【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4月11日提出
【計算期間】	第4期（自　2022年1月12日　至　2023年1月11日）
【ファンド名】	投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０） 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０） 投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
【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　　杉原　規之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【事務連絡者氏名】	酒井　隆
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目８番２号
【電話番号】	03-6774-5100
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①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。

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

＜ファンドの特色＞

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

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

*マザーファンドについては、後掲の「マザーファンドの概要」をご覧ください。

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

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

*一部の外貨建資産の通貨については、委託会社がその通貨との相関が高いと判断する通貨を用いて、円に対する為替ヘッジを行う「代替ヘッジ」を行うことがあります。

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

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

・ターゲットイヤーが異なる3つのファンドから選択できます。

	ターゲット・イヤー2040	ターゲット・イヤー2050	ターゲット・イヤー2060	目標変動リスク
資産育成期	設定日以降 2020年の決算日まで	設定日以降 2030年の決算日まで	設定日以降 2040年の決算日まで	年率6%程度
資産形成期	2020年の決算日翌日以降 2040年の決算日まで	2030年の決算日翌日以降 2050年の決算日まで	2040年の決算日翌日以降 2060年の決算日まで	年率6%程度から年率2%程度へ 月次で逓減
資産安定期	2040年の決算日翌日以降	2050年の決算日翌日以降	2060年の決算日翌日以降	年率2%程度

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

運用プロセス

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

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

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

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

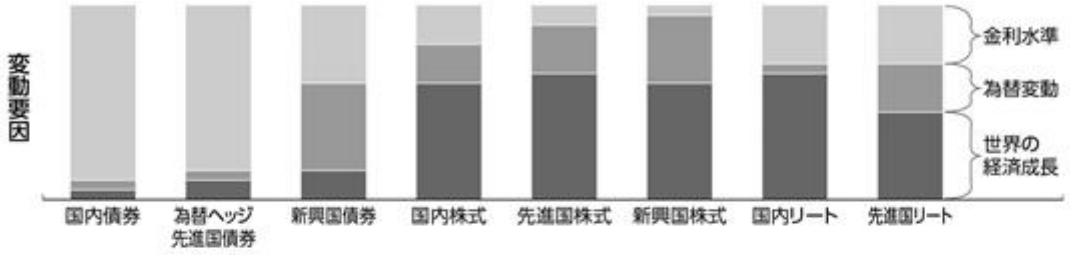
- 機動的配分戦略では、市場リスクの高まりに対し、リスクが比較的低い資産の組入比率を増やす等、機動的に各資産への投資比率（0%～100%）を変更します。
- 機動的配分戦略は日次で行います。

基本配分戦略
(月次戦略)

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

基本配分比率決定のイメージ

変動要因と値動きへの影響度合い(例)



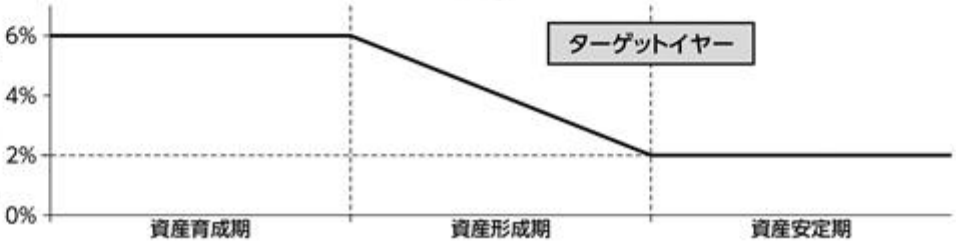
変動要因からファンドが受ける影響を均等に配分

着目する変動要因は各時点において適宜変更します。

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

資産配分のイメージ
(基本配分比率)

目標変動リスク
(年率)の推移



※基本配分比率決定のイメージについては、現金等は考慮しません。
※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。

