

【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】 2023年3月10日提出
【計算期間】 第12期（自 2022年6月14日 至 2022年12月12日）

【ファンド名】 ワールドアセットバランス（基本コース）
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

【発行者名】 アセットマネジメントOne株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 菅野 暁

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】 酒井 隆

【連絡場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【電話番号】 03-6774-5100

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々2,000億円とします。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 日本を除く先進国の株式、債券、不動産投資信託証券(リート)および新興国の株式、債券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。

●上記資産に関しては、主としてマザーファンド(*)を通じて実質的に投資します。また、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等へ直接投資する場合があります。

●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があります。

(*)外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド

※一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

2 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、為替リスクの低減をめざします。

※一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

3 基本コース、リスク抑制コースの2コースからお選びいただけます。

●各資産への基本投資比率は、統計的手法により、原則として年1回見直します。

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

●基本コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行います。

●リスク抑制コースは、基本投資比率をもとに分散投資を行いつつ、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に、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(**)を機動的に変更します。

下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。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。

(*) 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5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本投資比率をもとに運用を行います。

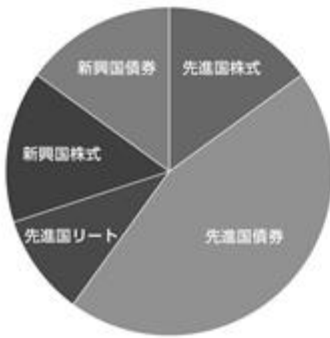
●各コース間でスイッチングが可能です。

※販売会社によっては、スイッチングの取扱いを行わない場合があります。

スイッチング時には、税金、購入時手数料がかかる場合があります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。

基本投資比率のイメージ

基本コース リスク抑制コース



※基本投資比率は、原則として年1回見直しします。
 ※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。

基本コース

投資対象資産の合計資産比率の変更は行いません。



※この図においては、左記の5つの資産への投資比率の合計を「合計資産比率」として表示しています。以下同じ。
 ※合計資産比率には、ETFおよび有価証券指数等先物取引等を含みます。

リスク抑制コース

基本投資比率をもとに投資対象資産の合計資産比率を、現金等*を用いて機動的に変更し、基準価額の下落の抑制をめざします。



※合計資産比率は、10%~100%程度とします。それにあわせて現金等*の比率は変動します。

リスク抑制コースでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等は機動的に合計資産比率を減少(現金等*比率を増加)させることで基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることをめざします。その後、市場環境回復局面では合計資産比率を増加(現金等*比率を減少)させます。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。

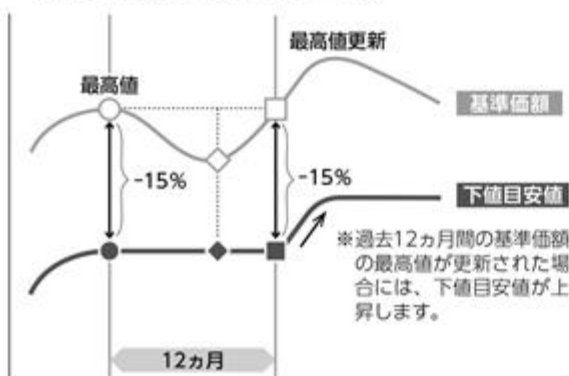
*現金等とは、短期国債、コール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産へは、「DIAMマネーマザーファンド」を通じてまたは直接投資を行います。
 ※円グラフの現金等・合計資産比率の割合はイメージです。

(リスク抑制コース)の下値目安値について

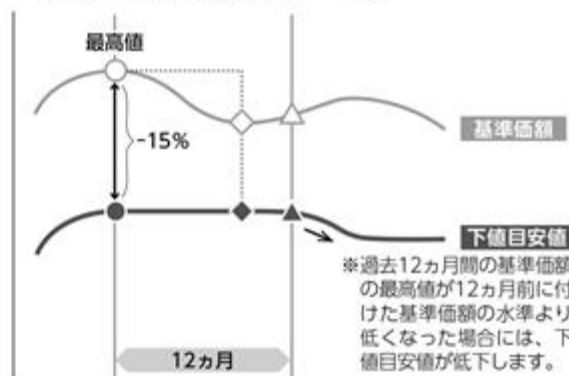
下値目安値は、過去12ヵ月間の基準価額の最高値から-15%の水準となるよう毎営業日決定します。

※(基本コース)は、下値目安値を定めておりません。
 ※設定後12ヵ月に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。

下値目安値が上昇するケース



下値目安値が低下するケース



※下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去12ヵ月間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去12ヵ月間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

※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。

※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。

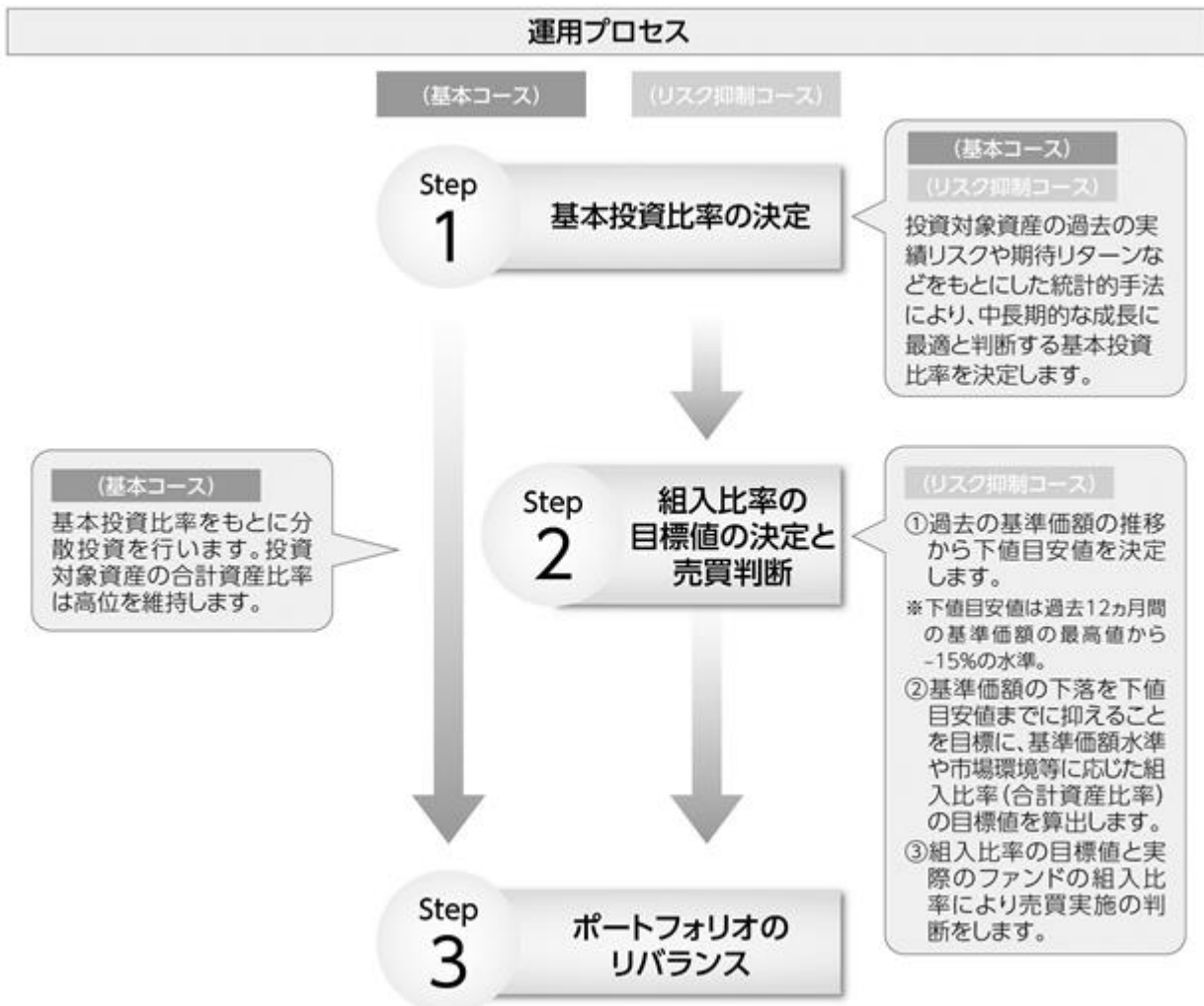
4 各資産への投資比率の決定にあたっては、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社の投資助言を活用します。

5 年2回決算を行います。

- 毎年6月、12月の各11日(休業日の場合は翌営業日)の決算時に、基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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



商品分類表

各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

商品分類定義

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

属性区分表

各ファンド

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

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

(注) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分定義

資産複合(投資信託証券 (債券、株式、 不動産投信)、先物、E T F、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、E T F、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 (日本除く)	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除く世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジあり (フルヘッジ)	目論見書または投資信託約款において、対円での為替のフルヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

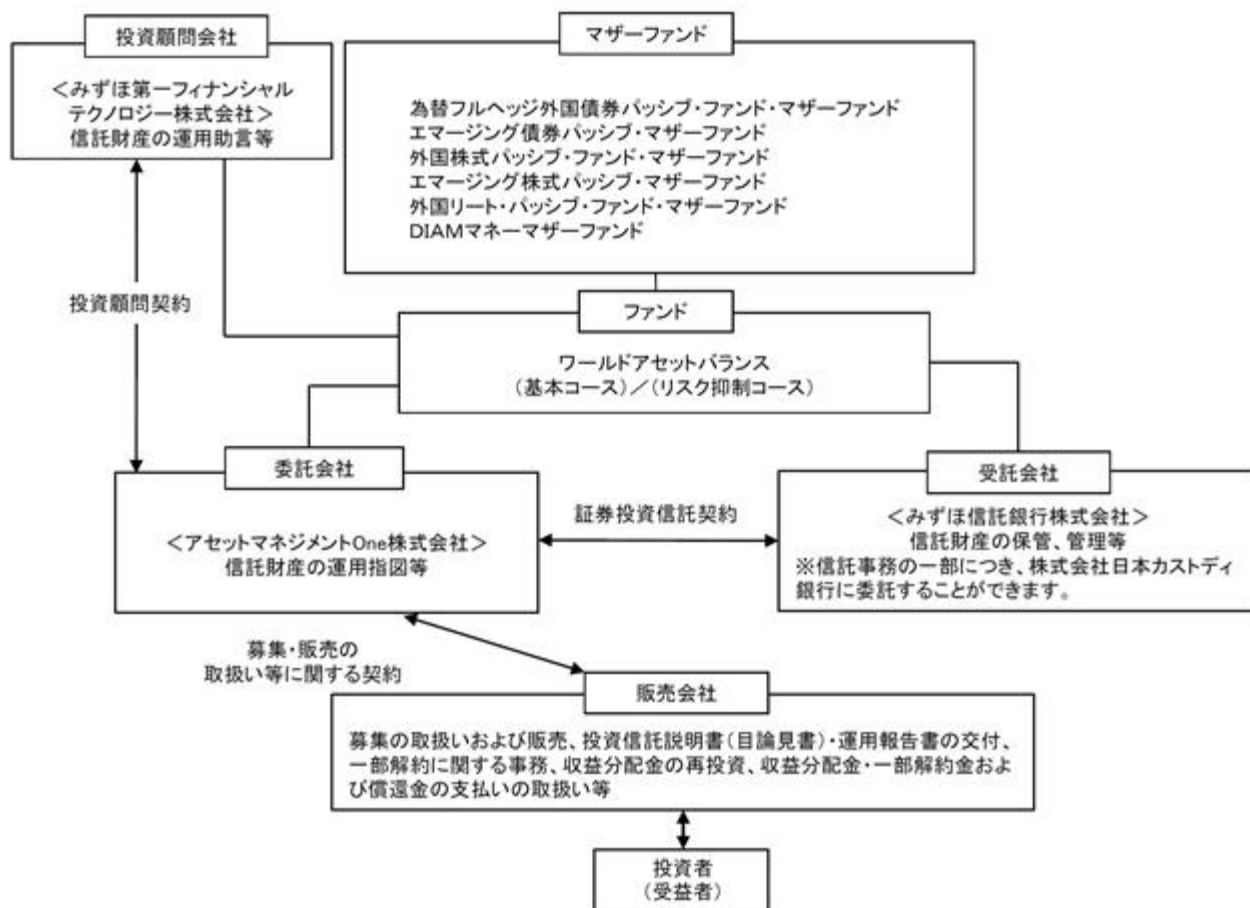
上記の分類は、一般社団法人投資信託協会の商品分類に関する指針に基づき記載しております。

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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年1月18日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・ 「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・ 「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

- ・ 「投資顧問契約」の概要

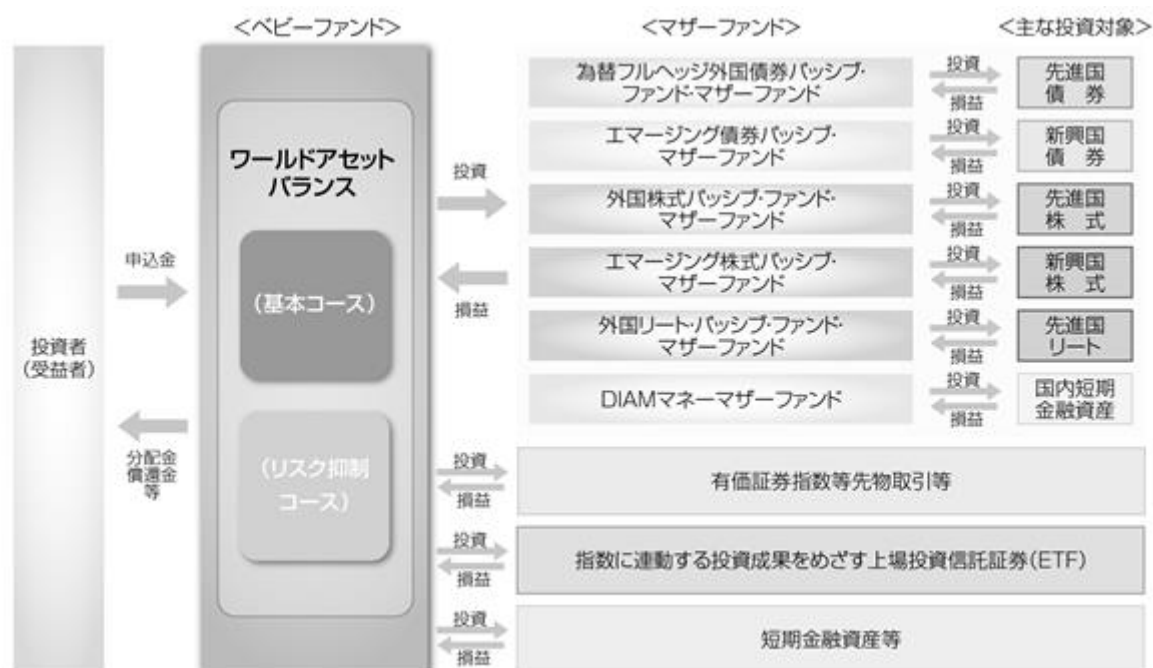
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、各ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

「ファミリーファンド方式」とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



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12月30日現在）

委託会社の沿革

日付	内容
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12月30日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

ワールドアセットバランス（基本コース）

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、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投資信託証券（ETF）を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（ETF）、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

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、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。

各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

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

「DIAMマネーマザーファンド」を除く5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率は、原則として高位を保ちます。

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

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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

<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>

「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券、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投資信託証券(ETF)を主要投資対象とします。なお、「DIAMマネーマザーファンド」受益証券や短期金融資産等に投資する場合があります。

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券(ETF)、有価証券指数等先物取引等への投資を通じて、海外の株式、債券、不動産投資信託証券に実質的に分散投資を行います。

- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・上記のほか、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

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、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の新興国通貨については代替通貨等により対円での為替取引を行う場合があります。各資産への基本投資比率は、統計的手法により決定し、原則として年1回見直します。

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

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に、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^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去12ヵ月間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。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。

(*) 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5つのマザーファンドとETFおよび有価証券指数等先物取引等への投資比率の合計をいいます。

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

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。

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

b.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証書

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。)、新株予約権証券および新投資口予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.~12.の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、振替受益権を含みます。)
15. 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの

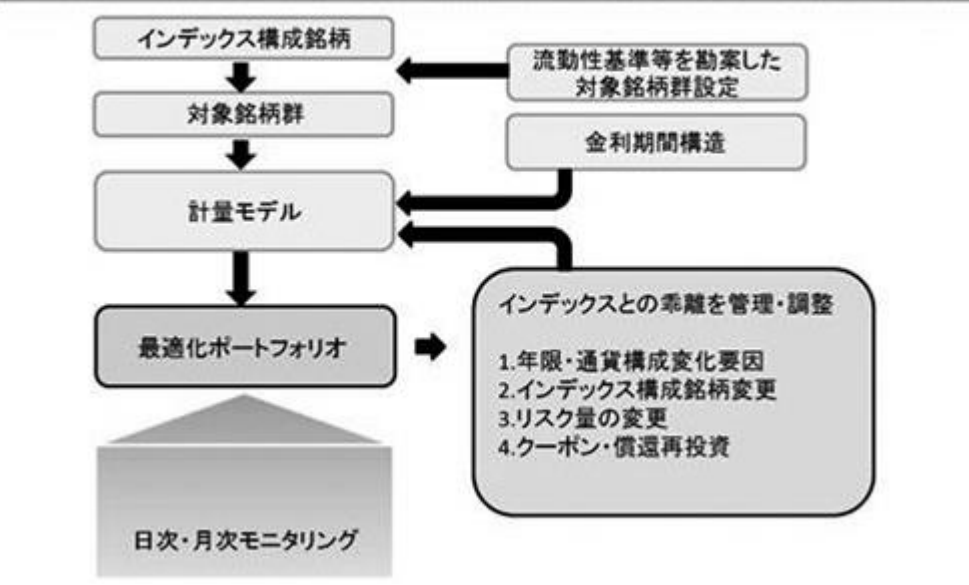
なお、1.の証券または証書、13.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から7.までの証券ならびに13.および18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.の証券および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

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

(参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジあり）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] subgraph H [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1.年限・通貨構成変化要因] H2[2.インデックス構成銘柄変更] H3[3.リスク量の変更] H4[4.クーポン・償還再投資] end </pre>

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

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

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

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

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

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

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

認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者または団体も、事前にMSCIの書面による承認を得ることなくMSCIとの関係を主張することはできません。

運用プロセス

1.流動性基準による対象銘柄群設定

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

2.最適化法によるポートフォリオの構築

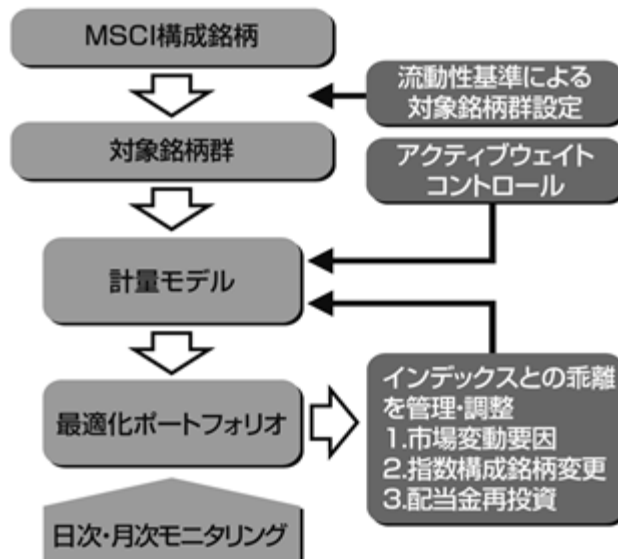
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



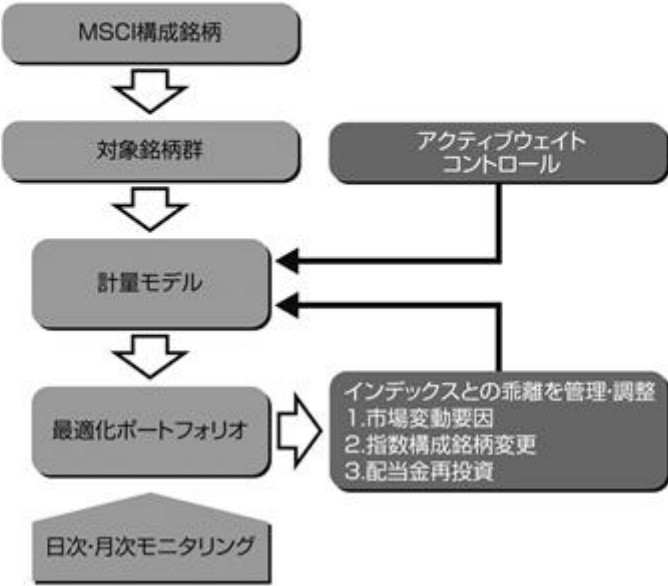
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資割合には、制限を設けません。 2. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において、原則として信託財産の純資産総額の20%以下とします。 3. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、原則として信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 外貨建資産への投資には、制限を設けません。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有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

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマージン・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

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

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

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

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

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

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

	<p>は責任も負わないものとしします。S&P Dow Jones Indicesは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、商品性、特定の目的または使用への適合性、もしくはS & P 先進国 R E I Tインデックスを使用することによって、またはそれに関連するデータに関して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとしします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。</p>
運用プロセス	<p>ポートフォリオの構築にあたっては、原則としてインデックスである「S&P先進国REITインデックス(除く日本)」を構成する全ての銘柄を、その時価構成比で組み入れることをめざします。インデックスに対する運動性を随時確認し、必要に応じてポートフォリオのリバランスを実施します。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[完全法をベースとして 組入銘柄および株数を決定] B --> C[ポートフォリオ] C --> D[日次・月次モニタリング] E[インデックスとの乖離を管理・調整 1.インデックス構成銘柄および株数の変更 2.配当金再投資 3.資本異動 4.設定/解約] --> B </pre>

主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 2. 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 3. 株式への直接投資は行いません。 4. 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）における時価の構成割合が30%を超える不動産投資信託証券がある場合には、指数との連動性を維持するために当該不動産投資信託証券をS & P 先進国 REITインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の構成割合の範囲で組入れることができます。 5. デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 6. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 7. 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
--------	--

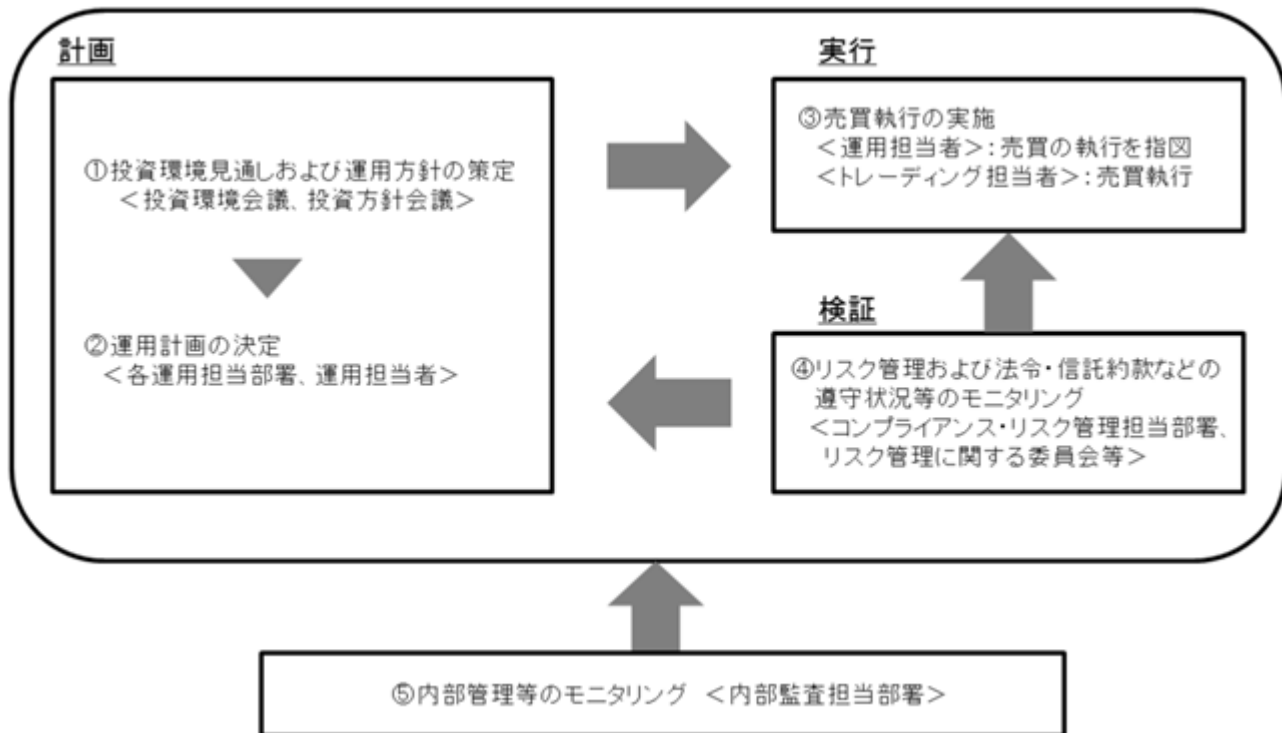
ファンド名	DIAMマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにCD、CP、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 国内の国債、政府保証債、政府機関債、地方債等のほか、取得時において主要格付機関^(*)の長期発行体格付（複数の格付機関が付与している場合は高い方の格付）がAA-格相当以上の社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券、さらに、国内格付機関の短期格付がa-1格相当以上のCD、CP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	<ol style="list-style-type: none">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



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2022年12月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時(原則として毎年6月、12月の各11日。休業日の場合は翌営業日。)に、原則として次のとおり収益分配を行う方針です。

(1) 分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

(2) 分配対象額についての分配方針

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

(3) 留保益の運用方針

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

収益の分配方式

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

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

- 2) 売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費、監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のある時はその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
- (2) 上記(1)の1)および2)におけるみなし配当等収益とは、マザーファンドの信託財産にかかる配当等収益の額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるこの信託の信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (3) 毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5) 【投資制限】

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

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)

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

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

同一銘柄の上場投資信託証券への実質投資割合は、当該上場投資信託証券が一般社団法人投資信託協会規則に定めるエクスポージャーがルックスルーできる場合に該当しないときは、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

- 1) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場におい

て取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

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

信用取引の指図範囲(約款第21条)

- 1)委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- 2)上記1)の信用取引の指図は、次の1.~6.に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の1.~6.に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
- 1.信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - 2.株式分割により取得する株券
 - 3.有償増資により取得する株券
 - 4.売出しにより取得する株券
 - 5.信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
 - 6.信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(約款第22条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

るヘッジ対象金利商品の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)の合計額の範囲内とします。

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

スワップ取引の運用指図(約款第23条)

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

- 5)スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 6)委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第24条)

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

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

- 7) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- 8) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供または受入れが必要と認めるときは、担保の提供または受入れの指図を行うものとします。

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第25条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第26条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の1.~2.の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- 2) 上記1)1.~2.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- 3) 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受け入れの指図を行うものとします。

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第29条)

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファ

ンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

資金の借入れ(約款第35条)

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

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

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

3【投資リスク】

<基準価額の主な変動要因>

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

・資産配分リスク

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

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

リスク抑制コースでは、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従できない場合があります。

・株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

・金利リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となります。

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

・リートの価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

リートの価格は、リートが投資対象とする不動産等の価値、当該不動産等による賃貸収入の増減、不動産市況の変動、景気や株式市況等の動向などによって変動します。

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

・為替リスク

為替ヘッジを行っても、為替相場の変動による基準価額への影響を完全には排除できません。

ファンドは、実質組入外貨建資産については原則として対円で為替ヘッジを行い為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。

なお、実質組入資産の直接ヘッジのほか、一部の新興国通貨については代替通貨を用いた為替ヘッジを行う場合があります。代替通貨を用いた為替ヘッジの場合、通貨間の値動きが異なる場

合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、代替通貨と一部の新興国通貨間の為替変動の影響を受ける可能性があります。

また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨および代替通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

・信用リスク

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

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

・流動性リスク

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

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

・カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

各ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性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。

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

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

リスク抑制コースでは、過去12カ月間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に15%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、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。

基準価額的水準が下値目安値に近づいた場合等では、下値目安値を意識した資産配分(組入比率)をめざすため、投資対象資産の合計資産比率の引上げについては機動的に行えない場合があります。

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

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

各ファンドは、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにおいて受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、その他やむを得ない事情が発生した場合は、当初定められていた信託期間の途中でも信託を終了(繰上償還)する場合があります。

注意事項

イ. ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの値動きのある有価証券(外貨建資産には為替リスクもあります。)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。

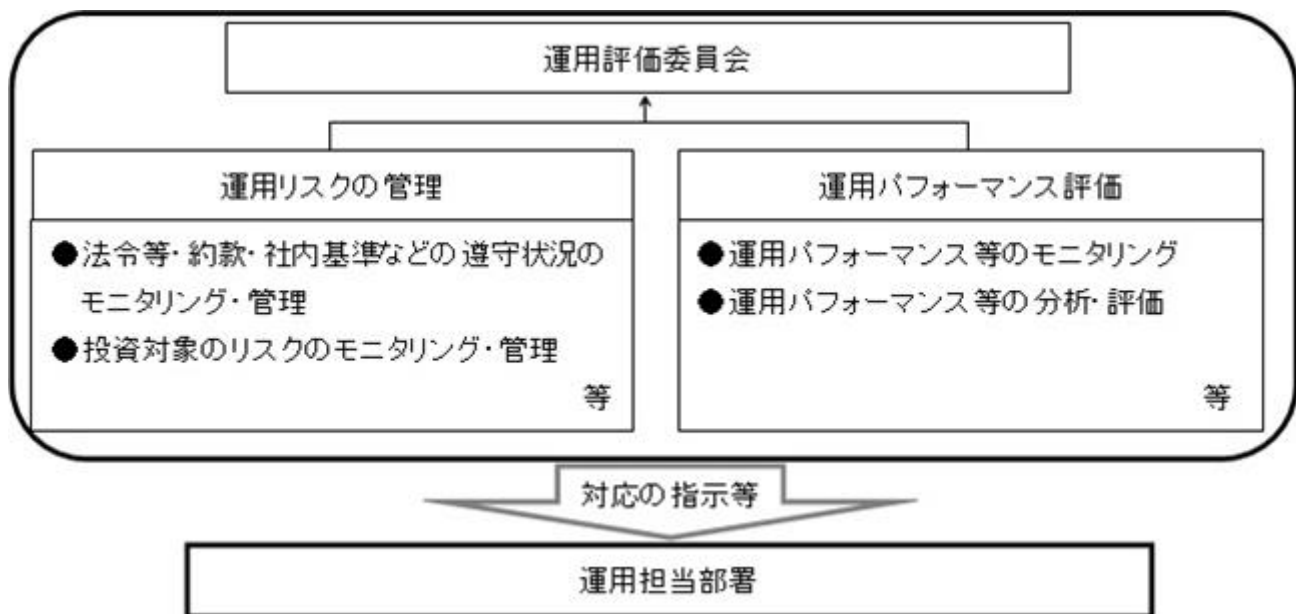
ハ. 投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。

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12月30日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

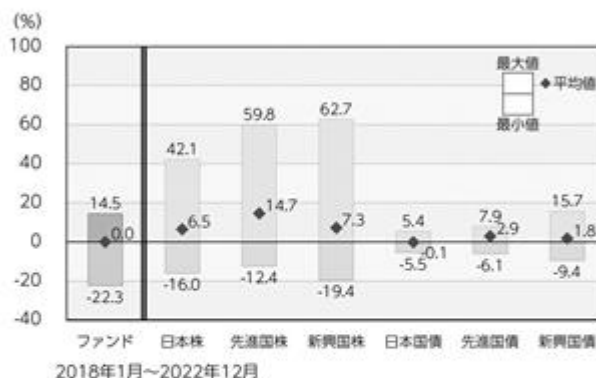
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

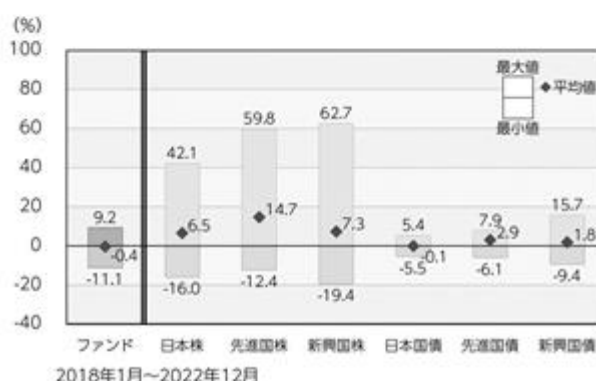
(基本コース)



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



(リスク抑制コース)



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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広く網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIコクサイ・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	[MSCIエマージング・マーケット・インデックス]は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	[NOMURA-BPI国債]は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(旧野村證券株式会社)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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利は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】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に2.2%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.243%（税抜1.13%）

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.55%	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0.55%	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0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

1. 信託財産留保額

ありません。

2. その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

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

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2022年12月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。

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

個別元本方式について

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

< 個別元本について >

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

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

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

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

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

< 収益分配金の課税について >

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2022年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	38,386,792	0.64
内 アメリカ	38,386,792	0.64
親投資信託受益証券	5,727,432,430	96.20
内 日本	5,727,432,430	96.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	187,898,913	3.16
純資産総額	5,953,718,135	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。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2022年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	8,502,855,000	42.77
内 日本	8,502,855,000	42.77
投資信託受益証券	59,167,612	0.30
内 アメリカ	59,167,612	0.30
親投資信託受益証券	3,710,645,897	18.66
内 日本	3,710,645,897	18.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	7,607,643,881	38.27
純資産総額	19,880,312,390	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）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	742,411,494,379	95.19
内 アメリカ	515,035,235,071	66.03
内 イギリス	33,859,880,506	4.34
内 カナダ	28,427,920,476	3.64
内 スイス	26,066,924,742	3.34
内 フランス	25,372,985,362	3.25
内 ドイツ	18,743,901,278	2.40
内 オーストラリア	16,971,070,984	2.18
内 オランダ	14,322,462,633	1.84
内 アイルランド	13,995,352,467	1.79
内 スウェーデン	7,217,363,155	0.93
内 デンマーク	6,872,788,316	0.88
内 スペイン	5,752,185,751	0.74
内 香港	5,302,211,481	0.68
内 イタリア	4,013,256,595	0.51
内 ジャージー	3,048,062,510	0.39
内 フィンランド	2,974,604,484	0.38
内 シンガポール	2,680,224,732	0.34

内 ベルギー	1,963,305,045	0.25
内 ノルウェー	1,806,872,635	0.23
内 イスラエル	1,644,098,514	0.21
内 ケイマン諸島	1,508,438,550	0.19
内 バミューダ	1,212,644,295	0.16
内 オランダ領キュラソー	1,203,257,802	0.15
内 ルクセンブルグ	546,091,755	0.07
内 ニュージーランド	536,322,922	0.07
内 オーストリア	432,452,655	0.06
内 ポルトガル	419,782,316	0.05
内 リベリア	181,580,655	0.02
内 マン島	158,372,166	0.02
内 パナマ	141,844,526	0.02
投資信託受益証券	1,353,786,892	0.17
内 オーストラリア	938,463,907	0.12
内 シンガポール	415,322,985	0.05
投資証券	16,175,293,204	2.07
内 アメリカ	15,142,251,696	1.94
内 イギリス	326,186,677	0.04
内 フランス	282,645,756	0.04
内 香港	253,783,667	0.03
内 ベルギー	104,226,392	0.01
内 カナダ	66,199,016	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	20,016,158,510	2.57
純資産総額	779,956,732,985	100.00

その他資産の投資状況

2022年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	20,553,939,401	2.64
内 アメリカ	15,233,613,321	1.95
内 ドイツ	3,106,978,287	0.40
内 イギリス	984,262,400	0.13
内 カナダ	761,462,816	0.10
内 オーストラリア	467,622,577	0.06

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

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	231,626,798,991	95.17
内 アメリカ	117,656,998,572	48.34
内 フランス	19,971,546,551	8.21
内 イタリア	17,476,349,100	7.18
内 ドイツ	15,632,822,431	6.42
内 スペイン	11,751,930,486	4.83
内 イギリス	10,700,774,553	4.40

内 中国	8,401,175,053	3.45
内 カナダ	4,691,667,149	1.93
内 ベルギー	4,334,990,999	1.78
内 オランダ	3,717,294,108	1.53
内 オーストラリア	3,665,401,720	1.51
内 オーストリア	2,756,170,801	1.13
内 メキシコ	1,885,518,278	0.77
内 アイルランド	1,488,655,256	0.61
内 マレーシア	1,237,099,657	0.51
内 フィンランド	1,189,726,971	0.49
内 シンガポール	1,086,362,579	0.45
内 ポーランド	1,006,797,065	0.41
内 イスラエル	788,200,004	0.32
内 デンマーク	752,391,958	0.31
内 ニュージーランド	487,692,319	0.20
内 ノルウェー	480,796,895	0.20
内 スウェーデン	466,436,486	0.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,766,160,766	4.83
純資産総額	243,392,959,757	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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	6,386,195,350	10.35
内 オーストラリア	4,059,376,490	6.58
内 シンガポール	2,270,294,589	3.68
内 香港	56,524,271	0.09
投資証券	54,837,175,495	88.84
内 アメリカ	47,177,842,975	76.43
内 イギリス	2,839,758,832	4.60
内 カナダ	1,139,256,209	1.85
内 フランス	1,085,853,032	1.76
内 香港	850,458,996	1.38
内 ベルギー	669,490,226	1.08
内 スペイン	261,850,608	0.42
内 ニュージーランド	251,427,173	0.41
内 韓国	148,970,734	0.24
内 ガーンジィ	146,790,982	0.24
内 オランダ	119,302,190	0.19
内 イスラエル	84,128,885	0.14
内 ドイツ	29,185,004	0.05
内 アイルランド	24,145,844	0.04
内 イタリア	8,713,805	0.01
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	505,057,615	0.82
純資産総額	61,728,428,460	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12月30日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	91,400,125,586	92.40
内 ケイマン諸島	17,132,553,272	17.32
内 インド	13,391,648,883	13.54
内 台湾	12,307,380,571	12.44
内 中国	11,067,002,855	11.19
内 韓国	10,476,823,850	10.59
内 ブラジル	4,651,417,051	4.70
内 サウジアラビア	3,781,960,466	3.82
内 南アフリカ	3,313,777,280	3.35
内 タイ	2,042,156,236	2.06
内 インドネシア	1,749,931,598	1.77
内 メキシコ	1,700,157,783	1.72
内 マレーシア	1,435,050,907	1.45
内 アラブ首長国連邦	1,256,549,751	1.27
内 香港	1,064,124,774	1.08
内 カタール	906,100,760	0.92
内 クエート	865,157,156	0.87
内 フィリピン	682,184,576	0.69
内 ポーランド	621,267,659	0.63
内 トルコ	612,727,692	0.62
内 チリ	503,161,137	0.51
内 バミューダ	477,757,685	0.48
内 アメリカ	419,745,720	0.42
内 ギリシャ	290,601,359	0.29
内 ハンガリー	176,787,434	0.18
内 チェコ	126,072,165	0.13
内 コロンビア	103,439,568	0.10
内 ルクセンブルグ	73,178,335	0.07
内 オランダ	61,525,195	0.06
内 エジプト	56,646,291	0.06
内 ベルギー	27,470,319	0.03
内 シンガポール	25,767,258	0.03
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	568,390,555	0.57
内 メキシコ	399,613,900	0.40
内 ブラジル	168,776,655	0.17
投資証券	98,897,621	0.10
内 メキシコ	55,443,971	0.06
内 南アフリカ	43,453,650	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	6,846,494,848	6.92
純資産総額	98,913,908,610	100.00

その他資産の投資状況

2022年12月30日現在

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

株価指数先物取引(買建)		6,796,958,359	6.87
	内 アメリカ	6,796,958,359	6.87

(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12月30日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	116,943,462,428	96.13
内 サウジアラビア	13,439,550,045	11.05
内 カタール	11,539,553,517	9.49
内 アラブ首長国連邦	10,775,893,279	8.86
内 メキシコ	10,543,972,699	8.67
内 チリ	8,172,383,617	6.72
内 ドミニカ共和国	7,102,074,425	5.84
内 パナマ	6,765,546,881	5.56
内 インドネシア	6,724,317,491	5.53
内 ブラジル	6,475,388,876	5.32
内 コロンビア	5,711,389,371	4.69
内 南アフリカ	5,288,201,636	4.35
内 オマーン	4,722,705,948	3.88
内 ベルギー	4,667,484,763	3.84
内 フィリピン	4,262,594,594	3.50
内 ハンガリー	4,076,058,069	3.35
内 ウルグアイ	3,250,972,977	2.67
内 ルーマニア	2,599,929,791	2.14
内 中国	825,444,449	0.68
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,713,997,452	3.87
純資産総額	121,657,459,880	100.00

