179,005.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	6,830	53.590	366,019.700	
JCET GROUP CO LTD	10,900	26.200	285,580.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	50.870	345,916.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	135.480	338,700.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	59.620	315,986.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	18.670	104,552.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	27.920	292,880.800	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	205.100	348,670.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	15.760	319,076.960	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	2,900	31.900	92,510.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	5,924	57.200	338,852.800	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	11.520	225,792.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	15.990	313,404.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	15.190	238,483.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	125.670	213,639.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	45.140	221,186.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	42.460	237,776.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,400	140.000	196,000.000	

YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	205.380	184,842.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	283.190	226,552.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	67.290	174,954.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	135.680	135,680.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	57.700	409,670.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	67.900	753,690.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	121,500	6.390	776,385.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	32,268	62.180	2,006,424.240	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	14.070	178,689.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	170.000	306,000.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	35,151	20.030	704,074.530	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	14,216	87.090	1,238,071.440	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	46.770	233,850.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	14.780	17,736.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	42.310	296,170.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.540	112,728.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	71.000	497,000.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	15.170	617,419.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	59,700	6.830	407,751.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	55.420	188,428.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	59.630	316,039.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	125.500	251,000.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.030	584,896.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	23,600	14.480	341,728.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	27.170	309,738.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	19.570	39,140.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	9,600	19.720	189,312.000	

	JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	1,950	52.550	102,472.500	
	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	9.300	282,720.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	163.630	130,904.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	3,900	18.190	70,941.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,480	62.690	343,541.200	
	TOLY BREAD CO LTD	7,056	15.800	111,484.800	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	52.630	150,521.800	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	48.550	142,737.000	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	29.710	336,020.100	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	19,400	9.290	180,226.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.030	240,480.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	51.350	231,075.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	23.010	246,207.000	
オフショア・人民元　小計		9,236,877		165,500,987.180 (3,374,863,030)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	306,211	19.210	5,882,313.310	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	137,382	6.595	906,034.290	
	OOREDOO QSC	43,816	7.760	340,012.160	
	QATAR FUEL QSC	29,591	17.060	504,822.460	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	27,176	17.730	481,830.480	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	47,292	11.000	520,212.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	101,419	15.400	1,561,852.600	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	113,117	23.520	2,660,511.840	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	145,382	3.770	548,090.140	
	MASRAF AL RAYAN	390,973	3.990	1,559,982.270	
	BARWA REAL ESTATE CO	138,449	3.441	476,403.000	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	315,284	2.580	813,432.720	
カタール・リアル　小計		1,796,092		16,255,497.270 (605,029,608)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	339,377	0.845	286,773.560	

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	140,459	0.591	83,011.260	
	GULF BANK KSCP	107,039	0.321	34,359.510	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	478,921	1.061	508,135.180	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	95,997	0.774	74,301.670	
	MABANEE CO KPSC	33,481	0.774	25,914.290	
	BOUBYAN BANK KSCP	93,708	0.779	72,998.530	
クウェート・ディナール　小計		1,288,982		1,085,494.000 (482,686,617)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	28,480	22,180.000	631,686,400.000	
	ECOPETROL SA	312,678	2,300.000	719,159,400.000	
	BANCOLOMBIA SA	17,683	35,490.000	627,569,670.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	32,245	32,500.000	1,047,962,500.000	
コロンビア・ペソ　小計		391,086		3,026,377,970.000 (93,817,717)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	17,311	47.950	830,062.450	
	JARIR MARKETING CO	3,870	157.000	607,590.000	
	ETIHAD ETISALAT CO	26,902	34.800	936,189.600	
	SAUDI BRITISH BANK	63,576	41.550	2,641,582.800	
	AL RAJHI BANK	129,980	81.600	10,606,368.000	
	ARAB NATIONAL BANK	41,665	30.000	1,249,950.000	
	BANK ALBILAD	33,589	40.900	1,373,790.100	
	BANK AL-JAZIRA	26,450	21.820	577,139.000	
	BANQUE SAUDI FRANSI	40,443	48.300	1,953,396.900	
	RIYAD BANK	91,717	33.400	3,063,347.800	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	31,451	19.520	613,923.520	
	SAUDI TELECOM CO	39,225	98.000	3,844,050.000	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	14,886	133.000	1,979,838.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	59,330	97.600	5,790,608.000	
	SAUDI ELECTRICITY CO	59,259	23.940	1,418,660.460	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	22,202	26.750	593,903.500	
	SAVOLA GROUP	15,273	34.750	530,736.750	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	26,550	15.020	398,781.000	
	ALMARAI CO JSC	16,797	51.500	865,045.500	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	2,116	180.600	382,149.600	
	EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	9.520	269,520.720	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	22,410	47.350	1,061,113.500	
	ADVANCED PETROCHEMICAL CO	10,008	47.600	476,380.800	

	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	52,637	14.680	772,711.160	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	31,011	10.840	336,159.240	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	12,965	17.700	229,480.500	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	35,907	11.280	405,030.960	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	4,552	158.000	719,216.000	
	ALINMA BANK	67,194	33.300	2,237,560.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	58,989	48.700	2,872,764.300	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	3,258	225.000	733,050.000	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	159,453	37.950	6,051,241.350	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	5,877	191.000	1,122,507.000	
	ACWA POWER CO	4,910	147.600	724,716.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	2,088	192.800	402,566.400	
	ELM CO	1,519	260.000	394,940.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	145,313	67.400	9,794,096.200	
サウジアラビア・リアル　小計		1,408,994		68,860,167.310 (2,507,198,692)	
タイ・バーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	90,400	32.500	2,938,000.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	221,800	14.900	3,304,820.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	81,200	38.500	3,126,200.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	685,755	4.720	3,236,763.600	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	18,400	178.500	3,284,400.000	
	SHIN CORP PCL	72,800	70.750	5,150,600.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	246,300	26.750	6,588,525.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	82,400	204.000	16,809,600.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	413,820	13.000	5,379,660.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	18,900	325.000	6,142,500.000	
	PTT PCL	646,700	34.500	22,311,150.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	166,500	15.800	2,630,700.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	59,100	55.750	3,294,825.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	647,000	8.250	5,337,750.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	49,850	379.000	18,893,150.000	