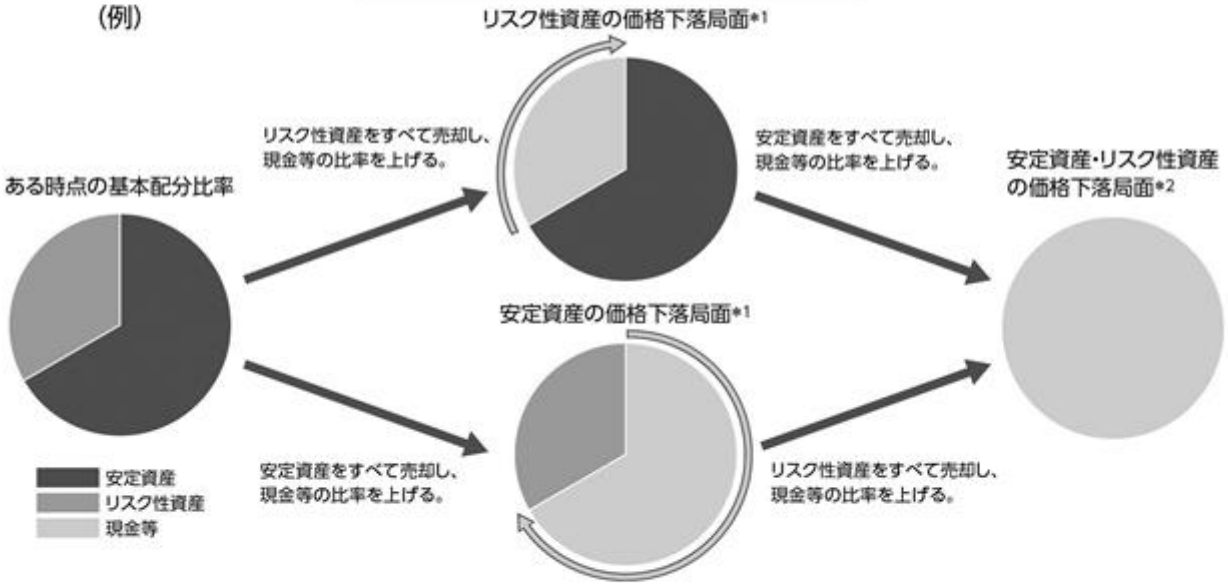
機動的配分戦略
（日次戦略）

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

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

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

価格下落局面における配分比率変更のイメージ

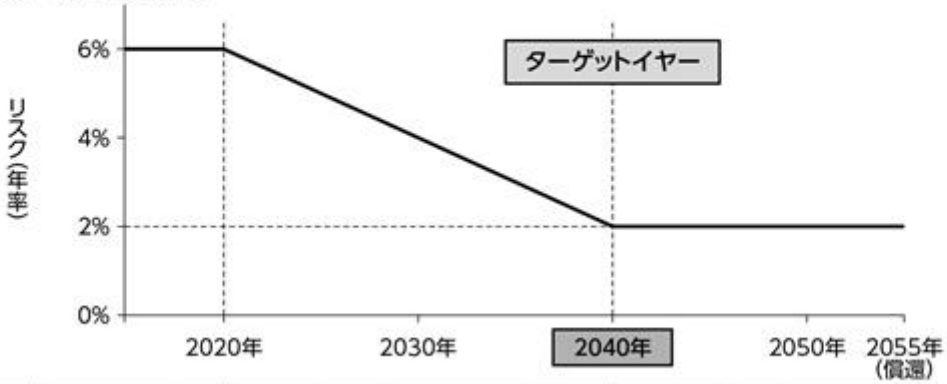


*1 上記は各資産価格の下落の危険性が最も高まった「危機局面」をイメージしたものです。当該局面に至る以前の局面では、リスク状況に応じて各資産を段階的に売却します。
*2 両資産価格についての下落の危険性が最も高まった場合は、速やかにリスク性資産および安定資産をすべて売却し、現金等に入れ替えます。
※相場環境によっては、リスク性資産と安定資産のうち、片方の下落の危険性が高まったとの判定を経ずに、両方の下落の危険性が高まったと判定する場合もあります。
※上記は投資環境および配分比率の一例を示したものであり、すべての要因や変動を説明したものではありません。また、今後の景気や市場の展望を示唆・保証する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

運用期間中のポートフォリオ変化のイメージ

ターゲット・イヤー2040

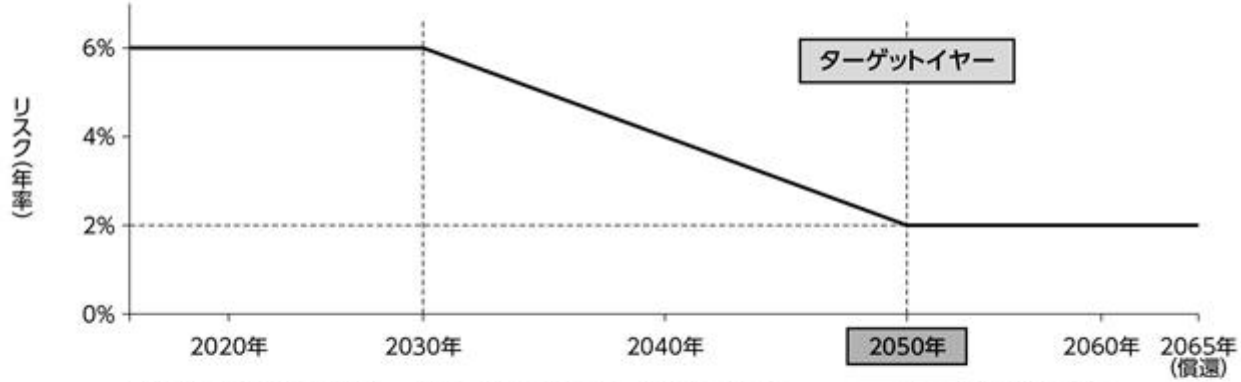
目標変動リスク（年率）の推移



	設定日～2020年決算日	2020年決算日翌日～2040年決算日	2040年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ（基本配分比率）			