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

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ワールドアセットバランス(基本コース)

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,225,029,548	1.2281 2,732,642,348	1.1969 2,663,137,866	- -	44.73
2	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	441,610,114	2.0443 902,801,031	1.9433 858,180,934	- -	14.41

3	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	144,201,865	6.0505 872,498,247	5.7722 832,362,005	- -	13.98
4	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	622,686,789	1.3972 870,077,053	1.3325 829,730,146	- -	13.94
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	347,351,219	1.6455 571,600,066	1.5662 544,021,479	- -	9.14
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	13,300	2,948.06 39,209,240	2,886.22 38,386,792	- -	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	0.64
親投資信託受益証券	96.20
合計	96.84

(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。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	1059回 国庫短期証券 日本	国債証 券	5,000,000,000	100.03 5,001,700,000	100.02 5,001,200,000	- 2023/2/20	25.16
2	1074回 国庫短期証券 日本	国債証 券	2,500,000,000	100.05 2,501,300,000	100.03 2,500,925,000	- 2023/4/20	12.58
3	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,440,931,286	1.2279 1,769,419,153	1.1969 1,724,650,656	- -	8.68
4	1108回 国庫短期証券 日本	国債証 券	1,000,000,000	100.09 1,000,960,000	100.07 1,000,730,000	- 2023/9/20	5.03
5	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	288,731,174	2.0489 591,583,361	1.9433 561,091,290	- -	2.82
6	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	95,332,662	6.0830 579,911,673	5.7722 550,279,191	- -	2.77
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	381,005,501	1.3965 532,100,688	1.3325 507,689,830	- -	2.55

8	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	234,283,572	1.6520 387,047,438	1.5662 366,934,930	- -	1.85
9	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF アメリカ	投資信 託受益 証券	20,500	2,948.06 60,435,295	2,886.22 59,167,612	- -	0.30

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	42.77
投資信託受益証券	0.30
親投資信託受益証券	18.66
合計	61.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	1,959,610	21,739.27 42,600,508,272	17,199.24 33,703,816,413	- -	4.32
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	863,965	38,083.85 32,903,114,473	31,982.02 27,631,351,957	- -	3.54
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,118,663	19,323.60 21,616,596,434	11,170.68 12,496,233,112	- -	1.60
4	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	730,399	17,173.62 12,543,596,877	11,737.31 8,572,923,138	- -	1.10

5	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 ア・サー ビス	114,300	64,336.57 7,353,671,020	70,315.07 8,037,013,186	- -	1.03
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	678,721	17,231.09 11,695,103,598	11,803.66 8,011,395,312	- -	1.03
7	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	320,456	22,299.14 7,145,893,385	23,562.21 7,550,652,208	- -	0.97
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	509,183	11,076.99 5,640,219,012	14,490.83 7,378,489,383	- -	0.95
9	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融 サービス	158,774	41,563.05 6,599,133,207	41,012.26 6,511,680,886	- -	0.83
10	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	357,732	19,241.82 6,883,417,316	17,678.29 6,324,091,469	- -	0.81
11	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	291,314	20,306.76 5,915,644,166	20,248.69 5,898,727,752	- -	0.76
12	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	304,283	29,888.36 9,094,522,392	19,378.18 5,896,451,049	- -	0.76
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	199,385	29,152.77 5,812,626,701	27,609.56 5,504,932,519	- -	0.71
14	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	227,013	19,373.60 4,398,060,558	23,663.06 5,371,823,147	- -	0.69
15	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	125,091	44,708.23 5,592,598,276	42,518.40 5,318,670,050	- -	0.68
16	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	325,351	36,675.31 11,932,350,576	16,165.51 5,259,466,145	- -	0.67
17	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	335,501	16,750.16 5,619,696,866	15,561.29 5,220,829,161	- -	0.67
18	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術 サービス	105,296	48,142.10 5,069,170,644	46,207.46 4,865,461,445	- -	0.62

19	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	98,682	34,367.97 3,391,500,294	48,703.55 4,806,164,115	- -	0.62
20	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	684,875	6,621.40 4,534,838,031	6,811.49 4,665,019,898	- -	0.60
21	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	215,856	19,344.44 4,175,615,029	21,571.71 4,656,383,465	- -	0.60
22	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	309,456	10,741.68 3,324,079,722	14,705.81 4,550,802,377	- -	0.58
23	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	279,047	27,083.68 7,557,620,122	15,958.50 4,453,172,107	- -	0.57
24	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	502,166	8,090.89 4,062,970,696	8,486.16 4,261,463,533	- -	0.55
25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	168,777	22,227.93 3,751,565,008	24,148.74 4,075,752,903	- -	0.52
26	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	883,002	5,872.11 5,185,085,560	4,397.67 3,883,158,469	- -	0.50
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	49,306	75,179.30 3,706,791,011	74,021.38 3,649,698,507	- -	0.47
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	49,677	78,107.16 3,880,129,410	73,097.54 3,631,266,941	- -	0.47
29	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	202,240	13,064.34 2,642,132,132	17,895.91 3,619,270,456	- -	0.46
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	85,335	48,789.94 4,163,490,367	42,094.25 3,592,113,591	- -	0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2022年12月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.19
投資信託受益証券	0.17
投資証券	2.07
合計	97.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2022年12月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	6.53

銀行	5.96
医薬品	5.75
石油・ガス・消耗燃料	5.49
コンピュータ・周辺機器	4.53
半導体・半導体製造装置	4.13
情報技術サービス	3.65
保険	3.39
資本市場	3.24
インタラクティブ・メディアおよびサービス	2.82
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.55
ヘルスケア機器・用品	2.40
バイオテクノロジー	2.20
化学	2.08
電力	1.99
インターネット販売・通信販売	1.96
飲料	1.92
ホテル・レストラン・レジャー	1.85
機械	1.83
食品	1.78
航空宇宙・防衛	1.75
専門小売り	1.74
金属・鉱業	1.70
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.54
食品・生活必需品小売り	1.51
繊維・アパレル・贅沢品	1.31
自動車	1.31
家庭用品	1.24
各種電気通信サービス	1.14
各種金融サービス	1.10
陸運・鉄道	1.07
娯楽	1.05
コングロマリット	0.97
総合公益事業	0.86
電気設備	0.85
メディア	0.76
タバコ	0.72
専門サービス	0.70
通信機器	0.69
パーソナル用品	0.63
建設関連製品	0.57
航空貨物・物流サービス	0.55
電子装置・機器・部品	0.53
商業サービス・用品	0.52
複合小売り	0.46
消費者金融	0.37
商社・流通業	0.36
不動産管理・開発	0.34
エネルギー設備・サービス	0.31
無線通信サービス	0.28
家庭用耐久財	0.28

建設・土木	0.27
建設資材	0.25
容器・包装	0.25
自動車部品	0.18
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.17
ガス	0.15
水道	0.12
運送インフラ	0.12
販売	0.11
紙製品・林産品	0.11
海運業	0.07
旅客航空輸送業	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.01
合計	95.19

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 3.25 08/31/24 アメリカ	国債証券	2,959,210,000	97.99 2,899,877,839	98.00 2,900,025,800	3.25 2024/8/31	1.19
2	US T N/B 0.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	2,388,600,000	92.94 2,220,060,384	93.52 2,233,900,816	0.375 2024/8/15	0.92
3	US T N/B 0.625 10/15/24 アメリカ	国債証券	2,301,018,000	92.93 2,138,484,094	93.46 2,150,552,981	0.625 2024/10/15	0.88
4	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	2,226,706,000	95.77 2,132,538,603	96.15 2,141,029,990	2.25 2024/11/15	0.88
5	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	2,157,702,000	93.17 2,010,460,415	93.68 2,021,412,759	1 2024/12/15	0.83
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,767,564,000	81.99 1,449,262,030	81.74 1,444,845,469	1.375 2031/11/15	0.59
7	US T N/B 0.875 09/30/26 アメリカ	国債証券	1,549,936,000	87.80 1,360,998,801	88.95 1,378,777,047	0.875 2026/9/30	0.57
8	US T N/B 4.25 10/15/25 アメリカ	国債証券	1,376,099,000	100.37 1,381,245,610	100.08 1,377,335,342	4.25 2025/10/15	0.57
9	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,459,700,000	95.33 1,391,591,725	94.23 1,375,596,187	2.75 2028/2/15	0.57
10	US T N/B 1.25 12/31/26 アメリカ	国債証券	1,454,392,000	88.62 1,288,940,366	89.72 1,304,975,938	1.25 2026/12/31	0.54
11	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	1,499,582,000	90.39 1,355,547,148	86.68 1,299,963,642	0.5 2029/5/25	0.53
12	US T N/B 2.5 03/31/27 アメリカ	国債証券	1,295,152,000	93.05 1,205,164,839	94.05 1,218,201,747	2.5 2027/3/31	0.50
13	US T N/B 6.125 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,104,064,000	108.40 1,196,838,497	109.37 1,207,613,123	6.125 2027/11/15	0.50

14	US T N/B 2.875 04/30/29 アメリカ	国債証券	1,243,399,000	94.80 1,178,866,591	93.92 1,167,872,220	2.875 2029/4/30	0.48
15	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,234,110,000	93.65 1,155,820,715	93.24 1,150,711,152	2.25 2027/2/15	0.47
16	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,212,878,000	93.43 1,133,240,430	94.68 1,148,396,469	2.875 2028/5/15	0.47
17	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,308,422,000	86.39 1,130,365,962	84.47 1,105,258,813	1.625 2031/5/15	0.45
18	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証券	1,129,277,000	98.54 1,112,886,692	97.08 1,096,325,046	2.25 2024/3/31	0.45
19	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,191,646,000	89.99 1,072,457,567	91.37 1,088,866,532	2.75 2032/8/15	0.45
20	US T N/B 3.125 08/31/27 アメリカ	国債証券	1,121,315,000	95.48 1,070,653,988	96.41 1,081,149,137	3.125 2027/8/31	0.44
21	US T N/B 0.25 08/31/25 アメリカ	国債証券	1,196,954,000	89.14 1,067,001,500	90.03 1,077,726,153	0.25 2025/8/31	0.44
22	US T N/B 3.875 09/30/29 アメリカ	国債証券	1,070,889,000	100.72 1,078,685,071	99.64 1,067,040,491	3.875 2029/9/30	0.44
23	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,008,520,000	103.92 1,048,124,580	102.40 1,032,787,512	4.125 2032/11/15	0.42
24	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,272,593,000	82.77 1,053,396,187	80.24 1,021,255,882	0.875 2030/11/15	0.42
25	US T N/B 3.125 08/31/29 アメリカ	国債証券	1,047,003,000	96.23 1,007,614,747	95.21 996,861,365	3.125 2029/8/31	0.41
26	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	804,964,300	131.40 1,057,733,935	123.27 992,282,712	5.75 2032/10/25	0.41
27	US T N/B 0.375 04/15/24 アメリカ	国債証券	1,027,098,000	95.05 976,264,669	94.67 972,413,051	0.375 2024/4/15	0.40
28	SPAIN 4.65 07/30/25 スペイン	国債証券	929,457,900	106.52 990,123,617	104.40 970,410,744	4.65 2025/7/30	0.40
29	DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27 ドイツ	国債証券	1,052,536,800	93.31 982,132,613	91.55 963,650,067	0.25 2027/2/15	0.40
30	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	1,208,897,000	79.10 956,243,949	78.96 954,650,849	0.625 2030/8/15	0.39

(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12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	95.17
合計	95.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

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

1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	339,740	14,950.03 5,079,124,605	15,123.81 5,138,166,267	- -	8.32
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	34,066	83,200.98 2,834,324,598	88,294.59 3,007,843,809	- -	4.87
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	58,203	40,309.28 2,346,121,140	37,498.36 2,182,517,396	- -	3.54
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	230,936	8,620.50 1,990,783,816	8,496.78 1,962,212,617	- -	3.18
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	120,395	13,247.67 1,594,954,309	15,568.36 1,874,353,183	- -	3.04
6	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	354,716	4,042.68 1,434,005,876	4,300.80 1,525,565,055	- -	2.47
7	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	174,035	9,901.29 1,723,171,992	8,735.64 1,520,307,281	- -	2.46
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	105,906	16,123.52 1,707,578,250	13,442.50 1,423,642,464	- -	2.31
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	51,545	25,011.68 1,289,227,189	21,583.65 1,112,529,496	- -	1.80
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	55,019	18,219.13 1,002,398,417	19,268.03 1,060,108,292	- -	1.72
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	125,341	9,264.62 1,161,237,905	7,940.76 995,303,801	- -	1.61
12	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	630,613	1,577.21 994,611,489	1,555.83 981,127,191	- -	1.59
13	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	49,354	22,096.92 1,090,571,410	19,773.62 975,907,586	- -	1.58
14	MID AMERICA アメリカ	投資証券	42,562	21,637.75 920,946,151	20,932.09 890,911,955	- -	1.44
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	147,325	6,196.67 912,925,838	6,045.81 890,699,252	- -	1.44
16	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	45,665	19,899.23 908,698,641	19,218.94 877,632,940	- -	1.42
17	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	214,103	4,524.93 968,801,155	3,984.98 853,196,387	- -	1.38
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	76,689	10,839.15 831,243,749	10,414.29 798,661,945	- -	1.29
19	LINK REIT 香港	投資証券	777,020	1,031.80 801,731,814	966.73 751,173,206	- -	1.22
20	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	107,193	6,432.48 689,517,329	6,652.25 713,074,741	- -	1.16
21	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	23,880	33,249.41 793,996,040	28,433.62 678,995,060	- -	1.10
22	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	198,239	3,273.77 648,988,932	3,344.03 662,919,145	- -	1.07
23	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	94,972	6,200.91 588,913,514	6,904.38 655,722,872	- -	1.06
24	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	228,099	2,613.68 596,179,953	2,807.93 640,486,481	- -	1.04

25	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	39,299	16,910.64 664,571,618	14,987.13 588,979,536	- -	0.95
26	UDR INC アメリカ	投資証券	112,893	5,761.73 650,459,519	5,163.35 582,906,861	- -	0.94
27	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	64,547	9,030.45 582,888,614	8,667.96 559,491,072	- -	0.91
28	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	263,802	2,233.89 589,306,590	2,097.98 553,453,166	- -	0.90
29	SEGRO PLC イギリス	投資証券	446,236	1,504.39 671,313,955	1,238.39 552,618,662	- -	0.90
30	SCENTRE GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	1,915,674	240.06 459,891,684	260.64 499,317,937	- -	0.81

（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12月30日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	10.35
投資証券	88.84
合計	99.18

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,701,609	2,292.20 6,192,632,485	1,924.80 5,200,062,946	- -	5.26
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	686,100	5,913.64 4,057,352,635	5,705.10 3,914,271,854	- -	3.96
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	523,604	6,712.07 3,514,467,535	5,834.14 3,054,784,276	- -	3.09

4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	1,627,668	1,594.91 2,595,986,362	1,456.06 2,369,983,895	- -	2.40
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	484,100	2,858.74 1,383,916,383	3,128.27 1,514,398,411	- -	1.53
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	333,449	4,177.29 1,392,915,611	4,094.71 1,365,377,955	- -	1.38
7	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉄 業	419,189	2,093.83 877,711,254	2,229.48 934,575,041	- -	0.94
8	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	369,336	2,653.53 980,045,080	2,443.25 902,382,213	- -	0.91
9	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	237,335	3,937.08 934,409,137	3,710.35 880,598,290	- -	0.89
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	10,527,530	92.07 969,309,902	83.05 874,391,375	- -	0.88
11	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	563,495	1,300.53 732,847,486	1,461.96 823,807,431	- -	0.83
12	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 各種金融 サービス	189,054	3,889.50 735,326,548	4,307.39 814,330,065	- -	0.82
13	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インター ネット販 売・通信 販売	55,627	7,259.35 403,816,023	10,935.80 608,326,135	- -	0.62
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	694,000	890.75 618,186,753	862.91 598,862,316	- -	0.61
15	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,364,601	452.68 617,739,764	430.27 587,154,091	- -	0.59
16	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	214,724	3,513.08 754,344,205	2,659.82 571,128,048	- -	0.58

17	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インター ネット販 売・通信 販売	23,951	15,166.89 363,262,415	22,326.09 534,732,421	- -	0.54
18	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	100,104	5,626.72 563,257,877	5,262.68 526,816,069	- -	0.53
19	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	89,739	6,092.07 546,696,930	5,327.74 478,106,957	- -	0.48
20	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	60,034	10,663.09 640,148,337	7,912.50 475,019,025	- -	0.48
21	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	242,700	2,365.93 574,212,860	1,872.20 454,382,940	- -	0.46
22	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	167,014	3,295.81 550,447,829	2,714.57 453,372,079	- -	0.46
23	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	6,060,800	67.29 407,877,213	72.88 441,756,560	- -	0.45
24	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	240,844	2,489.11 599,488,031	1,786.18 430,191,940	- -	0.43
25	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	6,184,235	75.16 464,845,416	68.25 422,075,275	- -	0.43
26	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,624,200	50.50 435,604,019	48.33 416,866,230	- -	0.42
27	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	217,600	2,480.93 539,850,979	1,894.32 412,205,337	- -	0.42
28	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	400,500	1,081.34 433,079,525	1,013.54 405,923,170	- -	0.41
29	SAMSUNG SDI CO LTD 韓国	株式 電子装 置・機 器・部品	6,046	64,057.70 387,292,889	62,350.50 376,971,123	- -	0.38

30	AXIS BANK LTD インド	株式 銀行	249,763	1,266.67 316,369,032	1,504.62 375,799,778	- -	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12月30日現在

種類	投資比率(%)
株式	92.40
投資信託受益証券	0.57
投資証券	0.10
合計	93.08

(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12月30日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	14.85
半導体・半導体製造装置		7.65
インターネット販売・通信販売		6.38
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.31
コンピュータ・周辺機器		4.62
石油・ガス・消耗燃料		4.45
金属・鉱業		4.05
化学		3.05
保険		2.53
電子装置・機器・部品		2.48
自動車		2.42
情報技術サービス		2.14
食品		1.85
不動産管理・開発		1.68
無線通信サービス		1.59
各種金融サービス		1.56
飲料		1.37
食品・生活必需品小売り		1.35
各種電気通信サービス		1.26
医薬品		1.25
ホテル・レストラン・レジャー		1.19
コングロマリット		1.14
繊維・アパレル・贅沢品		1.12
電力		1.06
電気設備		0.99
娯楽		0.94
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.92
資本市場		0.88
ライフサイエンス・ツール/サービス		0.85
建設資材		0.85
専門小売り		0.82
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		0.77
パーソナル用品		0.75
運送インフラ		0.70

バイオテクノロジー	0.68
ガス	0.65
消費者金融	0.60
建設・土木	0.55
自動車部品	0.51
機械	0.46
海運業	0.39
家庭用耐久財	0.35
タバコ	0.34
航空貨物・物流サービス	0.31
旅客航空輸送業	0.28
ソフトウェア	0.26
陸運・鉄道	0.25
商社・流通業	0.24
ヘルスケア機器・用品	0.23
航空宇宙・防衛	0.19
紙製品・林産品	0.18
各種消費者サービス	0.17
複合小売り	0.16
通信機器	0.14
メディア	0.14
水道	0.12
家庭用品	0.09
商業サービス・用品	0.07
エネルギー設備・サービス	0.07
容器・包装	0.04
建設関連製品	0.04
総合公益事業	0.03
レジャー用品	0.03
合計	92.40

(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。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年12月30日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	3,344,040,000	86.00 2,875,879,177	90.73 3,034,155,203	6 2033/2/22	2.49
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,255,900,000	99.99 2,255,771,281	99.00 2,233,341,000	4.375 2029/4/16	1.84
3	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,388,600,000	90.03 2,150,611,839	92.27 2,204,081,151	5.5 2029/2/22	1.81
4	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 カタール	国債証券	2,123,200,000	100.67 2,137,507,714	100.50 2,133,816,000	5.103 2048/4/23	1.75

5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	1,990,500,000	99.92 1,989,013,760	97.61 1,943,102,214	4.817 2049/3/14	1.60
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,521,300,000	70.55 1,779,026,626	73.92 1,863,838,071	5.875 2060/1/30	1.53
7	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,123,200,000	83.66 1,776,405,801	83.21 1,766,792,322	2.783 2031/1/23	1.45
8	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25 サウジアラビア	国債証券	1,725,100,000	100.32 1,730,738,423	98.89 1,705,951,390	4 2025/4/17	1.40
9	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,255,900,000	72.71 1,640,434,746	74.12 1,672,185,875	5.75 2049/9/30	1.37
10	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55 ウルグアイ	国債証券	1,725,100,000	95.28 1,643,729,687	96.41 1,663,216,177	4.975 2055/4/20	1.37
11	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,592,400,000	100.21 1,595,858,162	99.70 1,587,756,800	4.375 2031/1/23	1.31
12	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,725,100,000	92.85 1,601,781,890	91.92 1,585,711,920	4.4 2050/4/16	1.30
13	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30 サウジアラビア	国債証券	1,592,400,000	98.81 1,573,536,695	99.42 1,583,226,183	4.5 2030/4/17	1.30
14	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,592,400,000	98.95 1,575,690,416	98.53 1,569,063,378	4 2029/3/14	1.29
15	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,725,100,000	86.15 1,486,192,228	87.01 1,501,031,505	3.875 2030/6/12	1.23
16	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,592,400,000	86.20 1,372,802,732	89.68 1,428,163,048	4.85 2029/9/30	1.17
17	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,459,700,000	96.23 1,404,689,215	97.13 1,417,806,610	3.75 2030/4/16	1.17
18	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	1,990,500,000	71.24 1,418,217,980	70.47 1,402,852,288	4.75 2050/1/14	1.15
19	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,459,700,000	96.75 1,412,283,636	95.69 1,396,786,930	2.5 2025/4/16	1.15
20	PANAMA 2.252 09/29/32 パナマ	国債証券	1,857,800,000	74.44 1,383,121,484	74.45 1,383,307,624	2.252 2032/9/29	1.14
21	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,592,400,000	86.09 1,370,955,548	86.70 1,380,714,306	7.3 2052/4/20	1.13
22	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	1,327,000,000	98.16 1,302,642,915	100.57 1,334,590,440	6 2029/8/1	1.10

23	OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 オマーン	国債証券	1,327,000,000	97.67 1,296,080,900	98.58 1,308,156,600	5.625 2028/1/17	1.08
24	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,725,100,000	73.42 1,266,634,770	74.62 1,287,416,253	2.125 2031/9/22	1.06
25	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,592,400,000	77.73 1,237,820,292	79.49 1,265,876,246	3 2034/1/15	1.04
26	SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30 サウジアラビア	国債証券	1,353,540,000	89.30 1,208,825,342	91.52 1,238,838,313	3.25 2030/10/22	1.02
27	ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30 アラブ首長国連邦	国債証券	1,327,000,000	94.55 1,254,728,926	93.07 1,235,050,843	3.125 2030/4/16	1.02
28	STATE OF QATAR 4.5 04/23/28 カタール	国債証券	1,194,300,000	100.59 1,201,353,005	101.19 1,208,571,885	4.5 2028/4/23	0.99
29	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31 オマーン	国債証券	1,194,300,000	98.66 1,178,296,380	100.92 1,205,306,668	6.25 2031/1/25	0.99
30	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,194,300,000	96.80 1,156,089,035	95.88 1,145,133,057	2.125 2024/9/30	0.94

(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12月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	96.13
合計	96.13

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

ワールドアセットバランス(基本コース)

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

該当事項はありません。

(参考)

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。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

ワールドアセットバランス(基本コース)

該当事項はありません。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

該当事項はありません。

(参考)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Mar23	買建	593	15,493,073,337	15,233,613,321	1.95
	E U R E X 取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar23	買建	570	3,129,273,959	3,106,978,287	0.40
	I C E - E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar23	買建	82	979,548,800	984,262,400	0.13
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar23	買建	33	769,938,132	761,462,816	0.10
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Mar23	買建	30	476,731,846	467,622,577	0.06

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

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年12月30日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	I C E - U S	MINI MSCI EMG MKT Mar23	買建	1,051	6,802,547,683	6,796,958,359	6.87

(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。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

直近日(2022年12月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	6,004	6,004	1.0341	1.0341
第2計算期間末 (2017年12月11日)	13,684	13,684	1.0542	1.0542
第3計算期間末 (2018年6月11日)	16,409	16,409	1.0376	1.0376
第4計算期間末 (2018年12月11日)	14,083	14,083	1.0007	1.0007
第5計算期間末 (2019年6月11日)	12,878	12,878	1.0565	1.0565
第6計算期間末 (2019年12月11日)	12,003	12,003	1.0853	1.0853
第7計算期間末 (2020年6月11日)	11,343	11,343	1.0724	1.0724
第8計算期間末 (2020年12月11日)	10,467	10,467	1.1486	1.1486
第9計算期間末 (2021年6月11日)	9,706	9,706	1.1869	1.1869
第10計算期間末 (2021年12月13日)	8,589	8,589	1.1896	1.1896
第11計算期間末 (2022年6月13日)	6,748	6,748	1.0025	1.0025
第12計算期間末 (2022年12月12日)	6,104	6,104	0.9632	0.9632
2021年12月末日	8,446	-	1.1872	-
2022年1月末日	8,046	-	1.1475	-
2月末日	7,807	-	1.1209	-
3月末日	7,633	-	1.1045	-
4月末日	7,159	-	1.0519	-
5月末日	7,022	-	1.0398	-
6月末日	6,626	-	0.9890	-
7月末日	6,801	-	1.0195	-
8月末日	6,510	-	0.9916	-
9月末日	5,945	-	0.9157	-
10月末日	5,925	-	0.9231	-
11月末日	6,098	-	0.9565	-
12月末日	5,953	-	0.9405	-

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

直近日(2022年12月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月12日)	10,386	10,386	1.0337	1.0337
第2計算期間末 (2017年12月11日)	47,243	47,243	1.0544	1.0544
第3計算期間末 (2018年6月11日)	64,853	64,853	1.0356	1.0356
第4計算期間末 (2018年12月11日)	53,883	53,883	0.9975	0.9975
第5計算期間末 (2019年6月11日)	49,438	49,438	1.0392	1.0392
第6計算期間末 (2019年12月11日)	46,310	46,310	1.0681	1.0681
第7計算期間末 (2020年6月11日)	41,188	41,188	1.0437	1.0437
第8計算期間末 (2020年12月11日)	36,032	36,032	1.0685	1.0685
第9計算期間末 (2021年6月11日)	30,943	30,943	1.0971	1.0971
第10計算期間末 (2021年12月13日)	26,061	26,061	1.0983	1.0983
第11計算期間末 (2022年6月13日)	22,061	22,061	1.0041	1.0041
第12計算期間末 (2022年12月12日)	20,162	20,162	0.9801	0.9801
2021年12月末日	25,699	-	1.0960	-
2022年1月末日	24,642	-	1.0642	-
2月末日	23,975	-	1.0469	-
3月末日	23,537	-	1.0390	-
4月末日	22,855	-	1.0203	-
5月末日	22,401	-	1.0139	-
6月末日	21,864	-	0.9993	-
7月末日	21,789	-	1.0047	-
8月末日	21,362	-	0.9963	-
9月末日	20,657	-	0.9759	-
10月末日	20,427	-	0.9755	-
11月末日	20,278	-	0.9795	-
12月末日	19,880	-	0.9750	-

【分配の推移】

ワールドアセットバランス(基本コース)

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

第6計算期間	0.0000
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
第9計算期間	0.0000
第10計算期間	0.0000
第11計算期間	0.0000
第12計算期間	0.0000

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

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

【収益率の推移】

ワールドアセットバランス（基本コース）

	収益率（％）
第1計算期間	3.4
第2計算期間	1.9
第3計算期間	1.6
第4計算期間	3.6
第5計算期間	5.6
第6計算期間	2.7
第7計算期間	1.2
第8計算期間	7.1
第9計算期間	3.3
第10計算期間	0.2
第11計算期間	15.7
第12計算期間	3.9

（注）収益率は期間騰落率です。

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

	収益率（％）
第1計算期間	3.4
第2計算期間	2.0
第3計算期間	1.8
第4計算期間	3.7
第5計算期間	4.2
第6計算期間	2.8
第7計算期間	2.3
第8計算期間	2.4

第9計算期間	2.7
第10計算期間	0.1
第11計算期間	8.6
第12計算期間	2.4

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

ワールドアセットバランス(基本コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	5,868,621,462	62,212,876
第2計算期間	7,912,713,431	738,193,959
第3計算期間	4,414,882,467	1,581,611,324
第4計算期間	527,482,147	2,267,181,143
第5計算期間	180,523,898	2,065,395,074
第6計算期間	287,056,004	1,416,879,908
第7計算期間	213,369,846	696,011,702
第8計算期間	122,826,944	1,586,765,325
第9計算期間	227,608,795	1,163,074,115
第10計算期間	159,562,024	1,117,350,709
第11計算期間	48,454,636	537,462,741
第12計算期間	34,334,302	427,232,156

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	10,404,764,520	356,726,722
第2計算期間	37,154,151,069	2,394,963,569
第3計算期間	23,144,363,900	5,324,740,324
第4計算期間	2,278,919,156	10,886,978,597
第5計算期間	226,859,362	6,670,815,337
第6計算期間	398,143,626	4,613,079,433
第7計算期間	284,570,545	4,182,089,512
第8計算期間	108,436,378	5,849,150,571
第9計算期間	107,132,818	5,624,497,695
第10計算期間	92,831,691	4,569,076,002
第11計算期間	36,964,114	1,793,363,306
第12計算期間	25,965,966	1,426,678,849

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

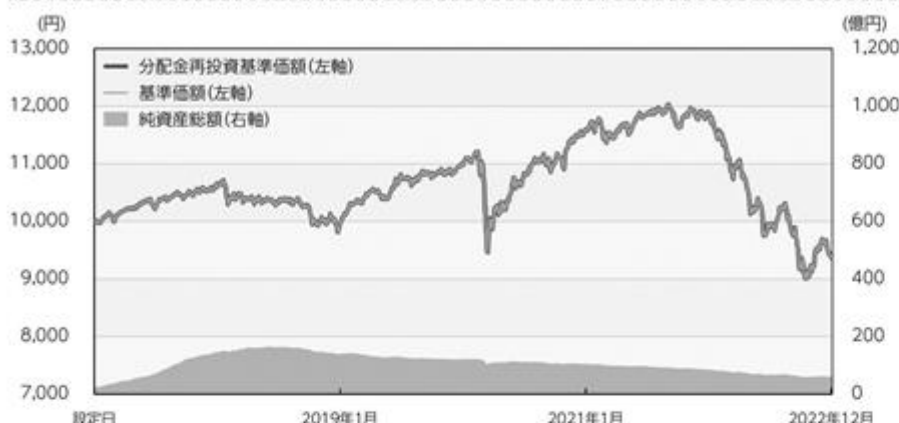
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2022年12月30日

(基本コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日~2022年12月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2020年12月	0円
2021年6月	0円
2021年12月	0円
2022年6月	0円
2022年12月	0円
設定来累計	0円

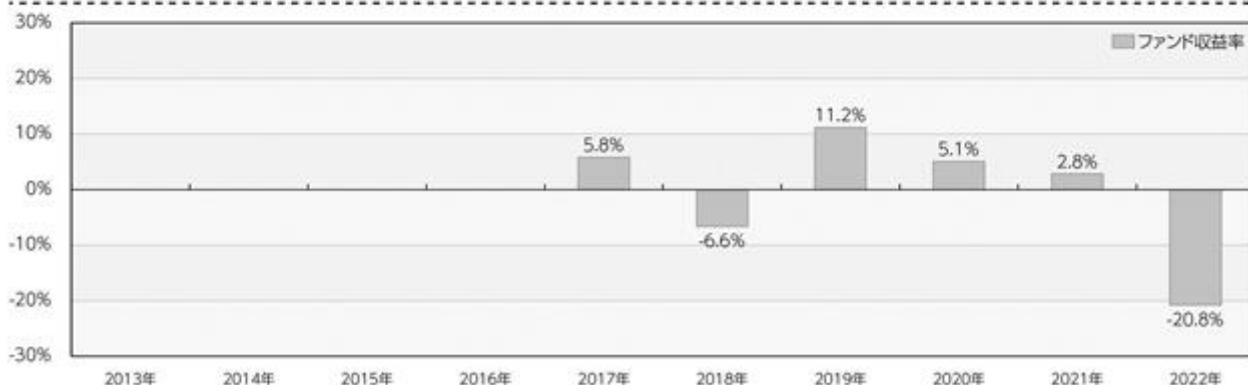
※分配金は1万口当たりです。

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	種類	国/地域	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	44.73
2	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	14.41
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	13.98
4	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	13.94
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	9.14
6	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.64

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。

※2017年は設定日から年末までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年12月30日

(リスク抑制コース)

基準価額・純資産の推移 (2017年1月18日～2022年12月30日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2017年1月18日)

分配の推移(税引前)

2020年12月	0円
2021年6月	0円
2021年12月	0円
2022年6月	0円
2022年12月	0円
設定来累計	0円

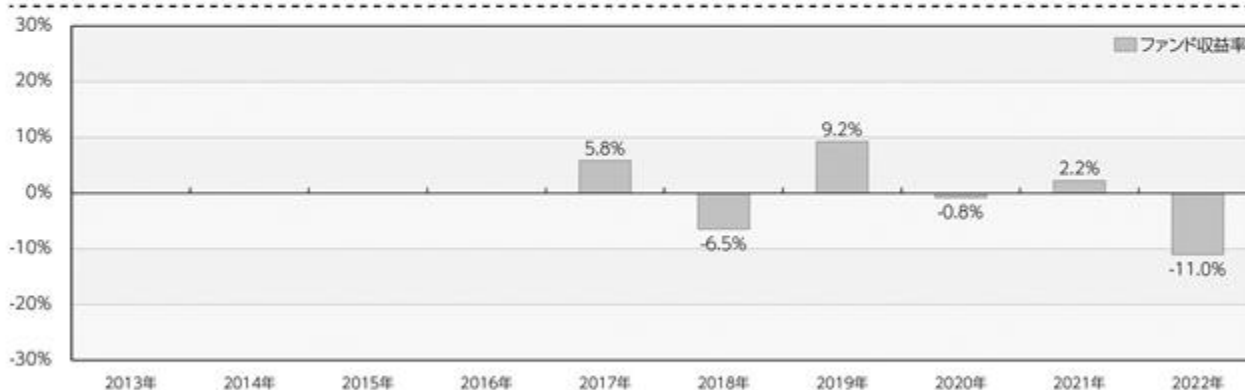
※分配金は1万口当たりです。

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	種類	国/地域	比率(%)
1	1059回 国庫短期証券	国債証券	日本	25.16
2	1074回 国庫短期証券	国債証券	日本	12.58
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	8.68
4	1108回 国庫短期証券	国債証券	日本	5.03
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2.82
6	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2.77
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	2.55
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	1.85
9	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	投資信託受益証券	アメリカ	0.30

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2017年は設定日から年末までの収益率を表示しています。

※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

データの基準日:2022年12月30日

主要な資産の状況

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	4.32
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.54
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.60
4	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	1.10
5	UNITEDHEALTH GROUP INC	株式	アメリカ	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケアサービス	1.03

■為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 3.25 08/31/24	国債証券	アメリカ	3.25	2024/8/31	1.19
2	US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	アメリカ	0.375	2024/8/15	0.92
3	US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	アメリカ	0.625	2024/10/15	0.88
4	US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	アメリカ	2.25	2024/11/15	0.88
5	US T N/B 1.0 12/15/24	国債証券	アメリカ	1	2024/12/15	0.83

■外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	アメリカ	8.32
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.87
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.54
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.18
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.04

■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	5.26
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	3.96
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.09
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	2.40
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.53

○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12月30日

■エマージング債券パッシブ・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	国債証券	ドミニカ共和国	6	2033/2/22	2.49
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.84
3	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.81
4	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	国債証券	カタール	5.103	2048/4/23	1.75
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.60

○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。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

・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します。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位としします。

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
不動産投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
上場先物取引等	計算日 における主たる金融商品取引所等が発表する清算値段または最終相場
上場投資信託証券	計算日 における金融商品取引所等の最終相場
外貨建資産の円換算	計算日の国内における対顧客電信売買相場の仲値
外国為替予約の円換算	計算日の国内における対顧客先物売買相場の仲値

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。
各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

信託期間は、2017年1月18日（設定日）から原則として2027年6月11日までです。

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

（4）【計算期間】

- 計算期間は、原則として毎年6月12日から12月11日まで、および12月12日から翌年6月11日までとします。
- 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日よ

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

(5) 【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、各ファンドにつき受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合にも適用しません。
- f. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- g. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が、信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「ロ.信託約款の変更等 b.」の書面決議が否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は下記「ロ.信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約を行う場合において、投資信

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

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
- 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發します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.の規定にかかわらず、この信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。
- h. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて約款を変更しようとするときは、上記a.からg.の規定にしたがいます。
- i. この信託は、受益者が一部解約請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

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、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二．公告

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

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

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

ホ．運用報告書

- ・委託会社は、毎年6月11日、12月11日(休業日の場合は翌営業日とします。)および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。
- ・運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページにおいて開示します。ただし、受益者から運用報告書(全体版)の請求があった場合には、これを交付します。

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

4【受益者の権利等】

収益分配金請求権

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

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

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

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

償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

一部解約請求権

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

帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

ワールドアセットバランス(基本コース)

ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)

(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12期計算期間(2022年6月14日から2022年12月12日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【ワールドアセットバランス（基本コース）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	4,878,254	5,421,935
コール・ローン	223,934,944	245,708,884
投資信託受益証券	41,580,189	40,408,860
親投資信託受益証券	6,595,966,384	5,849,618,745
派生商品評価勘定	-	4,676,712
未収入金	100,000,000	-
流動資産合計	6,966,359,771	6,145,835,136
資産合計	6,966,359,771	6,145,835,136
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	163,798,213	1,849,501
未払金	1,970,134	-
未払解約金	4,833,412	-
未払受託者報酬	1,261,949	1,043,246
未払委託者報酬	46,273,100	38,254,019
その他未払費用	149,663	123,710
流動負債合計	218,286,471	41,270,476
負債合計	218,286,471	41,270,476
純資産の部		
元本等		
元本	6,730,962,778	6,338,064,924
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,110,522	233,500,264
（分配準備積立金）	1,036,018,464	1,013,784,874
元本等合計	6,748,073,300	6,104,564,660
純資産合計	6,748,073,300	6,104,564,660
負債純資産合計	6,966,359,771	6,145,835,136

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6月13日	第12期 自 2022年6月14日 至 2022年12月12日
営業収益		
受取配当金	381,090	445,334
受取利息	1,174	35,864
有価証券売買等損益	538,325,110	97,861,050
為替差損益	705,408,120	123,685,277
営業収益合計	1,243,350,966	221,065,129
営業費用		
支払利息	13,545	41,311
受託者報酬	1,261,949	1,043,246
委託者報酬	46,273,100	38,254,019
その他費用	1,161,874	1,402,945
営業費用合計	48,710,468	40,741,521
営業利益又は営業損失()	1,292,061,434	261,806,650
経常利益又は経常損失()	1,292,061,434	261,806,650
当期純利益又は当期純損失()	1,292,061,434	261,806,650
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()	35,657,663	12,980,799
期首剰余金又は期首欠損金()	1,369,177,122	17,110,522
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,201,616	-
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	6,201,616	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	101,864,445	1,784,935
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	101,864,445	1,074,591
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	710,344
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	17,110,522	233,500,264

(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12期	
	自 2022年6月14日	至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い 当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2022年6月13日、当計算期間末日を2022年12月12日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	2022年6月13日現在	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	7,219,970,883円	6,730,962,778円
期中追加設定元本額	48,454,636円	34,334,302円
期中一部解約元本額	537,462,741円	427,232,156円
2. 受益権の総数	6,730,962,778口	6,338,064,924口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は233,500,264円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第11期	第12期
	自 2021年12月14日 至 2022年6月13日	自 2022年6月14日 至 2022年12月12日

1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(37,184,797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(234,475,225円)及び分配準備積立金(998,833,667円)より分配対象収益は1,270,493,689円(1万口当たり1,887.53円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(43,335,133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(225,922,694円)及び分配準備積立金(970,449,741円)より分配対象収益は1,239,707,568円(1万口当たり1,955.97円)であります。分配を行っておりません。
-------------	--	--

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6月13日	第12期 自 2022年6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
	1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	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	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	6,964,745	1,713,411
親投資信託受益証券	517,506,905	96,680,493
合計	524,471,650	98,393,904

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第11期 2022年6月13日現在		
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引			