	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	276,100	70.750	19,534,075.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	130,400	62.000	8,084,800.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	715,700	26.750	19,144,975.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	27,700	188.500	5,221,450.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	218,110	33.500	7,306,685.000	
	THAI OIL PCL NVDR	78,200	51.250	4,007,750.000	
	CP ALL PCL NVDR	393,400	63.500	24,980,900.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	589,700	8.650	5,100,905.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	94,845	159.000	15,080,355.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	113,322	46.250	5,241,142.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	149,708	45.500	6,811,714.000	
	JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	38,600	68.500	2,644,100.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	112,400	78.250	8,795,300.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	598,300	8.650	5,175,295.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	56,600	36.500	2,065,900.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	187,300	47.250	8,849,925.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	94,400	34.500	3,256,800.000	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	105,300	16.700	1,758,510.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	475,000	4.860	2,308,500.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	112,033	35.250	3,949,163.250	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	86,000	53.750	4,622,500.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	35,900	47.000	1,687,300.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	196,600	25.750	5,062,450.000	
	SCB X PCL NVDR	63,800	98.750	6,300,250.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	24,000	113.000	2,712,000.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	57,900	42.500	2,460,750.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	49,100	65.750	3,228,325.000	
タイ・バーツ　小計		8,581,343		293,820,463.350 (1,116,517,761)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,530	639.000	2,894,670.000	
	CEZ	11,004	1,007.000	11,081,028.000	
	MONETA MONEY BANK AS	25,508	86.000	2,193,688.000	
チェコ・コルナ　小計		41,042		16,169,386.000	

				(91,006,155)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	4,435,043	36.910	163,697,437.130	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	3,095	27,250.000	84,338,750.000	
	BANCO DE CHILE	3,180,097	83.000	263,948,051.000	
	EMPRESAS CMPC SA	63,023	1,690.000	106,508,870.000	
	EMPRESAS COPEC SA	28,473	7,000.000	199,311,000.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	5,900.000	62,044,400.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	886,464	90.000	79,781,760.000	
	ENEL AMERICAS SA	1,435,310	87.200	125,159,032.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	9,589	84,142.000	806,837,638.000	
	FALABELLA SA	48,873	1,988.000	97,159,524.000	
	CENCOSUD SA	103,148	1,235.000	127,387,780.000	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	21.000	50,729,742.000	
チリ・ペソ　小計		12,619,333		2,166,903,984.130 (304,640,697)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	224,367	8.090	1,815,129.030	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	44,898	22.200	996,735.600	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	89,195	26.520	2,365,451.400	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	4,668	274.000	1,279,032.000	
	KOC HOLDING AS	46,635	35.620	1,661,138.700	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	74,182	21.520	1,596,396.640	
	TURK HAVA YOLLARI	32,175	49.540	1,593,949.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	100,427	17.410	1,748,434.070	
	TURKIYE IS BANKASI	202,518	4.490	909,305.820	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	6,976	243.100	1,695,865.600	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	61,411	18.680	1,147,157.480	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	34,730	85.400	2,965,942.000	
トルコ・リラ　小計		922,182		19,774,537.840 (156,416,594)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	8,272	7,195.000	59,517,040.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	27,041	2,914.000	78,797,474.000	
	OTP BANK NYRT	15,864	8,470.000	134,368,080.000	
ハンガリー・フォリント　小計		51,177		272,682,594.000 (93,199,093)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	456,700	25.900	11,828,530.000	

	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	113,330	51.200	5,802,496.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	118,070	87.000	10,272,090.000	
	AYALA CORP	15,373	643.000	9,884,839.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,995	2,294.000	4,576,530.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	72,460	185.000	13,405,100.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	216,890	49.300	10,692,677.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	31,110	217.000	6,750,870.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	107,365	49.700	5,336,040.500	
	BDO UNIBANK INC	134,413	118.800	15,968,264.400	
	PLDT INC	5,260	1,690.000	8,889,400.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	803,475	36.900	29,648,227.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	59,590	119.500	7,121,005.000	
	SM INVESTMENTS CORP	16,483	839.000	13,829,237.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	889,900	3.700	3,292,630.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,210	350.000	5,673,500.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	492.800	3,252,972.800	
	AC ENERGY CORP	462,519	8.180	3,783,405.420	
	MONDE NISSIN CORP	445,400	13.040	5,808,016.000	
	CONVERGE INFORMATION AND COMMUNICATIONS TECHNOLOGY SOLUTIONS INC	132,900	21.800	2,897,220.000	
フィリピン・ペソ　小計		4,106,044		178,713,050.620 (435,809,645)	
ブラジル・レアル	BRF SA	41,392	15.680	649,026.560	
	VALE SA	266,389	75.400	20,085,730.600	
	RAIA DROGASIL SA	70,800	19.960	1,413,168.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	17,050	44.820	764,181.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	69,800	43.950	3,067,710.000	
	BANCO DO BRASIL SA	60,400	33.450	2,020,380.000	
	ITAUSA SA	305,488	8.390	2,563,044.320	
	GERDAU SA	78,030	23.380	1,824,341.400	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	247,810	31.200	7,731,672.000	
	VIBRA ENERGIA SA	77,300	16.570	1,280,861.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	321,612	28.800	9,262,425.600	
	CCR SA	78,720	12.140	955,660.800	
	WEG SA	109,344	27.270	2,981,810.880	
	BANCO BRADESCO SA PREF	361,602	17.390	6,288,258.780	
	BANCO BRADESCO SA	100,592	14.470	1,455,566.240	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	50,506	15.050	760,115.300	
	SUZANO SA	51,175	47.590	2,435,418.250	