ターゲット・イヤー2050

目標変動リスク（年率）の推移

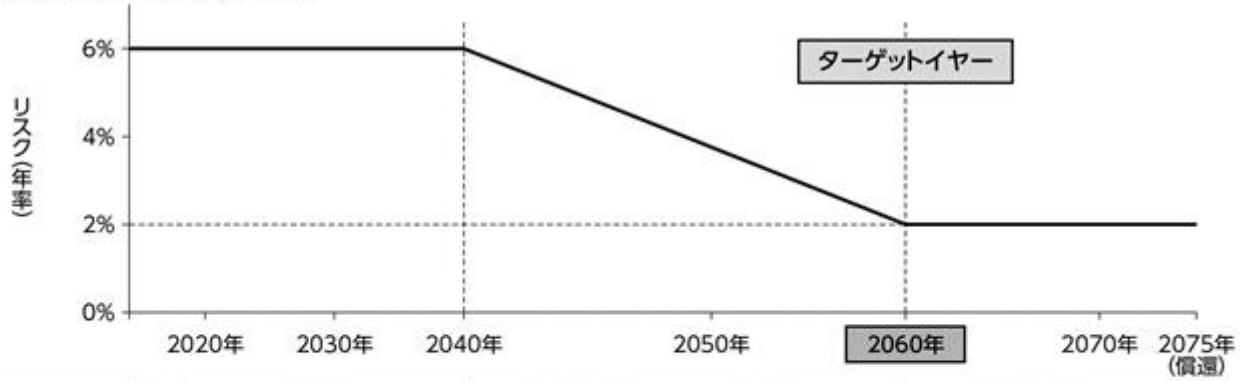


	設定日～2030年決算日	2030年決算日翌日～2050年決算日	2050年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ（基本配分比率）			

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

ターゲット・イヤー2060

目標変動リスク(年率)の推移



	設定日～2040年決算日	2040年決算日翌日～2060年決算日	2060年決算日翌日～
投資局面	資産育成期	資産形成期	資産安定期
運用戦略	基本配分戦略	基本配分戦略	基本配分戦略／機動的配分戦略
基準価額の変動リスクの目標値	年率6%程度	年率6%程度から年率2%程度へ月次で逓減	年率2%程度
資産配分のイメージ(基本配分比率)			