売建	3,690,640,633	-	3,854,438,846	163,798,213
アメリカ・ドル	3,007,478,528	-	3,150,236,160	142,757,632
イギリス・ポンド	82,795,236	-	84,420,300	1,625,064
イスラエル・シケル	1,941,270	-	1,989,650	48,380
オーストラリア・ドル	66,709,584	-	68,068,800	1,359,216
カナダ・ドル	52,933,920	-	54,771,600	1,837,680
シンガポール・ドル	24,427,468	-	25,203,880	776,412
スイス・フラン	30,911,310	-	31,377,060	465,750
スウェーデン・クローナ	10,432,424	-	10,601,800	169,376
デンマーク・クローネ	7,995,721	-	8,182,040	186,319
ニュージーランド・ドル	2,519,349	-	2,561,700	42,351
ノルウェー・クローネ	2,196,848	-	2,209,920	13,072
メキシコ・ペソ	21,207,930	-	21,804,836	596,906
ユーロ	125,893,040	-	128,783,200	2,890,160
香港・ドル	218,412,600	-	228,653,600	10,241,000
南アフリカ・ランド	34,785,405	-	35,574,300	788,895
合計	3,690,640,633	-	3,854,438,846	163,798,213

種類	第12期 2022年12月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	3,161,066,288	-	3,158,239,077	2,827,211
アメリカ・ドル	2,591,658,013	-	2,589,137,287	2,520,726
イギリス・ポンド	67,679,520	-	68,337,734	658,214
イスラエル・シケル	2,002,835	-	1,989,390	13,445
オーストラリア・ドル	58,516,668	-	58,034,781	481,887
カナダ・ドル	42,708,120	-	41,883,492	824,628
シンガポール・ドル	23,096,186	-	23,124,936	28,750
スイス・フラン	26,156,340	-	26,275,068	118,728
スウェーデン・クローナ	8,742,830	-	8,831,270	88,440
デンマーク・クローネ	6,904,080	-	6,948,360	44,280
ニュージーランド・ドル	2,584,482	-	2,610,018	25,536
ノルウェー・クローネ	2,083,800	-	2,044,695	39,105
メキシコ・ペソ	17,781,599	-	17,304,694	476,905
ユーロ	104,128,660	-	104,768,213	639,553
香港・ドル	179,050,075	-	179,296,075	246,000
南アフリカ・ランド	27,973,080	-	27,653,064	320,016
合計	3,161,066,288	-	3,158,239,077	2,827,211

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

れている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0025円 (10,025円)	0.9632円 (9,632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12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	13,300.000	295,472.800	
	アメリカ・ドル	小計	13,300.000	295,472.800 (40,408,860)	
投資信託受益証券 合計			13,300	40,408,860 (40,408,860)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	140,743,631	852,498,247	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	340,900,854	561,600,066	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,183,673,055	2,682,642,348	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	615,131,636	860,077,053	
		エマージング債券パッシブ・マザーファンド	436,492,144	892,801,031	
日本円 小計			3,716,941,320	5,849,618,745	
親投資信託受益証券 合計			3,716,941,320	5,849,618,745	
合計				5,890,027,605 (40,408,860)	

（注）投資信託受益証券及び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。

（注）

1. 各種通貨毎の小計の欄における（ ）内の金額は、邦貨換算額であります。

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

3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.66	0.69

(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。

【ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
資産の部		
流動資産		
預金	7,115,575	7,945,482
コール・ローン	9,257,645,623	8,986,189,158
国債証券	7,505,525,000	8,503,960,000
投資信託受益証券	64,089,765	62,284,333
親投資信託受益証券	5,529,654,657	2,783,762,313
派生商品評価勘定	-	2,322,206
流動資産合計	22,364,030,620	20,346,463,492
資産合計	22,364,030,620	20,346,463,492
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	137,739,119	939,730
未払解約金	16,497,366	51,953,217
未払受託者報酬	3,929,566	3,473,986
未払委託者報酬	144,084,954	127,381,556
その他未払費用	428,332	401,297
流動負債合計	302,679,337	184,149,786
負債合計	302,679,337	184,149,786
純資産の部		
元本等		
元本	21,971,656,111	20,570,943,228
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	89,695,172	408,629,522
(分配準備積立金)	1,428,388,805	1,335,701,854
元本等合計	22,061,351,283	20,162,313,706
純資産合計	22,061,351,283	20,162,313,706
負債純資産合計	22,364,030,620	20,346,463,492

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第11期 自 2021年12月14日 至 2022年6月13日	第12期 自 2022年6月14日 至 2022年12月12日
営業収益		
受取配当金	587,394	686,418
受取利息	12,719	95,560
有価証券売買等損益	1,167,379,264	219,442,316
為替差損益	840,989,739	160,806,511
営業収益合計	2,007,768,890	379,466,849
営業費用		
支払利息	607,633	2,284,104
受託者報酬	3,929,566	3,473,986
委託者報酬	144,084,954	127,381,556
その他費用	1,891,990	1,604,186
営業費用合計	150,514,143	134,743,832
営業利益又は営業損失()	2,158,283,033	514,210,681
経常利益又は経常損失()	2,158,283,033	514,210,681
当期純利益又は当期純損失()	2,158,283,033	514,210,681
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()	88,986,117	21,966,041
期首剰余金又は期首欠損金()	2,333,206,205	89,695,172
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,082,906	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,082,906	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	176,297,023	6,080,054
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	176,297,023	5,815,658
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	264,396
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	89,695,172	408,629,522

(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12期	
	自 2022年6月14日	至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p> <p>計算期間末日の取扱い</p> <p>当ファンドは、原則として毎年6月11日及び12月11日を計算期間の末日としておりますが、該当日が休業日のため、前計算期間末日を2022年6月13日、当計算期間末日を2022年12月12日としております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第11期	第12期
	2022年6月13日現在	2022年12月12日現在
1. 期首元本額	23,728,055,303円	21,971,656,111円
期中追加設定元本額	36,964,114円	25,965,966円
期中一部解約元本額	1,793,363,306円	1,426,678,849円
2. 受益権の総数	21,971,656,111口	20,570,943,228口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は408,629,522円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第11期	第12期
	自 2021年12月14日 至 2022年6月13日	自 2022年6月14日 至 2022年12月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（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（628,335,130円）及び分配準備積立金（1,428,388,805円）より分配対象収益は2,056,723,935円（1万口当たり936.08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（589,909,639円）及び分配準備積立金（1,335,701,854円）より分配対象収益は1,925,611,493円（1万口当たり936.08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11期	第12期
	自 2021年12月14日 至 2022年6月13日	自 2022年6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	470,000	2,809,000
投資信託受益証券	10,735,133	2,640,972
親投資信託受益証券	438,672,449	57,571,979
合計	449,877,582	63,021,951

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第11期 2022年6月13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	3,099,750,573	-	3,237,489,692	137,739,119
アメリカ・ドル	2,537,560,008	-	2,658,011,760	120,451,752
イギリス・ポンド	68,184,312	-	69,522,600	1,338,288
イスラエル・シェケル	1,553,016	-	1,591,720	38,704
オーストラリア・ドル	55,591,320	-	56,724,000	1,132,680
カナダ・ドル	43,772,280	-	45,291,900	1,519,620
シンガポール・ドル	20,669,396	-	21,326,360	656,964
スイス・フラン	25,535,430	-	25,920,180	384,750
スウェーデン・クローナ	8,583,640	-	8,723,000	139,360
デンマーク・クローネ	6,508,145	-	6,659,800	151,655
ニュージーランド・ドル	2,519,349	-	2,561,700	42,351
ノルウェー・クローネ	1,922,242	-	1,933,680	11,438
メキシコ・ペソ	17,044,410	-	17,524,132	479,722
ユーロ	103,758,000	-	106,140,000	2,382,000
香港・ドル	178,671,360	-	187,048,960	8,377,600
南アフリカ・ランド	27,877,665	-	28,509,900	632,235
合計	3,099,750,573	-	3,237,489,692	137,739,119

種類	第12期 2022年12月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	1,576,172,546	-	1,574,790,070	1,382,476
アメリカ・ドル	1,297,873,976	-	1,296,611,624	1,262,352
イギリス・ポンド	34,665,120	-	35,002,254	337,134
イスラエル・シェケル	1,201,701	-	1,193,634	8,067
オーストラリア・ドル	30,651,588	-	30,399,171	252,417
カナダ・ドル	22,370,920	-	21,938,972	431,948
シンガポール・ドル	12,050,184	-	12,065,184	15,000
スイス・フラン	13,078,170	-	13,137,534	59,364
スウェーデン・クローナ	4,567,150	-	4,613,350	46,200
デンマーク・クローネ	3,643,820	-	3,667,190	23,370
ニュージーランド・ドル	1,722,988	-	1,740,012	17,024
ノルウェー・クローネ	1,111,360	-	1,090,504	20,856
メキシコ・ペソ	7,731,130	-	7,523,780	207,350
ユーロ	54,203,960	-	54,536,878	332,918
香港・ドル	79,131,399	-	79,240,119	108,720
南アフリカ・ランド	12,169,080	-	12,029,864	139,216
合計	1,576,172,546	-	1,574,790,070	1,382,476

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第11期 2022年6月13日現在	第12期 2022年12月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0041円 (10,041円)	0.9801円 (9,801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12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	1059回 国庫短期証券	5,000,000,000	5,001,700,000	
		1074回 国庫短期証券	2,500,000,000	2,501,300,000	
		1108回 国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,960,000	
	日本円 小計		8,500,000,000	8,503,960,000	
国債証券 合計			8,500,000,000	8,503,960,000	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	XTRACKERS MSCI EMERGING MARKETS HEDGED EQUITY ETF	20,500.000	455,428.000	
	アメリカ・ドル 小計		20,500.000	455,428.000 (62,284,333)	
投資信託受益証券 合計			20,500	62,284,333 (62,284,333)	
親投資信託受益証券	日本円	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	72,776,027	440,811,673	
		外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	177,581,303	292,547,438	
		為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,015,970,007	1,248,119,153	
		エマージング株式パッシブ・マザーファンド	268,059,425	374,800,688	

	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	208,997,439	427,483,361	
	日本円 小計	1,743,384,201	2,783,762,313	
親投資信託受益証券 合計		1,743,384,201	2,783,762,313	
合計			11,350,006,646 (62,284,333)	

(注) 投資信託受益証券及び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。

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.31	0.55

(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。

(参考)

「ワールドアセットバランス(基本コース)」、「ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)」は、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

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12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,150,503,578
コール・ローン	274,018,851
株式	770,947,917,433
投資信託受益証券	1,377,100,248
投資証券	16,847,207,006
派生商品評価勘定	181,652,814
未収入金	5,839,878
未収配当金	1,072,834,549
差入委託証拠金	9,585,281,494
流動資産合計	807,442,355,851
資産合計	807,442,355,851
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	187,750,279
未払解約金	97,844,000
流動負債合計	285,594,279
負債合計	285,594,279
純資産の部	
元本等	
元本	133,258,330,696
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	673,898,430,876
元本等合計	807,156,761,572
純資産合計	807,156,761,572
負債純資産合計	807,442,355,851

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6月14日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	123,455,090,340円
同期中追加設定元本額	24,138,022,054円
同期中一部解約元本額	14,334,781,698円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	2,861,903,205円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,856,832円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	11,877,155円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	38,749,126円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,880,344円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,714,557円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,925,009円
たわらノーロード 先進国株式	40,487,334,953円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	427,168,371円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,936,671,241円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	766,953,418円
たわらノーロード バランス(堅実型)	77,034,673円
たわらノーロード バランス(標準型)	692,775,279円
たわらノーロード バランス(積極型)	870,035,350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)	456,933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)	143,490,863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)	429,896,865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)	361,405,484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)	527,041,739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)	1,236,230円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	27,131,245円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,947,708円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,382,020円
たわらノーロード 全世界株式	513,766,898円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	54,915,534,545円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,705,189,026円
Oneグローバルバランス	2,872,387円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	151,931,899円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	778,625,230円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,021,311,004円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	92,479,879円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	251,459,909円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	243,720,271円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,419,810円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	621,612,619円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,721,570円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	165,639,286円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	191,366,860円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	310,006,105円
投資のソムリエ	5,272,754,008円
クルーズコントロール	137,196,520円
投資のソムリエ<DC年金>	372,651,169円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	193,679,613円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	213,133,455円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	333,897,660円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,489,813,185円
ワールドアセットバランス(基本コース)	140,743,631円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	72,776,027円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	35,463,511円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	17,965,725円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,299,768円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	53,384,524円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	129,275,699円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	148,672,713円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	145,293,344円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	30,524,371円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	18,656,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	11,991,434円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	89,588,181円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,296,343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)	7,404,225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)	7,540,308円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	4,563,371円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	7,222,338円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	13,533,851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)	6,493,945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)	431,681,147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)	40,516,800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)	1,109,667,253円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,414,564円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,060,939,153円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	134,606,634円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	3,229,040円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	6,961,414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)	12,507,555円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	2,732,908円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	3,963,236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)	25,972,640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)	49,619,692円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,865,650円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	17,920,725円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,231,956円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,344円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,437,592円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,892,591円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	160,845,344円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	256,042,424円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	861,075,688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)	44,175,660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)	38,247,820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)	255,105,942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)	10,503,903円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	166,172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)	102,730,060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)	9,078,381円

D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	30,115,606円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	46,636,024円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	100,075,117円
動的パッケージファンド<DC年金>	8,359,934円
コア資産形成ファンド	5,545,575円
MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,744,262,783円
MHAM外国株式インデックスファンド	140,467,409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)	6,553,329円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	1,100,924,377円
MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,402,882,298円
計	133,258,330,696円
2. 受益権の総数	133,258,330,696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6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	63,605,670,367	
投資信託受益証券	117,928,156	
投資証券	2,599,033,566	
合計	66,322,632,089	

(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12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年12月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	331,865,514	-	331,876,497	10,983
イギリス・ポンド	222,716,880	-	222,721,115	4,235
オーストラリア・ドル	17,049,708	-	17,050,850	1,142
カナダ・ドル	12,931,660	-	12,930,764	896
ユーロ	10,606,148	-	10,607,928	1,780
	68,561,118	-	68,565,840	4,722
合計	331,865,514	-	331,876,497	10,983

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2022年12月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	18,265,626,085	-	18,259,517,637	6,108,448
合計	18,265,626,085	-	18,259,517,637	6,108,448

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	6.0571円 (60,571円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年12月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,105,512	89.090	98,490,064.080	
	ABBOTT LABORATORIES	211,539	107.510	22,742,557.890	
	AES CORP	79,505	28.520	2,267,482.600	
	ABIOMED INC	5,283	380.750	2,011,502.250	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	108,940	147.050	16,019,627.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	195,897	68.590	13,436,575.230	
	ADOBE INC	55,960	330.640	18,502,614.400	
	CHUBB LTD	50,533	217.330	10,982,336.890	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,919	314.410	8,463,602.790	
	ALLSTATE CORP	32,939	128.550	4,234,308.450	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	80,405	211.630	17,016,110.150	
AMGEN INC	64,461	278.650	17,962,057.650	
HESS CORP	33,470	129.320	4,328,340.400	
AMERICAN EXPRESS CO	75,741	153.900	11,656,539.900	
AMERICAN ELECTRIC POWER	62,653	96.580	6,051,026.740	
AFLAC INC	72,673	69.960	5,084,203.080	
AMERICAN INTL GROUP	93,843	62.510	5,866,125.930	
ANALOG DEVICES	61,526	168.680	10,378,205.680	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	82,900	65.770	5,452,333.000	
VALERO ENERGY CORP	48,490	114.650	5,559,378.500	
ANSYS INC	10,831	242.210	2,623,376.510	
APPLE INC	1,936,748	142.160	275,328,095.680	
APPLIED MATERIALS INC	102,343	107.340	10,985,497.620	
ALBEMARLE CORP	13,961	253.250	3,535,623.250	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	66,469	91.880	6,107,171.720	
AMEREN CORP	31,621	88.610	2,801,936.810	
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	106.740	1,060,568.640	
AUTODESK INC	25,798	194.310	5,012,809.380	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	49,624	257.200	12,763,292.800	
AUTOZONE INC	2,313	2,454.990	5,678,391.870	
AVERY DENNISON CORP	9,514	177.730	1,690,923.220	
BALL CORP	36,411	53.560	1,950,173.160	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	156,522	306.390	47,956,775.580	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,954	44.710	4,066,553.340	
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,174	52.380	3,309,054.120	
BECTON DICKINSON & CO	33,907	247.600	8,395,373.200	
AMETEK INC	27,428	139.110	3,815,509.080	
VERIZON COMM INC	507,941	37.400	18,996,993.400	
WR BERKLEY CORP	24,066	73.560	1,770,294.960	
BEST BUY CO INC	25,405	81.810	2,078,383.050	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	416.090	1,023,165.310	
YUM! BRANDS INC	33,465	127.710	4,273,815.150	
FIRSTENERGY CORP	67,213	41.480	2,787,995.240	
BOEING CO	68,391	179.540	12,278,920.140	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	73.010	1,055,432.560	
BORGWARNER INC	27,800	40.470	1,125,066.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	169,417	46.230	7,832,147.910	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	95.300	1,381,278.200	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,529	102.060	1,993,129.740	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,731	1,455.560	3,975,134.360	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	257,999	78.830	20,338,061.170	
ONEOK INC	52,652	63.550	3,346,034.600	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	135.970	1,072,939.270	
UNITED RENTALS INC	8,287	352.630	2,922,244.810	
SEMPRA ENERGY	36,952	161.150	5,954,814.800	
FEDEX CORP	29,483	172.330	5,080,805.390	
VERISIGN INC	11,850	197.670	2,342,389.500	
AMPHENOL CORP	71,112	78.510	5,583,003.120	
BROWN-FORMAN CORP	38,405	67.920	2,608,467.600	
QUANTA SERVICES INC	17,560	148.140	2,601,338.400	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.110	621,784.150	
CSX CORP	254,377	31.420	7,992,525.340	
COTERRA ENERGY INC	91,495	24.480	2,239,797.600	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	55.660	1,501,595.480	
CONSTELLATION BRANDS INC	19,343	242.040	4,681,779.720	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	77.550	2,470,510.350	
CARLISLE COS INC	6,119	248.330	1,519,531.270	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	8.870	1,173,421.170	
CATERPILLAR INC	63,238	227.290	14,373,365.020	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	131.530	1,661,355.430	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	5.490	532,930.770	
JPMORGAN CHASE & CO	353,481	132.160	46,716,048.960	
CHURCH & DWIGHT CO INC	30,236	80.030	2,419,787.080	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,259	105.910	1,827,900.690	
CINTAS CORP	10,530	453.460	4,774,933.800	
CISCO SYSTEMS INC	500,220	48.460	24,240,661.200	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	15.500	873,642.000	
CLOROX COMPANY	14,322	148.780	2,130,827.160	
COCA-COLA CO/THE	495,630	63.140	31,294,078.200	
COPART INC	49,880	63.790	3,181,845.200	
COGNEX CORP	20,432	48.330	987,478.560	
COLGATE-PALMOLIVE CO	96,159	77.780	7,479,247.020	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	32,963	161.160	5,312,317.080	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,695	341.150	2,283,999.250	
NRG ENERGY, INC.	28,364	32.280	915,589.920	
COMCAST CORP-CL A	530,560	35.320	18,739,379.200	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	38.020	2,123,150.860	
CONSOLIDATED EDISON INC	41,423	96.530	3,998,562.190	
CMS ENERGY CORP	36,603	62.220	2,277,438.660	
COOPER COS INC	6,342	309.470	1,962,658.740	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	52.460	1,116,401.260	
CORNING INC	95,758	33.020	3,161,929.160	

WOLFSPEED INC	15,684	82.670	1,296,596.280	
SEALED AIR CORP	17,610	50.780	894,235.800	
HEICO CORP-CL A	9,463	122.290	1,157,230.270	
CUMMINS INC	16,869	238.140	4,017,183.660	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	62.330	1,248,594.560	
DR HORTON INC	40,602	85.340	3,464,974.680	
DANAHER CORP	83,476	269.340	22,483,425.840	
MOODY'S CORP	19,566	287.970	5,634,421.020	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	62,906	58.340	3,669,936.040	
TARGET CORP	55,931	152.280	8,517,172.680	
DEERE & CO	35,044	434.810	15,237,481.640	
MORGAN STANLEY	155,106	89.470	13,877,333.820	
REPUBLIC SERVICES INC	27,024	135.810	3,670,129.440	
COSTAR GROUP INC	47,398	80.700	3,825,018.600	
THE WALT DISNEY CO	220,561	93.380	20,595,986.180	
DOLLAR TREE INC	26,771	142.310	3,809,781.010	
DOVER CORP	17,842	137.290	2,449,528.180	
OMNICOM GROUP	23,275	75.650	1,760,753.750	
DTE ENERGY CO	23,792	117.190	2,788,184.480	
DUKE ENERGY CORP	91,726	100.350	9,204,704.100	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	142.570	1,987,283.230	
EBAY INC	67,667	43.640	2,952,987.880	
BANK OF AMERICA CORP	871,429	32.380	28,216,871.020	
CITIGROUP INC	233,298	44.860	10,465,748.280	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	85.170	1,430,004.300	
EATON CORP PLC	47,526	158.280	7,522,415.280	
CADENCE DESIGN SYS INC	32,734	163.670	5,357,573.780	
DISH NETWORK CORP	24,416	14.740	359,891.840	
ECOLAB INC	30,824	150.350	4,634,388.400	
PERKINELMER INC	15,649	139.150	2,177,558.350	
ELECTRONIC ARTS INC	33,011	124.710	4,116,801.810	
SALESFORCE INC	120,954	131.110	15,858,278.940	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	266.900	899,986.800	
EMERSON ELECTRIC CO	71,700	94.190	6,753,423.000	
ATMOS ENERGY CORP	17,567	117.670	2,067,108.890	
ENTERGY CORP	23,769	116.870	2,777,883.030	
EOG RESOURCES INC	71,192	121.670	8,661,930.640	
EQUIFAX INC	15,156	197.450	2,992,552.200	
EQT CORP	40,996	35.670	1,462,327.320	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	28,280	240.410	6,798,794.800	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	107.910	2,155,394.340	
EXXON MOBIL CORP	502,575	103.540	52,036,615.500	
FMC CORP	15,534	126.600	1,966,604.400	
NEXTERA ENERGY INC	237,236	84.510	20,048,814.360	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	449.740	2,120,973.840	
FAIR ISAAC CORP	2,962	615.450	1,822,962.900	

ASSURANT INC	5,823	130.360	759,086.280	
FASTENAL CO	68,855	50.960	3,508,850.800	
FIFTH THIRD BANCORP	84,362	32.890	2,774,666.180	
M&T BANK CORP	20,766	151.380	3,143,557.080	
FIRST HORIZON CORP	69,634	24.480	1,704,640.320	
FISERV INC	73,824	100.640	7,429,647.360	
FORD MOTOR CO	479,168	13.180	6,315,434.240	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	26.590	1,008,186.440	
FREEMPORT-MCMORAN INC	172,370	38.590	6,651,758.300	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	777.430	987,336.100	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,816	191.830	4,760,453.280	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	30.260	774,625.740	
GENERAL DYNAMICS CORP	27,465	247.040	6,784,953.600	
GENERAL MILLS INC	72,417	85.840	6,216,275.280	
GENUINE PARTS CO	17,374	182.260	3,166,585.240	
GILEAD SCIENCES INC	151,364	87.970	13,315,491.080	
GARTNER INC	9,564	343.300	3,283,321.200	
MCKESSON CORP	17,325	371.410	6,434,678.250	
NVIDIA CORP	300,665	170.010	51,116,056.650	
GENERAL ELECTRIC CO	132,408	81.450	10,784,631.600	
VW GRAINGER INC	5,466	588.060	3,214,335.960	
HALLIBURTON CO	111,570	33.010	3,682,925.700	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,224	100.040	4,724,288.960	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41,062	359.140	14,747,006.680	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	22,879	215.530	4,931,110.870	
HASBRO INC	15,437	59.490	918,347.130	
HENRY SCHEIN INC	17,431	81.200	1,415,397.200	
HEICO CORP	5,185	157.030	814,200.550	
HERSHEY FOODS CORP	17,397	236.770	4,119,087.690	
HP INC	125,955	28.210	3,553,190.550	
F5 INC	6,924	149.490	1,035,068.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	80.260	1,229,743.720	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	32.380	1,415,491.700	
HOLOGIC INC	30,695	74.000	2,271,430.000	
HOME DEPOT INC	123,507	320.480	39,581,523.360	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	102.330	2,341,310.400	
HORMEL FOODS CORP	34,578	47.020	1,625,857.560	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,791	30.450	2,399,185.950	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	257.590	927,839.180	
HUBBELL INC	6,903	250.100	1,726,440.300	
HUMANA INC	15,368	533.420	8,197,598.560	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,348	177.980	1,841,737.040	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	181,491	14.550	2,640,694.050	
BIOGEN INC	17,603	285.370	5,023,368.110	

IDEX CORP	9,065	235.210	2,132,178.650	
ILLINOIS TOOL WORKS	37,531	219.760	8,247,812.560	
INTUIT INC	32,479	399.830	12,986,078.570	
IDEXX LABORATORIES INC	10,162	420.630	4,274,442.060	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	27,989	175.260	4,905,352.140	
INTEL CORP	497,669	28.240	14,054,172.560	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	31,979	107.260	3,430,067.540	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	36.080	1,593,040.240	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	32.070	1,464,925.530	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	181.540	1,479,914.080	
INCYTE CORP	21,658	82.340	1,783,319.720	
JOHNSON & JOHNSON	316,835	175.740	55,680,582.900	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	74.640	2,940,965.280	
KLA CORPORATION	17,734	393.410	6,976,732.940	
DEVON ENERGY CORP	74,759	59.620	4,457,131.580	
KELLOGG CO	29,915	72.340	2,164,051.100	
KEYCORP	106,247	17.420	1,850,822.740	
KIMBERLY-CLARK CORP	39,997	136.200	5,447,591.400	
BLACKROCK INC/NEW YORK	18,251	706.950	12,902,544.450	
KROGER CO	82,775	46.470	3,846,554.250	
LAM RESEARCH CORP	16,432	450.200	7,397,686.400	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,890	405.690	2,389,514.100	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	135.110	1,490,128.190	
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,036	89.020	1,783,604.720	
PLUG POWER INC	56,149	13.360	750,150.640	
LENNAR CORP	29,937	88.500	2,649,424.500	
ELI LILLY & CO	97,400	360.990	35,160,426.000	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	42.310	1,191,280.360	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	31.660	567,885.420	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	88,336	177.640	15,692,007.040	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35,535	152.950	5,435,078.250	
LOCKHEED MARTIN CORP	28,941	483.580	13,995,288.780	
LOEWS CORP	23,530	56.480	1,328,974.400	
LOWE'S COS INC	75,785	201.770	15,291,139.450	
DOMINION ENERGY INC	101,828	58.280	5,934,535.840	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	36.350	1,468,576.350	
MCCORMICK & CO INC	29,367	85.280	2,504,417.760	
MCDONALD'S CORPORATION	88,709	272.040	24,132,396.360	
S&P GLOBAL INC	41,169	346.750	14,275,350.750	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	332.560	1,481,222.240	
MARKEL CORPORATION	1,674	1,298.060	2,172,952.440	

EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	73,886	74.010	5,468,302.860	
MARSH & MCLENNAN COS	59,399	171.060	10,160,792.940	
MASCO CORP	28,937	49.320	1,427,172.840	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,736	356.940	2,761,287.840	
METLIFE INC	81,792	72.190	5,904,564.480	
MEDTRONIC PLC	161,408	78.590	12,685,054.720	
ACTIVISION BLIZZARD INC	94,367	75.160	7,092,623.720	
CVS HEALTH CORP	158,698	101.650	16,131,651.700	
MERCK & CO. INC.	305,529	108.780	33,235,444.620	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	50,668	70.530	3,573,614.040	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	233.560	2,474,101.080	
MICROSOFT CORP	853,885	245.420	209,560,456.700	
MICRON TECH INC	131,009	54.870	7,188,463.830	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	66,120	75.880	5,017,185.600	
3M CO	67,396	125.760	8,475,720.960	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	99.450	627,628.950	
ENTEGRIS INC	17,709	69.830	1,236,619.470	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	210.170	1,354,545.650	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,739	265.570	5,242,086.230	
ILLUMINA INC	18,747	205.620	3,854,758.140	
XCEL ENERGY INC	64,922	69.840	4,534,152.480	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,716	117.240	1,373,583.840	
NETAPP INC	24,953	64.290	1,604,228.370	
NEWELL BRANDS INC	41,984	13.440	564,264.960	
NEWMONT CORP	91,771	46.400	4,258,174.400	
NVR INC	365	4,648.530	1,696,713.450	
NIKE INC-CL B	152,983	109.420	16,739,399.860	
NORDSON CORP	6,447	232.900	1,501,506.300	
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,963	244.050	6,824,370.150	
EVERSOURCE ENERGY	43,042	84.050	3,617,680.100	
NISOURCE INC	53,270	27.390	1,459,065.300	
NORTHERN TRUST CORP	24,836	87.860	2,182,090.960	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,823	528.940	9,427,297.620	
WELLS FARGO & CO	456,709	42.500	19,410,132.500	
NUCOR CORP	31,660	147.070	4,656,236.200	
CHENIERE ENERGY INC	27,166	158.530	4,306,625.980	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	94.410	4,404,604.140	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	110,048	62.600	6,889,004.800	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,630	292.230	3,398,634.900	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	827.800	6,421,244.600	

ORACLE CORP	192,714	79.860	15,390,140.040	
PACCAR INC	40,847	101.260	4,136,167.220	
PTC INC	13,665	121.190	1,656,061.350	
EXELON CORP	116,226	41.420	4,814,080.920	
PARKER HANNIFIN CORP	15,434	289.440	4,467,216.960	
PAYCHEX INC	38,461	119.510	4,596,474.110	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	188.810	1,623,010.760	
PPL CORPORATION	88,737	28.950	2,568,936.150	
PEPSICO INC	166,515	183.100	30,488,896.500	
PENTAIR PLC	19,804	45.070	892,566.280	
PFIZER INC	676,687	51.720	34,998,251.640	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	48.230	1,581,751.080	
CONOCOPHILLIPS	153,140	110.020	16,848,462.800	
PG&E CORP	178,257	15.540	2,770,113.780	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	27,268	214.000	5,835,352.000	
ALTRIA GROUP INC	218,091	46.710	10,187,030.610	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	49,864	154.080	7,683,045.120	
BROWN & BROWN INC	30,650	57.500	1,762,375.000	
GARMIN LTD	17,835	95.030	1,694,860.050	
PPG INDUSTRIES INC	28,341	130.410	3,695,949.810	
COSTCO WHOLESALE CORP	53,486	483.020	25,834,807.720	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,707	119.830	3,320,129.810	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	148.850	2,163,683.600	
PROCTER & GAMBLE CO	287,487	150.920	43,387,538.040	
PROGRESSIVE CORP	70,907	129.380	9,173,947.660	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	60,100	59.770	3,592,177.000	
PULTE GROUP INC	29,050	43.920	1,275,876.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	33,653	97.820	3,291,936.460	
QUALCOMM INC	135,794	119.050	16,166,275.700	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	113.460	2,659,162.020	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	44.600	1,043,015.600	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,959	750.060	9,720,027.540	
REPLIGEN CORP	6,730	163.320	1,099,143.600	
RESMED INC	17,366	219.680	3,814,962.880	
US BANCORP	170,632	43.110	7,355,945.520	
SEAGEN INC	16,860	124.000	2,090,640.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	60.040	2,752,894.040	
ROSS STORES INC	42,360	114.890	4,866,740.400	
ROLLINS INC	25,920	38.510	998,179.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	12,443	431.330	5,367,039.190	
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,905	259.810	3,612,658.050	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	56.210	1,544,482.170	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	103.450	1,703,511.150	

ACCENTURE PLC-CL A	76,242	288.410	21,988,955.220	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	164,080	67.060	11,003,204.800	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	244.530	3,235,620.960	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	28,285	185.650	5,251,110.250	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	75,043	70.270	5,273,271.610	
BOOKING HOLDINGS INC	4,811	2,019.980	9,718,123.780	
SCHLUMBERGER LTD	171,376	46.970	8,049,530.720	
SCHWAB (CHARLES) CORP	175,962	79.820	14,045,286.840	
POOL CORP	4,660	331.010	1,542,506.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24,453	124.400	3,041,953.200	
BUNGE LTD	18,642	95.510	1,780,497.420	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	60.670	878,319.590	
ELEVANCE HEALTH INC	28,587	524.920	15,005,888.040	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	165.330	3,158,464.320	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	88.070	2,595,246.760	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	29,447	252.880	7,446,557.360	
CENTENE CORP	70,080	86.250	6,044,400.000	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	220.270	1,614,579.100	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	58.300	866,104.800	
SNAP-ON INC	6,118	233.840	1,430,633.120	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	44,592	101.370	4,520,291.040	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	145.900	1,045,373.500	
EDISON INTERNATIONAL	45,008	65.790	2,961,076.320	
SOUTHERN CO	131,528	68.360	8,991,254.080	
TRUIST FINANCIAL CORP	160,237	42.080	6,742,772.960	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	38.010	748,797.000	
AT&T INC	860,287	19.090	16,422,878.830	
CHEVRON CORP	224,137	168.000	37,655,016.000	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	79.230	1,526,762.100	
STATE STREET CORP	43,118	79.030	3,407,615.540	
STARBUCKS CORP	138,714	101.790	14,119,698.060	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	108.410	2,486,600.170	
STRYKER CORP	41,473	244.630	10,145,539.990	
NETFLIX INC	53,857	320.010	17,234,778.570	
GEN DIGITAL INC	73,086	22.670	1,656,859.620	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	54.780	916,469.400	
SYNOPSIS INC	18,073	325.750	5,887,279.750	
SYSCO CORP	59,770	82.230	4,914,887.100	
INTUITIVE SURGICAL INC	42,690	270.600	11,551,914.000	
TELEFLEX INC	5,532	247.340	1,368,284.880	

TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	8.440	1,137,551.640	
TERADYNE INC	18,512	92.410	1,710,693.920	
TEXAS INSTRUMENTS INC	110,356	174.260	19,230,636.560	
TEXTRON INC	25,824	71.710	1,851,839.040	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47,277	560.230	26,485,993.710	
GLOBE LIFE INC	12,153	116.520	1,416,067.560	
DAVITA INC	6,813	74.340	506,478.420	
TRACTOR SUPPLY CO	13,690	218.320	2,988,800.800	
BIO-TECHNE CORP	17,612	80.730	1,421,816.760	
TRIMBLE INC	28,676	57.500	1,648,870.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	323.080	1,712,324.000	
TYSON FOODS INC	35,684	63.750	2,274,855.000	
UGI CORP	24,160	38.360	926,777.600	
MARATHON OIL CORP	84,059	26.170	2,199,824.030	
UNION PACIFIC CORP	75,479	211.350	15,952,486.650	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	179,195	98.270	17,609,492.650	
UNITEDHEALTH GROUP INC	112,781	539.200	60,811,515.200	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	127.330	1,030,863.680	
VF CORP	37,887	28.200	1,068,413.400	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	19.020	1,283,222.340	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,026	312.220	9,686,937.720	
VULCAN MATERIALS CO	16,452	182.450	3,001,667.400	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86,056	40.430	3,479,244.080	
WALMART INC	182,063	145.310	26,455,574.530	
WASTE MANAGEMENT INC	48,739	166.830	8,131,127.370	
WATERS CORP	6,836	336.530	2,300,519.080	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	47.210	1,052,074.850	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,653	239.010	2,068,153.530	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	154.680	1,961,187.720	
VAIL RESORTS INC	5,235	258.640	1,353,980.400	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	35.710	1,264,883.910	
WABTEC CORP	20,273	100.390	2,035,206.470	
WHIRLPOOL CORP	6,832	143.810	982,509.920	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	94.520	1,780,095.160	
WYNN RESORTS LTD	12,757	84.990	1,084,217.430	
NASDAQ INC	41,596	63.200	2,628,867.200	
CME GROUP INC	42,685	178.830	7,633,358.550	
WILLIAMS COS INC	143,258	32.590	4,668,778.220	
LKQ CORP	31,504	53.230	1,676,957.920	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	55.310	1,607,640.460	
WEC ENERGY GROUP INC	38,318	95.730	3,668,182.140	
CARMAX INC	18,673	65.700	1,226,816.100	

TJX COMPANIES INC	140,433	78.060	10,962,199.980	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	251.450	1,498,139.100	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.510	515,713.990	
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	49.110	850,978.080	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,121	231.330	3,266,610.930	
SIGNATURE BANK	7,996	118.560	948,005.760	
CBRE GROUP INC	37,573	75.840	2,849,536.320	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	19.030	300,274.370	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	22.020	2,358,319.980	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	362.650	1,492,304.750	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,387	386.100	2,079,920.700	
WESTLAKE CORP	4,187	106.660	446,585.420	
T-MOBILE US INC	75,987	141.570	10,757,479.590	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,972	47.310	2,033,005.320	
MOSAIC CO/THE	42,561	46.810	1,992,280.410	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	280.930	1,177,939.490	
CELANESE CORP	13,841	102.360	1,416,764.760	
DEXCOM INC	46,766	116.460	5,446,368.360	
EXPEDIA GROUP INC	19,186	94.100	1,805,402.600	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	98.700	2,371,464.900	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,123	321.040	4,213,007.920	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	19.670	708,788.780	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	67,741	103.330	6,999,677.530	
LIVE NATION	20,444	71.770	1,467,265.880	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,304	1,526.260	5,042,763.040	
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	609.700	3,748,435.600	
MASTERCARD INC	103,952	348.830	36,261,576.160	
WESTERN UNION CO	46,712	13.980	653,033.760	
OWENS CORNING	10,366	92.800	961,964.800	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	106.850	1,614,289.800	
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	58.740	1,049,155.140	
FIRST SOLAR INC	11,903	150.960	1,796,876.880	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	13,610	142.110	1,934,117.100	
DELTA AIR LINES INC	15,786	33.800	533,566.800	
INSULET CORP	8,015	302.320	2,423,094.800	
DISCOVER FINANCIAL	33,236	103.000	3,423,308.000	
TE CONNECTIVITY LTD	38,762	121.730	4,718,498.260	
MASIMO CORP	5,688	138.490	787,731.120	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,904	326.390	4,538,126.560	
VMWARE INC	24,654	120.940	2,981,654.760	

MERCADOLIBRE INC	5,418	896.480	4,857,128.640	
ULTA BEAUTY INC	6,073	471.630	2,864,208.990	
INVESCO LTD	38,530	18.350	707,025.500	
MSCI INC	9,807	492.550	4,830,437.850	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	187,250	102.090	19,116,352.500	
VISA INC	196,969	208.700	41,107,430.300	
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	37.930	3,520,510.880	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,210	156.140	3,311,729.400	
MARATHON PETROLEUM CORP	60,388	106.830	6,451,250.040	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	16,182	60.330	976,260.060	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	241,328	17.450	4,211,173.600	
XYLEM INC	20,869	111.230	2,321,258.870	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,975	81.460	2,441,763.500	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	233.360	1,099,825.680	
SPLUNK INC	18,478	87.540	1,617,564.120	
EPAM SYSTEMS INC	7,090	343.880	2,438,109.200	
HCA HEALTHCARE INC	27,835	237.590	6,613,317.650	
VERISK ANALYTICS INC	18,974	182.510	3,462,944.740	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	151.950	1,183,994.400	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	183.450	1,622,431.800	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	116.980	2,624,329.320	
NXP SEMICONDUCTOR NV	32,109	169.720	5,449,539.480	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	16,343	104.830	1,713,236.690	
TARGA RESOURCES CORP	25,830	68.620	1,772,454.600	
LEAR CORP	6,911	130.390	901,125.290	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	124.390	1,580,872.510	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	51.740	1,362,572.900	
DOLLAR GENERAL CORP	26,671	243.260	6,487,987.460	
FORTINET INC	81,166	52.130	4,231,183.580	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	97.290	2,404,133.190	
TESLA INC	321,418	179.050	57,549,892.900	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	92.670	640,720.380	
ENPHASE ENERGY INC	16,090	319.550	5,141,559.500	
GENERAL MOTORS CO	164,696	38.280	6,304,562.880	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	25.010	981,142.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	221.040	2,135,467.440	
APTIV PLC	31,921	93.280	2,977,590.880	
PHILLIPS 66	56,789	98.000	5,565,322.000	