	CPFL ENERGIA SA	16,300	31.290	510,027.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	323,247	22.910	7,405,588.770	
	AMERICANAS SA	46,471	15.800	734,241.800	
	BRASKEM SA	12,300	34.480	424,104.000	
	ENGIE BRASIL SA	10,987	42.260	464,310.620	
	LOCALIZA RENT A CAR	39,789	55.850	2,222,215.650	
	LOJAS RENNER SA	68,520	24.780	1,697,925.600	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	49,404	11.930	589,389.720	
	COSAN SA	78,100	17.740	1,385,494.000	
	TOTVS SA	34,300	24.920	854,756.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	67,700	22.940	1,553,038.000	
	JBS SA	55,500	31.060	1,723,830.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	96,362	10.280	990,601.360	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	25,198	42.540	1,071,922.920	
	HYPERA SA	26,000	39.930	1,038,180.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	406,548	11.440	4,650,909.120	
	MAGAZINE LUIZA SA	208,600	2.620	546,532.000	
	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	46,800	21.760	1,018,368.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	32,728	47.490	1,554,252.720	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	45,000	25.340	1,140,300.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	312,661	6.340	1,982,270.740	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	29,900	17.470	522,353.000	
	AMBEV SA	307,495	14.310	4,400,253.450	
	NATURA &CO HOLDING SA	63,000	14.290	900,270.000	
	TIM SA	54,900	13.510	741,699.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	27,200	29.820	811,104.000	
	RUMO SA	82,200	16.080	1,321,776.000	
ブラジル・レアル　小計		4,875,220		107,795,084.200 (2,798,090,898)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	634	235.400	149,243.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	10,027	111.650	1,119,514.550	
	BANK PEKAO SA	11,752	81.680	959,903.360	
	ORANGE POLSKA SA	52,852	6.536	345,440.670	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	21,150	73.360	1,551,564.000	
	LPP SA	76	10,320.000	784,320.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,326	235.800	548,470.800	
	CD PROJEKT RED SA	4,466	103.800	463,570.800	

	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	59,681	27.700	1,653,163.700	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	113,812	5.898	671,263.170	
	CYFROWY POLSAT SA	19,008	21.920	416,655.360	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	52,192	10.345	539,926.240	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	41,019	30.350	1,244,926.650	
	DINO POLSKA SA	3,219	336.400	1,082,871.600	
	ALLEGRO.EU SA	24,068	26.875	646,827.500	
ポーランド・ズロチ　小計		416,282		12,177,662.000 (353,796,396)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	104,400	3.880	405,072.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	463,500	5.140	2,382,390.000	
	DIGI.COM BHD	208,500	3.490	727,665.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	47,920	6.310	302,375.200	
	RHB BANK BHD	100,280	5.640	565,579.200	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	31,700	7.160	226,972.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	332,800	0.990	329,472.000	
	GENTING BHD	147,700	4.520	667,604.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	18.500	334,036.000	
	HONG LEONG BANK BHD	43,208	20.220	873,665.760	
	IOI CORP BHD	168,913	3.800	641,869.400	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	27,000	20.620	556,740.000	
	MALAYAN BANKING BHD	305,875	8.620	2,636,642.500	
	MISC BHD	91,580	6.790	621,828.200	
	NESTLE MALAYSIA BHD	4,100	133.700	548,170.000	
	PPB GROUP BHD	42,860	15.600	668,616.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	21,400	21.900	468,660.000	
	PETRONAS GAS BHD	52,000	16.360	850,720.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	205,100	2.830	580,433.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	59,500	5.250	312,375.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	168,050	7.920	1,330,956.000	
	QL RESOURCES BHD	75,050	5.260	394,763.000	
	DIALOG GROUP BHD	278,044	2.020	561,648.880	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	956,450	4.400	4,208,380.000	
	SIME DARBY BERHAD	200,700	2.180	437,526.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	105,800	2.620	277,196.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	211,200	2.740	578,688.000	
	MAXIS BHD	167,000	3.370	562,790.000	
	INARI AMERTRON BHD	156,300	2.670	417,321.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	167,100	8.470	1,415,337.000	

	IHH HEALTHCARE BHD	117,100	6.360	744,756.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	253,300	4.280	1,084,124.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	159,100	4.070	647,537.000	
	MR DIY GROUP M BHD	158,400	2.090	331,056.000	
マレーシア・リンギット　小計		5,649,986		27,692,964.140 (853,779,623)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	201,200	14.950	3,007,940.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	85,600	70.600	6,043,360.000	
	GRUMA SAB DE CV	15,765	227.110	3,580,389.150	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	16,360	146.960	2,404,265.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	29,000	77.130	2,236,770.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	171,700	113.730	19,527,441.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	66,825	48.680	3,253,041.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,335	191.700	1,597,819.500	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	103,000	26.410	2,720,230.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	13,035	395.100	5,150,128.500	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	212,452	84.830	18,022,303.160	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	1,894,478	20.310	38,476,848.180	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	149,200	33.370	4,978,804.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	28,700	135.990	3,902,913.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	343,400	68.560	23,543,504.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	24,740	292.610	7,239,171.400	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	77,300	23.940	1,850,562.000	
メキシコ・ペソ　小計		3,441,090		147,535,490.490 (984,076,475)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	129,079	0.800	103,263.200	
	NATIONAL BANK OF GREECE	42,536	3.026	128,713.930	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	14,275	16.150	230,541.250	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	164,751	0.790	130,153.290	
	MYTILINEOS HOLDINGS	7,033	13.680	96,211.440	
	OPAP SA	12,831	13.850	177,709.350	
	JUMBO SA	6,996	13.950	97,594.200	
	PUBLIC POWER CORP	13,672	5.070	69,317.040	
ユーロ　小計		394,303		1,033,503.700	

				(143,233,278)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,361	132,000.000	179,652,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,014	23,550.000	118,079,700.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,226	86,400.000	192,326,400.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,160	196,500.000	424,440,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,097	58,200.000	180,245,400.000	
	COWAY CO LTD	3,558	64,900.000	230,914,200.000	
	KT&G CORP	6,998	80,700.000	564,738,600.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	63,700.000	99,180,900.000	
	CJ CORP	1,001	77,700.000	77,777,700.000	
	KAKAO CORP	20,613	71,800.000	1,480,013,400.000	
	CJ ENM CO LTD	761	95,800.000	72,903,800.000	
	SK TELECOM CO LTD	1,988	54,000.000	107,352,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	18,739	6,470.000	121,241,330.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,123	373,500.000	419,440,500.000	
	LG UPLUS CORP	14,448	12,300.000	177,710,400.000	
	DOOSAN ENERBILITY	27,596	18,550.000	511,905,800.000	
	LG H&H CO LTD	665	714,000.000	474,810,000.000	
	LG CHEM LTD	3,318	540,000.000	1,791,720,000.000	
	LG CHEM LTD	499	254,500.000	126,995,500.000	
	LG H&H CO LTD	102	330,500.000	33,711,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	30,618	36,250.000	1,109,902,500.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	18,660	25,100.000	468,366,000.000	
	S-OIL CORP	3,203	93,000.000	297,879,000.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	7,252	34,600.000	250,919,200.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	17,730	4,665.000	82,710,450.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	4,220	33,650.000	142,003,000.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,740	109,000.000	189,660,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,038	180,000.000	186,840,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	2,459	69,700.000	171,392,300.000	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	2,944	83,300.000	245,235,200.000	
	HYUNDAI MOBIS	4,052	204,500.000	828,634,000.000	
	SK HYNIX INC	36,324	94,800.000	3,443,515,200.000	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	5,807	39,550.000	229,666,850.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	1,515	87,000.000	131,805,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	9,213	178,000.000	1,639,914,000.000	
	HYUNDAI STEEL CO	5,729	32,750.000	187,624,750.000	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	17,601	9,210.000	162,105,210.000	
	KIA CORPORATION	17,377	76,800.000	1,334,553,600.000	