※上記はイメージであり、実際にはこれと異なる場合があります。

■分配方針

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

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

＜商品分類＞

・商品分類表

各ファンド

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

（注）各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・商品分類定義

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

＜属性区分＞

・属性区分表

各ファンド

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

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

（注2）各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

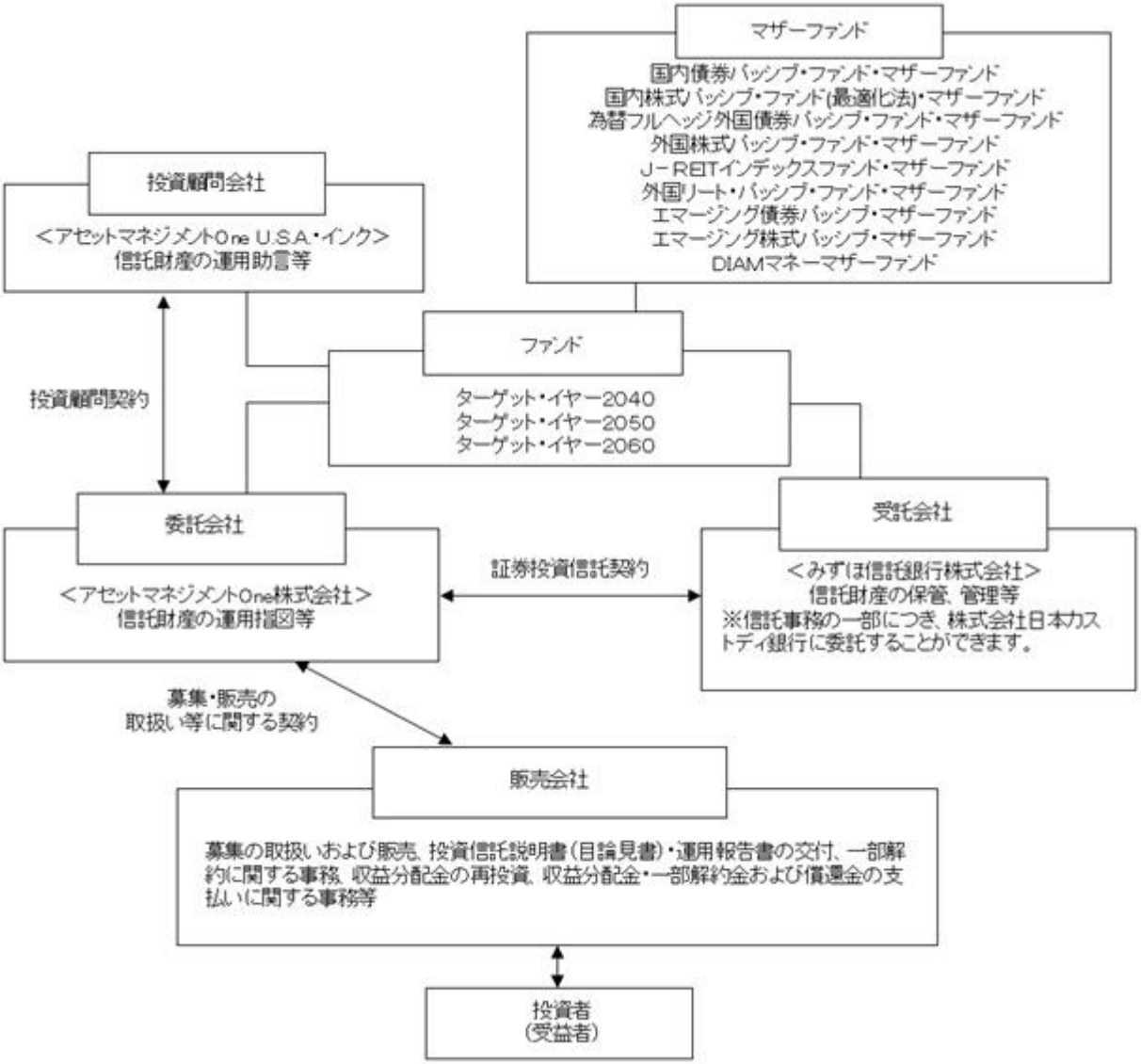
その他資産（投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または投資信託約款において、投資信託証券への投資を通じて、主として複数資産（債券、株式、不動産投信）を実質的な投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。
年１回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
グローバル（日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款におい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

（注1）商品分類および属性区分は、委託会社が目論見書または約款の記載内容等に基づいて分類しています。
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。
（注3）各ファンドはマザーファンド受益証券（投資信託証券）への投資を通じて、債券、株式、不動産投信を主要投資対象とします。したがって、「商品分類」における投資対象資産と、「属性区分」における投資対象資産の分類・区分は異なります。

（２）【ファンドの沿革】

2019年3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。

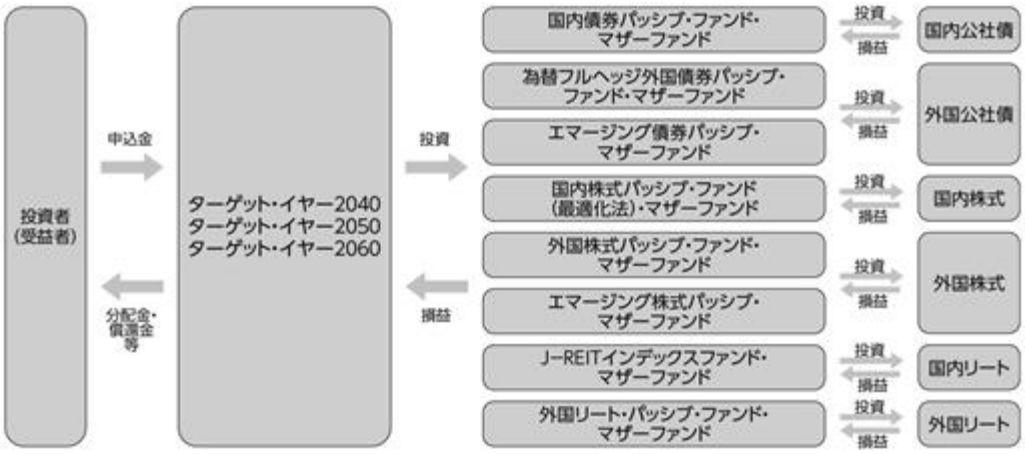
当該契約の内容は、証券投資信託の募集・販売の取扱い、一部解約に関する事務、収益分配金の再投資、収益分配金、一部解約金および償還金の受益者への支払い等に関する包括的な規則を定めたものです。

・「投資顧問契約」の概要

委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne Ｕ.Ｓ.Ａ.・インク）との間においては、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各マザーファンドにて行う仕組みです。



※各ファンドは、有価証券指数等先物取引等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券（ＥＴＦ）、ＤＩＡＭマネーマザーファンドおよび短期金融資産等に直接投資する場合もあります。
※投資対象とする資産については、将来の市況動向等によって見直す場合があります。