META PLATFORMS INC	275,539	115.900	31,934,970.100	
IQVIA HOLDINGS INC	22,514	208.530	4,694,844.420	
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,087	129.600	2,603,275.200	
SERVICENOW INC	24,507	393.580	9,645,465.060	
PALO ALTO NETWORKS INC	35,234	158.900	5,598,682.600	
WORKDAY INC	24,052	169.600	4,079,219.200	
ABBVIE INC	213,376	163.060	34,793,090.560	
ZOETIS INC	57,061	153.390	8,752,586.790	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	18.050	978,508.550	
CDW CORP	16,465	185.480	3,053,928.200	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	38.000	1,611,694.000	
TWILIO INC	21,090	45.550	960,649.500	
SNAP INC	127,318	9.450	1,203,155.100	
TRADE DESK INC A	53,230	47.810	2,544,926.300	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,466	61.670	1,385,478.220	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	41.480	366,890.600	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	41.360	821,864.560	
OKTA INC	17,828	64.420	1,148,479.760	
BLACK KNIGHT INC	17,653	59.890	1,057,238.170	
BAKER HUGHES CO	117,520	27.110	3,185,967.200	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,167	85.580	1,554,731.860	
BROADCOM INC	48,751	544.720	26,555,644.720	
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	69.160	1,350,971.440	
MONGODB INC	7,891	191.750	1,513,099.250	
BURLINGTON STORES INC	7,274	194.920	1,417,848.080	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	12.670	776,937.070	
VEEVA SYSTEMS INC	16,856	172.170	2,902,097.520	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	43.460	1,052,253.520	
EVERGY INC	28,226	62.390	1,761,020.140	
ALLEGION PLC	10,140	109.130	1,106,578.200	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	64.900	1,188,578.600	
STERIS PLC	12,524	191.960	2,404,107.040	
DOCUSIGN INC	26,362	49.160	1,295,955.920	
WIX.COM LTD	5,855	82.740	484,442.700	
DROPBOX INC	30,479	22.390	682,424.810	
KKR & CO INC	67,430	48.000	3,236,640.000	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	66.670	336,683.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	72.160	2,014,779.360	
MODERNA INC	40,114	177.350	7,114,217.900	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	32,335	137.430	4,443,799.050	
ARAMARK	31,133	41.160	1,281,434.280	
CIGNA CORP	37,115	332.120	12,326,633.800	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	41.830	1,370,769.100	
DOW INC	87,667	50.200	4,400,883.400	
OVINTIV INC	31,603	46.710	1,476,176.130	

AMCOR PLC	172,505	12.370	2,133,886.850	
PINTEREST INC	69,746	23.160	1,615,317.360	
FOX CORP-A	36,501	31.310	1,142,846.310	
FOX CORP-B	15,511	29.410	456,178.510	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	9.000	383,274.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	23,558	115.080	2,711,054.640	
CHEWY INC	9,648	43.650	421,135.200	
AVANTOR INC	78,214	21.510	1,682,383.140	
DYNATRACE INC	25,429	36.960	939,855.840	
CLOUDFLARE INC	29,770	48.420	1,441,463.400	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	64.550	890,790.000	
CARRIER GLOBAL CORP	101,898	43.020	4,383,651.960	
OTIS WORLDWIDE CORP	50,475	78.460	3,960,268.500	
UBER TECHNOLOGIES INC	181,560	26.550	4,820,418.000	
CORTEVA INC	86,360	62.990	5,439,816.400	
MATCH GROUP INC	35,259	43.580	1,536,587.220	
FERGUSON PLC	25,702	127.120	3,267,238.240	
BILL.COM HOLDINGS INC	11,988	111.850	1,340,857.800	
BLACKSTONE INC	85,115	78.480	6,679,825.200	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	202.700	1,078,769.400	
CARLYLE GROUP INC	24,530	29.550	724,861.500	
DATADOG INC	29,179	74.560	2,175,586.240	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	54.140	1,207,755.120	
INGERSOLL RAND INC	51,479	53.250	2,741,256.750	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,341	314.130	1,991,898.330	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	27.290	1,046,353.180	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	18.570	172,088.190	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	33.930	1,046,367.270	
AON PLC	25,506	305.680	7,796,674.080	
WARNER BROS DISCOVERY INC	275,379	11.090	3,053,953.110	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	2,380.080	1,751,738.880	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	39.630	894,290.580	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	40.240	526,902.560	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	11.340	210,107.520	
AIRBNB INC	44,486	94.700	4,212,824.200	
CONSTELLATION ENERGY CORP	38,995	89.720	3,498,631.400	
ROYALTY PHARMA PLC	41,775	41.750	1,744,106.250	
ROBLOX CORP	45,019	31.650	1,424,851.350	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	29.040	861,210.240	
VIATRIS INC	150,826	10.780	1,625,904.280	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,444	49.340	1,304,746.960	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	12,687	94.720	1,201,712.640	
HF SINCLAIR CORP	20,299	48.720	988,967.280	

SNOWFLAKE INC	26,591	144.530	3,843,197.230	
DOORDASH INC	29,575	55.270	1,634,610.250	
ARISTA NETWORKS INC	29,367	127.900	3,756,039.300	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	62.880	2,977,619.520	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	202,824	7.110	1,442,078.640	
FNF GROUP	31,004	37.330	1,157,379.320	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	121.360	1,767,122.960	
MARVELL TECHNOLOGY INC	101,624	41.500	4,217,396.000	
APA CORP	40,946	41.860	1,713,999.560	
LUCID GROUP INC	44,910	8.680	389,818.800	
AMERCO-NON VOTING	11,981	59.070	707,717.670	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	217.050	807,643.050	
TOAST INC	32,620	19.300	629,566.000	
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.020	508,350.560	
CATALENT INC	20,564	44.680	918,799.520	
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	35.110	2,145,852.980	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	39.820	2,267,470.260	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	135.870	711,551.190	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	180.720	4,013,610.480	
HUBSPOT INC	5,802	291.380	1,690,586.760	
QORVO INC	11,596	97.600	1,131,769.600	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	88.150	1,351,780.250	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	6,728	314.800	2,117,974.400	
GODADDY INC	19,713	74.720	1,472,955.360	
ETSY INC	15,614	126.780	1,979,542.920	
TRANSUNION	22,126	58.930	1,303,885.180	
ALCOA CORP	19,669	45.080	886,678.520	
BLOCK INC	62,426	64.600	4,032,719.600	
DUPONT DE NEMOURS INC	60,266	68.890	4,151,724.740	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	53.900	1,413,311.900	
WESTROCK CO	27,826	35.880	998,396.880	
KRAFT HEINZ CO	87,780	39.940	3,505,933.200	
NOVOCURE LTD	10,423	75.300	784,851.900	
FORTIVE CORP	38,946	65.720	2,559,531.120	
WASTE CONNECTIONS INC	31,039	139.940	4,343,597.660	
ALPHABET INC-CL A	724,100	92.830	67,218,203.000	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	156,384	16.150	2,525,601.600	
PAYPAL HOLDINGS INC	133,121	73.570	9,793,711.970	
SEA LTD ADR	43,908	60.650	2,663,020.200	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	29.700	1,334,242.800	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	35.100	572,867.100	

	ALPHABET INC-CL C	667,640	93.070	62,137,254.800	
	ZSCALER INC	10,310	117.210	1,208,435.100	
	LINDE PLC	60,190	332.210	19,995,719.900	
	ROKU INC	15,660	51.740	810,248.400	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,085	380.570	5,360,328.450	
	VISTRA CORP	41,133	23.860	981,433.380	
アメリカ・ドル	小計	40,965,917		4,091,346,333.390 (559,532,524,554)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	14.570	669,680.910	
	ASHTED GROUP	54,304	49.020	2,661,982.080	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.400	805,477.800	
	BARCLAYS PLC	2,022,417	1.594	3,223,732.690	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.079	506,595.480	
	BT GROUP PLC	756,852	1.135	859,027.020	
	BUNZL PLC	38,593	30.230	1,166,666.390	
	AVIVA PLC	348,683	4.480	1,562,099.840	
	CRODA INTERNATIONAL	16,782	67.960	1,140,504.720	
	DIAGEO PLC	270,227	37.430	10,114,596.610	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.520	498,854.320	
	DCC PLC	11,135	42.960	478,359.600	
	NATIONAL GRID PLC	436,527	10.170	4,439,479.590	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.416	544,547.070	
	BAE SYSTEMS PLC	379,623	8.256	3,134,167.480	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	256,003	33.160	8,489,059.480	
	HALMA PLC	41,997	21.330	895,796.010	
	NEXT PLC	18,751	58.460	1,096,183.460	
	IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.770	2,240,854.530	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	20.720	413,902.720	
	ANGLO AMERICAN PLC	150,601	31.900	4,804,171.900	
	COMPASS GROUP PLC	212,418	19.195	4,077,363.510	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,380,586	4.962	11,812,467.730	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.547	1,880,141.910	
	UNILEVER PLC	307,132	41.255	12,670,730.660	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.340	936,483.460	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	16.390	694,132.890	
	PEARSON PLC	84,159	9.366	788,233.190	
	PERSIMMON PLC	35,252	12.820	451,930.640	
	PRUDENTIAL PLC	333,971	10.905	3,641,953.750	
	RIO TINTO PLC	134,495	58.350	7,847,783.250	
	VODAFONE GROUP PLC	3,220,482	0.867	2,792,157.890	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	85,378	58.400	4,986,075.200	
	RELX PLC	229,145	23.290	5,336,787.050	

RENTOKIL INITIAL PLC	312,114	5.350	1,669,809.900	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	0.940	1,054,608.560	
NATWEST GROUP PLC	670,464	2.637	1,768,013.560	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	11.385	767,895.480	
SSE PLC	131,574	16.960	2,231,495.040	
BP PLC	2,266,380	4.619	10,468,409.220	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	7.788	1,003,818.680	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.140	834,357.300	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	109.950	982,513.200	
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	5.990	1,766,421.050	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,991,045	0.464	3,707,844.880	
TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.043	594,367.100	
TESCO PLC	934,247	2.279	2,129,148.910	
3I GROUP PLC	107,283	13.380	1,435,446.540	
SMITH & NEPHEW PLC	107,679	10.980	1,182,315.420	
GSK PLC	483,275	14.578	7,045,182.950	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	39,268	74.060	2,908,188.080	
WPP PLC	120,328	8.400	1,010,755.200	
ASTRAZENECA PLC	186,962	113.540	21,227,665.480	
WHITBREAD PLC	25,470	26.370	671,643.900	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	40.800	951,007.200	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	21.370	1,116,133.730	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	49.860	1,084,554.720	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.264	434,907.600	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	20.150	429,698.750	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	38.100	432,816.000	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	14.810	273,318.550	
AVEVA GROUP PLC	11,702	32.000	374,464.000	
ABRDN PLC	285,831	1.852	529,359.010	
EXPERIAN PLC	112,709	28.950	3,262,925.550	
MONDI PLC	58,887	14.875	875,944.120	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.648	319,474.410	
OCADO GROUP PLC	69,766	6.862	478,734.290	
INFORMA PLC	186,195	6.266	1,166,697.870	
GLENCORE PLC	1,187,922	5.425	6,444,476.850	
ENTAIN PLC	74,451	13.995	1,041,941.740	
COCA-COLA HBC AG	21,338	19.900	424,626.200	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.038	520,614.470	
M&G PLC	270,401	1.839	497,267.430	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.229	309,929.220	
HALEON PLC	622,766	3.146	1,959,221.830	
SHELL PLC	879,068	22.860	20,095,494.480	
AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.622	623,103.120	
MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.273	620,214.510	

イギリス・ボンド 小計		34,074,482		216,388,806.930 (36,180,208,519)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	32.210	4,725,303.630	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	31.150	5,617,684.450	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	5.920	1,703,616.160	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	589.000	1,503,717.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	157.000	1,974,118.000	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	20.050	3,267,027.200	
	ICL GROUP LTD	72,257	28.150	2,034,034.550	
	NICE LTD	7,640	675.800	5,163,112.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	123.300	2,150,352.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	242.500	1,132,960.000	
イスラエル・シュケル 小計		894,899		29,271,924.990 (1,167,700,996)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	65.880	1,433,153.520	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	355,854	23.640	8,412,388.560	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	423,771	23.440	9,933,192.240	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	210,104	21.390	4,494,124.560	
	ASX LTD	23,664	68.010	1,609,388.640	
	BHP GROUP LTD	612,254	47.480	29,069,819.920	
	AMPOL LTD	31,828	27.090	862,220.520	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	26.520	1,911,588.120	
	CSL LIMITED	58,245	298.460	17,383,802.700	
	REA GROUP LTD	6,134	121.220	743,563.480	
	TRANSURBAN GROUP	379,633	13.880	5,269,306.040	
	COCHLEAR LTD	7,836	208.680	1,635,216.480	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	7.800	1,663,186.200	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	205,033	104.980	21,524,364.340	
	RIO TINTO LIMITED	45,936	117.160	5,381,861.760	
	APA GROUP	164,300	10.930	1,795,799.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	34.010	2,607,716.750	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.790	1,349,170.560	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	29.260	1,778,042.420	
	IGO LTD	91,947	15.040	1,382,882.880	
ORICA LTD	43,659	15.440	674,094.960		
LEND LEASE CORP LTD	65,475	7.330	479,931.750		
BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	18.220	916,921.500		
MACQUARIE GROUP LTD	43,565	168.040	7,320,662.600		
SUNCORP GROUP LTD	154,162	11.790	1,817,569.980		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	374,560	30.190	11,307,966.400	
	NEWCREST MINING LTD	112,815	21.380	2,411,984.700	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.210	699,612.390	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	12.950	2,233,706.650	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	11.140	1,510,338.920	
	REECE LTD	31,558	14.600	460,746.800	
	SANTOS LTD	359,516	7.060	2,538,182.960	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	30.200	1,593,774.800	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	27.760	721,343.600	
	WESFARMERS LTD	139,720	47.920	6,695,382.400	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	225,877	34.180	7,720,475.860	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	145,725	34.450	5,020,226.250	
	SEEK LTD	38,405	21.800	837,229.000	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	90.500	1,916,699.500	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.940	2,040,892.260	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	4.470	1,465,923.090	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.800	846,826.200	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	13.720	1,087,076.760	
	XERO LTD	14,590	70.010	1,021,445.900	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	27.680	658,258.080	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	4.000	1,931,420.000	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.800	1,091,808.000	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.980	1,120,080.600	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.020	901,699.520	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.190	2,500,147.860	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.830	2,545,251.390	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	53.500	793,030.500	
	オーストラリア・ドル 小計	8,420,173		195,121,499.870 (18,025,324,158)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	69.510	3,628,422.000	
	BARRICK GOLD CORP	214,835	22.660	4,868,161.100	
	BANK OF MONTREAL	78,537	126.160	9,908,227.920	
	BANK OF NOVA SCOTIA	144,527	68.660	9,923,223.820	
	NATIONAL BANK OF CANADA	40,967	94.960	3,890,226.320	
	BCE INC	7,697	63.340	487,527.980	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	170,004	58.880	10,009,835.520	
	SAPUTO INC	26,668	34.110	909,645.480	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	9.780	902,801.580	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	93.380	1,074,617.040	

CGI INC	25,261	116.160	2,934,317.760	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	60.590	991,434.170	
CAE INC	40,808	27.770	1,133,238.160	
CAMECO CORP	54,264	29.550	1,603,501.200	
ROGERS COMM-CL B	45,607	60.830	2,774,273.810	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	109,348	58.520	6,399,044.960	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	136,276	74.650	10,173,003.400	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	149.750	917,069.000	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	37.320	609,435.600	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,975	170.040	12,068,589.000	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.460	856,794.980	
OPEN TEXT CORP	33,217	38.400	1,275,532.800	
EMPIRE CO LTD	29,433	36.970	1,088,138.010	
KINROSS GOLD CORP	219,914	5.740	1,262,306.360	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	77.190	1,025,546.340	
FORTIS INC	60,484	54.980	3,325,410.320	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	74,203	32.680	2,424,954.040	
TELUS CORP	31,890	28.100	896,109.000	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	30.450	1,041,633.600	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	68.220	1,858,722.120	
ENBRIDGE INC	244,225	53.390	13,039,172.750	
IGM FINANCIAL INC	12,478	38.650	482,274.700	
MANULIFE FINANCIAL CORP	233,861	24.190	5,657,097.590	
LOBLAW CO LTD	18,620	125.550	2,337,741.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	95,432	61.780	5,895,788.960	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	79.450	2,568,459.600	
SUN LIFE FINANCIAL INC	69,566	63.250	4,400,049.500	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	791.490	2,215,380.510	
METRO INC	28,629	78.380	2,243,941.020	
EMERA INC	30,947	53.360	1,651,331.920	
ONEX CORP	10,157	64.250	652,587.250	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	22.420	433,221.660	
POWER CORP OF CANADA	65,500	33.000	2,161,500.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	28.110	483,351.450	
ROYAL BANK OF CANADA	166,500	130.910	21,796,515.000	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	113,049	107.770	12,183,290.730	
SHAW COMM INC-B	59,877	36.660	2,195,090.820	
SUNCOR ENERGY INC	165,224	40.380	6,671,745.120	
LUNDIN MINING CORP	68,762	8.300	570,724.600	
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	50.060	2,869,739.560	
THOMSON REUTERS CORP	19,979	156.920	3,135,104.680	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	99.890	965,436.850	

TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	217,864	90.550	19,727,585.200	
TC ENERGY CORP	123,753	57.740	7,145,498.220	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	103.870	841,554.740	
WESTON (GEORGE) LTD	8,379	178.570	1,496,238.030	
INTACT FINANCIAL CORP	21,566	203.970	4,398,817.020	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	53.220	2,842,693.080	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,335	2,088.990	4,877,791.650	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	23,163	192.230	4,452,623.490	
TOURMALINE OIL CORP	39,298	74.160	2,914,339.680	
KEYERA CORP	24,571	29.700	729,758.700	
PARKLAND CORP	15,665	29.920	468,696.800	
ALTAGAS LTD	33,833	24.500	828,908.500	
PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	45.830	3,124,643.570	
DOLLARAMA INC	32,535	82.430	2,681,860.050	
CENOVUS ENERGY INC W/I	167,715	24.190	4,057,025.850	
ARC RESOURCES LTD	74,961	17.800	1,334,305.800	
NORTHLAND POWER INC	25,030	37.860	947,635.800	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	19.300	988,989.900	
TMX GROUP LTD	7,040	138.040	971,801.600	
BRP INC	4,307	104.710	450,985.970	
IVANHOE MINES LTD	64,027	12.170	779,208.590	
NUTRIEN LTD	66,177	104.800	6,935,349.600	
TFI INTERNATIONAL INC	9,399	141.740	1,332,214.260	
WSP GLOBAL INC	15,681	161.730	2,536,088.130	
IA FINANCIAL CORP INC	12,011	76.720	921,483.920	
GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	38.460	1,060,611.420	
NUVEI CORP	7,929	36.820	291,945.780	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	42.150	678,741.450	
AIR CANADA	18,814	18.900	355,584.600	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	35,384	90.820	3,213,574.880	
SHOPIFY INC	146,823	52.400	7,693,525.200	
FIRSTSERVICE CORP	5,237	168.710	883,534.270	
HYDRO ONE LTD	37,626	37.280	1,402,697.280	
カナダ・ドル 小計	4,913,387		288,237,601.690 (28,852,583,929)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.330	480,186.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	211,910	33.390	7,075,674.900	
CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	8.200	323,080.000	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.170	436,635.000	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.210	919,158.000	

	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.890	677,461.770	
	KEPPEL CORP LTD	184,900	7.480	1,383,052.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	398,198	12.300	4,897,835.400	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.640	2,490,391.200	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.490	893,223.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	139,966	31.050	4,345,944.300	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.700	292,120.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	17.360	760,368.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	4.050	1,046,925.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.630	1,112,921.700	
	シンガポール・ドル 小計	3,753,587		27,134,976.270 (2,739,004,505)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	451,599	3.141	1,418,472.450	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	56.660	1,075,576.780	
	NESTLE SA-REGISTERED	332,068	109.240	36,275,108.320	
	CIE FINANC RICHEMONT	62,024	123.300	7,647,559.200	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	84,203	304.600	25,648,233.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,236	179.950	942,218.200	
	SIKA INHABER	17,793	238.800	4,248,968.400	
	SGS SA-REG	748	2,175.000	1,626,900.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	259,791	85.480	22,206,934.680	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	143.500	814,362.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,837.000	845,020.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	14.960	315,237.120	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	512.600	1,758,730.600	
	ABB LTD	194,538	29.180	5,676,618.840	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	31.110	617,284.620	
	GEBERIT AG	4,377	454.200	1,988,033.400	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	457.300	4,128,047.100	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,740.000	1,139,580.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	96,700.000	1,257,100.000	
	GIVAUDAN-REG	1,105	3,051.000	3,371,355.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18,153	452.600	8,216,047.800	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	375.200	1,355,222.400	
	HOLCIM LTD	66,607	48.630	3,239,098.410	
	TEMENOS GROUP	7,082	53.340	377,753.880	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	85.650	400,242.450	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	244.400	1,499,394.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	218.300	1,503,432.100	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	109.000	1,413,621.000	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	261.600	818,808.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	47.780	442,395.020	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	170.800	464,576.000	

	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	495.000	1,786,950.000	
	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	89.750	440,044.250	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	655.500	530,955.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	79.700	667,248.400	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,852	874.200	2,493,218.400	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	54.320	1,414,003.920	
	SWISS RE LTD	36,229	87.040	3,153,372.160	
	BKW AG	3,194	127.500	407,235.000	
	SIG GROUP AG	38,322	21.260	814,725.720	
	ALCON INC	61,285	64.580	3,957,785.300	
	UBS GROUP AG	403,341	17.125	6,907,214.620	
	VAT GROUP AG	3,325	275.000	914,375.000	
スイス・フラン	小計	2,225,603		166,219,059.840 (24,276,293,690)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	313,452	131.000	41,062,212.000	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	118.660	23,044,246.640	
	ERICSSON LM-B SHS	330,309	67.690	22,358,616.210	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	241.500	6,219,832.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	200.700	11,728,305.900	
	LUNDBERGS B	7,859	453.500	3,564,056.500	
	SKF AB-B SHS	46,594	172.950	8,058,432.300	
	SANDVIK AB	133,350	189.350	25,249,822.500	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	195,837	118.750	23,255,643.750	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	168.600	7,407,778.200	
	SWEDBANK AB	112,296	169.600	19,045,401.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	144.850	10,170,063.350	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	102.650	16,632,995.400	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	204.400	4,946,071.200	
	VOLVO AB-B SHS	179,832	194.500	34,977,324.000	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	442.000	4,482,764.000	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	94.080	6,060,257.280	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	259.400	3,966,744.800	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	258.700	5,516,777.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	148.380	3,992,460.660	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	84.860	6,456,573.100	
	INVESTOR AB-B SHS	226,392	193.900	43,897,408.800	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	117.600	9,676,951.200	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	236.700	29,495,660.400	
	TELIA CO AB	344,810	28.290	9,754,674.900	
	BOLIDEN AB	29,779	399.200	11,887,776.800	
	ALFA LAVAL AB	35,313	308.100	10,879,935.300	
	KINNEVIK AB-B	36,278	151.700	5,503,372.600	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	50.180	3,660,229.560	
	INDUTRADE AB	29,769	220.500	6,564,064.500	

	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	81.100	3,874,065.900	
	NIBE INDUSTRIER AB	185,845	104.700	19,457,971.500	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	212.500	3,905,750.000	
	HEXAGON AB-B SHS	248,163	119.550	29,667,886.650	
	SAGAX AB	19,038	243.400	4,633,849.200	
	EPIROC AB-A	84,563	193.950	16,400,993.850	
	EPIROC AB-B	41,205	170.200	7,013,091.000	
	ESSITY AB-B	75,180	267.500	20,110,650.000	
	EQT AB	31,718	243.400	7,720,161.200	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	50.050	3,993,539.550	
	VOLVO CAR AB	63,710	50.410	3,211,621.100	
	LIFCO AB	26,835	186.200	4,996,677.000	
	EVOLUTION AB	22,326	1,073.000	23,955,798.000	
	NORDEA BANK ABP	403,793	108.520	43,819,616.360	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	208.200	3,235,219.800	
スウェーデン・クローナ 小計		4,458,511		615,513,344.560 (8,130,931,282)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	913.400	11,462,256.600	
	A P MOLLER A/S	557	14,920.000	8,310,440.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	14,660.000	5,262,940.000	
	DANSKE BANK A/S	85,371	129.000	11,012,859.000	
	GENMAB A/S	7,926	3,212.000	25,458,312.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	431.000	10,283,229.000	
	ROCKWOOL AS	873	1,557.500	1,359,697.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	199,900	921.700	184,247,830.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	125,436	203.300	25,501,138.800	
	COLOPLAST-B	15,343	853.800	13,099,853.400	
	DSV A/S	22,074	1,087.000	23,994,438.000	
	DEMANT A/S	11,367	192.750	2,190,989.250	
	TRYG A/S	44,887	163.350	7,332,291.450	
	PANDORA A/S	9,912	533.400	5,287,060.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	444.200	5,569,379.600	
ORSTED A/S	23,240	639.200	14,855,008.000		
デンマーク・クローネ 小計		596,191		355,227,723.400 (6,866,551,893)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.070	1,326,231.870	
	FISHER & PAYKEL	78,460	22.580	1,771,626.800	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.270	1,154,330.260	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.520	346,843.680	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.050	667,392.850	
ニュージーランド・ドル 小計		656,830		5,266,425.460 (459,864,271)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	155.700	7,084,972.800	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	74.660	12,167,414.860	

	TELENOR ASA	85,954	93.160	8,007,474.640	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	411.800	4,605,983.000	
	ORKLA ASA	116,068	70.160	8,143,330.880	
	EQUINOR ASA	115,617	358.200	41,414,009.400	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	432.500	8,578,205.000	
	AKER BP ASA	38,723	296.900	11,496,858.700	
	SALMAR ASA	7,248	360.600	2,613,628.800	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	192.600	4,953,864.600	
	ADEVINTA ASA	24,382	69.400	1,692,110.800	
	DNB BANK ASA	105,251	184.950	19,466,172.450	
	ノルウェー・クローネ 小計	758,458		130,224,025.930 (1,780,162,434)	
ユーロ	CRH PLC	90,748	37.630	3,414,847.240	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	139.450	2,782,445.850	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	85.940	1,569,951.920	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	53.160	927,695.160	
	UMICORE	24,290	34.950	848,935.500	
	AIR LIQUIDE	63,347	136.840	8,668,403.480	
	AIRBUS SE	70,244	111.640	7,842,040.160	
	AXA SA	228,092	27.350	6,238,316.200	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	25.230	2,112,255.600	
	ADIDAS AG	20,476	118.900	2,434,596.400	
	ASSICURAZIONI GENERALI	133,912	17.315	2,318,686.280	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	156.100	487,032.000	
	DANONE	79,150	50.210	3,974,121.500	
	SAFRAN SA	40,925	117.180	4,795,591.500	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.067	4,239,361.190	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39,262	84.540	3,319,209.480	
	ACCOR SA	18,305	26.040	476,662.200	
	BOUYGUES	29,123	29.440	857,381.120	
	BNP PARIBAS	133,053	52.890	7,037,173.170	
	THALES SA	12,886	120.000	1,546,320.000	
	CAPGEMINI SA	19,839	171.950	3,411,316.050	
	UNICREDIT SPA	241,149	12.530	3,021,596.970	
	D' IETEREN TRDG	2,736	181.400	496,310.400	
	KONINKLIJKE DSM NV	20,425	121.850	2,488,786.250	
	COMMERZBANK AG	112,781	7.914	892,548.830	
	EIFFAGE	8,993	96.100	864,227.300	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	26.670	1,305,443.160	
	UNITED INTERNET	10,010	19.765	197,847.650	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	61.040	1,615,850.880	
	IBERDROLA SA	730,877	10.995	8,035,992.610	
	ENI SPA	296,020	13.526	4,003,966.520	
	JERONIMO MARTINS	34,644	20.460	708,816.240	
	KESKO OYJ-B	35,252	20.950	738,529.400	
	KBC GROUPE	32,213	56.120	1,807,793.560	

HANNOVER RUECK SE	7,105	187.450	1,331,832.250	
WARTSILA OYJ	50,956	8.364	426,195.980	
L'OREAL	29,178	355.000	10,358,190.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33,404	720.300	24,060,901.200	
GEA GROUP AG	17,490	39.910	698,025.900	
BOLLORE	114,808	5.280	606,186.240	
MEDIOBANCA SPA	86,792	9.182	796,924.140	
MICHELIN(CGDE) -B	86,908	26.650	2,316,098.200	
CONTINENTAL AG	12,921	57.140	738,305.940	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,731	38.255	4,542,054.400	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	18.025	401,795.270	
OMV AG	17,258	47.230	815,095.340	
VERBUND AG	7,320	83.800	613,416.000	
PERNOD-RICARD	24,888	186.350	4,637,878.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	56.640	954,610.560	
RENAULT SA	27,902	34.405	959,968.310	
REPSOL SA	178,713	14.150	2,528,788.950	
REMY COINTREAU	2,866	160.200	459,133.200	
MERCK KGAA	15,234	180.000	2,742,120.000	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	61,460	46.800	2,876,328.000	
RWE AG	77,853	42.320	3,294,738.960	
SEB SA	2,596	79.650	206,771.400	
SOCIETE GENERALE-A	100,409	22.630	2,272,255.670	
VINCI S.A.	63,584	98.620	6,270,654.080	
SODEXO	9,822	95.780	940,751.160	
SOFINA	1,449	219.400	317,910.600	
SOLVAY SA	9,070	94.700	858,929.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	66,119	138.380	9,149,547.220	
VIVENDI SE	76,073	9.000	684,657.000	
SAP SE	126,307	102.340	12,926,258.380	
TELEFONICA S.A	614,947	3.474	2,136,325.870	
TOTALENERGIES SE	299,598	56.290	16,864,371.420	
VALEO	26,570	16.720	444,250.400	
E.ON SE	280,287	9.182	2,573,595.230	
VOEST-ALPINE AG	10,593	25.820	273,511.260	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	63.200	845,363.200	
SIEMENS AG-REG	92,954	133.440	12,403,781.760	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	36.950	2,299,509.350	
ING GROEP NV-CVA	454,638	11.354	5,161,959.850	
PUMA AG	16,210	52.080	844,216.800	
BAYER AG	116,574	52.880	6,164,433.120	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	14.715	861,342.520	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	67.620	1,328,327.280	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	95,638	64.790	6,196,386.020	

BASF SE	110,117	47.720	5,254,783.240	
BEIERSDORF AG	12,940	105.950	1,370,993.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	52.100	1,084,148.900	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	30.340	723,760.700	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	273.250	1,417,621.000	
ORANGE	228,746	9.299	2,127,109.050	
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	49.440	2,887,098.240	
RANDSTAD NV	15,584	56.200	875,820.800	
ALLIANZ SE	49,878	204.700	10,210,026.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.578	1,455,602.560	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	28.550	3,593,988.200	
HERMES INTL	3,764	1,528.500	5,753,274.000	
ENDESA S.A.	37,701	17.835	672,397.330	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.717	558,263.210	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	28.820	1,316,670.520	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	16,705	308.400	5,151,822.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	66,878	25.955	1,735,818.490	
DASSAULT SYSTEMES SA	81,900	34.785	2,848,891.500	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	27.260	642,545.460	
RHEINMETALL STAMM	4,693	196.550	922,409.150	
HEINEKEN NV	32,026	89.740	2,874,013.240	
AKZO NOBEL	22,627	65.140	1,473,922.780	
ASML HOLDING NV	49,182	577.300	28,392,768.600	
AEGON NV	196,332	4.690	920,797.080	
VOLKSWAGEN AG	3,315	177.700	589,075.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	22,269	137.240	3,056,197.560	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	735,118	5.533	4,067,407.890	
KERING	8,881	523.500	4,649,203.500	
ACCIONA S.A.	2,642	178.300	471,068.600	
FORTUM OYJ	54,194	15.510	840,548.940	
AGEAS	18,136	42.230	765,883.280	
UCB SA	16,732	71.660	1,199,015.120	
NEMETSCHEK SE	9,878	47.570	469,896.460	
CARREFOUR SA	75,572	16.525	1,248,827.300	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.560	469,501.120	
NOKIA OYJ	637,662	4.688	2,989,359.450	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115,512	13.546	1,564,725.550	
WOLTERS KLUWER-CVA	32,047	104.850	3,360,127.950	
SANOFI	137,939	88.730	12,239,327.470	
STMICROELECTRONICS NV	80,161	36.895	2,957,540.090	
ELISA OYJ	20,242	50.920	1,030,722.640	
BANCO SANTANDER SA	2,066,857	2.786	5,758,263.600	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	17.100	838,088.100	

QIAGEN N.V.	27,412	46.990	1,288,089.880	
DEUTSCHE BANK AG-REG	253,716	10.140	2,572,680.240	
BMW VORZUG	7,821	80.700	631,154.700	
ENEL SPA	958,960	5.222	5,007,689.120	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	393,301	19.324	7,600,148.520	
SARTORIUS AG	2,847	350.800	998,727.600	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	26.960	297,422.720	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159,023	31.285	4,975,034.550	
RATIONAL AG	516	600.500	309,858.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	121.650	591,948.900	
BECHTLE AG	8,139	36.190	294,550.410	
KONINKLIJKE KPN NV	475,739	2.992	1,423,411.080	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	66.180	978,074.220	
TELEPERFORMANCE	7,845	224.700	1,762,771.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	22,570	172.150	3,885,425.500	
EURAZEO	5,673	60.250	341,798.250	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	76.840	869,675.120	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	73.400	796,610.200	
INDITEX	126,694	24.480	3,101,469.120	
ESSILORLUXOTTICA	35,682	179.750	6,413,839.500	
SNAM SPA	256,415	4.874	1,249,766.710	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	9.553	1,372,957.160	
ENAGAS	38,270	17.045	652,312.150	
WENDEL	2,354	89.700	211,153.800	
TENARIS SA	55,855	15.385	859,329.170	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.203	184,382.050	
TERNA SPA	166,064	7.362	1,222,563.160	
BIOMERIEUX	4,870	96.960	472,195.200	
GRIFOLS SA	31,982	10.190	325,896.580	
FERROVIAL SA	56,362	25.690	1,447,939.780	
NESTE OYJ	50,599	45.740	2,314,398.260	
RECORDATI SPA	10,908	40.840	445,482.720	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.956	575,207.900	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	205.000	1,231,640.000	
KONE OYJ	39,178	48.600	1,904,050.800	
ELIA GROUP	4,078	138.900	566,434.200	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	313.700	975,293.300	
ENGIE	221,751	14.384	3,189,666.380	
ALSTOM	37,007	24.040	889,648.280	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	12.000	780,144.000	
IPSEN SA	3,873	102.600	397,369.800	
ARKEMA SA	6,392	85.840	548,689.280	
LEGRAND SA	32,783	79.120	2,593,790.960	
AMPLIFON SPA	12,300	27.970	344,031.000	
ADP	3,975	133.800	531,855.000	
ORION OYJ	13,559	50.340	682,560.060	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	11.670	693,268.020	
SYMRISE AG	15,064	105.100	1,583,226.400	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	35.640	1,155,520.080	
PRYSMIAN SPA	30,728	35.500	1,090,844.000	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	130.700	317,470.300	
CAIXABANK	566,059	3.304	1,870,258.930	
BUREAU VERITAS SA	31,295	24.990	782,062.050	
GETLINK	63,509	15.755	1,000,584.290	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	21.530	636,448.330	
AMADEUS IT GROUP SA	54,712	51.900	2,839,552.800	
BRENTAG SE	17,934	59.940	1,074,963.960	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	18.125	447,451.870	
EDENRED	31,091	52.500	1,632,277.500	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.270	239,425.980	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	63.120	518,152.080	
VONOVIA SE	85,937	23.370	2,008,347.690	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	8.018	1,078,717.660	
KNORR-BREMSE AG	10,342	51.700	534,681.400	
OCI NV	12,329	37.540	462,830.660	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34,318	49.980	1,715,213.640	
FERRARI NV	15,435	209.400	3,232,089.000	
CNH INDUSTRIAL NV	124,604	15.350	1,912,671.400	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.388	270,381.300	
AIB GROUP PLC	147,578	3.170	467,822.260	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	38.710	669,412.030	
MONCLER SPA	25,014	49.370	1,234,941.180	
NEXI SPA	58,847	7.742	455,593.470	
PROSUS NV	98,305	64.980	6,387,858.900	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	101.400	1,538,643.600	
JDE PEET'S BV	14,385	27.680	398,176.800	
EXOR NV	14,142	73.820	1,043,962.440	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	16.935	787,612.980	
EURONEXT NV	10,081	70.760	713,331.560	
IMCD NV	6,823	147.050	1,003,322.150	
WORLDLINE SA	29,916	41.130	1,230,445.080	
NN GROUP NV	31,214	41.130	1,283,831.820	
FINECOBANK SPA	75,180	15.480	1,163,786.400	
ARGENX SE	6,753	369.400	2,494,558.200	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	22.745	1,877,213.080	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	30.910	1,752,380.630	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	36.460	358,110.120	
ZALANDO SE	24,405	31.250	762,656.250	
STELLANTIS NV	262,624	13.724	3,604,251.770	
AENA SME SA	8,494	127.100	1,079,587.400	

	CELLNEX TELECOM SAU	64,293	32.790	2,108,167.470	
	JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	21.375	484,571.250	
	ABN AMRO BANK NV	52,835	12.590	665,192.650	
	SCOUT24 SE	10,048	51.280	515,261.440	
	COVESTRO AG	27,558	36.670	1,010,551.860	
	HELLOFRESH SE	17,856	24.120	430,686.720	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,327	56.880	5,990,999.760	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.376	552,143.260	
	AMUNDI SA	6,292	54.850	345,116.200	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.480	397,012.920	
	ADYEN NV	2,593	1,411.000	3,658,723.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	40.000	902,560.000	
ユーロ 小計		22,001,586		531,067,134.590 (76,346,211,269)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	15.000	3,855,000.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	56.350	11,117,629.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	40.550	3,783,882.700	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	145,391	345.800	50,276,207.800	
	MTR CORP	192,441	38.700	7,447,466.700	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	125.500	11,934,548.000	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	26.500	4,530,758.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	41.600	6,294,912.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.190	11,046,759.140	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	52.900	13,801,821.600	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	24.900	10,457,875.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	22.250	3,850,718.500	
	SINO LAND CO	411,200	10.280	4,227,136.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,565	102.500	18,507,912.500	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	64.200	3,403,884.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	94.550	15,048,199.800	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	15.400	2,741,200.000	
	AIA GROUP LTD	1,454,316	85.500	124,344,018.000	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	9.480	4,390,529.280	
	SANDS CHINA LTD	260,600	26.300	6,853,780.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	17.460	2,444,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	19.440	3,919,104.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	42.900	8,414,191.500	
	ESR GROUP LTD	216,400	17.360	3,756,704.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.470	1,348,355.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	24.500	6,492,500.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.630	4,312,845.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	45.450	14,109,725.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	47.350	12,604,333.250	
香港・ドル	小計	9,626,969		375,316,397.120 (6,590,555,933)	
合計		133,346,593		770,947,917,433 (770,947,917,433)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益 証券	オーストラリ ア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,313,551.890		
		GOODMAN GROUP	214,602.000	3,901,464.360		
		GPT GROUP	219,223.000	951,427.820		
		MIRVAC GROUP	432,802.000	952,164.400		
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,863,927.360		
		STOCKLAND	259,328.000	1,003,599.360		
		VICINITY CENTRES	386,564.000	763,463.900		
		オーストラリア・ドル	小計	2,323,705.000	10,749,599.090 (993,047,963)	
	シンガポール・ ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,149,038.620		
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,211,864.500		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	758,560.000		
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	685,295.000		
		シンガポール・ドル	小計	1,889,109.000	3,804,758.120 (384,052,285)	
	投資信託受益証券 合計			4,212,814	1,377,100,248 (1,377,100,248)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	2,811,312.100		
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,385,936.220		
		AMERICAN TOWER CORP	56,451.000	12,071,481.840		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,278,378.310		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	2,871,328.560		
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,234,349.910		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,539,436.000		
		CROWN CASTLE INC	52,742.000	7,374,386.440		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	34,187.000	3,656,641.520		

	EQUINIX INC	11,088.000	7,493,270.400	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,327,697.660	
	EQUITY RESIDENTIAL	41,364.000	2,594,763.720	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,345.000	1,792,422.550	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	16,256.000	2,545,364.480	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,567,949.500	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	834,284.990	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,586,048.100	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,392,468.350	
	INVITATION HOMES INC	76,646.000	2,421,247.140	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,877,906.740	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,552,634.070	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	853,458.600	
	MID AMERICA	13,578.000	2,194,747.920	
	PROLOGIS INC	111,846.000	13,009,926.720	
	PUBLIC STORAGE	19,317.000	5,748,739.200	
	REALTY INCOME CORP	76,685.000	4,942,348.250	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,269,312.030	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,918.000	3,722,838.420	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	39,034.000	4,557,219.500	
	SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,091,103.140	
	UDR INC	41,516.000	1,656,073.240	
	VENTAS INC	48,092.000	2,184,819.560	
	VICI PROPERTIES INC	114,690.000	3,891,431.700	
	WELLTOWER INC	54,422.000	3,628,314.740	
	WEYERHAEUSER CO	89,893.000	2,829,831.640	
	WP CAREY INC	23,664.000	1,865,906.400	
アメリカ・ドル	小計	1,558,069.000	115,655,379.660 (15,817,029,722)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	472,394.220	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	483,058.470	
	SEGRO PLC	139,569.000	1,120,459.930	
イギリス・ポンド	小計	335,772.000	2,075,912.620 (347,092,590)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	375,307.660	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	301,461.600	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	676,769.260 (67,744,603)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	287,748.800	
	GECINA SA	5,045.000	486,842.500	
	KLEPIERRE	25,279.000	565,996.810	