KOREA ZINC CO LTD	617	463,000.000	285,671,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	17,026	22,200.000	377,977,200.000	
KOREAN AIR CO LTD	11,593	25,150.000	291,563,950.000	
CJ LOGISTICS	393	122,000.000	47,946,000.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,199	138,000.000	165,462,000.000	
HLB INC	5,992	40,300.000	241,477,600.000	
LG ELECTRONICS INC	7,139	92,000.000	656,788,000.000	
LG CORP	6,127	78,400.000	480,356,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	9,163	9,230.000	84,574,490.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	4,422	29,550.000	130,670,100.000	
NAVER CORP	8,664	249,000.000	2,157,336,000.000	
L&F CO LTD	1,405	214,200.000	300,951,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	2,661	61,600.000	163,917,600.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,234	37,800.000	84,445,200.000	
KANGWON LAND INC	6,830	25,450.000	173,823,500.000	
POSCO HOLDINGS INC	5,258	231,000.000	1,214,598,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	11,667	20,550.000	239,756,850.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	3,653	537,000.000	1,961,661,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	3,750	134,500.000	504,375,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	177,000.000	72,570,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	318,493	58,700.000	18,695,539,100.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	45,966	5,500.000	252,813,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	54,475	53,900.000	2,936,202,500.000	
YUHAN CORP	3,380	57,300.000	193,674,000.000	
HANON SYSTEMS	12,332	10,000.000	123,320,000.000	
GS HOLDINGS CORP	2,622	39,650.000	103,962,300.000	
LG DISPLAY CO LTD	15,215	15,250.000	232,028,750.000	
CELLTRION INC	6,755	182,500.000	1,232,787,500.000	
HANA FINANCIAL GROUP	19,929	37,200.000	741,358,800.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,138	180,000.000	204,840,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,017	79,400.000	80,749,800.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	99,000.000	101,475,000.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	2,499	32,550.000	81,342,450.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	5,182	60,200.000	311,956,400.000	
AMOREPACIFIC CORP	1,790	133,000.000	238,070,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	3,712	171,500.000	636,608,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	480	389,000.000	186,720,000.000	

	STX PAN OCEAN CO LTD	18,613	5,590.000	104,046,670.000	
	LG INNOTEK CO LTD	1,009	338,000.000	341,042,000.000	
	SK INC	2,536	208,500.000	528,756,000.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	26,148	47,000.000	1,228,956,000.000	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	4,341	49,450.000	214,662,450.000	
	ILJIN MATERIALS CO LTD	1,593	69,300.000	110,394,900.000	
	MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,277	26,600.000	60,568,200.000	
	HANMI PHARM CO LTD	545	322,500.000	175,762,500.000	
	SEEGENE INC	1,958	44,700.000	87,522,600.000	
	E-MART CO LTD	1,426	106,500.000	151,869,000.000	
	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	5,028	32,750.000	164,667,000.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	3,223	52,900.000	170,496,700.000	
	BGF RETAIL CO LTD	413	189,500.000	78,263,500.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	1,663	106,000.000	176,278,000.000	
	SK CHEMICALS CO LTD	613	102,000.000	62,526,000.000	
	NETMARBLE CORP	1,478	68,700.000	101,538,600.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	35,234	11,600.000	408,714,400.000	
	ECOPRO BM CO LTD	3,376	118,900.000	401,406,400.000	
	SD BIOSENSOR INC	2,353	43,900.000	103,296,700.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,002	78,800.000	157,757,600.000	
	KRAFTON INC	1,699	237,000.000	402,663,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,087	125,500.000	136,418,500.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	1,874	82,000.000	153,668,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	6,686	39,800.000	266,102,800.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	1,444	140,000.000	202,160,000.000	
	KAKAO GAMES CORP	2,243	49,000.000	109,907,000.000	
	HYBE CO LTD	1,036	164,500.000	170,422,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	1,408	388,000.000	546,304,000.000	
	KAKAOBANK CORP	8,354	31,300.000	261,480,200.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,052	138,000.000	145,176,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,501	132,500.000	331,382,500.000	
	ALTEOGEN INC	2,026	63,900.000	129,461,400.000	
	SAMSUNG C&T CORP	5,566	114,000.000	634,524,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,164	819,000.000	953,316,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	52,600.000	109,408,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	2,805	29,100.000	81,625,500.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	6,026	71,500.000	430,859,000.000	
韓国・ウォン　小計		1,075,399		64,370,656,900.000 (6,778,230,172)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	67,000	10.300	690,100.000	
	JIANGSU EXPRESS	90,000	7.440	669,600.000	

CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	152,000	4.600	699,200.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	6,400	122.680	785,152.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	87,500	34.950	3,058,125.000	
BEIJING ENTERPRISES	40,000	26.950	1,078,000.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	280,000	4.270	1,195,600.000	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	278,000	5.530	1,537,340.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	96,000	21.500	2,064,000.000	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	56,749	11.160	633,318.840	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	47,000	36.800	1,729,600.000	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	142,000	0.000	0.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	607,600	8.470	5,146,372.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	263,620	24.900	6,564,138.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	218,888	37.000	8,098,856.000	
CITIC LTD	392,000	8.290	3,249,680.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	164,000	4.990	818,360.000	
LENOVO GROUP LTD	486,000	7.150	3,474,900.000	
PETRO CHINA CO LTD	1,432,000	3.560	5,097,920.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	99,190	8.860	878,823.400	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	1,699,200	3.480	5,913,216.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	56,000	14.740	825,440.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	177,000	18.400	3,256,800.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	52,900	130.900	6,924,610.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	250,000	6.400	1,600,000.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	150,000	5.790	868,500.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	101,200	9.960	1,007,952.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	94,000	13.740	1,291,560.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	244,000	2.990	729,560.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	76,000	29.150	2,215,400.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	74,500	7.570	563,965.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	218,400	12.520	2,734,368.000	