○委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社
本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目８番２号

資本金の額
20億円（2023年1月31日現在）

委託会社の沿革

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

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

大株主の状況

（2023年1月31日現在）

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

※1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

＜基本方針＞

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

＜投資対象＞

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

＜投資態度＞

①投資環境の変化を速やかに察知し、中長期的に安定的なリターンをめざします。

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

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

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

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

	ターゲット・イヤー２０４０	ターゲット・イヤー２０５０	ターゲット・イヤー２０６０	目標変動リスク
	期　　間			
資産育成期	設定日以降 2020年の決算日まで	設定日以降 2030年の決算日まで	設定日以降 2040年の決算日まで	年率6%程度
資産形成期	2020年の決算日翌日以降 2040年の決算日まで	2030年の決算日翌日以降 2050年の決算日まで	2040年の決算日翌日以降 2060年の決算日まで	年率6％程度から年率2％程度へ月次で逓減
資産安定期	2040年の決算日翌日以降	2050年の決算日翌日以降	2060年の決算日翌日以降	年率2%程度

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

③資産育成期および資産形成期においては、基本配分戦略に基づき、各資産への投資比率（0%～100%）を決定します。

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

・基本配分戦略は月次で行います。

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

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

・機動的配分戦略は日次で行います。

⑤ファンドの資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

①投資の対象とする資産の種類（約款第16条）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ.有価証券

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

ハ.金銭債権

ニ.約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ.為替手形

②運用の指図範囲等（約款第17条第1項）

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

1．株券または新株引受権証書

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債で

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

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

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

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

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

10.コマーシャル・ペーパー

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

12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの

13.投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

14.投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）

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

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

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

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

19.外国法人が発行する譲渡性預金証書

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

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

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

23.外国の者に対する権利で上記22.の有価証券の性質を有するもの

なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

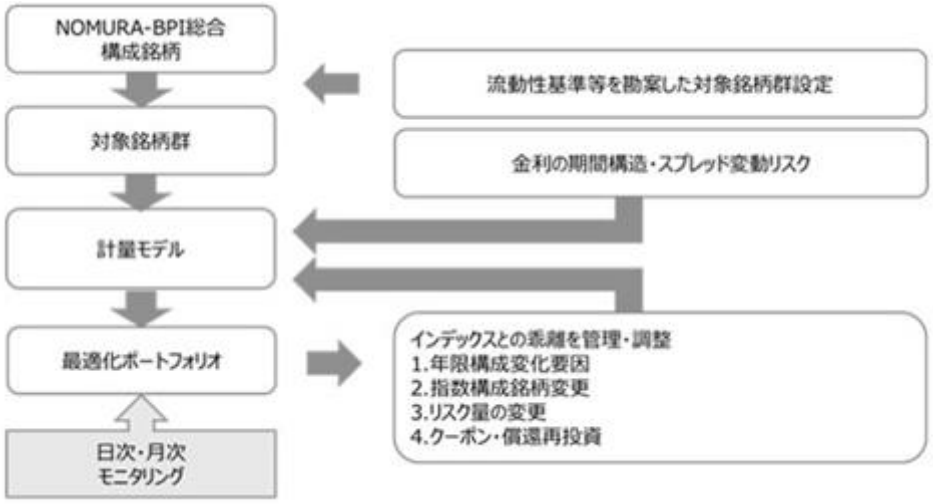
③運用の指図範囲等（約款第17条第2項）

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

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

（参考）各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

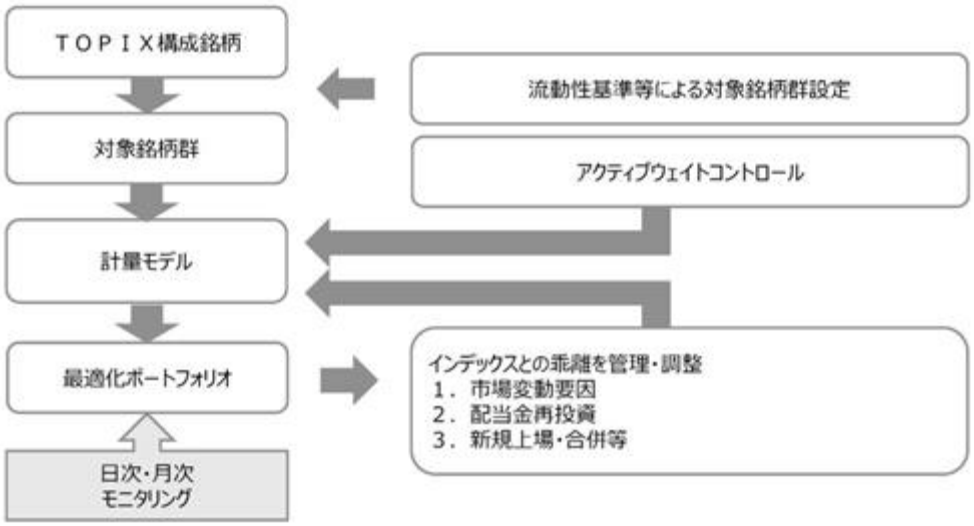
ファンド名	**国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド**
基本方針	**この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。**
主な投資対象	**わが国の公社債を主要投資対象とします。**
投資態度	**1.主としてわが国の公社債に投資し、「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。** **※ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権その他一切の権利は野村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。**