		UNIBAIL-RODAMCO	13,535.000	710,452.150	
		WESTFIELD			
		WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	449,636.200	
	ユーロ 小計		65,715.000	2,500,676.460 (359,497,248)	
	香港・ドル	LINK REIT	262,516.000	14,569,638.000	
	香港・ドル 小計		262,516.000	14,569,638.000 (255,842,843)	
投資証券 合計			2,245,218	16,847,207,006 (16,847,207,006)	
合計				18,224,307,254 (18,224,307,254)	

(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 601銘柄	69.32	-	-	72.91
	投資証券 36銘柄	-	-	1.96	
イギリス・ポンド	株式 78銘柄	4.48	-	-	4.63
	投資証券 3銘柄	-	-	0.04	
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.14	-	-	0.15
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄	2.23	-	-	2.41
	投資信託受益証券 7銘柄	-	0.12	-	
カナダ・ドル	株式 85銘柄	3.57	-	-	3.66
	投資証券 2銘柄	-	-	0.01	
シンガポール・ドル	株式 15銘柄	0.34	-	-	0.40
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.05	-	
スイス・フラン	株式 43銘柄	3.01	-	-	3.08
スウェーデン・クローナ	株式 45銘柄	1.01	-	-	1.03
デンマーク・クローネ	株式 16銘柄	0.85	-	-	0.87
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.06	-	-	0.06
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.22	-	-	0.23
ユーロ	株式 223銘柄	9.46	-	-	9.72
	投資証券 5銘柄	-	-	0.04	
香港・ドル	株式 29銘柄	0.82	-	-	0.87
	投資証券 1銘柄	-	-	0.03	

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,840,603,936
コール・ローン	1,444,753,987
国債証券	242,507,611,590
派生商品評価勘定	2,594,496,040
未収利息	939,541,323
前払費用	452,225,286
流動資産合計	249,779,232,162
資産合計	249,779,232,162
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	201,828,724
未払解約金	4,736,000
流動負債合計	206,564,724
負債合計	206,564,724
純資産の部	
元本等	
元本	203,149,904,502
剰余金	
剰余金又は欠損金()	46,422,762,936
元本等合計	249,572,667,438
純資産合計	249,572,667,438
負債純資産合計	249,779,232,162

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6月14日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	306,068,649,641円
同期中追加設定元本額	111,702,914,795円
同期中一部解約元本額	214,621,659,934円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	9,119,310,437円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,118,468,146円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,968,558,087円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,433,313,807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)	52,781,858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)	1,498,689,258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)	1,737,636,103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)	467,104,596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)	59,009,617円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,513,758円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	20,275,520円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	195,107,661円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	11,231,585円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,144,310円
投資のソムリエ	88,580,700,602円
投資のソムリエ<DC年金>	6,262,448,652円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,955,053,623円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	31,019,382,534円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,183,673,055円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,015,970,007円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	306,431,575円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	155,434,083円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	47,565,793円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	890,001,594円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,108,906,909円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,522,315,010円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	322,895,998円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	160,947,514円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	103,447,036円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	19,817,859円
外国債券パッシブファンド2(為替フルヘッジ)(適格機関投資家限定)	19,874,644,260円
先進国債券パッシブファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	7,181,749,401円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,303,553,873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)	45,712,532円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	82,599,179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)	519,997,972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)	45,956,648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)	305,023,837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)	590,376,544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)	844,706,117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)	290,879,272円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	2,403,879,369円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	3,179,279,422円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	126,409,489円
計	203,149,904,502円
2. 受益権の総数	203,149,904,502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6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	566,797,004	
合計	566,797,004	

(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6月23日から2022年12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年12月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	246,504,449,957	-	244,111,782,641	2,392,667,316
アメリカ・ドル	124,809,435,930	-	122,552,755,012	2,256,680,918
イギリス・ポンド	11,797,997,415	-	11,881,086,772	83,089,357
イスラエル・シェケル	913,051,346	-	901,429,844	11,621,502
オーストラリア・ドル	3,922,338,791	-	3,880,797,776	41,541,015
オフショア・人民元	8,845,279,656	-	8,805,959,104	39,320,552
カナダ・ドル	5,071,467,281	-	4,937,795,660	133,671,621

シンガポール・ドル	1,128,245,220	-	1,120,094,511	8,150,709
スウェーデン・クローナ	491,231,543	-	496,021,715	4,790,172
デンマーク・クローネ	803,573,967	-	804,619,409	1,045,442
ニュージーランド・ドル	542,338,734	-	547,046,707	4,707,973
ノルウェー・クローネ	502,200,350	-	491,119,488	11,080,862
ポーランド・ズロチ	1,041,912,223	-	1,045,072,760	3,160,537
マレーシア・リンギット	1,259,119,814	-	1,257,662,796	1,457,018
メキシコ・ペソ	2,139,982,117	-	2,059,220,689	80,761,428
ユーロ	83,236,275,570	-	83,331,100,398	94,824,828
合計	246,504,449,957	-	244,111,782,641	2,392,667,316

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.2285円
(1万口当たり純資産額)	(12,285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12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 02/15/24	4,870,000.000	4,618,319.900	
		US T N/B 0.25 05/15/24	550,000.000	517,000.000	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,000,000.000	3,636,562.480	
		US T N/B 0.25 06/30/25	5,000,000.000	4,539,453.100	
		US T N/B 0.25 08/31/25	9,020,000.000	8,132,093.750	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,810,000.000	2,521,535.930	
		US T N/B 0.375 01/31/26	4,000,000.000	3,572,812.480	
		US T N/B 0.375 04/15/24	7,740,000.000	7,313,997.590	
		US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,279,609.370	

US T N/B 0.375 07/31/27	3,000,000.000	2,565,820.290	
US T N/B 0.375 08/15/24	18,000,000.000	16,813,125.000	
US T N/B 0.375 09/15/24	60,000.000	55,889.060	
US T N/B 0.375 09/30/27	7,760,000.000	6,600,243.710	
US T N/B 0.375 11/30/25	3,020,000.000	2,710,685.920	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,400,000.000	3,048,843.750	
US T N/B 0.5 02/28/26	5,000,000.000	4,473,242.150	
US T N/B 0.5 03/31/25	6,790,000.000	6,245,208.550	
US T N/B 0.5 05/31/27	3,830,000.000	3,307,115.220	
US T N/B 0.5 06/30/27	3,170,000.000	2,731,524.580	
US T N/B 0.5 08/31/27	2,520,000.000	2,161,589.040	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,562,187.500	
US T N/B 0.5 11/30/23	2,000,000.000	1,921,406.240	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,630,000.000	2,294,572.270	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,150,000.000	4,155,808.550	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,000,000.000	2,665,781.250	
US T N/B 0.625 08/15/30	9,110,000.000	7,318,603.860	
US T N/B 0.625 10/15/24	17,340,000.000	16,200,707.710	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,160,000.000	2,703,528.140	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,270,000.000	2,812,455.450	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,140,000.000	4,631,220.280	
US T N/B 0.75 04/30/26	900,000.000	808,523.430	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,689,804.680	
US T N/B 0.75 08/31/26	5,000,000.000	4,453,906.250	
US T N/B 0.75 11/15/24	4,040,000.000	3,772,823.400	
US T N/B 0.75 12/31/23	4,940,000.000	4,742,014.030	
US T N/B 0.875 01/31/24	6,000,000.000	5,749,453.080	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,250,000.000	2,920,429.680	
US T N/B 0.875 09/30/26	11,680,000.000	10,436,718.660	
US T N/B 0.875 11/15/30	9,590,000.000	7,826,339.060	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,670,000.000	3,159,497.230	
US T N/B 1.0 12/15/24	16,260,000.000	15,229,776.480	
US T N/B 1.125 02/15/31	8,230,000.000	6,854,689.800	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,503,687.500	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,380,000.000	4,711,282.780	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,930,000.000	1,268,673.430	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,760,000.000	2,455,750.000	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,370,000.000	3,783,122.630	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,000,000.000	3,600,781.240	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,880,000.000	3,411,975.000	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,000,000.000	3,514,687.480	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,565,326.560	
US T N/B 1.25 05/31/28	3,850,000.000	3,376,269.510	
US T N/B 1.25 06/30/28	5,000,000.000	4,375,781.250	
US T N/B 1.25 08/15/31	7,680,000.000	6,364,800.000	
US T N/B 1.25 08/31/24	5,400,000.000	5,114,812.500	
US T N/B 1.25 09/30/28	7,120,000.000	6,194,956.210	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,000,000.000	3,613,906.240	
US T N/B 1.25 12/31/26	10,960,000.000	9,883,693.690	

US T N/B 1.375 08/15/50	6,850,000.000	4,175,289.050	
US T N/B 1.375 08/31/26	2,750,000.000	2,510,878.890	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,000,000.000	3,501,562.480	
US T N/B 1.375 11/15/31	13,320,000.000	11,105,029.570	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,330,000.000	2,951,503.880	
US T N/B 1.375 12/31/28	3,900,000.000	3,411,890.620	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,290,000.000	4,811,420.310	
US T N/B 1.5 02/15/25	5,580,000.000	5,259,150.000	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,730,000.000	4,104,014.060	
US T N/B 1.5 02/29/24	20,000.000	19,256.250	
US T N/B 1.5 08/15/26	4,990,000.000	4,575,596.060	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,524,062.480	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,900,000.000	3,624,562.500	
US T N/B 1.625 05/15/26	2,000,000.000	1,850,312.500	
US T N/B 1.625 05/15/31	9,860,000.000	8,478,059.370	
US T N/B 1.625 08/15/29	4,400,000.000	3,881,109.360	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,517,981.250	
US T N/B 1.625 11/15/50	7,310,000.000	4,767,776.140	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,000,000.000	3,567,812.480	
US T N/B 1.75 03/15/25	6,100,000.000	5,780,703.120	
US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,477,981.250	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,140,000.000	3,684,335.910	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,900,000.000	2,575,335.920	
US T N/B 1.875 02/15/32	6,010,000.000	5,219,544.120	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,330,000.000	3,950,029.680	
US T N/B 1.875 02/15/51	6,700,000.000	4,653,882.770	
US T N/B 1.875 02/28/27	4,690,000.000	4,328,357.000	
US T N/B 1.875 02/28/29	6,000,000.000	5,388,984.360	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,920,000.000	2,721,189.050	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,690,000.000	3,943,881.250	
US T N/B 2.0 02/15/50	6,540,000.000	4,698,070.270	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	6,618,292.140	
US T N/B 2.0 05/31/24	6,440,000.000	6,203,028.080	
US T N/B 2.0 08/15/25	2,190,000.000	2,072,458.580	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,310,000.000	4,514,114.810	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	3,855,375.000	
US T N/B 2.0 11/15/41	6,490,000.000	4,851,781.990	
US T N/B 2.125 02/29/24	5,000,000.000	4,851,171.850	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,600,000.000	4,454,812.500	
US T N/B 2.125 05/15/25	2,500,000.000	2,381,640.620	
US T N/B 2.125 05/31/26	50,000.000	47,041.010	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	5,939,106.990	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,400,000.000	2,306,062.480	
US T N/B 2.25 01/31/24	6,160,000.000	5,994,931.210	
US T N/B 2.25 02/15/27	9,300,000.000	8,721,656.250	
US T N/B 2.25 02/15/52	6,020,000.000	4,569,556.250	
US T N/B 2.25 03/31/24	8,510,000.000	8,256,029.680	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,000,000.000	6,628,125.000	
US T N/B 2.25 04/30/24	5,000,000.000	4,840,429.650	

US T N/B 2.25 05/15/41	3,220,000.000	2,531,473.420	
US T N/B 2.25 08/15/27	3,640,000.000	3,397,712.500	
US T N/B 2.25 08/15/46	4,130,000.000	3,125,571.050	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,030,000.000	2,303,273.430	
US T N/B 2.25 11/15/24	16,780,000.000	16,132,396.870	
US T N/B 2.25 11/15/25	2,320,000.000	2,204,181.230	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,340,000.000	3,109,331.250	
US T N/B 2.375 02/15/42	5,560,000.000	4,435,837.500	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,645,484.340	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,693,906.240	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,063,157.780	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,000,000.000	4,703,515.600	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,450,000.000	3,185,185.520	
US T N/B 2.375 05/15/51	8,560,000.000	6,683,487.490	
US T N/B 2.375 08/15/24	4,000,000.000	3,863,281.240	
US T N/B 2.375 11/15/49	5,000,000.000	3,911,328.090	
US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	5,781,093.720	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,710,000.000	1,368,400.760	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,130,000.000	2,496,175.000	
US T N/B 2.5 02/28/26	3,520,000.000	3,359,400.000	
US T N/B 2.5 03/31/27	9,760,000.000	9,238,068.670	
US T N/B 2.5 04/30/24	7,100,000.000	6,896,152.320	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,360,000.000	1,868,917.180	
US T N/B 2.625 01/31/26	1,280,000.000	1,228,400.000	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,530,000.000	4,252,006.620	
US T N/B 2.625 04/15/25	2,280,000.000	2,199,665.610	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,000,000.000	2,852,695.290	
US T N/B 2.625 07/31/29	1,500,000.000	1,404,726.550	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,000,000.000	1,920,234.360	
US T N/B 2.75 02/15/24	3,470,000.000	3,392,467.180	
US T N/B 2.75 02/15/28	11,000,000.000	10,462,890.570	
US T N/B 2.75 02/28/25	10,000.000	9,685.930	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,740,000.000	2,618,947.640	
US T N/B 2.75 05/15/25	6,500,000.000	6,282,656.250	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,000,000.000	2,831,835.930	
US T N/B 2.75 06/30/25	70,000.000	67,730.460	
US T N/B 2.75 07/31/27	2,000,000.000	1,910,156.240	
US T N/B 2.75 08/15/32	8,980,000.000	8,382,268.750	
US T N/B 2.75 08/15/42	2,180,000.000	1,843,121.860	
US T N/B 2.75 08/15/47	4,590,000.000	3,839,463.250	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,895,585.930	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,030,000.000	868,861.320	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,160,000.000	1,807,312.500	
US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,803,012.490	
US T N/B 2.875 04/30/29	9,370,000.000	8,911,382.350	
US T N/B 2.875 05/15/28	9,140,000.000	8,738,696.870	
US T N/B 2.875 05/15/32	5,840,000.000	5,515,834.330	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,538,491.000	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,050,000.000	2,637,296.870	

US T N/B 2.875 05/15/52	7,200,000.000	6,270,750.000	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,409,945.310	
US T N/B 2.875 06/15/25	4,000,000.000	3,876,875.000	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,172,155.450	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,860,000.000	3,680,419.520	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,400,000.000	2,049,937.480	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,020,000.000	871,621.870	
US T N/B 2.875 11/30/23	2,070,000.000	2,035,958.180	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,140,000.000	1,101,792.180	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,020,000.000	4,388,185.900	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,080,000.000	2,704,384.350	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,030,000.000	2,683,443.750	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	884,375.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,930,000.000	1,686,186.700	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,210,000.000	1,057,899.210	
US T N/B 3.0 07/15/25	5,000,000.000	4,859,375.000	
US T N/B 3.0 08/15/48	5,880,000.000	5,173,481.240	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,340,000.000	3,889,725.000	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,942,187.500	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,040,000.000	1,009,368.740	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,320,000.000	1,154,175.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	870,000.000	760,366.400	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,310,000.000	1,185,345.310	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,760,000.000	2,474,081.250	
US T N/B 3.125 05/15/48	5,220,000.000	4,693,921.870	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,650,000.000	1,472,625.000	
US T N/B 3.125 08/31/27	8,450,000.000	8,208,712.860	
US T N/B 3.125 08/31/29	7,890,000.000	7,616,623.800	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,380,000.000	5,197,584.370	
US T N/B 3.125 11/15/41	80,000.000	72,443.740	
US T N/B 3.25 05/15/42	4,950,000.000	4,548,199.190	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,000,000.000	2,927,460.930	
US T N/B 3.25 06/30/29	4,860,000.000	4,725,210.910	
US T N/B 3.25 08/31/24	22,300,000.000	21,856,613.110	
US T N/B 3.375 05/15/44	900,000.000	837,562.500	
US T N/B 3.375 08/15/42	3,480,000.000	3,258,150.000	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,840,000.000	2,683,800.000	
US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	873,521.080	
US T N/B 3.625 02/15/44	2,160,000.000	2,090,559.360	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,000,000.000	967,578.120	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	994,765.620	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	985,937.500	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	2,626,964.040	
US T N/B 3.875 09/30/29	8,070,000.000	8,145,656.250	
US T N/B 3.875 11/30/29	2,000,000.000	2,020,625.000	
US T N/B 4.0 11/15/42	3,000,000.000	3,069,843.750	
US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,939,625.000	
US T N/B 4.25 05/15/39	2,000,000.000	2,149,218.740	
US T N/B 4.25 10/15/25	10,370,000.000	10,406,456.970	

	US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	1,067,578.120	
	US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	818,847.650	
	US T N/B 4.375 05/15/40	2,220,000.000	2,413,382.790	
	US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	942,998.430	
	US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,306,312.500	
	US T N/B 4.5 02/15/36	1,410,000.000	1,559,702.330	
	US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	1,139,678.900	
	US T N/B 4.75 02/15/41	20,000.000	22,720.310	
	US T N/B 5.0 05/15/37	750,000.000	870,292.960	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,826,437.500	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	2,566,052.330	
	US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,916,620.300	
	US T N/B 6.125 11/15/27	8,320,000.000	9,174,100.000	
	US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,326,406.210	
アメリカ・ドル	小計	988,720,000.000 (135,217,347,200)	894,515,183.690 (122,333,896,524)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	900,000.000	819,810.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,120,000.000	1,079,410.750	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	730,000.000	624,398.200	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,240,000.000	2,089,084.020	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	3,350,000.000	2,604,457.500	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,270,000.000	1,138,555.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	2,240,000.000	1,805,104.000	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,000,000.000	847,600.000	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,610,000.000	650,520.500	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,410,000.000	1,323,214.500	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,420,000.000	1,015,806.940	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,120,000.000	547,388.800	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	650,000.000	369,915.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,860,000.000	1,455,729.000	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,770,000.000	1,525,032.000	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	3,350,000.000	2,756,380.000	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,990,000.000	1,927,513.200	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,770,000.000	1,240,689.280	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	2,010,000.000	999,693.600	

UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,290,000.000	1,181,446.500	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,270,000.000	746,760.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,370,000.000	1,615,420.910	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,040,000.000	979,555.200	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,720,000.000	1,127,159.330	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,870,000.000	1,162,739.070	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,320,000.000	1,212,957.900	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	880,000.000	564,678.400	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	670,000.000	417,564.100	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	351,677.020	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,510,000.000	1,008,529.000	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,760,000.000	1,401,804.800	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	910,000.000	879,795.280	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	950,000.000	782,049.500	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,050,000.000	1,037,023.050	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,060,000.000	2,876,179.210	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,630,000.000	1,592,363.300	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,310,000.000	1,373,862.500	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	770,000.000	793,720.620	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,390,000.000	1,565,737.700	
UK TREASURY 4.125 01/29/27	1,470,000.000	1,507,117.500	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,120,000.000	1,216,577.600	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,000,000.000	3,264,720.000	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,020,000.000	1,101,172.620	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,550,000.000	2,667,252.570	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	200,000.000	216,028.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,110,000.000	2,312,391.200	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	450,000.000	498,019.500	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,650,000.000	1,883,392.500	

	UK TREASURY 4.5 12/07/42	800,000.000	898,782.400	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	860,000.000	957,072.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,760,000.000	2,012,825.760	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,580,000.000	1,636,998.340	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,661,813.660	
イギリス・ボンド	小計	79,110,000.000 (13,227,192,000)	69,325,489.830 (11,591,221,900)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	2,390,000.000	2,255,703.510	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,770,000.000	1,613,717.850	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,180,000.000	1,099,874.460	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,810,000.000	2,391,616.290	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	90,000.000	75,600.900	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,070,000.000	2,400,540.450	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,630,000.000	1,559,606.820	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,350,000.000	2,219,523.300	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,260,000.000	2,127,514.280	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,920,000.000	1,991,109.120	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	930,000.000	1,188,850.620	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,100,000.000	2,312,681.700	
イスラエル・シュケル	小計	22,500,000.000 (897,558,750)	21,236,339.300 (847,149,429)	
オーストラリ ア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,970,000.000	1,867,007.540	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	3,490,000.000	3,220,339.800	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,540,000.000	1,399,812.680	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,470,000.000	1,212,091.020	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,710,000.000	1,439,760.160	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	230,000.000	192,321.370	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	3,520,000.000	3,060,257.820	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,580,000.000	1,049,120.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,430,000.000	2,983,969.520	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,340,000.000	2,229,301.400	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	470,000.000	414,864.300	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	160,000.000	148,872.810	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,440,000.000	2,396,568.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	929,371.620	

	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,060,000.000	1,997,685.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	880,000.000	790,719.230	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	5,000,000.000	4,850,424.650	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,040,000.000	1,046,282.950	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,500,000.000	3,516,317.000	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	670,000.000	642,474.650	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	680,000.000	697,988.850	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	780,000.000	809,698.650	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,290,000.000	3,634,883.130	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,490,000.000	1,590,085.080	
	オーストラリア・ドル 小計	44,690,000.000 (4,128,462,200)	42,120,217.230 (3,891,065,668)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	25,000,000.000	24,821,294.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	5,300,000.000	5,284,249.560	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	34,600,000.000	34,303,115.390	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	2,000,000.000	1,994,188.720	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	25,000,000.000	24,992,593.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	4,938,485.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	22,000,000.000	21,745,036.720	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	34,000,000.000	34,045,702.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	22,000,000.000	21,834,261.460	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	25,000,000.000	24,773,125.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	10,000,000.000	9,733,872.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	36,000,000.000	35,471,700.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	23,500,000.000	23,212,102.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	27,310,000.000	27,370,172.120	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	9,400,000.000	9,224,126.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,000,000.000	14,846,235.150	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	10,000,000.000	9,876,016.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	6,000,000.000	5,994,588.180	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	10,000,000.000	9,913,500.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	5,500,000.000	5,535,571.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	12,000,000.000	12,171,414.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,500,000.000	9,608,095.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	17,500,000.000	18,032,239.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	28,400,000.000	28,565,512.360	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	7,700,000.000	7,945,822.500	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,950,000.000	8,447,144.500	
オフショア・人民元 小計		435,660,000.000 (8,541,288,564)	434,680,166.660 (8,522,078,539)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	260,000.000	235,226.940	
	CANADA 0.25 04/01/24	600,000.000	572,040.600	
	CANADA 0.5 09/01/25	4,390,000.000	4,045,385.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	3,500,000.000	2,918,632.500	
	CANADA 0.75 10/01/24	410,000.000	388,344.210	
	CANADA 1.0 06/01/27	1,910,000.000	1,752,071.650	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,860,000.000	1,712,559.660	
	CANADA 1.25 03/01/25	1,400,000.000	1,327,887.400	
	CANADA 1.25 03/01/27	760,000.000	703,278.160	
	CANADA 1.25 06/01/30	3,090,000.000	2,761,251.810	
	CANADA 1.5 04/01/25	2,080,000.000	1,980,218.240	
	CANADA 1.5 05/01/24	1,620,000.000	1,566,021.600	
	CANADA 1.5 06/01/31	4,500,000.000	4,043,569.500	
	CANADA 1.5 09/01/24	1,040,000.000	1,000,179.440	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,850,000.000	2,237,663.250	
	CANADA 2.0 06/01/32	3,000,000.000	2,788,242.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	4,260,000.000	3,579,631.140	
	CANADA 2.25 03/01/24	1,550,000.000	1,517,736.750	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,260,000.000	1,221,780.420	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	1,846,496.320	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,300,000.000	1,255,137.000	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,200,000.000	2,131,841.800	
	CANADA 2.75 08/01/24	1,260,000.000	1,236,851.280	
	CANADA 2.75 09/01/27	2,160,000.000	2,131,367.040	
	CANADA 2.75 12/01/48	170,000.000	167,467.680	
	CANADA 2.75 12/01/64	580,000.000	574,151.280	
	CANADA 3.0 11/01/24	1,160,000.000	1,142,603.480	
	CANADA 3.5 12/01/45	790,000.000	872,171.060	
CANADA 4.0 06/01/41	110,000.000	126,791.940		
CANADA 5.0 06/01/37	80,000.000	99,380.800		
CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	903,743.280		
カナダ・ドル 小計		52,780,000.000 (5,283,278,000)	48,839,723.230 (4,888,856,295)	

シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	240,000.000	223,560.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	630,000.000	591,255.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	400,000.000	359,505.860	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	380,000.000	317,680.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	400,000.000	337,638.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	290,000.000	285,090.860	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,030,000.000	1,001,469.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,220,000.000	1,122,064.500	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	740,000.000	728,530.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	40,000.000	37,080.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	140,000.000	137,872.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	720,000.000	722,880.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	580,000.000	573,121.200	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	290,000.000	287,970.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	920,000.000	920,731.400	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,188,600.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	130,000.000	141,208.490	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	750,000.000	747,026.250	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	780,000.000	809,016.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	440,000.000	450,340.000	
シンガポール・ドル 小計		11,320,000.000 (1,142,640,800)	10,982,638.560 (1,108,587,536)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	50,000.000	43,743.470	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	10,680,000.000	10,082,345.150	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	8,310,000.000	7,744,504.500	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,900,000.000	4,710,263.910	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,000,000.000	3,148,500.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	6,220,000.000	6,247,191.970	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,890,000.000	6,218,249.180	
スウェーデン・クローナ 小計		38,050,000.000 (502,640,500)	38,194,798.180 (504,553,284)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	3,170,000.000	3,037,097.750	
	DENMARK 0.0 11/15/31	8,860,000.000	7,333,172.480	
	DENMARK 0.25 11/15/52	6,200,000.000	4,049,491.860	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,390,000.000	4,987,683.380	
	DENMARK 0.5 11/15/29	12,800,000.000	11,482,895.350	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,250,000.000	3,210,931.090	
	DENMARK 4.5 11/15/39	5,600,000.000	7,544,672.800	
デンマーク・クローネ 小計		45,270,000.000 (875,069,100)	41,645,944.710 (805,016,111)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	500,000.000	339,737.370	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,000,000.000	841,704.660	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	1,400,000.000	1,343,389.340	

	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	500,000.000	422,092.710	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	380,000.000	289,783.620	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	1,200,000.000	1,126,156.950	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	600,000.000	607,980.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	1,000,000.000	1,010,034.700	
ニュージーランド・ドル 小計		6,580,000.000 (574,565,600)	5,980,879.350 (522,250,385)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	4,140,000.000	3,627,906.840	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,355,862.350	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,720,000.000	4,520,872.640	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,840,000.000	4,634,279.650	
	NORWAY 1.75 03/13/25	6,240,000.000	6,078,371.520	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,870,000.000	2,684,797.750	
	NORWAY 2.0 04/26/28	6,860,000.000	6,574,967.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,960,000.000	1,839,062.900	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,980,000.000	2,979,286.370	
ノルウェー・クローネ 小計		38,340,000.000 (524,107,800)	36,295,407.020 (496,158,214)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	864,039.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	1,700,000.000	1,485,035.000	
	POLAND 07/25/24	220,000.000	197,461.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,940,000.000	3,398,720.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	4,300,000.000	2,922,925.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	7,510,000.000	6,936,558.930	
	POLAND 2.5 07/25/26	8,400,000.000	7,281,624.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,090,000.000	2,609,659.500	
	POLAND 2.75 04/25/28	4,210,000.000	3,510,887.400	
	POLAND 2.75 10/25/29	1,160,000.000	930,523.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,740,000.000	3,434,255.000	
ポーランド・ズロチ 小計		40,370,000.000 (1,237,921,828)	33,571,687.830 (1,029,455,664)	
マレーシア・リ ンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,290,000.000	1,163,321.480	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,830,000.000	1,831,944.190	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	200,000.000	196,875.890	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	2,000,000.000	1,922,297.860	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,980,402.460	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,750,000.000	1,628,878.370	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	3,410,000.000	3,312,949.610	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,010,000.000	1,959,673.510	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,000,000.000	1,005,365.100	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	2,410,000.000	2,397,988.170	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,370,766.510	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,300,000.000	1,302,515.630	

	MALAYSIA 3.9 11/30/26	2,090,000.000	2,096,835.130	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	870,000.000	873,043.780	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,240,000.000	1,249,445.570	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	420,000.000	424,035.610	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,070,000.000	1,938,020.830	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	670,000.000	677,680.340	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	1,000,000.000	1,012,279.900	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	200,000.000	201,036.780	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,030,000.000	1,050,581.350	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,050,000.000	1,083,379.810	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,100,000.000	1,131,171.250	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,000,000.000	2,089,075.600	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	2,610,000.000	2,721,977.870	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	780,000.000	813,752.310	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	380,000.000	402,197.470	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,030,000.000	1,102,156.030	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,000,000.000	1,069,203.500	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	580,000.000	621,450.910	
マレーシア・リングギット 小計		40,690,000.000 (1,261,105,170)	40,630,302.820 (1,259,254,975)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	17,645,200.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	14,710,000.000	13,353,738.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	10,000,000.000	9,029,456.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,000,000.000	5,406,150.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	24,390,000.000	24,465,898.010	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	41,894,000.000	38,012,101.960	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	18,585,000.000	17,653,519.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,300,000.000	28,192,180.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,528,000.000	19,775,078.400	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,011,000.000	3,639,862.170	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	30,040,000.000	29,197,797.350	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,346,000.000	17,473,113.740	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	27,501,000.000	26,999,931.780	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	28,443,000.000	27,102,196.980	
	メキシコ・ペソ 小計		296,748,000.000 (2,052,338,843)	277,946,224.690 (1,922,303,885)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,460,000.000	1,230,794.600	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,000,000.000	820,266.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	1,250,000.000	913,750.000	

AUSTRIA 0.5 02/20/29	640,000.000	573,784.960	
AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,010,000.000	1,873,561.200	
AUSTRIA 0.7 04/20/71	100,000.000	54,326.100	
AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,770,000.000	1,645,250.400	
AUSTRIA 0.75 03/20/51	180,000.000	120,467.160	
AUSTRIA 0.75 10/20/26	2,830,000.000	2,694,867.500	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	610,000.000	310,042.870	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,400,000.000	1,216,363.400	
AUSTRIA 07/15/24	490,000.000	473,494.510	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	200,000.000	195,261.600	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,110,000.000	924,732.120	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	80,000.000	57,128.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,530,000.000	1,516,693.590	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	570,000.000	499,181.490	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,660,000.000	1,640,468.440	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	620,000.000	689,493.940	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	160,000.000	213,285.600	
AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	1,955,250.000	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	440,000.000	478,076.720	
BELGIUM 0.0 10/22/27	640,000.000	574,906.880	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,290,000.000	1,042,191.000	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,700,000.000	1,440,920.000	
BELGIUM 0.5 10/22/24	2,620,000.000	2,540,042.840	
BELGIUM 0.65 06/22/71	2,090,000.000	1,056,114.620	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,290,000.000	2,215,769.650	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,030,000.000	968,787.100	
BELGIUM 0.9 06/22/29	3,630,000.000	3,333,247.500	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,000,000.000	962,733.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,110,000.000	992,967.150	
BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,132,966.400	
BELGIUM 1.4 06/22/53	510,000.000	378,320.550	
BELGIUM 1.45 06/22/37	280,000.000	238,736.120	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,330,000.000	1,077,153.700	
BELGIUM 1.7 06/22/50	280,000.000	227,764.880	
BELGIUM 1.9 06/22/38	80,000.000	71,935.040	
BELGIUM 2.15 06/22/66	90,000.000	82,503.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	1,090,000.000	1,007,387.010	
BELGIUM 2.6 06/22/24	60,000.000	60,303.420	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,540,000.000	1,597,845.480	
BELGIUM 3.75 06/22/45	200,000.000	234,929.200	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,250,000.000	1,403,867.500	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,750,000.000	2,119,896.090	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,300,000.000	1,399,348.600	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,630,000.000	3,271,856.760	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,500,000.000	1,751,281.500	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,100,000.000	2,909,784.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,670,000.000	1,594,123.550	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,710,000.000	1,588,196.700	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,050,000.000	993,625.500	

BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,740,000.000	2,597,821.400	
BUNDESOBL 04/05/24	2,280,000.000	2,221,176.000	
BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,900,000.000	2,816,190.000	
BUNDESOBL 10/18/24	1,040,000.000	1,001,770.380	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,450,000.000	1,413,547.000	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	580,000.000	568,402.900	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	3,970,000.000	3,853,321.700	
BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	2,500,000.000	2,503,075.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	3,690,000.000	3,229,229.700	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,100,000.000	1,802,577.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,650,000.000	2,229,998.850	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	2,670,000.000	2,091,784.800	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,010,000.000	1,546,976.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	4,200,000.000	3,645,600.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	711,678.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,320,000.000	1,972,788.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,000,000.000	851,568.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,500,000.000	1,585,305.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	470,000.000	298,224.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,660,000.000	1,019,339.600	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,060,000.000	966,582.200	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	3,000,000.000	2,689,506.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,440,000.000	6,953,944.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	3,540,000.000	3,212,613.720	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,640,000.000	3,325,504.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,300,000.000	1,258,413.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,490,000.000	3,336,265.500	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	660,000.000	615,621.600	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,501,849.600	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,180,000.000	2,033,883.320	
DEUTSCHLAND 08/15/29	3,930,000.000	3,475,236.120	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,000,000.000	871,960.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,020,000.000	1,986,211.460	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,220,000.000	2,162,923.800	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	5,160,000.000	4,681,905.360	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,270,000.000	1,260,906.800	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,950,000.000	1,911,351.000	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,980,000.000	1,974,604.500	
DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	3,500,000.000	3,544,485.000	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,930,000.000	3,283,387.300	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,400,000.000	2,744,092.800	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,520,000.000	1,858,701.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,630,000.000	2,039,762.440	

DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,220,000.000	1,612,364.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,390,000.000	3,084,629.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,090,000.000	1,541,794.100	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,640,000.000	2,068,860.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,233,147.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	400,000.000	514,072.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	1,996,718.800	
FINLAND 0.0 09/15/24	1,330,000.000	1,282,343.440	
FINLAND 0.0 09/15/26	1,140,000.000	1,046,805.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	880,000.000	730,928.880	
FINLAND 0.125 04/15/52	560,000.000	312,989.600	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	147,693.960	
FINLAND 0.25 09/15/40	100,000.000	67,746.150	
FINLAND 0.5 04/15/26	800,000.000	758,191.850	
FINLAND 0.5 04/15/43	190,000.000	131,224.260	
FINLAND 0.5 09/15/27	860,000.000	791,329.340	
FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	81,223.470	
FINLAND 0.5 09/15/29	560,000.000	495,167.450	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	856,080.070	
FINLAND 1.125 04/15/34	570,000.000	491,888.340	
FINLAND 1.375 04/15/47	450,000.000	374,444.100	
FINLAND 2.625 07/04/42	870,000.000	888,300.450	
FINLAND 2.75 07/04/28	200,000.000	204,758.800	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	2,000,000.000	1,948,923.320	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,500,000.000	1,427,794.980	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,550,000.000	2,380,223.550	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,500,000.000	4,114,381.500	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,820,000.000	3,061,348.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,760,000.000	2,371,491.360	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,680,000.000	3,086,165.760	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,070,000.000	2,507,388.730	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,590,000.000	3,335,232.060	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	6,180,000.000	5,929,920.120	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,220,000.000	3,044,152.580	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	10,600,000.000	9,531,286.800	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	3,480,000.000	2,454,959.040	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	510,000.000	246,374.880	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	650,000.000	433,141.150	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,000,000.000	1,856,700.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,345,688.340	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,770,000.000	1,776,545.040	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,980,000.000	1,244,414.160	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,800,000.000	4,419,360.000	
FRANCE OAT 03/25/24	2,000,000.000	1,943,864.000	

FRANCE OAT 03/25/25	2,810,000.000	2,670,684.410	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,000,000.000	2,854,680.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,380,000.000	5,204,907.900	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,010,000.000	3,500,830.250	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,960,000.000	3,350,952.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	100,000.000	82,660.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,410,000.000	4,170,629.610	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,220,000.000	2,567,660.200	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	910,000.000	752,945.990	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,690,000.000	2,401,954.800	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,490,000.000	3,455,969.010	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	3,220,000.000	2,876,136.200	
FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,900,000.000	1,835,844.600	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,880,000.000	1,879,739.620	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,920,000.000	5,024,638.560	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,590,000.000	4,715,463.060	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,960,000.000	3,281,485.600	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	5,430,000.000	5,652,901.500	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,640,000.000	2,129,704.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	2,148,570.560	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,900,000.000	2,239,288.700	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,780,000.000	4,790,613.240	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,410,000.000	2,959,817.400	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,690,000.000	3,213,845.220	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,690,000.000	7,373,511.680	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,000,000.000	4,422,148.000	
IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	758,858.610	
IRISH 0.2 10/18/30	1,160,000.000	989,046.160	
IRISH 0.4 05/15/35	100,000.000	77,545.200	
IRISH 0.55 04/22/41	1,330,000.000	934,383.520	
IRISH 0.9 05/15/28	60,000.000	56,099.940	
IRISH 1.0 05/15/26	2,420,000.000	2,338,112.040	
IRISH 1.1 05/15/29	420,000.000	392,128.510	
IRISH 1.3 05/15/33	1,180,000.000	1,057,312.240	
IRISH 1.35 03/18/31	820,000.000	765,474.100	
IRISH 1.5 05/15/50	520,000.000	421,003.440	
IRISH 1.7 05/15/37	80,000.000	71,733.600	
IRISH 2.0 02/18/45	760,000.000	684,209.760	
IRISH 2.4 05/15/30	910,000.000	920,664.290	
IRISH 5.4 03/13/25	1,460,000.000	1,562,924.160	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,799,069.500	
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	2,300,000.000	2,234,450.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,920,000.000	1,741,632.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	2,730,000.000	2,640,729.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,000,000.000	1,797,600.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,000,000.000	958,200.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	2,000,000.000	1,901,600.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	2,610,000.000	2,233,116.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	2,810,000.000	2,678,348.690	

ITALY BTPS 0.45 02/15/29	3,000,000.000	2,512,350.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,600,000.000	1,484,532.800	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,500,000.000	1,287,600.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,000,000.000	1,559,076.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	30,000.000	27,547.500	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.000	1,620,100.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,440,000.000	2,375,664.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,650,000.000	1,295,580.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,750,000.000	1,449,350.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,000,000.000	1,810,400.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,350,000.000	1,074,347.550	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,000,000.000	921,300.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	2,070,000.000	1,982,646.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	110,000.000	103,040.060	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	2,000,000.000	1,727,746.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	510,000.000	385,050.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	330,000.000	321,188.340	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,000,000.000	1,958,702.000	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,630,000.000	1,061,456.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	30,000.000	29,158.180	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,140,000.000	1,090,182.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,640,000.000	1,386,825.000	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,660,000.000	2,308,955.540	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	300,000.000	196,381.800	
ITALY BTPS 1.75 05/30/24	2,000,000.000	1,978,180.000	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,000,000.000	987,468.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,570,000.000	1,139,192.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,400,000.000	1,385,706.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	90,000.000	87,966.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,700,000.000	1,606,122.600	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	110,000.000	107,418.830	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	6,440,000.000	6,155,197.440	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.000	971,062.000	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	913,422.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,180,000.000	843,464.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,060,000.000	1,990,784.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	340,000.000	283,560.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,050,000.000	1,794,299.400	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,770,000.000	1,368,033.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,500,000.000	1,488,033.030	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,000,000.000	1,996,209.620	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	720,000.000	642,758.400	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	455,620.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,230,000.000	967,518.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,660,000.000	3,568,500.000	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,850,000.000	2,528,805.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,890,000.000	2,826,818.820	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,640,000.000	2,358,430.800	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,750,000.000	1,599,675.000	

ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,940,000.000	1,764,521.180	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,270,000.000	1,192,297.590	
ITALY BTPS 3.5 01/15/26	3,630,000.000	3,683,724.000	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,360,000.000	2,374,056.160	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,200,000.000	1,223,869.200	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,800,000.000	1,799,229.600	
ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,000,000.000	1,019,000.000	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,280,000.000	1,296,000.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,070,000.000	3,138,694.320	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,720,000.000	1,804,624.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,970,000.000	4,274,459.300	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	790,000.000	881,849.350	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,620,000.000	1,703,015.920	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,470,000.000	3,798,262.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,360,000.000	1,528,776.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,450,000.000	1,649,520.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,940,000.000	2,169,114.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,390,000.000	1,613,929.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,300,000.000	2,714,000.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	770,000.000	889,504.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	300,000.000	281,053.620	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,900,000.000	1,747,329.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	2,040,000.000	1,795,499.880	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,260,000.000	907,624.620	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,860,000.000	1,094,874.120	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,140,000.000	973,174.680	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	980,000.000	818,118.700	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	6,200,000.000	5,915,992.810	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,720,000.000	1,524,738.720	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,670,000.000	1,278,127.820	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	210,000.000	198,555.000	
NETHERLANDS 0.5 07/15/32	500,000.000	427,493.500	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,130,000.000	2,010,526.170	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	200,000.000	186,307.200	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	70,000.000	69,891.680	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,620,000.000	1,662,199.380	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,170,000.000	1,335,581.910	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,850,000.000	2,304,424.750	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,570,000.000	1,899,857.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	760,000.000	883,728.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,750,000.000	1,664,250.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,690,000.000	1,568,079.680	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,000,000.000	1,806,700.000	

SPAIN 0.0 05/31/24	2,740,000.000	2,647,596.780	
SPAIN 0.0 05/31/25	2,000,000.000	1,885,637.800	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,490,000.000	1,194,980.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,230,000.000	1,189,729.800	
SPAIN 0.5 04/30/30	2,840,000.000	2,434,394.040	
SPAIN 0.5 10/31/31	390,000.000	319,861.620	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,338,854.040	
SPAIN 0.7 04/30/32	870,000.000	716,706.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,500,000.000	1,393,725.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	893,300.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,312,063.570	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,180,000.000	806,058.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,100,000.000	666,162.200	
SPAIN 1.2 10/31/40	2,780,000.000	2,010,565.500	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,970,000.000	2,672,703.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,540,000.000	1,479,627.480	
SPAIN 1.4 04/30/28	3,000,000.000	2,828,793.000	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,427,554.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,930,000.000	2,737,305.620	
SPAIN 1.45 10/31/27	3,000,000.000	2,857,956.000	
SPAIN 1.45 10/31/71	250,000.000	140,479.750	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,840,000.000	1,768,608.000	
SPAIN 1.6 04/30/25	2,520,000.000	2,479,213.800	
SPAIN 1.85 07/30/35	2,230,000.000	1,949,963.290	
SPAIN 1.9 10/31/52	380,000.000	282,598.020	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,770,000.000	1,745,708.520	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,660,000.000	1,576,189.920	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,260,000.000	1,191,330.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,910,000.000	1,847,357.730	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,530,000.000	1,402,599.960	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,900,000.000	1,914,322.200	
SPAIN 2.9 10/31/46	2,070,000.000	1,987,291.080	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,330,000.000	1,377,499.620	
SPAIN 3.8 04/30/24	410,000.000	418,370.880	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,330,000.000	2,623,789.700	
SPAIN 4.65 07/30/25	6,570,000.000	6,958,556.370	
SPAIN 4.7 07/30/41	1,940,000.000	2,357,224.160	
SPAIN 4.9 07/30/40	2,120,000.000	2,609,720.000	
SPAIN 5.15 10/31/28	5,360,000.000	6,126,480.000	
SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	1,969,702.500	
SPAIN 5.75 07/30/32	2,010,000.000	2,513,360.280	
SPAIN 5.9 07/30/26	1,600,000.000	1,797,961.600	
SPAIN 6.0 01/31/29	1,140,000.000	1,362,991.980	
ユーロ 小計	605,190,000.000 (87,002,114,400)	575,860,901.370 (82,785,763,181)	
国債証券 合計	262,467,630,754.800 (262,467,630,755)	242,507,611,590 (242,507,611,590)	
合計		242,507,611,590 (242,507,611,590)	

(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 219銘柄	49.02	50.45
イギリス・ポンド	国債証券 53銘柄	4.64	4.78
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.34	0.35
オーストラリア・ドル	国債証券 24銘柄	1.56	1.60
オフショア・人民元	国債証券 26銘柄	3.41	3.51
カナダ・ドル	国債証券 31銘柄	1.96	2.02
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	0.44	0.46
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.20	0.21
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.32	0.33
ニュージーランド・ドル	国債証券 8銘柄	0.21	0.22
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.20	0.20
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.41	0.42
マレーシア・リングgit	国債証券 30銘柄	0.50	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券 14銘柄	0.77	0.79
ユーロ	国債証券 323銘柄	33.17	34.14

(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。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	113,247,486
コール・ローン	95,021,204
投資信託受益証券	6,594,289,552
投資証券	57,160,070,853
未収入金	3,073,573
未収配当金	139,643,992
流動資産合計	64,105,346,660
資産合計	64,105,346,660
負債の部	
流動負債	
未払解約金	30,014,000
流動負債合計	30,014,000
負債合計	30,014,000
純資産の部	
元本等	
元本	38,893,824,604
剰余金	
剰余金又は欠損金()	25,181,508,056
元本等合計	64,075,332,660
純資産合計	64,075,332,660
負債純資産合計	64,105,346,660

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6月14日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	42,385,507,995円
同期中追加設定元本額	20,145,738,406円
同期中一部解約元本額	23,637,421,797円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	75,183,512円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	23,801,904円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,043,946円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	19,532,209円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	65,002,127円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	37,661,996円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,556,284円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	37,722,922円
たわらノーロード 先進国リート	14,512,969,903円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,769,336,922円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	313,701,635円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,828,724,061円
たわらノーロード バランス(堅実型)	25,484,417円
たわらノーロード バランス(標準型)	483,017,090円
たわらノーロード バランス(積極型)	979,600,798円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	2,849,915円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	211,608,355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)	227,643,337円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	383,554,547円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	21,392,062円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,789,236円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,564,379円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,536,838,121円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,195,493円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	508,628,309円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	180,894,270円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	278,085,864円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	514,843,856円
投資のソムリエ	6,604,064,857円
投資のソムリエ<DC年金>	466,303,452円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	213,805,832円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	489,016,603円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,241,865,276円
ワールドアセットバランス(基本コース)	340,900,854円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	177,581,303円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	23,573,316円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,945,180円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,391,063円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	77,052,137円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	212,305,284円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	160,916,416円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	34,120,528円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	12,404,102円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,971,653円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,524,908円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	259,405,069円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	287,012,255円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	983,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	656,048円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	459,027円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	826,526円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	692,408円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	173,462,835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)	9,362,886円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,380,735円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3,395,678円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	5,876,951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)	77,483,006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)	189,104,653円

D I A Mグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,497,280,798円
D I A M海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	167,877,427円
計	38,893,824,604円
2. 受益権の総数	38,893,824,604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6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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12月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
投資信託受益証券	15,949,649
投資証券	1,220,881,074

合計	1,236,830,723
----	---------------

（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6月23日から2022年12月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年12月12日現在
1口当たり純資産額	1.6474円
（1万口当たり純資産額）	（16,474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12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	144,600.000	88,929.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	309,900.000	168,895.500		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	645,800.000	232,488.000		
		PRIME US REIT	238,000.000	110,670.000		
	アメリカ・ドル	小計		1,411,000.000	600,982.500 (82,190,367)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	149,481.000	403,598.700		
		ARENA REIT	125,752.000	474,085.040		
		BWP TRUST	170,064.000	685,357.920		
		CENTURIA CAPITAL GROUP	269,403.000	474,149.280		
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	195,918.000	617,141.700		
		CENTURIA OFFICE REIT	170,806.000	275,851.690		
		CHARTER HALL GROUP	169,822.000	2,151,644.740		
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	231,435.000	1,032,200.100		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	182,866.000	729,635.340		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	122,555.000	399,529.300		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	516,778.000	353,992.930		
DEXUS		394,034.000	3,156,212.340			
DEXUS INDUSTRIA REIT	78,918.000	237,543.180				
GDI PROPERTY GROUP	210,436.000	163,087.900				
GOODMAN GROUP	619,424.000	11,261,128.320				

	GPT GROUP	688,952.000	2,990,051.680	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	114,912.000	359,674.560	
	HEALTHCO REIT	92,113.000	157,052.660	
	HMC CAPITAL LTD	75,942.000	341,739.000	
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	547,729.000	723,002.280	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,699.000	262,368.440	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	128,647.000	566,046.800	
	MIRVAC GROUP	1,438,327.000	3,164,319.400	
	NATIONAL STORAGE REIT	382,002.000	897,704.700	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	104,555.530	
	REGION RE LTD	419,075.000	1,127,311.750	
	RURAL FUNDS GROUP	141,590.000	346,895.500	
	SCENTRE GROUP	1,894,236.000	5,455,399.680	
	STOCKLAND	873,115.000	3,378,955.050	
	VICINITY CENTRES	1,391,147.000	2,747,515.320	
	WAYPOINT REIT LTD	263,507.000	732,549.460	
	オーストラリア・ドル 小計	12,273,028.000	45,770,300.290 (4,228,260,339)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	201,395.000	241,674.000	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	697,216.000	686,757.760	
	CAPITALAND CHINA TRUST	423,480.000	482,767.200	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,839,709.000	3,716,212.180	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,228,460.000	3,378,265.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	307,200.000	374,784.000	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	224,800.000	141,624.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	50,018.000	
	ESR LOGOS REIT	1,981,940.000	713,498.400	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	393,900.000	240,279.000	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	389,500.000	97,375.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	399,900.000	811,797.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,028,664.000	1,172,676.960	
	KEPPEL DC REIT	470,000.000	888,300.000	
	KEPPEL REIT	697,700.000	627,930.000	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	653,500.000	470,520.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	712,620.000	1,574,890.200	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,182,320.000	1,891,712.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	823,700.000	1,392,053.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	910,555.000	323,247.020	
		PARKWAY LIFE REIT	147,200.000	559,360.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	207,400.000	155,550.000	
		SPH REIT	394,200.000	350,838.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	553,000.000	295,855.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	799,090.000	1,126,716.900	
	シンガポール・ドル 小計		16,779,849.000	21,764,700.620 (2,196,928,881)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	133,740.000	209,971.800	
	ユーロ 小計		133,740.000	209,971.800 (30,185,546)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	542,000.000	3,230,320.000	
	香港・ドル 小計		542,000.000	3,230,320.000 (56,724,419)	
投資信託受益証券 合計			31,139,617	6,594,289,552 (6,594,289,552)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,926.000	528,112.200	
		AGREE REALTY CORP	28,709.000	2,057,861.120	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	27,741.000	544,555.830	
		ALEXANDER'S INC.	801.000	187,265.790	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	54,095.000	8,074,219.700	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,698.000	89,355.960	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,859.000	539,370.440	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	110,585.000	3,633,823.100	
		AMERICOLD REALTY TRUST	98,539.000	2,872,411.850	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	55,461.000	2,047,065.510	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	58,566.000	469,699.320	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	76,306.000	1,282,703.860	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,069.000	299,323.860	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	70,578.240	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	50,939.000	8,638,235.620	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	27,751.680	
		BOSTON PROPERTIES INC	51,943.000	3,459,923.230	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	77,867.780	
BRANDYWINE REALTY TRUST	65,995.000	416,428.450	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	107,894.000	2,431,930.760	
BROADSTONE NET LEASE INC	61,921.000	1,069,375.670	
BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	84,906.400	
CAMDEN PROPERTY TRUST	38,854.000	4,507,064.000	
CARETRUST REIT INC	34,506.000	690,810.120	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	9,033.000	241,271.430	
CENTERSPACE	5,946.000	389,581.920	
CHATHAM LODGING TRUST	19,111.000	254,367.410	
CITY OFFICE REIT INC	15,657.000	146,862.660	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	37,585.540	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,646.000	303,128.760	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	40,243.000	1,037,464.540	
COUSINS PROPERTIES INC	54,331.000	1,355,558.450	
CTO REALTY GROUTH INC	6,628.000	125,070.360	
CUBESMART	82,065.000	3,525,512.400	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	75,032.000	682,040.880	
DIGITAL REALTY TRUST INC	104,666.000	11,195,075.360	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	62,131.200	
DOUGLAS EMMETT INC	62,899.000	1,001,981.070	
EAST GROUP	15,682.000	2,423,182.640	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,578.000	528,351.840	
ELME COMMUNITIES	33,244.000	637,287.480	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	50,759.000	344,653.610	
EPR PROPERTIES	26,850.000	1,094,943.000	
EQUINIX INC	33,151.000	22,403,445.800	
EQUITY COMMONWEALTH	39,805.000	1,033,735.850	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	63,813.000	4,135,720.530	
EQUITY RESIDENTIAL	123,333.000	7,736,679.090	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	50,572.000	1,176,810.440	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	23,746.000	5,100,403.340	
EXTRA SPACE STORAGE INC	48,792.000	7,639,851.360	
FARMLAND PARTNERS INC	17,744.000	228,897.600	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	26,639.000	2,867,688.350	
FIRST INDUSTRIAL RT	47,538.000	2,323,657.440	

FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	29,032.000	781,541.440	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	97,869.200	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	93,170.000	4,854,157.000	
GETTY REALTY CORP	16,282.000	541,539.320	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,534.000	277,018.040	
GLADSTONE LAND CORP	11,727.000	223,868.430	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,924.000	229,698.480	
GLOBAL NET LEASE INC	38,640.000	522,026.400	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	139,236.000	2,741,556.840	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	196,753.000	4,987,688.550	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	128,758.000	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	37,652.000	1,078,729.800	
HOST HOTELS & RESORTS INC	260,707.000	4,611,906.830	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	49,184.000	506,595.200	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	79,578.000	1,419,671.520	
INDUS REALTY TRUST INC	2,126.000	136,127.780	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	97,846.840	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,020.000	1,124,244.000	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	25,638.000	624,028.920	
INVITATION HOMES INC	211,312.000	6,675,346.080	
IRON MOUNTAIN INC	105,971.000	5,765,882.110	
ISTAR INC	31,134.000	230,391.600	
JBG SMITH PROPERTIES	35,422.000	702,418.260	
KILROY REALTY CORP	37,771.000	1,516,127.940	
KIMCO REALTY	225,523.000	4,896,104.330	
KITE REALTY GROUP TRUST	78,743.000	1,719,747.120	
LIFE STORAGE INC	30,857.000	3,309,413.250	
LTC PROPERTIES INC	15,425.000	595,405.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	100,136.000	1,059,438.880	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	217,267.000	2,563,750.600	
MID AMERICA	42,069.000	6,800,033.160	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,699.000	946,833.300	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	64,787.000	2,986,680.700	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	30,568.000	1,175,950.960	
NETSTREIT CORP	18,304.000	354,182.400	

NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,811.000	409,447.170	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,765.000	255,105.400	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	84,297.000	2,512,893.570	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	131,811.500	
ORION OFFICE REIT INC	21,073.000	191,975.030	
PARAMOUNT GROUP INC	65,045.000	378,561.900	
PARK HOTELS & RESORTS INC	83,950.000	1,034,264.000	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	46,834.000	724,521.980	
PHILLIPS EDISON & CO INC	41,850.000	1,363,473.000	
PHYSICIANS REALTY TRUST	81,063.000	1,207,028.070	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,250.000	436,117.500	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,446.000	269,726.760	
POSTAL REALTY TRUST INC	7,309.000	110,000.450	
PROLOGIS INC	336,482.000	39,139,586.240	
PUBLIC STORAGE	57,517.000	17,117,059.200	
REALTY INCOME CORP	224,866.000	14,492,613.700	
REGENCY CENTERS CORP	56,292.000	3,700,073.160	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	44,285.000	692,174.550	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	62,543.000	3,407,968.070	
RLJ LODGING TRUST	57,897.000	666,394.470	
RPT REALTY	31,140.000	338,491.800	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	19,822.000	1,761,977.580	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	82,648.000	1,041,364.800	
SAFEHOLD INC	8,894.000	246,452.740	
SAUL CENTERS INC	4,804.000	198,741.480	
SERVICE PROPERTIES TRUST	62,996.000	495,148.560	
SIMON PROPERTY GROUP INC	119,192.000	13,915,666.000	
SITE CENTERS CORP	69,723.000	925,224.210	
SL GREEN	24,047.000	856,313.670	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	49,033.000	2,024,572.570	
STAG INDUSTRIAL INC	64,463.000	2,136,303.820	
STORE CAPITAL CORP	97,189.000	3,108,104.220	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,921.000	307,475.900	
SUN COMMUNITIES INC	44,946.000	6,396,265.260	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	79,465.000	821,668.100	

	TANGER FACTORY OUTLET	37,159.000	690,414.220	
	TERRENO REALTY CORP	23,846.000	1,360,891.220	
	THE MACERICH COMPANY	76,796.000	956,878.160	
	THE NECESSITY RETAIL REIT INC	51,710.000	341,803.100	
	UDR INC	111,402.000	4,443,825.780	
	UMH PROPERTIES INC	18,532.000	314,673.360	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,699.000	241,340.640	
	URBAN EDGE PROPERTIES	41,741.000	630,706.510	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,191.000	206,362.040	
	VENTAS INC	145,672.000	6,617,878.960	
	VERIS RESIDENTIAL INC	30,360.000	487,278.000	
	VICI PROPERTIES INC	350,725.000	11,900,099.250	
	VORNADO REALTY TRUST	57,812.000	1,277,067.080	
	WELLTOWER INC	168,743.000	11,250,095.810	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	158,905.400	
	WP CAREY INC	75,658.000	5,965,633.300	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,381.000	658,957.390	
アメリカ・ドル	小計	8,042,448.000	360,733,535.770 (49,333,918,350)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	162,134.000	91,605.710	
	AEW UK REIT PLC	58,660.000	56,782.880	
	ASSURA PLC	1,052,905.000	570,674.510	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	307,797.000	290,252.570	
	BIG YELLOW GROUP PLC	62,370.000	701,662.500	
	BRITISH LAND CO PLC	343,757.000	1,363,340.260	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	327,616.000	332,857.850	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	232,446.000	143,186.730	
	CUSTODIAN REIT PLC	166,617.000	150,788.380	
	DERWENT LONDON PLC	40,215.000	945,856.800	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	74,836.000	45,350.610	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	221,510.000	181,195.180	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	89,924.000	449,440.150	
	HAMMERSON PLC	1,294,519.000	308,095.520	
	HOME REIT PLC	286,621.000	132,992.140	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	160,660.000	163,873.200	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	

	LAND SECURITIES GROUP PLC	274,950.000	1,722,836.700	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	349,414.000	617,065.120	
	LXI REIT PLC	611,869.000	710,991.770	
	NEWRIVER REIT PLC	124,025.000	97,359.620	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	213,675.000	177,136.570	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	473,631.000	525,256.770	
	PRS REIT PLC/THE	206,206.000	176,512.330	
	REGIONAL REIT LTD	168,230.000	97,405.170	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	75,199.000	705,742.610	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	206,528.000	91,904.960	
	SEGRO PLC	441,131.000	3,541,399.660	
	SHAFTESBURY PLC	102,794.000	357,517.530	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	439,209.000	450,189.220	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	105,962.610	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	669,395.000	976,647.300	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	316,742.000	184,343.840	
	UNITE GROUP PLC	146,812.000	1,362,415.360	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	171,713.000	242,973.890	
	WAREHOUSE REIT PLC	156,027.000	170,069.430	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,876.000	211,542.400	
イギリス・ポンド 小計		10,465,622.000	18,453,227.850 (3,085,379,697)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,208.000	397,560.600	
	REIT 1 LTD	69,832.000	1,225,551.600	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	74,889.000	628,917.820	
イスラエル・シュケル 小計		381,929.000	2,252,030.020 (89,836,856)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	22,086.000	587,266.740	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,633.000	173,100.570	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	94,291.470	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,165.000	411,434.350	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,285.000	131,130.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	57,373.560	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	31,219.000	1,343,353.570	

	CHOICE PROPERTIES REIT	57,015.000	835,839.900	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,845.000	302,273.800	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,186.000	295,080.680	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	43,897.000	528,080.910	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,013.000	135,465.390	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	56,666.920	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,058.000	622,574.400	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	11,412.000	873,930.960	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	49,416.000	602,875.200	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	19,454.170	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,307.000	316,590.570	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,565.000	340,762.050	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,096.000	116,582.400	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	102,682.200	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,304.000	122,055.680	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	42,192.000	416,856.960	
	PRIMARIS REIT	18,329.000	272,185.650	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,243.000	60,740.990	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	54,378.000	1,136,500.200	
	SLATE GROCERY REIT	11,204.000	179,151.960	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	78,755.560	
	SMARTCENTRES REIT	25,869.000	701,308.590	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	32,966.000	747,009.560	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	14,758.000	86,334.300	
	カナダ・ドル 小計	679,996.000	11,747,709.260 (1,175,945,697)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	329,282.000	395,138.400	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	371,415.000	768,829.050	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	568,732.000	531,764.420	
	PRECINCT PROPERTIES	504,991.000	671,638.030	
	STRIDE STAPLED GROUP	200,290.000	284,411.800	

	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	160,996.000	379,950.560	
ニュージーランド・ドル 小計		2,135,706.000	3,031,732.260 (264,730,861)	
ユーロ	AEDIFICA	14,269.000	1,108,701.300	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	29,207.680	
	ALTAREA	1,836.000	246,391.200	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,525.000	158,085.500	
	CARMILA SA	22,209.000	308,705.100	
	COFINIMMO SA	10,717.000	920,054.450	
	COVIVIO	16,591.000	942,368.800	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,373.000	353,886.460	
	GECINA SA	19,770.000	1,907,805.000	
	HAMBORNER REIT AG	25,669.000	183,276.660	
	ICADE	11,589.000	469,818.060	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	19,492.000	63,251.540	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	110,515.000	662,537.420	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,821.000	175,185.060	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	155,162.000	166,954.310	
	KLEPIERRE	70,057.000	1,568,576.230	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,349.000	98,335.600	
	MERCIALYS	28,373.000	273,090.120	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	119,413.000	1,080,687.650	
	MONTEA SCA	4,768.000	309,920.000	
	NSI NV	6,797.000	161,768.600	
	RETAIL ESTATES	4,131.000	252,404.100	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	39,098.000	2,052,254.020	
VASTNED RETAIL	6,847.000	143,444.650		
WAREHOUSES DE PAUW	51,707.000	1,384,713.460		
WERELDHAVE NV	13,743.000	176,872.410		
XIOR STUDENT HOUSING NV	7,591.000	210,270.700		
ユーロ 小計		821,351.000	15,408,566.080 (2,215,135,460)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,294.000	56,458,710.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	60,129,000.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	60,102.000	232,895,250.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	50,526,560.000	
	JR REIT XXVII	55,330.000	243,175,350.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,110.000	70,056,150.000	
	LOTTE REIT CO LTD	46,445.000	186,012,225.000	

	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	31,255.000	128,614,325.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	10,401.000	33,959,265.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,249.000	156,233,280.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	37,433,800.000	
	SK REITS CO LTD	29,445.000	153,114,000.000	
	韓国・ウォン 小計	318,649.000	1,408,607,915.000 (147,340,388)	
	香港・ドル			
	CHAMPION REIT	696,070.000	2,039,485.100	
	LINK REIT	767,320.000	42,586,260.000	
	PROSPERITY REIT	394,000.000	776,180.000	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	385,000.000	1,208,900.000	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	806,000.000	1,668,420.000	
	香港・ドル 小計	3,048,390.000	48,279,245.100 (847,783,544)	
投資証券 合計		25,894,091	57,160,070,853 (57,160,070,853)	
合計			63,754,360,405 (63,754,360,405)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入 投資信託受益証券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	投資信託受益証券 5銘柄 投資証券 140銘柄	0.13 -	- 76.99	77.51
イギリス・ポンド	投資証券 37銘柄	-	4.82	4.84
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-	0.14	0.14
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	6.60	-	6.63
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	-	1.84	1.84
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	3.43	-	3.45
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-	0.41	0.42
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 27銘柄	0.05 -	- 3.46	3.52
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-	0.23	0.23
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄 投資証券 5銘柄	0.09 -	- 1.32	1.42

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,457,253,139
コール・ローン	125,569,145
株式	91,102,181,841
投資信託受益証券	562,693,325
投資証券	91,753,667
派生商品評価勘定	651,732,515
未収入金	67,501,697
未収配当金	127,405,800
差入委託証拠金	4,695,189,740
流動資産合計	103,881,280,869
資産合計	
103,881,280,869	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	68,057,930
未払解約金	35,182,000
流動負債合計	103,239,930
負債合計	
103,239,930	
純資産の部	
元本等	
元本	74,225,058,256
剰余金	
剰余金又は欠損金()	29,552,982,683
元本等合計	103,778,040,939
純資産合計	103,778,040,939
負債純資産合計	103,881,280,869

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6月14日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	45,900,304,902円
同期中追加設定元本額	33,498,187,887円
同期中一部解約元本額	5,173,434,533円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	8,791,536,061円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	222,313,437円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,391,561円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	15,306,532円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	50,095,186円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	29,612,241円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,728,436円

グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,704,783円
たわらノーロード 新興国株式	10,637,516,968円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,786,848,377円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,420,715,144円
たわらノーロード バランス(堅実型)	30,427,198円
たわらノーロード バランス(標準型)	115,309,897円
たわらノーロード バランス(積極型)	197,668,291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)	106,344,289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)	256,842,766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)	183,347,787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)	327,521,307円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	677,177円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	17,212,124円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,286,910円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,452,555円
たわらノーロード 全世界株式	299,235,960円
One DC 新興国株式インデックスファンド	650,976,941円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	393,970,478円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	365,583,478円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	571,644,006円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,043,749,178円
投資のソムリエ	27,452,592,737円
クルーズコントロール	592,395,311円
投資のソムリエ<DC年金>	1,942,745,670円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	435,711,387円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,804,335,346円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,041,138,720円
ワールドアセットバランス(基本コース)	615,131,636円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	268,059,425円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	68,132,069円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	34,492,944円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	12,357,436円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	276,449,547円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	523,206,701円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	325,527,880円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	96,080,703円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	35,829,528円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	23,056,773円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,430,352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)	11,101,329円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	721,106,204円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	14,314,978円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	21,408,907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)	227,658,326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)	103,682,188円
計	74,225,058,256円
2. 受益権の総数	74,225,058,256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6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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12月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	4,658,210,191
投資信託受益証券	35,113,106
投資証券	4,059,676
合計	4,689,263,621

(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12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年12月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	11,420,564,337	-	12,004,238,922	583,674,585
合計	11,420,564,337	-	12,004,238,922	583,674,585

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

- 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
 - 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
 - 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3982円 (13,982円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年12月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	57,268	32.410	1,856,055.880	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,333	8.100	156,597.300	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,612	147.780	1,124,901.360	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,443	60.670	512,236.810	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	265,492	1.340	355,759.280	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	90,200	1.447	130,519.400	

	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.802	69,363.370	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	57,440	2.967	170,424.480	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	50,259	1.150	57,797.850	
	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	
	MAGNIT PJSC	7,574	0.000	0.000	
	ROSNEFT OIL CO PJSC	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	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,473	13.030	566,453.190	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	6.610	305,348.950	
	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	
	H WORLD GROUP LTD ADR	20,483	42.980	880,359.340	
	JOYY INC-ADR	4,368	34.880	152,355.840	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	49.610	297,461.560	
	ZAI LAB LTD ADR	8,902	35.400	315,130.800	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	360 DIGITECH INC ADR	9,625	17.950	172,768.750	
	NIO INC ADR	144,163	12.630	1,820,778.690	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	72,505	8.210	595,266.050	
	AUTOHOME INC ADR	7,801	32.950	257,042.950	
	WEIBO CORP ADR	6,293	18.040	113,525.720	
	KANZHUN LTD ADR	18,254	20.070	366,357.780	
	KE HOLDINGS INC ADR	70,088	15.390	1,078,654.320	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,058	53.550	270,855.900	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	2.300	139,007.400	
	PINDUODUO INC ADR	52,712	89.710	4,728,793.520	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	43,775	56.530	2,474,600.750	
	IQIYI INC ADR	27,254	3.670	100,022.180	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	44,462	25.720	1,143,562.640	
アメリカ・ドル	小計	307,689,062		20,212,002.060 (2,764,193,402)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	149,810	9.120	1,366,267.200	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	289,285	5.600	1,619,996.000	

	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	361,727	23.640	8,551,226.280	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	291,901	9.200	2,685,489.200	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	459,257	16.540	7,596,110.780	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	415,618	6.130	2,547,738.340	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	413,204	4.440	1,834,625.760	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	198,294	13.050	2,587,736.700	
	Q HOLDING PJSC	222,915	4.330	965,221.950	
	MULTIPLY GROUP	357,097	4.980	1,778,343.060	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	307,502	4.530	1,392,984.060	
	アラブ首長国連邦・ディルハム 小計	3,466,610		32,925,739.330 (1,227,800,820)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	316,302	2,609.100	825,263,548.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	88,686	338.450	30,015,776.700	
	ASIAN PAINTS LTD	40,048	3,226.950	129,232,893.600	
	EICHER MOTORS LTD	13,548	3,358.200	45,496,893.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,870	1,799.900	50,163,213.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	90,767	1,265.400	114,856,561.800	
	SHREE CEMENT LTD	1,110	24,441.550	27,130,120.500	
	ICICI BANK LTD	534,524	929.900	497,053,867.600	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	68,931	240.000	16,543,440.000	
	STATE BANK OF INDIA LTD	184,690	616.500	113,861,385.000	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	774.050	21,900,196.650	
	TATA STEEL LTD	770,337	110.450	85,083,721.650	
	TATA MOTORS LTD	173,864	413.300	71,857,991.200	
	JSW STEEL LTD	75,685	740.400	56,037,174.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	60,239	803.300	48,389,988.700	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,895	6,209.800	17,977,371.000	
	TATA POWER CO LTD	141,916	219.400	31,136,370.400	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,830	4,410.300	47,763,549.000	
	NESTLE INDIA LTD	3,536	20,241.750	71,574,828.000	
	GAIL INDIA LTD	257,886	90.850	23,428,943.100	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	57,874	1,888.050	109,269,005.700	
	VEDANTA LTD	74,877	308.850	23,125,761.450	
	AXIS BANK LTD	236,617	933.700	220,929,292.900	
	TITAN COMPANY LTD	37,206	2,615.450	97,310,432.700	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	255,742	140.700	35,982,899.400	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	14,144	1,656.950	23,435,900.800	

BHARAT ELECTRONICS LTD	362,967	105.800	38,401,908.600	
LUPIN LTD	19,147	751.500	14,388,970.500	
MPHASIS LTD	8,886	1,997.300	17,748,007.800	
ACC LTD	8,629	2,619.500	22,603,665.500	
BAJAJ FINANCE LTD	28,395	6,517.450	185,062,992.750	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	179,252	2,672.100	478,979,269.200	
INFOSYS LTD	349,723	1,569.300	548,820,303.900	
WIPRO LTD	144,848	394.050	57,077,354.400	
TATA ELXSI LTD	3,406	6,745.750	22,976,024.500	
MRF LTD	215	91,510.700	19,674,800.500	
INDIAN OIL CORP LTD	326,644	77.000	25,151,588.000	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	85,293	2,722.250	232,188,869.250	
TRENT LTD	18,269	1,458.000	26,636,202.000	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,027	4,685.100	46,977,497.700	
HCL TECHNOLOGIES LTD	113,077	1,027.500	116,186,617.500	
DABUR INDIA LTD	61,644	598.750	36,909,345.000	
HERO MOTOCORP LTD	11,148	2,751.500	30,673,722.000	
SRF LTD	14,620	2,365.500	34,583,610.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,829	2,058.100	18,170,964.900	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	11,683	4,407.100	51,488,149.300	
BHARTI AIRTEL LTD	231,203	834.900	193,031,384.700	
UNITED SPIRITS LTD	31,760	938.000	29,790,880.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	100,370	992.850	99,652,354.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,384	3,274.050	47,093,935.200	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,531	8,613.350	107,933,888.850	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,755	454.000	10,784,770.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,994	1,182.000	29,542,908.000	
TVS MOTOR COMPANY LTD	23,063	1,036.150	23,896,727.450	
INDRAPRASTHA GAS LTD	30,576	435.750	13,323,492.000	
JINDAL STEEL & POWER LTD	44,243	545.800	24,147,829.400	
BIOCON LTD	37,897	272.250	10,317,458.250	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	210,454	73.100	15,384,187.400	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	26,086	1,344.050	35,060,888.300	
PETRONET LNG LTD	90,609	213.750	19,367,673.750	
CIPLA LTD/INDIA	51,586	1,107.900	57,152,129.400	
LARSEN & TOUBRO LTD	71,262	2,154.050	153,501,911.100	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,593	7,077.400	74,970,898.200	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	94,727	3,292.750	311,912,329.250	
ADANI ENTERPRISES LTD	29,726	3,996.800	118,808,876.800	
NTPC LTD	408,472	169.500	69,236,004.000	
YES BANK LTD	1,230,792	19.700	24,246,602.400	

AMBUJA CEMENTS LTD	59,555	581.000	34,601,455.000	
BHARAT FORGE LTD	26,609	857.400	22,814,556.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	143,357	462.850	66,352,787.450	
ITC LTD	308,123	341.400	105,193,192.200	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,019	2,739.650	41,146,803.350	
UNITED PHOSPHORUS LTD	48,286	763.700	36,876,018.200	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,851	1,617.600	15,934,977.600	
SIEMENS INDIA LTD	7,173	2,967.000	21,282,291.000	
INFO EDGE INDIA LTD	7,181	4,015.000	28,831,715.000	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,356	923.600	38,196,401.600	
TECH MAHINDRA LTD	61,964	1,035.300	64,151,329.200	
INDIAN HOTELS CO LTD	92,561	330.100	30,554,386.100	
MARICO LTD	52,342	523.750	27,414,122.500	
PAGE INDUSTRIES LTD	613	46,395.950	28,440,717.350	
ABB LTD/INDIA	5,891	2,976.650	17,535,445.150	
DLF LTD	60,549	402.250	24,355,835.250	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	331,822	217.200	72,071,738.400	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	55,624	890.750	49,547,078.000	
BAJAJ FINSERV LTD	39,980	1,598.600	63,912,028.000	
BAJAJ AUTO LTD	6,864	3,616.950	24,826,744.800	
JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	535.650	21,719,536.200	
ADANI POWER LTD	77,437	316.050	24,473,963.850	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,565	1,103.300	12,759,664.500	
COAL INDIA LTD	153,824	228.850	35,202,622.400	
INDUS TOWERS LTD	64,346	194.600	12,521,731.600	
PI INDUSTRIES LTD	7,535	3,452.850	26,017,224.750	
VARUN BEVERAGES LTD	24,592	1,410.250	34,680,868.000	
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,416	3,010.200	34,364,443.200	
LTIMINDTREE LTD	9,300	4,401.750	40,936,275.000	
ADANI GREEN ENERGY LTD	33,531	2,053.450	68,854,231.950	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	102,431	579.600	59,369,007.600	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	682.150	10,777,287.850	
BANDHAN BANK LTD	73,413	246.950	18,129,340.350	
ADANI TOTAL GAS LTD	28,740	3,621.300	104,076,162.000	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,277.650	16,210,823.200	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	40,943	744.100	30,465,686.300	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	23,890	801.400	19,145,446.000	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	26,775	722.150	19,335,566.250	
ZOMATO LTD	332,258	64.150	21,314,350.700	

	BERGER PAINTS INDIA LTD	28,692	615.150	17,649,883.800	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	29,241	2,646.400	77,383,382.400	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	17,001	4,002.400	68,044,802.400	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	24,802	1,247.950	30,951,655.900	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	456.850	16,751,318.950	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	9,662	1,992.050	19,247,187.100	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	47,327	1,269.650	60,088,725.550	
インド・ルピー	小計	10,793,345		8,043,188,929.450 (13,432,125,512)	
インドネシア・ ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	1,935.000	1,745,757,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,875,400	775.000	2,228,435,000.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	169,701	26,125.000	4,433,438,625.000	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	509,800	6,925.000	3,530,365,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	822,500	4,620.000	3,799,950,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,123,100	5,675.000	12,048,592,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,177,400	3,650.000	18,897,510,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	752,600	5,725.000	4,308,635,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	9,275.000	2,712,010,000.000	
	BANK MANDIRI	1,938,200	9,925.000	19,236,635,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	7,083,200	4,800.000	33,999,360,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	756,200	9,550.000	7,221,710,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,330,100	2,130.000	4,963,113,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	273,600	6,950.000	1,901,520,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,739,300	8,575.000	49,214,497,500.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	287,700	7,250.000	2,085,825,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,455,300	3,680.000	5,355,504,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	10,150.000	2,631,895,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,500.000	4,244,750,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,110.000	2,462,646,000.000	
	BANK JAGO TBK PT	428,300	3,530.000	1,511,899,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	4,380.000	5,398,271,160.000	
インドネシア・ルピア	小計	39,325,283		193,932,318,785.000 (1,706,604,405)	

オフショア・人 民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	90.600	1,180,699.200	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	37.650	218,370.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	13.320	302,364.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	12.250	72,765.000	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	110.000	330,000.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	20,800	18.470	384,176.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	5,100	37.620	191,862.000	
	GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	48,300	6.520	314,916.000	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.760	105,120.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	80.710	974,976.800	
	YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	5,200	12.300	63,960.000	
	KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	17.150	300,125.000	
	UNISPLENDOR CORP LTD	21,240	19.700	418,428.000	
	JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	19.600	205,800.000	
	SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.260	215,066.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	91.500	109,800.000	
	SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	24.340	394,308.000	
	HUAGONG TECH CO LTD	7,500	17.690	132,675.000	
	CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	178.270	374,367.000	
	NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	21.020	187,078.000	
	MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	18,300	26.510	485,133.000	
	SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	24.500	340,550.000	
	YINTAI GOLD CO LTD	23,900	13.090	312,851.000	
	TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	8.980	282,870.000	
	ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	4.120	254,616.000	
	GEM CO LTD	29,100	8.180	238,038.000	

THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	109.500	284,700.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	40.700	280,830.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	4.130	76,818.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	13.310	224,939.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	106.800	1,046,640.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	11.600	139,142.000	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	29.380	173,459.520	
ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	19.750	539,412.000	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	10.230	302,808.000	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	50.880	679,756.800	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	24.030	158,598.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	27.530	140,403.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	59.700	555,210.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	32.730	340,392.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	41,400	10.940	452,916.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	36.390	418,485.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	48.790	1,624,707.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	11,300	86.770	980,501.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	5,700	34.030	193,971.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	12.840	231,120.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	13.330	239,940.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	88.900	897,890.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	11.030	123,536.000	
BEIJING YANJING BREWERY CO LTD	40,300	10.740	432,822.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.140	92,314.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.540	64,624.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	21.930	309,213.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	17.200	239,080.000	

SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	18,300	23.470	429,501.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	20.710	161,538.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	13.420	962,885.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	52.080	312,480.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	135.800	833,676.200	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	22.550	80,503.500	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	9.850	125,095.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	5.120	44,032.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	4.690	172,123.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	8.640	276,480.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	50,467	28.930	1,460,010.310	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	30.000	324,000.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	11,184	39.000	436,176.000	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	11,100	32.160	356,976.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	24.350	168,015.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	5.380	205,516.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	38.500	188,650.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	8.490	129,897.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	44.300	332,250.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	30.200	151,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	3.270	324,057.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	17.360	114,576.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	26.910	263,718.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	10,000	212.880	2,128,800.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	69.370	1,234,786.000	

BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.970	134,101.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	22,300	40.300	898,690.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	14.410	85,595.400	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	14.830	110,453.840	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	104.100	218,610.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.080	221,798.400	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	8.640	123,552.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	31.950	1,439,475.300	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	25.460	761,254.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.600	154,000.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	6.860	489,118.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	13.460	267,854.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	12.540	239,514.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	6.100	23,180.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	34.000	401,200.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.440	227,896.000	
GOERTEK INC	25,100	17.610	442,011.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.970	148,461.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	45,200	33.000	1,491,600.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	10.910	432,036.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	135,200	3.980	538,096.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.600	158,480.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	5.980	224,848.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	38,688	13.900	537,763.200	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.480	147,096.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	25.660	703,084.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	58.990	620,574.800	