KINGBOARD HOLDINGS LTD	42,500	29.300	1,245,250.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	406,000	17.380	7,056,280.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	63,700	38.000	2,420,600.000	
BYD CO LTD	54,000	320.800	17,323,200.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	118,000	7.320	863,760.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	680,000	0.730	496,400.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	283,592	4.490	1,273,328.080	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	170,000	7.800	1,326,000.000	
MMG LTD	184,000	2.810	517,040.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	9,000	223.200	2,008,800.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	469,788	8.290	3,894,542.520	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	135,000	4.590	619,650.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	123,200	17.080	2,104,256.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	204,000	14.600	2,978,400.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	510,000	12.620	6,436,200.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	375,000	9.220	3,457,500.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	188,800	9.550	1,803,040.000	
WEICHAI POWER CO LTD	127,440	12.880	1,641,427.200	
TINGYI HOLDING CORP	140,000	14.100	1,974,000.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	36,000	75.950	2,734,200.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	212,000	8.520	1,806,240.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	174,000	4.810	836,940.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	109,333	54.300	5,936,781.900	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	6.950	806,200.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	721,250	5.260	3,793,775.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	209,000	38.700	8,088,300.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	416,600	352.600	146,893,160.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	422,000	52.850	22,302,700.000	
LI NING CO LTD	156,500	71.900	11,252,350.000	

BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	280,000	2.380	666,400.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	349,000	5.250	1,832,250.000	
AIR CHINA / HONG KONG	132,000	6.690	883,080.000	
ZTE CORP	44,288	17.560	777,697.280	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	232,000	22.300	5,173,600.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	213,250	11.580	2,469,435.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	556,205	4.840	2,692,032.200	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	124,250	8.890	1,104,582.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	51,000	16.800	856,800.000	
BAIDU INC	149,050	150.000	22,357,500.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	6,389,530	5.190	33,161,660.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	55,400	87.300	4,836,420.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	194,000	5.890	1,142,660.000	
MINTH GROUP LTD	44,000	21.850	961,400.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	108,000	6.670	720,360.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	278,000	8.780	2,440,840.000	
BANK OF CHINA LTD	5,246,200	2.870	15,056,594.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	60,000	17.400	1,044,000.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	256,470	48.750	12,502,912.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	3,747,235	4.280	16,038,165.800	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	74,000	6.680	494,320.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	53,500	9.690	518,415.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	167,600	3.360	563,136.000	
CHINA COAL ENERGY CO	149,000	6.560	977,440.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	51,000	19.920	1,015,920.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	37,300	38.850	1,449,105.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	578,142	4.510	2,607,420.420	
CMOC GROUP LIMITED	237,000	4.160	985,920.000	
CHINA CITIC BANK-H	568,800	3.420	1,945,296.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	48,000	116.300	5,582,400.000	

ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80,600	99.150	7,991,490.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	20,000	20.300	406,000.000	
FOSUN INTERNATIONAL	184,528	7.110	1,311,994.080	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	306,000	2.120	648,720.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	218,000	5.100	1,111,800.000	
KINGSOFT CORP LTD	67,600	28.900	1,953,640.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	34,000	10.640	361,760.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	314,000	4.960	1,557,440.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	88,000	6.940	610,720.000	
DONGYUE GROUP	116,000	9.200	1,067,200.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	47,500	22.950	1,090,125.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	341,000	6.820	2,325,620.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	184,000	18.660	3,433,440.000	
CRRC CORP LTD - H	349,000	2.970	1,036,530.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	76,000	14.780	1,123,280.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	107,000	12.480	1,335,360.000	
SINOPHARM GROUP CO	99,200	19.720	1,956,224.000	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	125,000	4.080	510,000.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	136,000	5.460	742,560.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	186,527	7.940	1,481,024.380	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	150,500	8.670	1,304,835.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	224,000	15.580	3,489,920.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	46,600	13.240	616,984.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	107,200	4.410	472,752.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	60,000	8.460	507,600.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	126,500	35.150	4,446,475.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	59,700	19.880	1,186,836.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	472,656	2.670	1,261,991.520	

XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	48,000	14.080	675,840.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	74,000	11.220	830,280.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.460	615,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	1,901,000	2.700	5,132,700.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	37,500	55.050	2,064,375.000	
FAR EAST HORIZON LTD	103,000	6.490	668,470.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	44,600	22.150	987,890.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	131,000	16.780	2,198,180.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	98,000	3.330	326,340.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	194,000	5.330	1,034,020.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	554,000	2.380	1,318,520.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	32,000	32.700	1,046,400.000	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	289,120	3.230	933,857.600	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	216,500	4.040	874,660.000	
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	108,000	9.030	975,240.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	548,000	5.730	3,140,040.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	30,000	25.800	774,000.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	74,000	32.050	2,371,700.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	140,000	32.650	4,571,000.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	33,000	23.500	775,500.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	37,500	13.160	493,500.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	44,250	11.100	491,175.000	
CHINA TOWER CORP LTD	3,152,000	1.010	3,183,520.000	
XIAOMI CORP	1,023,000	13.460	13,769,580.000	
WUXI APPTEC CO LTD	22,712	115.200	2,616,422.400	
MEITUAN	273,400	192.300	52,574,820.000	

TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	71,200	16.180	1,152,016.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	76,000	16.980	1,290,480.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	324,000	12.220	3,959,280.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	75,500	36.800	2,778,400.000	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES GROUP LTD	62,000	8.250	511,500.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	640,000	1.200	768,000.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	36,000	23.800	856,800.000	
LOGAN GROUP COMPANY LTD	103,000	2.180	224,540.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	102,500	16.740	1,715,850.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	107,500	6.810	732,075.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	77.000	477,400.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	116,000	7.260	842,160.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	76,000	16.720	1,270,720.000	
CHINA FEIHE LTD	248,000	8.490	2,105,520.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,014,568	121.000	122,762,728.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	13,600	83.850	1,140,360.000	
JD.COM INC	134,435	245.800	33,044,123.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	125,000	23.400	2,925,000.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	50,000	19.420	971,000.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	117,700	86.600	10,192,820.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	151,000	27.750	4,190,250.000	
BILIBILI INC	12,680	212.400	2,693,232.000	
NETEASE INC	138,300	140.200	19,389,660.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	65,000	11.260	731,900.000	
GDS HOLDINGS LTD	61,700	31.400	1,937,380.000	
NONGFU SPRING CO LTD	117,000	45.500	5,323,500.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	77,650	63.300	4,915,245.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	22,000	49.450	1,087,900.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	43,000	38.350	1,649,050.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	8,800	97.450	857,560.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	106,561	19.300	2,056,627.300	

	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	116,300	18.120	2,107,356.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	32,800	33.150	1,087,320.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	37,000	25.650	949,050.000	
	CGN POWER CO LTD	609,000	2.030	1,236,270.000	
	GF SECURITIES CO LTD	68,200	10.280	701,096.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	39.750	1,558,200.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	92,400	10.780	996,072.000	
	3SBIO INC	90,500	6.120	553,860.000	
	CHINA LITERATURE LTD	28,400	35.400	1,005,360.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	31,000	27.900	864,900.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	146,500	4.180	612,370.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	105,000	9.220	968,100.000	
	BOC AVIATION LTD	16,400	66.200	1,085,680.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	41,100	25.550	1,050,105.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	74,000	16.120	1,192,880.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	108,000	15.840	1,710,720.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	240,000	80.000	19,200,000.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	264,000	2.670	704,880.000	
	GANFENG LITHIUM CO LTD	24,640	83.050	2,046,352.000	
香港・ドル　小計		57,092,097		906,117,537.620 (15,757,383,978)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	34,000	230.000	7,820,000.000	
	ACER INC	212,532	21.700	4,611,944.400	
	ASUSTEK COMPUTER INC	44,554	305.000	13,588,970.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	29,616	335.000	9,921,360.000	
	ASIA CEMENT CORP	149,928	43.850	6,574,342.800	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	62,000	71.800	4,451,600.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	45,000	108.000	4,860,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	84,000	157.500	13,230,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	175,858	76.200	13,400,379.600	
	EVA AIRWAYS CORP	164,000	32.100	5,264,400.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	48,760	160.500	7,825,980.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	308,208	17.300	5,331,998.400	
	CHINA AIRLINES	176,000	23.250	4,092,000.000	

CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	122,169	36.100	4,410,300.900	
CHINA STEEL CORP	803,058	29.350	23,569,752.300	
ADVANTECH CO LTD	27,675	331.000	9,160,425.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	296,304	21.900	6,489,057.600	
DELTA ELECTRONICS INC	126,663	227.500	28,815,832.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	83,000	49.650	4,120,950.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	247,427	124.500	30,804,661.500	
AUO CORP	563,194	15.550	8,757,666.700	
TAIWAN MOBILE CO LTD	112,800	103.000	11,618,400.000	
EVERGREEN MARINE CORP	173,820	92.700	16,113,114.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	196,824	31.350	6,170,432.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	28,768	176.500	5,077,552.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	13,322	425.500	5,668,511.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	37,285	300.000	11,185,500.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	280,633	85.000	23,853,805.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	230,594	70.100	16,164,639.400	
GIANT MANUFACTURING	20,151	228.000	4,594,428.000	
MEDIATEK INC	100,507	651.000	65,430,057.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	465,942	58.900	27,443,983.800	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	581,752	22.150	12,885,806.800	
HOTAI MOTOR CO LTD	19,000	594.000	11,286,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	114,000	84.800	9,667,200.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	619,146	19.800	12,259,090.800	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	524,941	44.800	23,517,356.800	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,046,011	12.900	13,493,541.900	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	824,798	28.300	23,341,783.400	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	827,225	102.000	84,376,950.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	717,495	35.050	25,148,199.750	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,220	1,870.000	11,631,400.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	692,132	15.900	11,004,898.800	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	912,345	8.510	7,764,055.950	
INVENTEC CO LTD	194,005	24.000	4,656,120.000	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	134,845	57.200	7,713,134.000	

SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	696,443	16.600	11,560,953.800	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,185,048	23.850	28,263,394.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	689,806	25.500	17,590,053.000	
NAN YA PLASTICS CORP	314,828	65.000	20,463,820.000	
POU CHEN CORP	168,990	28.700	4,850,013.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	311,297	68.800	21,417,233.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	39,392	275.500	10,852,496.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,480	89.400	6,479,712.000	
E INK HOLDINGS INC	59,000	170.500	10,059,500.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	76,224	70.900	5,404,281.600	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	94,899	52.500	4,982,197.500	
TAIWAN CEMENT CORP	355,171	40.800	14,490,976.800	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,643,083	467.000	767,319,761.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	784,525	39.700	31,145,642.500	
WAN HAI LINES LTD	39,500	120.500	4,759,750.000	
WALSIN LIHWA CORP	149,000	33.250	4,954,250.000	
WINBOND ELECTRONICS CORP	220,000	20.250	4,455,000.000	
YAGEO CORP	29,160	308.500	8,995,860.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	120,000	86.500	10,380,000.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	138,000	28.600	3,946,800.000	
INNOLUX CORPORATION	684,345	12.250	8,383,226.250	
WPG HOLDINGS CO LTD	105,203	53.000	5,575,759.000	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	15,000	262.000	3,930,000.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	4,000	1,050.000	4,200,000.000	
PEGATRON CORP	134,554	57.400	7,723,399.600	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	9,371	981.000	9,192,951.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	23,000	171.500	3,944,500.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	90,922	192.500	17,502,485.000	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	5,000	1,170.000	5,850,000.000	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	1,055.000	2,110,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	49,385	96.000	4,740,960.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	624,393	26.000	16,234,218.000	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	237,993	49.800	11,852,051.400	