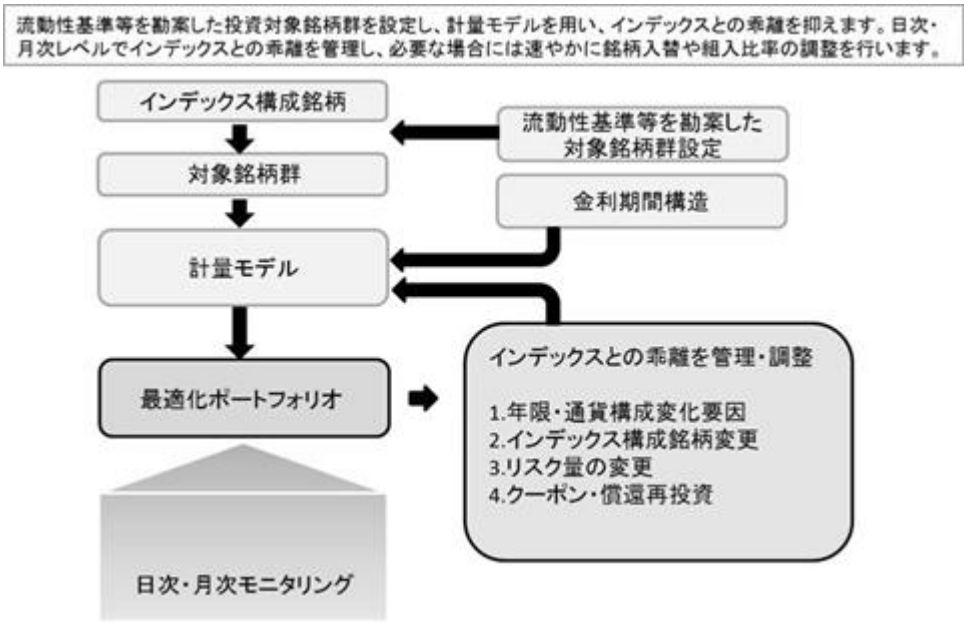
運用プロセス	**1.流動性基準等による対象銘柄群設定** **ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。** **2.最適化法によるポートフォリオの構築** **1）債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因** **2）金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因** **1）、2）が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。** **3.インデックスとの乖離を管理** **日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。** **組入比率の調整に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

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

ファンド名	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄を主要投資対象とします。

投資態度	1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている（または採用予定の）銘柄に投資し、「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）」※に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。 3.株式（株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。 5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 ※①東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。 ②ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。 ③ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値および東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。 ④ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。 ⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。 ⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。 ⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。 ⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

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

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

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

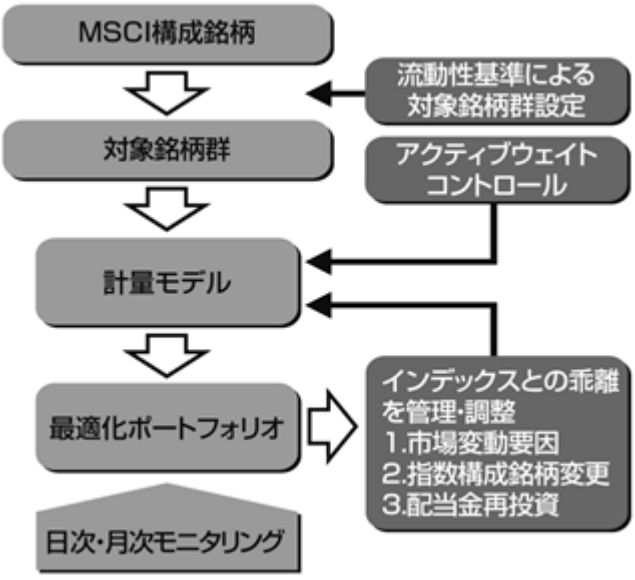
ファンド名	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。