EAST MONEY INFORMATION CO LTD	84,349	20.580	1,735,902.420	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	10,300	161.030	1,658,609.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	23,400	183.270	4,288,518.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	76,600	5.790	443,514.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.610	787,341.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	14.620	671,058.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	33.880	633,556.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.270	392,121.000	
PING AN BANK CO LTD	128,100	13.700	1,754,970.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	34,080	18.200	620,256.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	4.180	611,534.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	20.460	1,127,346.000	
ZTE CORP	19,700	26.510	522,247.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	5.970	170,145.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,100	10.910	524,771.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	36.220	152,124.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	16.360	633,132.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.380	240,118.000	
BYD CO LTD	11,200	274.700	3,076,640.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	116.680	245,028.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	7.380	222,876.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.820	164,362.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	50.520	488,023.200	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	43.270	225,869.400	
LB GROUP CO LTD	11,000	19.780	217,580.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	14.740	263,846.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	26.540	222,936.000	

YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	55.480	116,508.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	29.990	287,904.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	24.150	282,555.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	52.640	336,896.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	53.240	154,396.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	21.480	171,840.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	22.160	281,432.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	244.810	856,835.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	8.600	258,860.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	16.500	211,200.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	7.360	251,712.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.960	284,208.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.580	75,369.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,000	266.180	532,360.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.400	115,440.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	70.780	467,148.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	49.500	29,700.000	
NINESTAR CORP	5,700	51.440	293,208.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	14.290	363,251.800	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.170	107,146.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	49.990	79,984.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	17.670	298,623.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	31.770	339,939.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	136.120	247,738.400	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	140.800	253,440.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	5.520	83,352.000	

SF HOLDING CO LTD	32,000	58.030	1,856,960.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	109.800	197,640.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.980	141,128.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	63.550	254,200.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	78.290	195,725.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	82.000	385,400.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	119,490	6.050	722,914.500	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	6.950	270,355.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	5.410	394,930.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	83.900	192,970.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	25.650	669,465.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	12,180	58.770	715,818.600	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	17.330	157,703.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,200	17.500	581,000.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	72.790	225,649.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.680	240,300.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,872	43.900	82,180.800	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	10.130	393,044.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	43.560	161,172.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	27.250	141,700.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	15.700	239,864.600	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	62.810	197,851.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	4,600	139.950	643,770.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	62.010	167,427.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	56.250	174,375.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	119.200	250,320.000	

ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	65.350	595,730.600	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.480	137,560.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	28.180	84,540.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	19.880	204,764.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	53.530	251,591.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	39.610	273,309.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	76.150	345,721.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	114.880	344,640.000	
ZHEJIANG WOLVO BIO- PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	50.670	136,809.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	32.240	258,887.200	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	57.870	75,231.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	71.190	213,570.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	11,600	35.200	408,320.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	34.790	111,328.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.560	96,012.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	101.000	242,400.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	15.320	326,316.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	15.020	198,264.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	4,200	80.650	338,730.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	71.300	135,470.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	9.460	530,706.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO- MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	311.440	2,304,656.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	8.270	128,185.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	4,400	112.860	496,584.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	24.340	206,890.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	33.220	134,873.200	
SG MICRO CORP	3,150	174.800	550,620.000	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	15,700	424.600	6,666,220.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	99.360	299,669.760	
WUXI APPTTEC CO LTD	17,572	80.000	1,405,760.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	34.500	355,350.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	3.630	334,323.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	56.200	410,260.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	112.590	288,230.400	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	14.260	423,522.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	64.410	318,829.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	265.560	159,336.000	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,900	100.510	291,479.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	221.390	243,529.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	79.670	87,637.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	99.700	388,830.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	95.010	171,018.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	107.000	321,000.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	68.500	369,900.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	4.790	359,250.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	77.760	209,952.000	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO	3,500	45.770	160,195.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	36.150	296,430.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	12.750	335,325.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	9,130	84.700	773,311.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	114.950	273,581.000	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	59.470	191,493.400	

MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	25.910	331,648.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	6.970	304,589.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	3.080	352,044.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	5.330	376,831.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	28.350	303,345.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.810	218,488.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	118.140	259,908.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	162.180	204,346.800	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	67.590	196,011.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	335.320	268,256.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	451.630	433,564.800	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	4.650	860,250.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	11.300	237,300.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	61.820	142,186.000	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD	32,900	12.100	398,090.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	8.530	371,055.000	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	3,900	62.630	244,257.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	193.450	270,830.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	44.480	271,328.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	39.140	62,624.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	6,300	54.500	343,350.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	52.770	316,620.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	104.250	229,350.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	17,380	57.370	997,090.600	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.950	247,420.000	

BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	5,055	144.480	730,346.400	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	9,100	47.320	430,612.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	167.230	434,798.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	40.430	303,225.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	56.810	261,326.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	2,900	77.300	224,170.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,600	528.930	846,288.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	82.330	263,456.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	3,247	250.170	812,301.990	
SHANGHAI MEDICILON INC	800	210.180	168,144.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.450	454,720.000	
PETROCHINA CO LTD	164,900	5.140	847,586.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	373,700	4.300	1,606,910.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	511,200	2.890	1,477,368.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	3.160	619,360.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	227,300	4.510	1,025,123.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,700	36.200	821,740.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	46,200	29.110	1,344,882.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	123,100	36.750	4,523,925.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	64,700	47.600	3,079,720.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	18.000	2,338,200.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	156,900	7.320	1,148,508.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	3.570	777,189.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	15.240	647,700.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,900	1,730.000	13,667,000.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	4.760	1,074,332.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	83,100	20.640	1,715,184.000	

CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	25.280	1,028,896.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.560	212,948.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	144,800	20.920	3,029,216.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.760	558,376.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	3.120	671,112.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	271,500	5.940	1,612,710.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	9.100	505,050.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.300	374,710.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	47,400	31.990	1,516,326.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.370	384,123.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	4.950	946,440.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	169,900	5.880	999,012.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	30.250	701,800.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	59,800	13.890	830,622.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.010	413,590.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	31.550	369,135.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	63,600	16.450	1,046,220.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.360	759,512.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	43,252	38.820	1,679,042.640	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	16,800	26.820	450,576.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	13.300	658,350.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	157,500	6.090	959,175.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	16,300	30.510	497,313.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	45,500	25.450	1,157,975.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	16.910	815,062.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.090	414,317.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	5.600	314,720.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	37.000	643,800.000	

GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	10.090	266,376.000	
GEMDALE CORP	39,700	11.840	470,048.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	93.400	1,868,000.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.240	333,688.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	140,200	10.610	1,487,522.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	35,044	26.400	925,161.600	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.970	177,906.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	12,000	213.230	2,558,760.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	12.100	373,890.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.020	449,450.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	110.960	488,224.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.680	92,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	4.910	500,820.000	
AIR CHINA LTD	28,400	10.920	310,128.000	
TBEA CO LTD	18,600	21.060	391,716.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.890	386,715.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	164,900	3.460	570,554.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	71,300	7.630	544,019.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	33,700	23.420	789,254.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	58.260	605,904.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	32.150	221,835.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.080	269,392.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	4.020	137,886.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	18.410	524,685.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	11.590	274,683.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	19.530	222,642.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	12,600	44.000	554,400.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.360	593,628.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	14.520	110,352.000	

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	13.300	1,192,611.000	
CMOC GROUP LIMITED	119,700	5.010	599,697.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	115,800	3.290	380,982.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	84,800	6.160	522,368.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	48.910	440,190.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	20.590	414,270.800	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	29.850	226,860.000	
BBMG CORP	54,200	2.700	146,340.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	38.740	542,360.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	111,500	5.570	621,055.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	21.060	316,300.140	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.360	310,880.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	26,400	18.580	490,512.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	39.500	405,428.000	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	22.620	367,575.000	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	127,500	2.630	335,325.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	21.780	71,874.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	96,500	7.470	720,855.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.780	164,020.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	37.790	385,458.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	15.200	287,280.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.480	165,888.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	46.370	213,302.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.910	116,088.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	23.190	350,169.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	49,500	5.700	282,150.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	14,900	16.190	241,231.000	

INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.280	168,632.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.560	128,576.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	11.390	265,387.000	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	273.000	1,064,700.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	9.090	309,969.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	284.190	2,125,741.200	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	15.500	195,300.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	6.150	349,320.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	7.870	196,750.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	6,500	63.210	410,865.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	16.730	339,619.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	12.280	238,232.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.620	94,844.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	9.800	312,620.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	15.800	199,080.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	13.650	356,265.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	39.950	167,790.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.660	287,512.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	33,900	11.290	382,731.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	24.040	305,308.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	20.000	116,600.000	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	12.080	142,544.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	26,800	14.810	396,908.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	41.990	1,217,710.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	8,879	40.770	361,996.830	
JCET GROUP CO LTD	10,900	24.220	263,998.000	

HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	36.320	246,976.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	126.030	315,075.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	54.980	291,394.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	15.700	87,920.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	32.300	338,827.000	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	155.300	264,010.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	14.750	298,628.500	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	3.200	199,680.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	19.550	258,060.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	5,924	65.490	387,962.760	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	10.930	214,228.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	15.200	297,920.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	9.450	186,165.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	15.310	240,367.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	105.890	180,013.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	47.030	230,447.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	33.600	188,160.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	77.000	323,400.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,400	79.150	110,810.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	136.210	122,589.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	354.690	283,752.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	48.950	127,270.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	125.560	125,560.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	312.200	312,200.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	54.860	389,506.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	58.250	646,575.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.680	1,032,056.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	28.190	327,004.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	97,900	6.010	588,379.000	

PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	345.580	345,580.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	600	429.860	257,916.000	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	203.690	325,904.000	
3PEAK INC	1,200	337.990	405,588.000	
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	4,800	89.930	431,664.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	46.300	2,174,618.400	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	14.030	178,181.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	131.300	236,340.000	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	30.650	312,630.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	19.680	1,244,779.680	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	24,016	80.200	1,926,083.200	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	47.920	239,600.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	14.550	17,460.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	32.900	230,300.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.280	109,296.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	62.840	439,880.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	22,300	15.620	348,326.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	14.300	582,010.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	6.260	657,300.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	61.350	208,590.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	58.890	312,117.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	124.960	249,920.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.470	621,504.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	13.500	612,900.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	21.050	239,970.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	26.090	52,180.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	21.550	609,865.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	45.800	405,330.000	

	CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	10.060	305,824.000	
	TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	139.770	111,816.000	
	ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	17.950	382,335.000	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	10,580	63.520	672,041.600	
	TOLY BREAD CO LTD	7,056	16.020	113,037.120	
	YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	66.850	191,191.000	
	G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	1,000	337.070	337,070.000	
	ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	52.410	154,085.400	
	ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	19.410	219,527.100	
	ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	9.210	454,053.000	
	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	16.060	256,960.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	53.420	240,390.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	23.820	254,874.000	
	オフショア・人民元 小計	15,064,747		241,616,395.610 (4,736,986,082)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	477,347	18.290	8,730,676.630	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	325,231	5.450	1,772,508.950	
	OOREDOO QSC	86,085	9.150	787,677.750	
	QATAR FUEL QSC	67,101	18.080	1,213,186.080	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	49,676	16.970	843,001.720	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	109,350	10.800	1,180,980.000	
	INDUSTRIES QATAR QSC	159,428	14.310	2,281,414.680	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	172,016	22.880	3,935,726.080	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	3.809	950,299.790	
	MASRAF AL RAYAN	562,961	3.387	1,906,748.900	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	3.100	631,820.300	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	2.197	992,301.410	
	カタール・リアル 小計	2,914,158		25,226,342.290 (942,708,411)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	770,722	0.847	652,801.530	

	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	216,726	0.580	125,701.080	
	GULF BANK KSCP	185,675	0.331	61,458.420	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	741,819	1.094	811,549.980	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	149,005	0.756	112,647.780	
	MABANEE CO KPSC	68,589	0.850	58,300.650	
	BOUBYAN BANK KSCP	136,266	0.824	112,283.180	
	クウェート・ディナール 小計	2,268,802		1,934,742.620 (864,133,444)	
コロンビア・ペ ソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	48,542	18,900.000	917,443,800.000	
	BANCOLOMBIA SA	29,016	39,980.000	1,160,059,680.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,692	31,950.000	1,459,859,400.000	
	コロンビア・ペソ 小計	123,250		3,537,362,880.000 (100,560,152)	
サウジアラビ ア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,055	39.800	1,036,989.000	
	JARIR MARKETING CO	6,127	155.800	954,586.600	
	ETIHAD ETISALAT CO	38,569	33.550	1,293,989.950	
	SAUDI BRITISH BANK	96,385	36.450	3,513,233.250	
	AL RAJHI BANK	203,342	74.300	15,108,310.600	
	ARAB NATIONAL BANK	60,216	29.950	1,803,469.200	
	BANK ALBILAD	48,763	46.250	2,255,288.750	
	BANK AL-JAZIRA	41,743	19.460	812,318.780	
	BANQUE SAUDI FRANSI	62,154	36.900	2,293,482.600	
	RIYAD BANK	140,103	31.050	4,350,198.150	
	SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	17.660	928,103.640	
	SAUDI TELECOM CO	155,471	36.700	5,705,785.700	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	22,638	131.000	2,965,578.000	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	93,194	81.300	7,576,672.200	
	SAUDI ELECTRICITY CO	87,342	23.020	2,010,612.840	
	SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	19.980	776,342.880	
	SAVOLA GROUP	30,777	26.850	826,362.450	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	44,863	11.240	504,260.120	
	ALMARAI CO JSC	24,903	52.600	1,309,897.800	
	SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,987	186.000	741,582.000	
EMAAR ECONOMIC CITY	53,833	8.080	434,970.640		
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	35,820	33.050	1,183,851.000		
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	39.550	569,401.350		

	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	11.800	895,761.600	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	59,592	13.020	775,887.840	
	RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	35,214	10.520	370,451.280	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	53,271	10.120	539,102.520	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	6,526	169.000	1,102,894.000	
	ALINMA BANK	102,584	30.050	3,082,649.200	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	89,559	68.500	6,134,791.500	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	183.000	921,588.000	
	DALLAH HEALTHCARE CO	4,127	154.600	638,034.200	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	249,782	30.850	7,705,774.700	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,656	214.800	1,859,308.800	
	ACWA POWER CO	7,940	138.000	1,095,720.000	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,627	233.800	614,192.600	
	NAHDI MEDICAL CO	4,279	166.000	710,314.000	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	5,202	152.200	791,744.400	
	ELM CO	2,420	318.800	771,496.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	227,627	47.850	10,891,951.950	
	サウジアラビア・リアル 小計	2,322,446		97,856,950.090 (3,564,928,692)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	148,800	34.750	5,170,800.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	302,300	17.600	5,320,480.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	42.000	5,220,600.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,039,555	4.600	4,781,953.000	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	66,300	143.000	9,480,900.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	170.000	4,998,000.000	
	SHIN CORP PCL	127,600	74.250	9,474,300.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	23.600	9,255,920.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	118,600	187.000	22,178,200.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	666,020	14.400	9,590,688.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	30,900	700.000	21,630,000.000	
	PTT PCL	1,061,900	32.000	33,980,800.000	

THAI UNION GROUP PCL-NVDR	265,000	16.800	4,452,000.000	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	83,100	59.500	4,944,450.000	
LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	9.550	7,889,255.000	
SIAM CEMENT PCL NVDR	82,050	334.000	27,404,700.000	
AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	446,500	73.500	32,817,750.000	
CENTRAL PATTANA PCL NVDR	201,700	71.000	14,320,700.000	
BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,097,500	28.250	31,004,375.000	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	62,700	210.000	13,167,000.000	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	328,110	30.750	10,089,382.500	
THAI OIL PCL NVDR	124,700	54.250	6,764,975.000	
CP ALL PCL NVDR	610,900	64.500	39,403,050.000	
BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	8.300	7,195,270.000	
PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	138,845	171.500	23,811,917.500	
INDORAMA VENTURES PCL NVDR	189,722	40.750	7,731,171.500	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	234,908	46.000	10,805,768.000	
JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	56,700	70.000	3,969,000.000	
ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	168,000	97.000	16,296,000.000	
BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	860,800	9.600	8,263,680.000	
B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	37.750	3,707,050.000	
GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	286,200	54.000	15,454,800.000	
OSOTSPA PCL NVDR	142,800	28.750	4,105,500.000	
ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	6.200	5,066,640.000	
CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	203,033	43.500	8,831,935.500	
SCG PACKAGING PCL NVDR	143,300	57.750	8,275,575.000	
SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	49.750	3,432,750.000	
PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	24.300	7,175,790.000	
SCB X PCL NVDR	90,300	103.000	9,300,900.000	
CARABAO GROUP PCL NVDR	24,000	95.500	2,292,000.000	
MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	107,100	39.000	4,176,900.000	
GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	70.000	5,208,000.000	
タイ・パーツ 小計	13,102,943		488,440,926.000 (1,919,572,839)	
チェコ・コルナ KOMERCNI BANKA AS	8,062	652.500	5,260,455.000	

	CEZ	17,008	748.500	12,730,488.000	
	MONETA MONEY BANK AS	40,915	71.600	2,929,514.000	
チェコ・コルナ	小計	65,985		20,920,457.000 (123,840,737)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,868,510	33.300	228,721,383.000	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,121	24,000.000	122,904,000.000	
	BANCO DE CHILE	4,571,902	83.350	381,068,031.700	
	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,449.900	172,912,174.200	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	6,148.000	248,520,604.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	5,156.000	54,220,496.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,882,457	69.300	130,454,270.100	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	114.390	244,011,257.280	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	14,962	81,500.000	1,219,403,000.000	
	FALABELLA SA	96,178	1,580.000	151,961,240.000	
	CENCOSUD SA	152,261	1,320.100	200,999,746.100	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	37.100	89,622,544.200	
チリ・ペソ	小計	18,310,442		3,244,798,746.580 (514,767,852)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	335,192	16.670	5,587,650.640	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	73,827	53.500	3,949,744.500	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	147,123	40.500	5,958,481.500	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	428.800	3,177,408.000	
	HEKTAS TICARET TAS	121,118	38.700	4,687,266.600	
	KOC HOLDING AS	70,710	68.650	4,854,241.500	
	SASA POLYESTER SANAYI	46,986	113.900	5,351,705.400	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	144,586	39.380	5,693,796.680	
	TURK HAVA YOLLARI	57,648	141.000	8,128,368.000	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	137,757	32.380	4,460,571.660	
	TURKIYE IS BANKASI	331,103	10.570	3,499,758.710	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,554	437.400	5,928,519.600	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	313,727	11.350	3,560,801.450	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	94,865	40.100	3,804,086.500	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,467	123.000	5,961,441.000	
トルコ・リラ	小計	1,944,073		74,603,841.740 (547,211,719)	
ハンガリー・ フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,715	8,800.000	120,692,000.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,781	2,600.000	106,030,600.000	

	OTP BANK NYRT	22,689	10,000.000	226,890,000.000	
ハンガリー・フォリント 小計		77,185		453,612,600.000 (155,966,981)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	752,600	29.200	21,975,920.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158,120	54.000	8,538,480.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	188,130	98.500	18,530,805.000	
	AYALA CORP	27,283	700.000	19,098,100.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,335	2,160.000	7,203,600.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	103,500	203.000	21,010,500.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	318,290	46.500	14,800,485.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46,960	236.800	11,120,128.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	205,155	55.000	11,283,525.000	
	BDO UNIBANK INC	200,993	129.000	25,928,097.000	
	PLDT INC	8,985	1,730.000	15,544,050.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,199,975	34.700	41,639,132.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	96,820	136.600	13,225,612.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,153	930.000	22,462,290.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,720	280.000	6,921,600.000	
	ACEN CORP	763,119	7.250	5,532,612.750	
	MONDE NISSIN CORP	649,200	11.240	7,297,008.000	
フィリピン・ペソ 小計		4,771,338		272,111,945.250 (671,871,604)	
ブラジル・リアル	BRF SA	54,692	7.520	411,283.840	
	VALE SA	398,089	88.740	35,326,417.860	
	RAIA DROGASIL SA	106,700	23.540	2,511,718.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,950	45.220	1,083,019.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	129,900	42.670	5,542,833.000	
	BANCO DO BRASIL SA	84,500	34.980	2,955,810.000	
	ITAUSA SA	544,626	8.170	4,449,594.420	
	GERDAU SA	115,430	31.470	3,632,582.100	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	383,310	28.060	10,755,678.600	
	VIBRA ENERGIA SA	117,700	14.930	1,757,261.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	502,312	24.710	12,412,129.520	
	CCR SA	121,020	10.780	1,304,595.600	
	WEG SA	176,044	37.100	6,531,232.400	
	BANCO BRADESCO SA PREF	565,702	14.300	8,089,538.600	
	BANCO BRADESCO SA	155,292	12.810	1,989,290.520	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64,606	14.810	956,814.860	
	SUZANO SA	78,675	54.990	4,326,338.250	
CPFL ENERGIA SA	23,600	32.210	760,156.000		

	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	504,747	24.330	12,280,494.510	
	AMERICANAS SA	69,171	8.370	578,961.270	
	BRASKEM SA	19,900	25.080	499,092.000	
	ENGIE BRASIL SA	25,587	38.310	980,237.970	
	LOCALIZA RENT A CAR	79,789	52.810	4,213,657.090	
	LOJAS RENNER SA	99,120	20.740	2,055,748.800	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	66,304	12.650	838,745.600	
	COSAN SA	119,800	16.640	1,993,472.000	
	TOTVS SA	53,400	26.760	1,428,984.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	110,600	26.380	2,917,628.000	
	JBS SA	76,700	21.110	1,619,137.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	160,262	11.080	1,775,702.960	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,098	55.770	1,901,645.460	
	HYPERA SA	41,200	42.460	1,749,352.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	645,448	11.740	7,577,559.520	
	MAGAZINE LUIZA SA	271,500	2.800	760,200.000	
	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	70,200	33.650	2,362,230.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	50,528	37.600	1,899,852.800	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,700	31.720	2,179,164.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	463,461	4.730	2,192,170.530	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	73,400	14.860	1,090,724.000	
	AMBEV SA	490,195	15.510	7,602,924.450	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	11.530	1,068,831.000	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	89,700	19.280	1,729,416.000	
	TIM SA	97,900	12.570	1,230,603.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	45,900	26.410	1,212,219.000	
	RUMO SA	127,600	17.640	2,250,864.000	
	ブラジル・リアル 小計	7,694,058		172,785,910.530 (4,502,576,207)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	281.200	377,932.800	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,187	121.550	1,845,979.850	
	BANK PEKAO SA	20,059	82.640	1,657,675.760	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	67,889	62.200	4,222,695.800	
	LPP SA	112	9,600.000	1,075,200.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,927	258.800	1,016,307.600	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	131.380	919,791.380	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	90,467	28.590	2,586,451.530	

	CYFROWY POLSAT SA	33,104	18.160	601,168.640	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,101	6.898	511,148.690	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	60,071	32.470	1,950,505.370	
	DINO POLSKA SA	4,847	369.100	1,789,027.700	
	ALLEGRO.EU SA	40,496	24.250	982,028.000	
	PEPCO GROUP NV	16,587	39.880	661,489.560	
ポーランド・ズロチ	小計	435,192		20,197,402.680 (619,341,235)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	210,200	4.220	887,044.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	710,500	5.650	4,014,325.000	
	DIGI.COM BHD	338,100	3.910	1,321,971.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,020	6.350	558,927.000	
	RHB BANK BHD	133,680	5.610	749,944.800	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	60,000	6.220	373,200.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	0.840	420,588.000	
	GENTING BHD	250,100	4.360	1,090,436.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	18.420	332,591.520	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	20.620	1,350,774.960	
	IOI CORP BHD	276,613	3.820	1,056,661.660	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	48,500	20.800	1,008,800.000	
	MALAYAN BANKING BHD	484,175	8.690	4,207,480.750	
	MISC BHD	147,380	7.190	1,059,662.200	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,800	136.800	930,240.000	
	PPB GROUP BHD	70,260	17.500	1,229,550.000	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	22.200	763,680.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	16.840	1,338,780.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	275,400	2.640	727,056.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	99,500	5.420	539,290.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	270,750	9.330	2,526,097.500	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.540	639,593.000	
	DIALOG GROUP BHD	418,344	2.310	966,374.640	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,500,150	4.410	6,615,661.500	
	SIME DARBY BERHAD	320,700	2.190	702,333.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	105,800	1.630	172,454.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	317,100	3.090	979,839.000	
	MAXIS BHD	214,200	3.880	831,096.000	
	INARI AMERTRON BHD	330,600	2.690	889,314.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	238,100	8.530	2,030,993.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	177,700	6.000	1,066,200.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.840	1,820,324.000	

	SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.350	960,480.000	
	MR DIY GROUP M BHD	259,200	2.070	536,544.000	
マレーシア・リンギット 小計		8,762,386		44,698,306.530 (1,385,334,614)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	338,400	13.210	4,470,264.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	132,300	85.990	11,376,477.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,700	249.670	5,417,839.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,660	173.330	3,927,657.800	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	48,500	84.320	4,089,520.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	271,300	143.320	38,882,716.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	121,125	36.720	4,447,710.000	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	12,455	281.740	3,509,071.700	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	170,000	32.970	5,604,900.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	19,220	486.120	9,343,226.400	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	328,952	78.280	25,750,362.560	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,893,678	17.990	52,057,267.220	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	219,900	35.100	7,718,490.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,700	162.650	7,270,455.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	544,700	70.870	38,602,889.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	35,785	308.080	11,024,642.800	
OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	117,000	20.360	2,382,120.000		
BANCO DEL BAJIO SA	85,300	61.150	5,216,095.000		
メキシコ・ペソ 小計		5,427,675		241,091,703.480 (1,667,414,330)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	235,597	1.005	236,774.980	
	NATIONAL BANK OF GREECE	62,656	3.650	228,694.400	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,850	14.800	308,580.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	256,259	1.040	266,509.360	
	MYTILINEOS HOLDINGS	10,944	18.860	206,403.840	
	OPAP SA	19,031	13.290	252,921.990	
	JUMBO SA	12,011	15.160	182,086.760	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	6.750	144,726.750	
	TERNA ENERGY SA	6,102	20.400	124,480.800	
ユーロ 小計		648,021		1,951,178.880 (280,501,476)	

韓国・ウォン	SKC CO LTD	2,357	98,100.000	231,221,700.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	8,603	23,750.000	204,321,250.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,498	79,500.000	278,091,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,110	207,000.000	643,770,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,051	63,100.000	318,718,100.000	
	COWAY CO LTD	5,833	58,900.000	343,563,700.000	
	KT&G CORP	11,416	98,000.000	1,118,768,000.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	64,200.000	99,959,400.000	
	CJ CORP	1,958	80,800.000	158,206,400.000	
	KAKAO CORP	32,882	58,100.000	1,910,444,200.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	6,460.000	201,732,880.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,664	468,000.000	778,752,000.000	
	LG UPLUS CORP	25,277	12,050.000	304,587,850.000	
	DOOSAN ENERBILITY	44,086	16,000.000	705,376,000.000	
	LG H&H CO LTD	981	722,000.000	708,282,000.000	
	LG CHEM LTD	5,172	627,000.000	3,242,844,000.000	
	LG CHEM LTD	733	289,000.000	211,837,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	47,938	38,000.000	1,821,644,000.000	
	HYUNDAI MERCHANT MARINE	27,028	22,050.000	595,967,400.000	
	S-OIL CORP	4,649	84,400.000	392,375,600.000	
	HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	11,502	46,950.000	540,018,900.000	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	30,993	5,700.000	176,660,100.000	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	35,000.000	219,660,000.000	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	2,719	193,000.000	524,767,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,831	186,000.000	340,566,000.000	
	HOTEL SHILLA CO LTD	3,641	79,600.000	289,823,600.000	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	73,600.000	322,588,800.000	
	HYUNDAI MOBIS	6,365	208,500.000	1,327,102,500.000	
	SK HYNIX INC	56,787	81,500.000	4,628,140,500.000	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,580	38,600.000	331,188,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	2,064	79,500.000	164,088,000.000	
	HYUNDAI MOTOR CO	14,637	162,500.000	2,378,512,500.000	
	HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,694	83,700.000	225,487,800.000	
HYUNDAI STEEL CO	9,701	33,100.000	321,103,100.000		
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,033	11,050.000	309,764,650.000		
KIA CORPORATION	27,321	65,200.000	1,781,329,200.000		
KOREA ZINC CO LTD	943	602,000.000	567,686,000.000		
KOREA ELECTRIC POWER CORP	25,278	21,000.000	530,838,000.000		

KOREAN AIR CO LTD	19,941	26,050.000	519,463,050.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,003	142,000.000	284,426,000.000	
HLB INC	9,695	32,700.000	317,026,500.000	
LG ELECTRONICS INC	11,222	91,000.000	1,021,202,000.000	
LG CORP	9,347	80,400.000	751,498,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	9,690.000	148,160,100.000	
NAVER CORP	13,766	195,000.000	2,684,370,000.000	
L&F CO LTD	2,321	193,300.000	448,649,300.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,934	58,500.000	288,639,000.000	
KANGWON LAND INC	9,245	24,650.000	227,889,250.000	
POSCO HOLDINGS INC	8,157	284,000.000	2,316,588,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,885	22,850.000	385,822,250.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,725	645,000.000	3,692,625,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,630	138,000.000	776,940,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	496,098	60,400.000	29,964,319,200.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	68,830	5,140.000	353,786,200.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	85,412	54,700.000	4,672,036,400.000	
YUHAN CORP	5,874	58,500.000	343,629,000.000	
HANON SYSTEMS	19,141	8,620.000	164,995,420.000	
GS HOLDINGS CORP	4,259	45,900.000	195,488,100.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	13,950.000	331,200,900.000	
CELLTRION INC	10,323	180,500.000	1,863,301,500.000	
HANA FINANCIAL GROUP	31,123	46,450.000	1,445,663,350.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	173,000.000	333,544,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,680	65,600.000	110,208,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	90,100.000	92,352,500.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	3,912	44,400.000	173,692,800.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,005	73,700.000	589,968,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	139,500.000	422,964,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,862	168,500.000	987,747,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	890	378,500.000	336,865,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	5,950.000	186,193,350.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	286,500.000	411,414,000.000	
SK INC	3,655	203,500.000	743,792,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	40,515	52,600.000	2,131,089,000.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	45,900.000	340,853,400.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,508	58,300.000	146,216,400.000	
HANMI PHARM CO LTD	795	269,500.000	214,252,500.000	
E-MART CO LTD	1,887	100,000.000	188,700,000.000	

	HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	33,300.000	256,310,100.000	
	HD HYUNDAI CO LTD	5,382	63,800.000	343,371,600.000	
	BGF RETAIL CO LTD	715	205,000.000	146,575,000.000	
	ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,318	118,000.000	273,524,000.000	
	NETMARBLE CORP	2,597	50,000.000	129,850,000.000	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	56,041	12,950.000	725,730,950.000	
	ECOPRO BM CO LTD	4,843	101,000.000	489,143,000.000	
	SD BIOSENSOR INC	4,288	32,850.000	140,860,800.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,850	72,900.000	207,765,000.000	
	KRAFTON INC	3,153	180,500.000	569,116,500.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,482	116,000.000	171,912,000.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	62,600.000	170,272,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	10,144	35,900.000	364,169,600.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	1,958	82,900.000	162,318,200.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	42,750.000	139,536,000.000	
	HYBE CO LTD	1,920	156,500.000	300,480,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,645	515,000.000	1,877,175,000.000	
	KAKAObANK CORP	15,775	28,100.000	443,277,500.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,875	150,500.000	282,187,500.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,640	127,500.000	464,100,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,744	118,500.000	1,036,164,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,851	827,000.000	1,530,777,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	3,427	44,650.000	153,015,550.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	35,300.000	162,380,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,748	65,200.000	570,369,600.000	
	韓国・ウォン 小計	1,667,258		100,967,740,300.000 (10,561,225,635)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	98,000	11.980	1,174,040.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	6.860	987,840.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	152,000	5.140	781,280.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12,000	119.060	1,428,720.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,500	30.000	3,705,000.000	
	BEIJING ENTERPRISES	58,000	24.750	1,435,500.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	390,000	3.340	1,302,600.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	496,000	9.400	4,662,400.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	150,000	24.900	3,735,000.000	

HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	5,674	9.950	56,456.300	
HENGAN INTERNATIONAL GROUP	67,500	37.400	2,524,500.000	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	939,600	8.320	7,817,472.000	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	401,120	21.950	8,804,584.000	
CHINA RESOURCES LAND LTD	334,888	35.500	11,888,524.000	
CITIC LTD	601,000	7.880	4,735,880.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	164,000	5.660	928,240.000	
LENOVO GROUP LTD	772,000	6.210	4,794,120.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,200,000	3.470	7,634,000.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	170,790	9.910	1,692,528.900	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC	29,000	32.450	941,050.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,651,200	3.700	9,809,440.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	106,000	16.000	1,696,000.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	263,000	15.880	4,176,440.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	83,400	112.800	9,407,520.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	392,000	5.980	2,344,160.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	216,000	6.070	1,311,120.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	152,200	9.700	1,476,340.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	128,000	11.440	1,464,320.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	3.570	1,356,600.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	130,500	7.390	964,395.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	304,400	11.320	3,445,808.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	73,500	26.350	1,936,725.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	639,000	12.540	8,013,060.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	93,400	31.500	2,942,100.000	
BYD CO LTD	86,000	215.000	18,490,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	200,000	9.250	1,850,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	3.490	1,436,456.080	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	300,000	6.910	2,073,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	137.900	1,792,700.000	

PICC PROPERTY & CASUALTY -H	723,788	7.690	5,565,929.720	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.730	816,870.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	191,200	14.100	2,695,920.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	314,000	10.760	3,378,640.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	761,000	12.400	9,436,400.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	593,000	11.260	6,677,180.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	256,000	11.640	2,979,840.000	
WEICHAI POWER CO LTD	189,440	10.840	2,053,529.600	
TINGYI HOLDING CORP	202,000	13.600	2,747,200.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	66,000	74.850	4,940,100.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	332,000	7.840	2,602,880.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	3.910	1,235,560.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	171,333	55.000	9,423,315.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	5.950	690,200.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,044,250	4.540	4,740,895.000	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	334,000	34.800	11,623,200.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	650,300	325.600	211,737,680.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	661,500	52.750	34,894,125.000	
LI NING CO LTD	248,500	63.050	15,667,925.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	522,000	2.020	1,054,440.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	2.870	1,558,410.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	7.180	1,407,280.000	
ZTE CORP	91,288	17.900	1,634,055.200	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	349,500	22.700	7,933,650.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	300,750	8.310	2,499,232.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	906,205	4.420	4,005,426.100	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	216,250	8.600	1,859,750.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	85,000	17.940	1,524,900.000	
BAIDU INC	230,550	123.000	28,357,650.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,966,530	4.730	47,141,686.900	

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	88,400	86.650	7,659,860.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	334,000	4.660	1,556,440.000	
MINTH GROUP LTD	82,000	21.050	1,726,100.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	6.650	1,077,300.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	390,000	7.080	2,761,200.000	
BANK OF CHINA LTD	8,202,200	2.750	22,556,050.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	84,000	14.380	1,207,920.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	412,470	42.300	17,447,481.000	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,852,235	3.890	22,765,194.150	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	137,000	8.690	1,190,530.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	8.710	979,875.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	2.690	768,264.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	6.670	1,394,030.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	74,000	20.400	1,509,600.000	
ZHUZHOU CRRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	38.250	2,046,375.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	1,091,142	3.060	3,338,894.520	
CMOC GROUP LIMITED	393,000	3.880	1,524,840.000	
CHINA CITIC BANK-H	869,800	3.460	3,009,508.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	76,200	107.100	8,161,020.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	128,400	100.400	12,891,360.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	19.140	669,900.000	
FOSUN INTERNATIONAL	288,028	6.410	1,846,259.480	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	2.010	1,121,580.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	274,000	3.900	1,068,600.000	
KINGSOFT CORP LTD	98,800	25.100	2,479,880.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,145,000	2.060	4,418,700.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	395,000	4.520	1,785,400.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	6.960	1,057,920.000	
DONGYUE GROUP	159,000	9.360	1,488,240.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	71,000	27.250	1,934,750.000	

WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	492,000	5.070	2,494,440.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	282,200	18.520	5,226,344.000	
CRRG CORP LTD - H	487,000	3.170	1,543,790.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	110,000	10.060	1,106,600.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	13.200	1,887,600.000	
SINOPHARM GROUP CO	140,400	20.150	2,829,060.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	222,000	4.450	987,900.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	5.570	1,618,235.390	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	257,500	7.510	1,933,825.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	327,000	9.100	2,975,700.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,900	13.560	1,015,644.000	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	210,600	14.920	3,142,152.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	99,000	7.790	771,210.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	198,000	29.500	5,841,000.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	19.620	1,732,446.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	2.700	1,696,021.200	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	62,200	7.880	490,136.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	9.180	973,080.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.370	592,500.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,007,000	2.600	7,818,200.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	61,500	41.000	2,521,500.000	
FAR EAST HORIZON LTD	188,000	6.090	1,144,920.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	61,200	21.400	1,309,680.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	219,500	16.360	3,591,020.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	343,200	5.020	1,722,864.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	836,000	2.640	2,207,040.000	

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	25.850	1,189,100.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	4.000	1,392,000.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	176,000	5.880	1,034,880.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	834,000	4.890	4,078,260.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	42,000	26.600	1,117,200.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	116,000	23.950	2,778,200.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	42,500	45.200	1,921,000.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	204,000	23.950	4,885,800.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	30.800	1,727,880.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	62,000	15.320	949,840.000	
CHINA TOWER CORP LTD	4,406,000	0.830	3,656,980.000	
XIAOMI CORP	1,605,800	11.480	18,434,584.000	
BEIGENE LTD	65,500	124.200	8,135,100.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	36,912	78.750	2,906,820.000	
MEITUAN	458,900	188.500	86,502,650.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	17.880	2,288,640.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	124,000	21.900	2,715,600.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	484,000	8.510	4,118,840.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	32.250	3,354,000.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	1.110	1,106,670.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	50,000	16.820	841,000.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	176,500	17.520	3,092,280.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	163,000	6.020	981,260.000	
HANSHO PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	128,000	15.440	1,976,320.000	
CHINA FEIHE LTD	374,000	7.470	2,793,780.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,542,368	91.850	141,666,500.800	
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	48.700	939,910.000	

HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS LTD	351,000	1.660	582,660.000	
JD.COM INC	224,885	236.800	53,252,768.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	14.340	2,638,560.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	213.400	1,621,840.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	19.940	1,375,860.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	186,300	70.100	13,059,630.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	236,800	26.850	6,358,080.000	
BILIBILI INC	18,540	196.500	3,643,110.000	
NETEASE INC	203,200	112.500	22,860,000.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	20.500	1,855,250.000	
NONGFU SPRING CO LTD	183,400	43.450	7,968,730.000	
LI AUTO INC	118,500	94.000	11,139,000.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	117,400	84.650	9,937,910.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	38,400	49.500	1,900,800.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	69,200	39.700	2,747,240.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	75.900	956,340.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	171,761	17.640	3,029,864.040	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	151,900	25.500	3,873,450.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	22.050	1,093,680.000	
XPENG INC	93,600	46.850	4,385,160.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	65,000	26.800	1,742,000.000	
CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.850	1,929,550.000	
GF SECURITIES CO LTD	106,000	11.320	1,199,920.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	34.300	2,112,880.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	149,400	9.200	1,374,480.000	
3SBIO INC	146,500	8.450	1,237,925.000	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	182,500	6.600	1,204,500.000	
CHINA LITERATURE LTD	38,600	31.900	1,231,340.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	19.320	830,760.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	3.650	954,475.000	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	145,000	8.870	1,286,150.000	
BOC AVIATION LTD	23,600	62.100	1,465,560.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	62,600	22.450	1,405,370.000	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	13.760	1,706,240.000	

	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	150,400	15.100	2,271,040.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	380,000	53.900	20,482,000.000	
	HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	396,000	1.880	744,480.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	37,240	70.250	2,616,110.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	70,000	20.800	1,456,000.000	
香港・ドル 小計		87,290,112		1,280,631,574.880 (22,487,890,458)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	50,000	250.500	12,525,000.000	
	ACER INC	278,532	23.600	6,573,355.200	
	ASUSTEK COMPUTER INC	76,387	268.500	20,509,909.500	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	299.500	13,961,492.000	
	ASIA CEMENT CORP	223,928	41.350	9,259,422.800	
	TAIWAN BUSINESS BANK	665,088	13.000	8,646,144.000	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	96,000	83.200	7,987,200.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	70,000	119.000	8,330,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	133,577	149.500	19,969,761.500	
	QUANTA COMPUTER INC	288,704	72.500	20,931,040.000	
	EVA AIRWAYS CORP	255,000	28.350	7,229,250.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	65,760	173.500	11,409,360.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	465,030	17.450	8,114,773.500	
	CHINA AIRLINES	290,000	19.650	5,698,500.000	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	178,169	35.000	6,235,915.000	
	CHINA STEEL CORP	1,234,313	29.050	35,856,792.650	
	ADVANTECH CO LTD	46,107	334.500	15,422,791.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	423,304	21.950	9,291,522.800	
	DELTA ELECTRONICS INC	202,454	294.500	59,622,703.000	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	134,000	53.700	7,195,800.000	
	CHUNG HWA TELECOM CO LTD	392,021	112.000	43,906,352.000	
	AUO CORP	652,155	15.700	10,238,833.500	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	168,800	95.400	16,103,520.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	108,427	154.500	16,751,971.500	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	314,824	33.200	10,452,156.800	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	194.500	8,707,376.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	480.000	9,274,560.000		
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	299.000	17,427,215.000		