	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	4,000	1,455.000	5,820,000.000	
	WIWYNN CORP	5,000	669.000	3,345,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	217,903	76.100	16,582,418.300	
	SILERGY CORP	5,000	2,485.000	12,425,000.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	184,000	40.550	7,461,200.000	
	MOMO.COM INC	3,600	755.000	2,718,000.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	433.500	5,635,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	11,000	277.000	3,047,000.000	
台湾・ドル　小計		22,294,022		1,819,812,946.650 (8,334,197,352)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	7,163	226.170	1,620,055.710	
	BIDVEST GROUP LTD	19,373	215.570	4,176,237.610	
	CLICKS GROUP LTD	15,256	283.070	4,318,515.920	
	DISCOVERY LTD	33,035	130.350	4,306,112.250	
	GOLD FIELDS LTD	61,862	158.550	9,808,220.100	
	REMGRO LTD	34,581	130.900	4,526,652.900	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	20,765	120.830	2,509,034.950	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	36,308	56.600	2,055,032.800	
	EXXARO RESOURCES LTD	15,424	199.010	3,069,530.240	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	5,750	1,991.080	11,448,710.000	
	MTN GROUP LTD	114,341	144.490	16,521,131.090	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	29,196	257.460	7,516,802.160	
	FIRSTRAND LTD	335,817	63.930	21,468,780.810	
	NASPERS LTD	14,541	2,656.500	38,628,166.500	
	NEDBANK GROUP LTD	30,397	207.370	6,303,425.890	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3,490	1,512.420	5,278,345.800	
	SASOL LTD	38,668	375.270	14,510,940.360	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	34,039	207.510	7,063,432.890	
	MR PRICE GROUP LTD	17,098	177.640	3,037,288.720	
	STANDARD BANK GROUP LTD	89,166	154.160	13,745,830.560	
	SPAR GROUP LTD/THE	15,257	137.240	2,093,870.680	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	67,813	54.880	3,721,577.440	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	26,382	146.920	3,876,043.440	
	ABSA GROUP LTD	53,264	157.230	8,374,698.720	
	SANLAM LTD	117,672	53.560	6,302,512.320	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	56,479	190.400	10,753,601.600	
	KUMBA IRON ORE LTD	4,271	520.780	2,224,251.380	
	VODACOM GROUP PTY LTD	40,450	136.270	5,512,121.500	
	NEPI ROCKCASTLE SA	30,168	91.570	2,762,483.760	

	OLD MUTUAL LTD	299,244	11.570	3,462,253.080	
	REINET INVESTMENTS SCA	9,455	293.190	2,772,111.450	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	100,374	19.820	1,989,412.680	
	MULTICHOICE GROUP LTD	24,565	119.900	2,945,343.500	
	SIBANYE STILLWATER LTD	194,863	43.670	8,509,667.210	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	23,806	182.220	4,337,929.320	
	BID CORP LTD	21,703	317.510	6,890,919.530	
南アフリカ・ランド　小計		2,042,036		258,441,044.870 (2,093,372,463)	
合計		478,948,494		58,942,010,212 (58,942,010,212)	

（２）株式以外の有価証券

2022年7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	77,800.000	1,748,944.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	24,900.000	710,148.000	
		ENERGISA SA	12,500.000	493,750.000	
		KLABIN SA	49,100.000	967,761.000	
	ブラジル・レアル　小計		164,300.000	3,920,603.000 (101,769,052)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	991,375.000	8,000,396.250	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	34,700.000	3,902,362.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	128,900.000	15,965,554.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	157,800.000	5,183,730.000	
	メキシコ・ペソ　小計		1,312,775.000	33,052,042.250 (220,460,428)	
投資信託受益証券　合計			1,477,075	322,229,480 (322,229,480)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	233,300.000	4,878,303.000	
	メキシコ・ペソ　小計		233,300.000	4,878,303.000 (32,538,768)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	247,694.000	3,259,653.040	
	南アフリカ・ランド　小計		247,694.000	3,259,653.040 (26,403,190)	
投資証券　合計			480,994	58,941,958 (58,941,958)	
合計				381,171,438 (381,171,438)	

（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	54銘柄	3.12	－	－	3.41
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式	9銘柄	1.12	－	－	1.23
インド・ルピー	株式	109銘柄	12.01	－	－	13.11
インドネシア・ルピア	株式	25銘柄	1.64	－	－	1.79
オフショア・人民元	株式	398銘柄	5.21	－	－	5.69
カタール・リアル	株式	12銘柄	0.93	－	－	1.02
クウェート・ディナール	株式	7銘柄	0.75	－	－	0.81
コロンビア・ペソ	株式	4銘柄	0.14	－	－	0.16
サウジアラビア・リアル	株式	37銘柄	3.87	－	－	4.23
タイ・バーツ	株式	42銘柄	1.72	－	－	1.88
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.14	－	－	0.15
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.47	－	－	0.51
トルコ・リラ	株式	12銘柄	0.24	－	－	0.26
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.14	－	－	0.16
フィリピン・ペソ	株式	20銘柄	0.67	－	－	0.73
ブラジル・レアル	株式	44銘柄	4.32	－	－	4.89
	投資信託受益証券	4銘柄	－	0.16	－	
ポーランド・ズロチ	株式	15銘柄	0.55	－	－	0.60
マレーシア・リンギット	株式	34銘柄	1.32	－	－	1.44
メキシコ・ペソ	株式	17銘柄	1.52	－	－	2.09
	投資信託受益証券	4銘柄	－	0.34	－	
	投資証券	1銘柄	－	－	0.05	
ユーロ	株式	9銘柄	0.22	－	－	0.24
韓国・ウォン	株式	112銘柄	10.47	－	－	11.43
香港・ドル	株式	197銘柄	24.33	－	－	26.56
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.87	－	－	14.05
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.23	－	－	3.57
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

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	291,891,621
国債証券	900,599,000
未収利息	210,534
前払費用	876
流動資産合計	1,192,702,031
資産合計	1,192,702,031
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	－
負債合計	－
純資産の部	
元本等	
元本	1,184,299,773
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	8,402,258
元本等合計	1,192,702,031
純資産合計	1,192,702,031
負債純資産合計	1,192,702,031