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

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

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

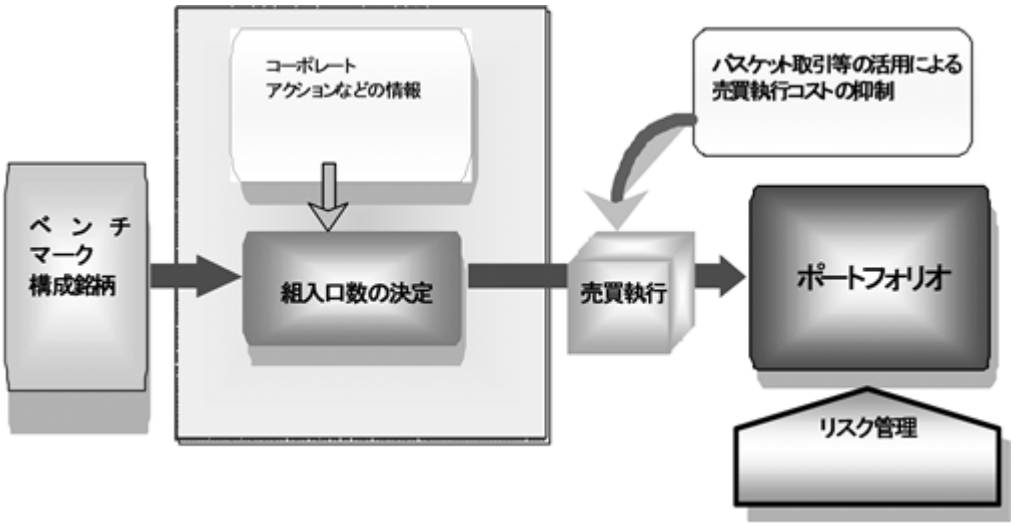
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかな

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

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

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

投資態度	**1.東京証券取引所に上場し、東証ＲＥＩＴ指数※に採用されている（または採用予定の）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。** **2.不動産投資信託証券への投資は、原則として高位を維持することをめざします。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。** **3.但し、ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じたとき、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときならびに東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）が改廃されたとき等、やむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。** **※①東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標は、株式会社ＪＰＸ総研または株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証ＲＥＩＴ指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はＪＰＸが有しています。** **②ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出もしくは公表の停止または東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。** **③ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値および東証ＲＥＩＴ指数にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証ＲＥＩＴ指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。** **④ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、ＪＰＸは、東証ＲＥＩＴ指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。** **⑤本件商品は、ＪＰＸにより提供、保証または販売されるものではありません。** **⑥ＪＰＸは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。** **⑦ＪＰＸは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証ＲＥＩＴ指数の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。** **⑧以上の項目に限らず、ＪＰＸは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。**

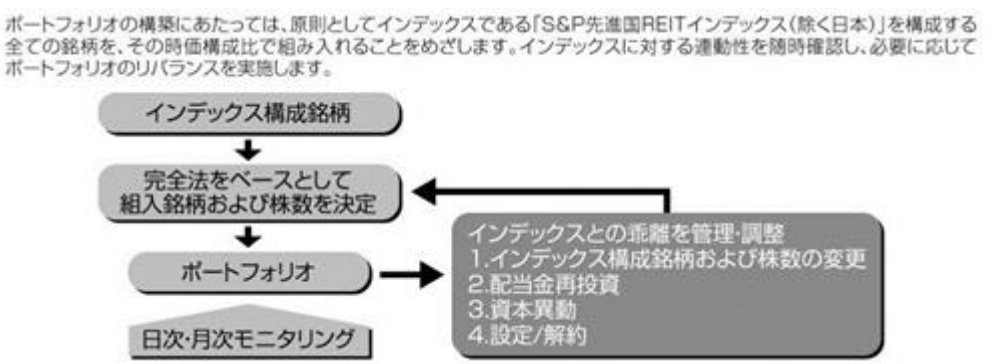
運用プロセス	・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	①投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 ②同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、東証ＲＥＩＴ指数採用の不動産投資信託証券の上場時価総額の合計額に占める同一銘柄の不動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

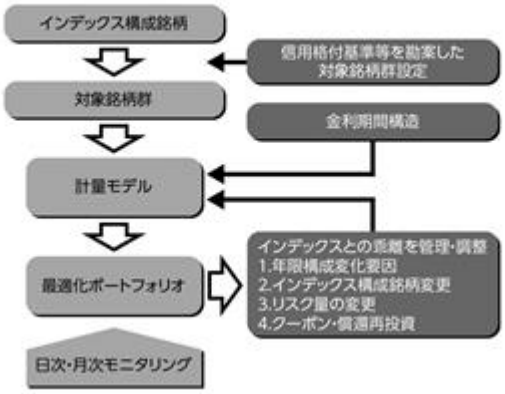
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ 先進国 ＲＥＩＴインデックス（除く日本、円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