FORMOSA PLASTICS CORP	431,018	87.900	37,886,482.200	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	361,505	70.900	25,630,704.500	
GIANT MANUFACTURING	31,244	231.500	7,232,986.000	
MEDIATEK INC	158,431	729.000	115,496,199.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	772,973	57.500	44,445,947.500	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	926,468	22.650	20,984,500.200	
HOTAI MOTOR CO LTD	31,009	624.000	19,349,616.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	165,000	67.500	11,137,500.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,048,050	22.400	23,476,320.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	828,064	41.100	34,033,430.400	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,644,723	12.950	21,299,162.850	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,355,771	24.650	33,419,755.150	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,292,009	102.000	131,784,918.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,174,297	31.150	36,579,351.550	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,527	2,190.000	23,054,130.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,169,529	15.050	17,601,411.450	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,303,345	8.710	11,352,134.950	
INVENTEC CO LTD	270,005	24.500	6,615,122.500	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	197,845	63.700	12,602,726.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,095,163	17.750	19,439,143.250	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,840,308	22.700	41,774,991.600	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,104,413	26.200	28,935,620.600	
NAN YA PLASTICS CORP	494,283	73.500	36,329,800.500	
POU CHEN CORP	233,990	33.050	7,733,369.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	501,749	66.000	33,115,434.000	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	60,771	273.000	16,590,483.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,480	81.500	8,922,620.000	
E INK HOLDINGS INC	84,000	170.000	14,280,000.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	174,336	44.850	7,818,969.600	

SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	151,509	59.800	9,060,238.200	
TAIWAN CEMENT CORP	656,781	33.700	22,133,519.700	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,560,849	481.500	1,233,048,793.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,241,985	43.500	54,026,347.500	
WAN HAI LINES LTD	78,747	70.100	5,520,164.700	
WALSIN LIHWA CORP	257,421	46.950	12,085,915.950	
WINBOND ELECTRONICS CORP	278,000	20.700	5,754,600.000	
YAGEO CORP	37,651	479.000	18,034,829.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	173,000	62.800	10,864,400.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	28.500	5,500,500.000	
INNOLUX CORPORATION	910,742	12.000	10,928,904.000	
WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	48.500	8,012,345.500	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	26,098	281.500	7,346,587.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,995	1,490.000	10,422,550.000	
PEGATRON CORP	196,554	63.100	12,402,557.400	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,928	947.000	14,136,816.000	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	39,402	149.500	5,890,599.000	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	150,185	212.500	31,914,312.500	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	821.000	6,568,000.000	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	72,362	116.000	8,393,992.000	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,020,788	26.250	26,795,685.000	
SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	405,144	47.800	19,365,883.200	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	7,029	1,715.000	12,054,735.000	
WIWYNN CORP	8,000	906.000	7,248,000.000	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	341,292	99.500	33,958,554.000	
SILERGY CORP	32,000	477.000	15,264,000.000	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	326,209	33.450	10,911,691.050	
PHARMAESSENTIA CORP	20,576	537.000	11,049,312.000	
MOMO.COM INC	6,600	636.000	4,197,600.000	
GLOBALWAFERS CO LTD	23,884	463.000	11,058,292.000	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	20,508	275.500	5,649,954.000	
台湾・ドル 小計	35,283,319		2,926,155,227.250 (13,066,160,936)	
南アフリカ・ラ ンド				
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,125	294.260	2,979,382.500	
BIDVEST GROUP LTD	28,428	220.750	6,275,481.000	

CLICKS GROUP LTD	24,148	289.220	6,984,084.560	
DISCOVERY LTD	49,614	122.830	6,094,087.620	
GOLD FIELDS LTD	93,534	192.560	18,010,907.040	
REMGRO LTD	51,843	137.340	7,120,117.620	
THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	101.770	3,357,494.070	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	60,894	61.410	3,739,500.540	
EXXARO RESOURCES LTD	24,734	225.350	5,573,806.900	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	9,162	1,900.000	17,407,800.000	
MTN GROUP LTD	177,991	130.700	23,263,423.700	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,096	326.300	14,388,524.800	
FIRSTRAND LTD	522,554	60.870	31,807,861.980	
NASPERS LTD	22,681	2,797.050	63,439,891.050	
NEDBANK GROUP LTD	48,729	211.700	10,315,929.300	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,182	1,589.560	8,237,099.920	
SASOL LTD	59,453	271.010	16,112,357.530	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	52,979	238.000	12,609,002.000	
MR PRICE GROUP LTD	25,493	163.850	4,177,028.050	
STANDARD BANK GROUP LTD	139,650	169.550	23,677,657.500	
SPAR GROUP LTD/THE	21,004	137.000	2,877,548.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	99,816	67.960	6,783,495.360	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	140.950	5,435,454.850	
ABSA GROUP LTD	88,937	195.140	17,355,166.180	
SANLAM LTD	189,923	48.370	9,186,575.510	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	90,076	214.060	19,281,668.560	
KUMBA IRON ORE LTD	7,079	507.450	3,592,238.550	
VODACOM GROUP PTY LTD	69,076	129.200	8,924,619.200	
NEPI ROCKCASTLE NV	43,623	104.280	4,549,006.440	
OLD MUTUAL LTD	479,238	10.160	4,869,058.080	
REINET INVESTMENTS SCA	13,711	330.000	4,524,630.000	
PEPKOR HOLDINGS LTD	166,142	20.470	3,400,926.740	
MULTICHOICE GROUP LTD	37,859	117.590	4,451,839.810	
SIBANYE STILLWATER LTD	305,993	49.260	15,073,215.180	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	34,041	190.660	6,490,257.060	
BID CORP LTD	35,633	342.260	12,195,750.580	
南アフリカ・ランド 小計	3,204,995		414,562,887.780 (3,258,464,298)	
合計	572,652,685		91,102,181,841 (91,102,181,841)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	126,200.000	2,883,670.000	

		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,027,900.000	
		ENERGISA SA	24,300.000	1,015,983.000	
		KLABIN SA	78,200.000	1,650,802.000	
	ブラジル・リアル	小計	266,700.000	6,578,355.000 (171,423,379)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,625,775.000	13,542,705.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	52,300.000	6,794,816.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	203,700.000	31,404,429.000	
		GRUPO TELEVISIA SAB	246,900.000	4,831,833.000	
	メキシコ・ペソ	小計	2,128,675.000	56,573,783.750 (391,269,946)	
投資信託受益証券 合計			2,395,375	562,693,325 (562,693,325)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	303,700.000	7,267,541.000	
	メキシコ・ペソ	小計	303,700.000	7,267,541.000 (50,263,040)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	380,859.000	5,278,705.740	
	南アフリカ・ランド	小計	380,859.000	5,278,705.740 (41,490,627)	
投資証券 合計			684,559	91,753,667 (91,753,667)	
合計				654,446,992 (654,446,992)	

(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 49銘柄	2.66	-	-	3.01
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 11銘柄	1.18	-	-	1.34
インド・ルピー	株式 113銘柄	12.94	-	-	14.64
インドネシア・ルピア	株式 22銘柄	1.64	-	-	1.86
オフショア・人民元	株式 469銘柄	4.56	-	-	5.16
カタール・リアル	株式 12銘柄	0.91	-	-	1.03
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.83	-	-	0.94
コロンビア・ペソ	株式 3銘柄	0.10	-	-	0.11
サウジアラビア・リアル	株式 40銘柄	3.44	-	-	3.89

タイ・パーツ	株式	42銘柄	1.85	-	-	2.09
チェコ・コルナ	株式	3銘柄	0.12	-	-	0.13
チリ・ペソ	株式	12銘柄	0.50	-	-	0.56
トルコ・リラ	株式	15銘柄	0.53	-	-	0.60
ハンガリー・フォリント	株式	3銘柄	0.15	-	-	0.17
フィリピン・ペソ	株式	17銘柄	0.65	-	-	0.73
ブラジル・レアル	株式	45銘柄	4.34	-	-	5.09
	投資信託受益証券	4銘柄	-	0.17	-	
ポーランド・ズロチ	株式	14銘柄	0.60	-	-	0.67
マレーシア・リンギット	株式	34銘柄	1.33	-	-	1.51
メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.61	-	-	2.30
	投資信託受益証券	4銘柄	-	0.38	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	0.05	
ユーロ	株式	10銘柄	0.27	-	-	0.31
韓国・ウォン	株式	102銘柄	10.18	-	-	11.51
香港・ドル	株式	193銘柄	21.67	-	-	24.51
台湾・ドル	株式	88銘柄	12.59	-	-	14.24
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.14	-	-	3.60
	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12月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,744,508,293
コール・ローン	347,543,111
国債証券	128,868,479,909
未収利息	1,102,007,512
前払費用	434,193,811
流動資産合計	132,496,732,636
資産合計	132,496,732,636
負債の部	
流動負債	
未払金	943,354,069
未払解約金	1,163,000
流動負債合計	944,517,069
負債合計	944,517,069
純資産の部	
元本等	
元本	64,316,633,021
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,235,582,546
元本等合計	131,552,215,567
純資産合計	131,552,215,567
負債純資産合計	132,496,732,636

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6月14日 至 2022年12月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年12月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	71,376,492,707円
同期中追加設定元本額	49,668,286,168円
同期中一部解約元本額	56,728,145,854円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	107,444,046円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,318,751,556円
たわらノーロード バランス（堅実型）	166,469,360円
たわらノーロード バランス（標準型）	469,791,208円
たわらノーロード バランス（積極型）	200,496,992円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	869,752円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,730,118円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	40,953,227円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,590,895円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	4,811,680円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,598,674円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	247,766,761円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	383,076,974円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	707,944,057円
投資のソムリエ	19,971,309,735円
クルーズコントロール	395,266,666円
投資のソムリエ<DC年金>	1,412,476,915円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	290,088,639円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,426,862,147円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	6,363,430,614円
ワールドアセットバランス（基本コース）	436,492,144円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	208,997,439円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	57,927,393円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	29,361,088円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	9,895,735円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	214,713,860円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	495,792,023円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	224,682,879円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	75,087,327円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	30,243,801円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	19,442,951円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,743,243円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	22,477,005,942円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	515,088,109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)	1,176,021,360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)	338,861,201円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	10,553,650円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	16,956,751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)	7,554,901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)	156,200,001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)	70,885,381円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,169,395,826円
計	64,316,633,021円
2. 受益権の総数	64,316,633,021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6月14日 至 2022年12月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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12月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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12月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	2,419,486,488	
合計	2,419,486,488	

(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12月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年12月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,045円 (20,454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12月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	3,000,000.000	2,910,087.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	8,000,000.000	7,110,400.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	7,000,000.000	5,923,323.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	7,000,000.000	5,932,360.000	

ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	9,000,000.000	8,647,902.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	11,000,000.000	10,554,500.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	10,000,000.000	9,136,400.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	2,000,000.000	1,298,680.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	10,000,000.000	9,459,720.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	10,000,000.000	7,699,400.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	9,000,000.000	7,860,006.000	
BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,560,637.730	
BRAZIL 3.75 09/12/31	6,000,000.000	5,217,180.540	
BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,571,862.510	
BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	7,535,200.000	
BRAZIL 4.625 01/13/28	3,000,000.000	2,924,135.280	
BRAZIL 4.75 01/14/50	15,000,000.000	11,242,802.850	
BRAZIL 5.625 01/07/41	2,100,000.000	1,874,959.730	
BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	5,005,064.440	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,669,679.960	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,629,327.440	
CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	954,750.000	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	5,425,554.540	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	11,000,000.000	8,305,891.550	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	6,622,990.290	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	3,092,047.800	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	4,708,350.400	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	8,000,000.000	7,036,523.360	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	11,000,000.000	7,709,900.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	2,000,000.000	1,504,196.980	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	20,000,000.000	18,525,631.000	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	19,000,000.000	14,285,943.820	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	25,200,000.000	22,948,083.140	
HUNGARY 2.125 09/22/31	14,000,000.000	10,745,378.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	12,000,000.000	7,530,600.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	8,000,000.000	7,791,782.320	
HUNGARY 5.375 03/25/24	4,380,000.000	4,388,278.200	
HUNGARY 7.625 03/29/41	2,400,000.000	2,673,206.400	
INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,632,593.630	
INDONESIA 2.85 02/14/30	2,000,000.000	1,825,304.160	

INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,725,117.250	
INDONESIA 3.4 09/18/29	2,200,000.000	2,057,321.590	
INDONESIA 3.5 01/11/28	4,200,000.000	4,043,128.820	
INDONESIA 3.85 10/15/30	6,400,000.000	6,145,177.470	
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	2,945,988.120	
INDONESIA 4.125 01/15/25	3,200,000.000	3,180,936.800	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	6,020,234.780	
INDONESIA 4.35 01/08/27	4,600,000.000	4,589,037.230	
INDONESIA 4.35 01/11/48	9,600,000.000	8,521,072.890	
INDONESIA 4.75 01/08/26	2,000,000.000	2,011,310.600	
INDONESIA 5.25 01/17/42	2,500,000.000	2,525,590.820	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	4,304,204.800	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	10,000,000.000	9,899,000.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	10,000,000.000	10,095,710.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	9,000,000.000	9,132,840.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.75 01/17/48	7,000,000.000	6,682,200.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	14,000,000.000	10,793,839.700	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	7,063,200.000	
PANAMA 3.87 07/23/60	13,000,000.000	9,034,051.390	
PANAMA 4.5 01/19/63	5,000,000.000	3,818,642.700	
PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	8,568,693.760	
PANAMA 4.5 04/16/50	10,300,000.000	8,252,351.550	
PANAMA 6.4 02/14/35	6,000,000.000	6,363,280.740	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,068,943.020	
PERU 2.392 01/23/26	2,000,000.000	1,873,845.900	
PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	5,130,664.160	
PERU 2.783 01/23/31	16,000,000.000	13,806,844.480	
PERU 3.0 01/15/34	14,000,000.000	11,737,693.940	
PERU 3.55 03/10/51	8,000,000.000	6,191,074.320	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	3,600,000.000	2,916,683.530	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	3,800,000.000	3,344,578.010	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	7,000,000.000	4,949,862.260	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	9,426,433.200	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	5,355,819.630	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	3,000,000.000	2,529,300.000	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	7,200,000.000	6,985,061.060	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	6,200,000.000	5,321,389.190	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	6,116,562.640	

REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	8,000,000.000	6,532,185.520	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	9,200,000.000	8,605,482.560	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	5,000,000.000	3,406,294.000	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	12,000,000.000	9,143,990.160	
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	6,600,000.000	6,242,699.030	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	6,000,000.000	4,660,687.740	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	7,200,000.000	6,375,183.550	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	3,057,118.600	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	9,000,000.000	8,020,151.280	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	14,000,000.000	14,083,360.900	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	13,000,000.000	12,975,804.400	
ROMANIA 3.0 02/14/31	5,000,000.000	4,074,320.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	10,000,000.000	6,960,280.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	3,826,298.400	
ROMANIA 6.125 01/22/44	6,600,000.000	6,277,537.200	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	8,000,000.000	6,635,336.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	9,000,000.000	8,633,700.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	13,200,000.000	12,243,554.400	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	2,981,560.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	6,400,000.000	5,209,574.400	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	13,000,000.000	12,851,800.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	17,000,000.000	16,988,168.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	12,000,000.000	12,052,932.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	5,000,000.000	4,579,715.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	9,000,000.000	8,737,290.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	7,000,000.000	7,059,150.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	7,000,000.000	7,462,140.000	

SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	10,806,456.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	2,400,000.000	2,344,776.000	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	17,000,000.000	12,778,050.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	4,000,000.000	3,763,588.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	12,000,000.000	10,543,824.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	6,000,000.000	5,893,800.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,814,150.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	11,000,000.000	10,758,000.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	12,000,000.000	11,958,132.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	13,000,000.000	12,283,700.000	
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	11,000,000.000	11,216,150.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	15,000,000.000	15,094,620.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	18,000,000.000	18,657,000.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	6,000,000.000	4,558,200.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,991,035.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	9,000,000.000	7,590,433.140	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,440,709.340	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	9,000,000.000	7,625,792.160	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	5,200,000.000	5,023,881.090	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,807,765.690	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	6,000,000.000	4,178,123.640	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,583,981.810	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	3,400,000.000	3,372,485.290	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	11,000,000.000	9,092,609.020	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	7,000,000.000	5,588,216.060	

	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	4,000,000.000	3,289,937.480	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	9,000,000.000	8,868,243.060	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	2,000,000.000	1,680,265.800	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	1,400,000.000	1,166,770.020	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	8,000,000.000	7,818,632.480	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,783,209.860	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	5,249,406.780	
	アメリカ・ドル 小計	1,067,380,000.000 (145,974,888,800)	942,296,577.280 (128,868,479,909)	
国債証券 合計		145,974,888,800 (145,974,888,800)	128,868,479,909 (128,868,479,909)	
合計			128,868,479,909 (128,868,479,909)	

(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 137銘柄	97.96	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ワールドアセットバランス（基本コース）

2022年12月30日現在

資産総額	5,959,024,903円
負債総額	5,306,768円
純資産総額（ - ）	5,953,718,135円
発行済数量	6,330,074,280口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9405円

ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）

2022年12月30日現在

資産総額	19,915,691,851円
負債総額	35,379,461円
純資産総額（ - ）	19,880,312,390円
発行済数量	20,390,294,120口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9750円

（参考）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産総額	780,433,978,095円
負債総額	477,245,110円
純資産総額（ - ）	779,956,732,985円
発行済数量	135,123,174,874口
1口当たり純資産額（ / ）	5.7722円

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産総額	243,597,056,144円
負債総額	204,096,387円
純資産総額（ - ）	243,392,959,757円
発行済数量	203,355,109,730口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1969円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産総額	62,215,171,949円
負債総額	486,743,489円
純資産総額（ - ）	61,728,428,460円
発行済数量	39,413,969,934口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5662円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産総額	98,934,379,524円
負債総額	20,470,914円
純資産総額（ - ）	98,913,908,610円
発行済数量	74,231,264,627口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3325円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2022年12月30日現在

資産総額	121,790,080,260円
負債総額	132,620,380円
純資産総額(-)	121,657,459,880円
発行済数量	62,602,151,740口
1口当たり純資産額(/)	1.9433円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2022年12月30日現在）

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構（2022年12月30日現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2022年12月30日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,424,902,194,914
追加型株式投資信託	798	14,074,219,849,558
単位型公社債投資信託	25	45,982,861,355
単位型株式投資信託	214	1,116,655,615,180
合計	1,063	16,661,760,521,007

3【委託会社等の経理状況】

- 1．委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社(以下「委託会社」という。)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
- 2．財務諸表及び中間財務諸表の金額は、百万円未満の端数を切り捨てて記載しております。
- 3．委託会社は、第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、第38期中間会計期間(自2022年4月1日至2022年9月30日)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	36,734	31,421
金銭の信託	25,670	30,332
未収委託者報酬	16,804	17,567
未収運用受託報酬	5,814	4,348
未収投資助言報酬	317	309
未収収益	7	5
前払費用	724	1,167
その他	2,419	2,673
流動資産計	88,493	87,826
固定資産		
有形固定資産	1,119	1,268
建物	1 915	1 1,109
器具備品	1 202	1 158
建設仮勘定	0	-
無形固定資産	3,991	4,561
ソフトウェア	2,878	3,107
ソフトウェア仮勘定	1,109	1,449
電話加入権	3	3
投資その他の資産	11,153	10,153
投資有価証券	261	241
関係会社株式	5,299	5,349
長期差入保証金	1,324	1,102
繰延税金資産	3,676	3,092
その他	591	367
固定資産計	16,264	15,983
資産合計	104,757	103,810

(単位:百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	3,730	1,445
未払金	7,337	7,616
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	9
未払手数料	6,889	7,430
その他未払金	437	175
未払費用	9,713	8,501
未払法人税等	4,199	2,683
未払消費税等	2,106	1,330
賞与引当金	1,789	1,933
役員賞与引当金	76	69
流動負債計	28,954	23,581
固定負債		
退職給付引当金	2,292	2,507
時効後支払損引当金	157	147
固定負債計	2,450	2,655
負債合計	31,404	26,236
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000	2,000
資本剰余金	19,552	19,552
資本準備金	2,428	2,428
その他資本剰余金	17,124	17,124
利益剰余金	51,800	56,020
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	51,676	55,896
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	19,996	24,216
株主資本計	73,353	77,573
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	0
評価・換算差額等計	0	0
純資産合計	73,353	77,573
負債・純資産合計	104,757	103,810

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	89,905		108,563	
運用受託報酬	17,640		16,716	
投資助言報酬	1,103		1,587	
その他営業収益	781		12	
営業収益計		109,430		126,879
営業費用				
支払手数料	37,003		45,172	
広告宣伝費	424		391	
公告費	0		0	
調査費	30,794		36,488	
調査費	11,302		10,963	
委託調査費	19,491		25,525	
委託計算費	543		557	
営業雑経費	938		842	
通信費	46		35	
印刷費	680		606	
協会費	71		66	
諸会費	23		26	
支払販売手数料	116		106	
営業費用計		69,704		83,453
一般管理費				
給料	10,586		10,377	
役員報酬	163		168	
給料・手当	9,030		8,995	
賞与	1,392		1,213	
交際費	8		6	
寄付金	7		15	
旅費交通費	50		40	
租税公課	912		367	
不動産賃借料	1,499		1,674	
退職給付費用	524		495	
固定資産減価償却費	1,078		1,389	
福利厚生費	44		42	
修繕費	0		0	
賞与引当金繰入額	1,789		1,933	
役員賞与引当金繰入額	76		69	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,793		3,901	
事務用消耗品費	68		45	
器具備品費	0		0	
諸経費	152		217	
一般管理費計		20,594		20,578
営業利益		19,132		22,848

(単位:百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)		第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
営業外収益				
受取利息	27		13	
受取配当金	2		1	559
時効成立分配金・償還金	0			0
為替差益	7			7
金銭の信託運用益	1,229			-
雑収入	13			19
時効後支払損引当金戻入額	13			10
営業外収益計		1,293		610
営業外費用				
投資信託償還損	0			-
金銭の信託運用損	-			743
早期割増退職金	48			20
雑損失	0			-
営業外費用計		48		764
経常利益		20,376		22,694
特別利益				
固定資産売却益	-			0
特別利益計		-		0
特別損失				
固定資産除却損	1			5
投資有価証券売却損	-			6
ゴルフ会員権売却損	-			3
オフィス再編費用	-		2	509
特別損失計		1		525
税引前当期純利益		20,375		22,169
法人税、住民税及び事業税		7,418		6,085
法人税等調整額		1,168		584
法人税等合計		6,249		6,669
当期純利益		14,125		15,499

(3) 【株主資本等変動計算書】

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:百万円)

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

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	71,227
当期変動額			
剰余金の配当			12,000
当期純利益			14,125
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	2,125
当期末残高	0	0	73,353

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計		別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	19,996	51,800	73,353
当期変動額									
剰余金の配当							11,280	11,280	11,280
当期純利益							15,499	15,499	15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	4,219	4,219	4,219
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216	56,020	77,573

	評価・換算差額等		純資産 合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	73,353
当期変動額			
剰余金の配当			11,280
当期純利益			15,499
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	0	0	0
当期変動額合計	0	0	4,219
当期末残高	0	0	77,573

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 … 8～18年 器具備品 … 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

6. 収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき、日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は4回受取ります。当該報酬は期間の経過とともに履行義務が充足されるという前提に基づき、顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

(会計上の見積りの変更)

第37期

(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

当社は、当事業年度において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万円減少しております。

(会計方針の変更)

1. 収益認識に関する会計基準等の適用

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下「収益認識会計基準」という。)等を当会計期間の期首から適用し、約束した財又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等の適用

「時価の算定に関する会計基準」(企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。)等を当会計期間の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)第44-2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することといたしました。当該会計方針の変更による影響はありません。

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

(未適用の会計基準等)

・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(会計基準適用指針第31号 2021年6月17日)

(1) 概要

投資信託の時価の算定及び注記に関する取扱い並びに貸借対照表に持分法相当額を純額で計上する組合等への出資の時価の注記に関する取扱いが定められました。

(2) 適用予定日

当社は、当該会計基準等を2022年4月1日に開始する事業年度の期首から適用する予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1. 有形固定資産の減価償却累計額

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
建物	407	415
器具備品	978	966

(損益計算書関係)

1. 各科目に含まれている関係会社に対する営業外収益は、次のとおりであります。

(百万円)

	第36期 (自2020年4月1日 至2021年3月31日)	第37期 (自2021年4月1日 至2022年3月31日)
受取配当金	-	543

2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

(株主資本等変動計算書関係)

第36期(自2020年4月1日至2021年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2020年6月17日 定時株主総会	普通株式	12,000	300,000	2020年3月31日	2020年6月18日
	A種種類 株式				

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

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種 類株式					

第37期(自2021年4月1日至2022年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2021年6月16日 定時株主総会	普通株式	11,280	282,000	2021年3月31日	2021年6月17日
	A種種類 株式				

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

2022年6月16日開催予定の定時株主総会において、以下のとおり決議を予定しております。

決議	株式の 種類	配当の 原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通 株式	利益 剰余金	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種 類株式					

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

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

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

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

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

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

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

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

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期(2021年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	25,670	25,670	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	25,672	25,672	-

第37期(2022年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	30,332	30,332	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	30,334	30,334	-

(注1) 現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬及び未払手数料は、短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、注記を省略しております。

(注2) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期(2021年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	36,734	-	-	-
(2) 金銭の信託	25,670	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,804	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	5,814	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	85,024	1	-	-

第37期(2022年3月31日現在)

	1年以内 (百万円)	1年超5年以内 (百万円)	5年超10年以内 (百万円)	10年超 (百万円)
(1) 現金・預金	31,421	-	-	-
(2) 金銭の信託	30,332	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	17,567	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	4,348	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	83,670	1	-	-

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
(1) 金銭の信託	-	6,932	-	6,932
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）第26項に従い、経過措置を適用した投資信託は上表には含めておりません。貸借対照表における当該投資信託の金額は、金銭の信託23,399百万円、投資有価証券1百万円となります。

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）第5項に従い、2. 金融商品の時価等に関する事項及び3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

（百万円）

	第36期 （2021年3月31日現在）	第37期 （2022年3月31日現在）
投資有価証券（その他有価証券）		
非上場株式	259	239
関係会社株式		
非上場株式	5,299	5,349

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(第36期の貸借対照表計上額5,299百万円、第37期の貸借対照表計上額5,349百万円)については市場価格がないことから、貸借対照表日における時価及び貸借対照表計上額と当該時価との差額の記載は省略しております。

2. その他有価証券

第36期(2021年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額259百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

第37期(2022年3月31日現在)

(百万円)

区分	貸借対照表日における 貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

(注)非上場株式(貸借対照表計上額239百万円)については、市場価格がないことから、上表に含めておりません。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
投資信託	0	-	0

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

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

区分	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
株式	13	-	6

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,422	2,479
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	4	14
退職給付の支払額	245	185
過去勤務費用の発生額	1	-
その他	1	-
退職給付債務の期末残高	2,479	2,576

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

(百万円)

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,479	2,576
未積立退職給付債務	2,479	2,576
未認識数理計算上の差異	84	35
未認識過去勤務費用	102	33
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507
退職給付引当金	2,292	2,507
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,292	2,507

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
勤務費用	303	295
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	41	34
過去勤務費用の費用処理額	69	69
その他	7	3
確定給付制度に係る退職給付費用	409	398

(注) 上記退職給付費用以外に早期割増退職金として、前事業年度において48百万円、当事業年度において20百万円を営業外費用に計上しております。

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
割引率	0.09%	0.09%
予想昇給率	1.00% ~ 3.76%	1.00% ~ 3.76%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度100百万円、当事業年度97百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第36期	第37期
	(2021年3月31日現在)	(2022年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	260	156
未払事業所税	10	10
賞与引当金	547	592
未払法定福利費	92	92
運用受託報酬	1,410	845
資産除去債務	18	13
減価償却超過額(一括償却資産)	25	12
減価償却超過額	51	58
繰延資産償却超過額(税法上)	301	292
退職給付引当金	701	767
時効後支払損引当金	48	45
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	166
投資有価証券評価損	28	28
その他	3	2
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産小計	3,676	3,092
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	3,676	3,092
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	-
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,676	3,092

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

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	MHAMの普通株式	144,212百万円
取得原価		144,212百万円

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん	金額	76,224百万円
b. 発生原因		被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。
c. のれんの償却方法及び償却期間		20年間の均等償却

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額	資産合計	40,451百万円
	うち現金・預金	11,605百万円
	うち金銭の信託	11,792百万円
b. 負債の額	負債合計	9,256百万円
	うち未払手数料及び未払費用	4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額	53,030百万円
b. 主要な種類別の内訳	
顧客関連資産	53,030百万円
c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間	
顧客関連資産	16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第36期 (2021年3月31日現在)	第37期 (2022年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	84,609百万円	76,763百万円
資産合計	84,609百万円	76,763百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	5,570百万円	4,740百万円
負債合計	5,570百万円	4,740百万円
純資産	79,038百万円	72,022百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれん及び顧客関連資産の金額が含まれております。

のれん	59,074百万円	55,263百万円
顧客関連資産	29,793百万円	25,175百万円

(2) 損益計算書項目

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,823百万円	8,429百万円
経常利益	8,823百万円	8,429百万円
税引前当期純利益	8,823百万円	8,429百万円
当期純利益	7,288百万円	7,015百万円
1株当たり当期純利益	182,220円85銭	175,380円68銭
(注) 営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。		
のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	
委託者報酬	108,259百万円
運用受託報酬	14,425百万円
投資助言報酬	1,587百万円
成功報酬(注)	2,594百万円
その他営業収益	12百万円
合計	126,879百万円

(注) 成功報酬は、損益計算書において委託者報酬及び運用受託報酬に含めて表示しております。

2. 収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は「重要な会計方針 6. 収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

1. セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)及び第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

(1) サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び法人主要株主等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(2) 子会社及び関連会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当はありません。

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

第36期(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の 関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	6,435	未払 手数料	1,457
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	12,767	未払 手数料	2,524

第37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

属性	会社等の名称	住所	資本金 又は 出資金	事業の 内容又 は職業	議決権 等の所 有(被 所有) 割合	関係内容		取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
						役員 の兼 任等	事業 上 の 関 係				
親 会 社 の 子 会 社	株式会社 みずほ銀 行	東京都 千代田 区	14,040 億円	銀行業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	7,789	未払 手数料	1,592
	みずほ証 券株式会 社	東京都 千代田 区	1,251 億円	証券業	-	-	当社設定 投資信託 の販売	投資信託の 販売代行手 数料	16,373	未払 手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

(1株当たり情報)

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
1株当たり純資産額	1,833,828円44銭	1,939,327円79銭
1株当たり当期純利益金額	353,145円08銭	387,499円36銭

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

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

	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)
当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る当期純利益金額	14,125百万円	15,499百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

(1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		27,934
金銭の信託		29,712
未収委託者報酬		17,398
未収運用受託報酬		3,150
未収投資助言報酬		291
未収収益		16
前払費用		939
その他		2,564
	流動資産計	82,009
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	1,055
器具備品	1	138
リース資産	1	8
無形固定資産		
ソフトウェア		3,151
ソフトウェア仮勘定		1,794
電話加入権		2
投資その他の資産		
投資有価証券		182
関係会社株式		5,810
長期差入保証金		779
繰延税金資産		2,962
その他		411
	固定資産計	16,298
資産合計		98,307

(単位:百万円)

	第38期中間会計期間末 (2022年9月30日現在)
(負債の部)	
流動負債	
預り金	959
リース債務	1
未払金	7,709
未払収益分配金	0
未払手数料	7,486
その他未払金	221
未払費用	9,245
未払法人税等	2,605
未払消費税等	719
契約負債	20
賞与引当金	866
役員賞与引当金	26
流動負債計	22,155
固定負債	
リース債務	7
退職給付引当金	2,600
時効後支払損引当金	108
固定負債計	2,716
負債合計	24,871
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	19,552
資本準備金	2,428
その他資本剰余金	17,124
利益剰余金	51,882
利益準備金	123
その他利益剰余金	51,759
別途積立金	31,680
繰越利益剰余金	20,079
株主資本計	73,435
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	0
評価・換算差額等計	0
純資産合計	73,435
負債・純資産合計	98,307

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬	48,925	
運用受託報酬	7,371	
投資助言報酬	1,029	
その他営業収益	11	
		営業収益計 57,336
営業費用		
支払手数料	20,939	
広告宣伝費	102	
公告費	0	
調査費	16,544	
調査費	5,756	
委託調査費	10,787	
委託計算費	277	
営業雑経費	371	
通信費	17	
印刷費	249	
協会費	34	
諸会費	20	
支払販売手数料	49	
		営業費用計 38,235
一般管理費		
給料	4,691	
役員報酬	81	
給料・手当	4,561	
賞与	49	
交際費	4	
寄付金	4	
旅費交通費	48	
租税公課	243	
不動産賃借料	504	
退職給付費用	235	
固定資産減価償却費	1 655	
福利厚生費	26	
修繕費	0	
賞与引当金繰入額	866	
役員賞与引当金繰入額	26	
機器リース料	0	
事務委託費	2,103	
事務用消耗品費	18	
器具備品費	0	
諸経費	159	
		一般管理費計 9,590
営業利益		9,510

（単位：百万円）

	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）	
営業外収益		
受取利息	6	
受取配当金	2,400	
時効成立分配金・償還金	0	
時効後支払損引当金戻入額	25	
為替差益	28	
雑収入	2	
		営業外収益計 2,463
営業外費用		
金銭の信託運用損	530	
早期割増退職金	3	
雑損失	28	
		営業外費用計 561
経常利益		11,411
特別利益		
投資有価証券売却益	4	
		特別利益計 4
特別損失		
固定資産除却損	12	
投資有価証券売却損	9	
関係会社株式評価損	584	
		特別損失計 605
税引前中間純利益		10,809
法人税、住民税及び事業税		2,457
法人税等調整額		129
法人税等合計		2,587
中間純利益		8,222

(3) 中間株主資本等変動計算書

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本						
	資本金	資本剰余金			利益剰余金		
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余金 合計	利益 準備金	その他利益剰余金	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	24,216
当中間期変動額							
剰余金の配当							12,360
中間純利益							8,222
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)							
当中間期変動額 合計	-	-	-	-	-	-	4,137
当中間期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	20,079

	株主資本		評価・換算差額等		純資産 合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	56,020	77,573	0	0	77,573
当中間期変動額					
剰余金の配当	12,360	12,360			12,360
中間純利益	8,222	8,222			8,222
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)		-	0	0	0
当中間期変動額 合計	4,137	4,137	0	0	4,137
当中間期末残高	51,882	73,435	0	0	73,435

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。 ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金は、従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金は、役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当中間会計期間に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。</p> <p>数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金は、時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
6. 重要な収益及び費用の計上基準	<p>当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年2回又は4回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。</p> <p>(4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。</p>
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

（会計方針の変更）

「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 2021年6月17日。以下「時価算定会計基準適用指針」という。）を当中間期間の期首から適用し、時価算定会計基準適用指針第27 - 2項に定める経過的な取り扱いに従って、時価算定会計基準適用指針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しております。なお、当該適用指針の適用に伴う、当中間財務諸表への影響はありません。

注記事項

（中間貸借対照表関係）

項目	第38期中間会計期間末 （2022年9月30日現在）		
1.有形固定資産の減価償却累計額	建物	...	469百万円
	器具備品	...	975百万円
	リース資産	...	0百万円

（中間損益計算書関係）

項目	第38期中間会計期間 （自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）		
1.減価償却実施額	有形固定資産	...	74百万円
	無形固定資産	...	580百万円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第38期中間会計期間（自 2022年4月1日 至 2022年9月30日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2.配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の 種類	配当金の 総額 （百万円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類 株式				

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

(金融商品関係)

第38期中間会計期間末(2022年9月30日現在)

1.金融商品の時価等に関する事項

2022年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

	中間貸借対照表計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
(1) 金銭の信託	29,712	29,712	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,714	29,714	-

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

2.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

区分	時価(百万円)			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託	-	29,712	-	29,712
投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,714	-	29,714

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

信託財産を構成する金融商品の時価について、投資信託は基準価額、デリバティブ取引は、取引相手先金融機関より提示された価格によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

これらについては、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号2020年3月31日)第5項に従い、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項で開示している表中には含めておりません。

区分	中間貸借対照表計上額 (百万円)
投資有価証券（その他有価証券）	
非上場株式	180
関係会社株式	
非上場株式	5,810

（有価証券関係）

第38期中間会計期間末

（2022年9月30日現在）

1. 子会社株式

関係会社株式（中間貸借対照表計上額5,810百万円）で市場価格のあるものはありません。

2. その他有価証券

区 分	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの 投資信託	-	-	-
小計	-	-	-
中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの 投資信託	1	2	0
小計	1	2	0
合計	1	2	0

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額180百万円）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。

（持分法損益等）

当社は2022年8月1日付でPayPayアセットマネジメント株式会社の株式を取得し持分法適用関連会社としておりますが、重要性が乏しいため、関連会社に対する投資の金額等の記載を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間

2022年4月1日から2022年9月30日まで

(2) 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価 MHAMの普通株式 144,212百万円

取得原価 144,212百万円

(3) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

a. 発生したのれん金額 76,224百万円

b. 発生原因 被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

c. のれんの償却方法及び償却期間 20年間の均等償却

(4) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

a. 資産の額 資産合計 40,451百万円

うち現金・預金 11,605百万円

うち金銭の信託 11,792百万円

b. 負債の額 負債合計 9,256百万円

うち未払手数料及び未払費用 4,539百万円

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

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

a. 無形固定資産に配分された金額 53,030百万円

b. 主要な種類別の内訳

顧客関連資産 53,030百万円

c. 全体及び主要な種類別の加重平均償却期間

顧客関連資産 16.9年

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

流動資産	- 百万円
固定資産	72,873百万円
資産合計	72,873百万円
流動負債	- 百万円
固定負債	4,223百万円
負債合計	4,223百万円
純資産	68,650百万円

(注) 固定資産及び資産合計には、のれんの金額53,357百万円及び顧客関連資産の金額23,061百万円が含まれております。

(2) 損益計算書項目

営業収益	- 百万円
営業利益	4,019百万円
経常利益	4,019百万円
税引前中間純利益	4,019百万円
中間純利益	3,372百万円
1株当たり中間純利益	84,308円98銭

(注) 営業利益には、のれんの償却額1,905百万円及び顧客関連資産の償却額2,114百万円が含まれております。

(資産除去債務関係)

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

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

(収益認識関係)

1. 収益の分解情報

当中間会計期間の収益の構成は次の通りです。

第38期中間会計期間
(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

委託者報酬	48,925百万円
運用受託報酬	7,338百万円
投資助言報酬	1,029百万円
成功報酬(注)	32百万円
その他営業収益	11百万円
合計	57,336百万円

(注) 成功報酬は、中間損益計算書において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. 重要な収益及び費用の計上基準」に記載の通りであります。

(セグメント情報等)

第38期中間会計期間(自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)

1.セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2.関連情報

(1)サービスごとの情報

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(1株当たり情報)

第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,835,889円89銭
1株当たり中間純利益金額	205,562円11銭

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

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期中間会計期間 (自 2022年4月1日 至 2022年9月30日)
中間純利益金額	8,222百万円
普通株主及び普通株主と同等の株主に帰属しない金額	-
普通株式及び普通株式と同等の株式に係る中間純利益金額	8,222百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。
- (3) 通常の見積りの条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- (5) 上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
みずほ信託銀行株式会社	247,369	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(注) 資本金の額は2022年3月末日現在

(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、各ファンドの信託財産の運用指図等について助言を行います。

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2022年9月13日	有価証券報告書
2022年9月13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 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 長谷川 敬
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月10日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（基本コース）の2022年6月14日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（基本コース）の2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2023年2月10日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 丘本 正彦
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2022年6月14日から2022年12月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）の2022年12月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年11月24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 敬指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 稲葉 宏和

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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2022年4月1日から2023年3月31日までの第38期事業年度の中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の2022年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2022年4月1日から2022年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

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

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- ・ 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- ・ 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注1) 上記の中間監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)が別途保管しております。

(注2) XBR Lデータは中間監査の対象には含まれておりません。