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。

（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	1,184,299,773円
同期中追加設定元本額	－円
同期中一部解約元本額	－円
元本の内訳	
ファンド名	
短期ハイイールド債券ファンド（ヘッジあり）	990,775円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし）	15,843,407円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり）	13,867,169円
新光バンクローン・ファンド・ネオ（円ヘッジ型）	5,049,059円
バンクローン・ファンド（ヘッジなし／年１回決算型）	1,088,285円
バンクローン・ファンド（ヘッジあり／年１回決算型）	98,095円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド１０月号	3,959,763円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド１１月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド１２月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド１月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド２月号	48,517円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド３月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド４月号	11,377円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド５月号	98,027円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド６月号	989,197円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド７月号	395,083円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド８月号	494,102円
新光ピムコ・ストラテジック・インカム・ファンド９月号	494,102円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス＜為替ヘッジあり＞	791,316円
ダブルライン・シラー・ケープ米国株式プラス＜為替ヘッジなし＞	2,474,972円
クルーズコントロール	990,000,991円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜円コース＞	870,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜豪ドルコース＞	530,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜南アフリカランドコース＞	70,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜ブラジルレアルコース＞	10,530,000円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜中国元コース＞	149,716円
ＤＩＡＭ新興国ソブリンオープン通貨選択シリーズ＜米ドルコース＞	5,972円
ＵＳストラテジック・インカム・ファンド　Ａコース（為替ヘッジあり）	993,740円
ＵＳストラテジック・インカム・ファンド　Ｂコース（為替ヘッジなし）	1,987,479円

ＤＩＡＭ－ジャナス　グローバル債券コアプラス・ファンド＜ＤＣ年金＞	9,935円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）円コース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）米ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）豪ドルコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）メキシコペソコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）トルコリラコース	9,925円
みずほジャパン・アクティブ・ストラテジー（通貨選択型）ブラジルレアルコース	9,925円
ＵＳストラテジック・インカム・ファンド（年１回決算型）為替ヘッジあり	9,924円
ＵＳストラテジック・インカム・ファンド（年１回決算型）為替ヘッジなし	9,924円
マシューズ・アジア株式ファンド	29,641,137円
Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ａコース）	99,040円
Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ｂコース）	99,040円
Ｏｎｅ世界分散セレクト（Ｃコース）	99,040円
世界８資産リスク分散バランスファンド（目標払出し型）	99,109円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（毎月決算型）（為替ヘッジあり）	188,380円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（毎月決算型）（為替ヘッジなし）	109,063円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（年１回決算型）（為替ヘッジあり）	297,442円
モルガン・スタンレーＵＳハイイールド債券ファンド（年１回決算型）（為替ヘッジなし）	118,977円
ファンドスミス・グローバル・エクイティ・ファンド	99,255,584円
計	1,184,299,773円
２．　受益権の総数	1,184,299,773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　2022年1月12日 至　2022年7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。

（有価証券に関する注記）
売買目的有価証券

種類	2022年7月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	△202,000
合計	△202,000

（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（2022年4月6日から2022年7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）	1.0071円 (10,071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7月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	４１５回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,028,000	
	４１６回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,074,000	
	４１８回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,168,000	
	４１９回　利付国庫債券（２年）	100,000,000	100,097,000	
	４２４回　利付国庫債券（２年）	200,000,000	200,232,000	
国債証券　合計		900,000,000	900,599,000	
合計			900,599,000	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	11,225,180,010円
Ⅱ　負債総額	13,050,979円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,212,129,031円
Ⅳ　発行済数量	8,982,276,257口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2483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

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	185,495,214,658円
Ⅱ　負債総額	2,056,768,053円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	183,438,446,605円
Ⅳ　発行済数量	86,255,487,463口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.1267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

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**

ＤＩＡＭマネーマザーファンド

2022年7月29日現在

Ⅰ　資産総額	**1,192,684,108円**
Ⅱ　負債総額	**0円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**1,192,684,108円**
Ⅳ　発行済数量	**1,184,299,773口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.0071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。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（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
株式会社東北銀行（※1）	13,233	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東邦銀行（※1）	23,519	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社群馬銀行	48,652	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社北陸銀行	140,409	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社富山銀行	6,730	日本において銀行業務を営んでおります。
スルガ銀行株式会社	30,043	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社大垣共立銀行	46,773	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社池田泉州銀行	61,385	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社紀陽銀行	80,096	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社広島銀行（※1）	54,573	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社伊予銀行	20,948	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社十八親和銀行	36,878	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社肥後銀行	18,128	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社鹿児島銀行	18,130	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社きらやか銀行	24,200	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社仙台銀行	22,735	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社東和銀行	38,653	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社神奈川銀行	6,191	日本において銀行業務を営んでおります。
信金中央金庫	（※2）690,998	日本において全国の信用金庫の中央金融機関として、信用金庫の余裕資金の効率運用と信用金庫間の資金の受給調整、信用金庫業界の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。
第一生命保険株式会社（※1）	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
アイザワ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ａｕカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

池田泉州ＴＴ証券株式会社	1,250	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
四国アライアンス証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社ＳＢＩ証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ＯＫＢ証券株式会社	1,500	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
岡三証券株式会社	5,000	「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。
九州ＦＧ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ぐんぎん証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
静岡東海証券株式会社	600	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
みずほ証券株式会社（※1）	125,167	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
十六ＴＴ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
立花証券株式会社	6,695	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	（※3）17,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東海東京証券株式会社	6,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
とうほう証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
内藤証券株式会社	3,002	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社証券ジャパン	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
野村證券株式会社（※1）	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ひろぎん証券株式会社（※1）	5,000	「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。
フィデリティ証券株式会社	11,758	「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。

ほくほくＴＴ証券株式会社	1,250	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
水戸証券株式会社	12,272	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
ワイエム証券株式会社	1,270	「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

（※1）新規の取得のお申込みのお取扱いを行っておりません。

（※2）出資の総額

（※3）2021年12月31日現在

(3) 投資顧問会社

名称	みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社
資本金の額	200百万円（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2022年4月11日	有価証券報告書
2022年4月11日	有価証券届出書

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

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」に掲げられているクルーズコントロールの２０２２年1月１２日から２０２２年7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、クルーズコントロールの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。

その他の記載内容
その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。
当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。
財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。
その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。