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

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

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

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

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

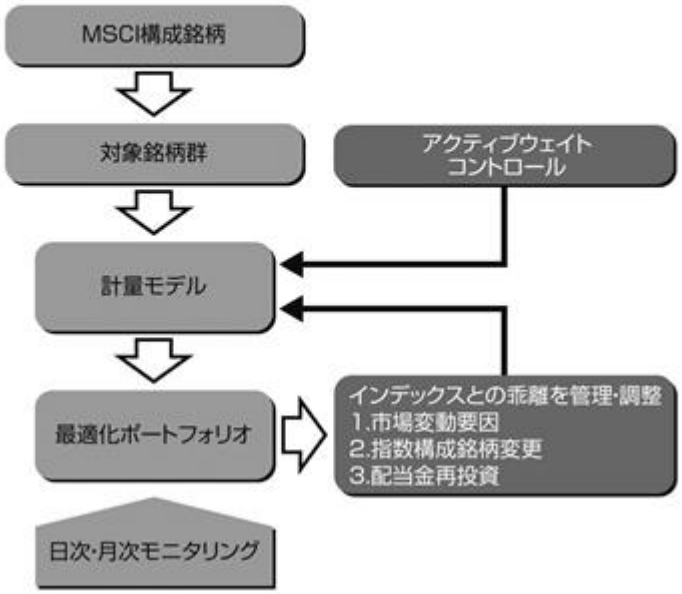
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式（＊）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。 （＊）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

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

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

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

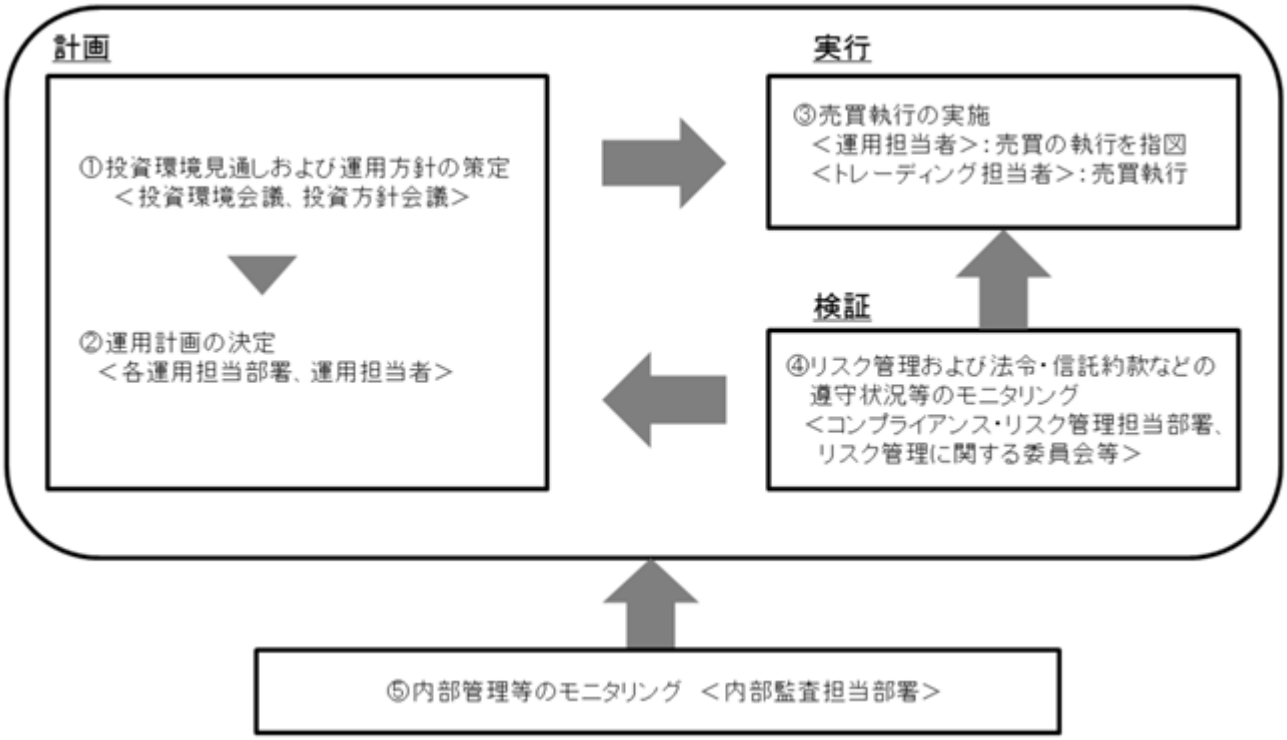
ファンド名	ＤＩＡＭマネーマザーファンド
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保をめざします。
主な投資対象	国内発行体の公社債、転換社債、ユーロ円債、資産担保証券ならびにＣＤ、ＣＰ、コールローン等の国内短期金融資産を主要投資対象とします。

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

（３）【運用体制】

ａ．ファンドの運用体制



①　投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

②　運用計画の決定

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

③　売買執行の実施

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

④　モニタリング

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

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

⑤　内部管理等のモニタリング

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

ｂ．ファンドの関係法人に関する管理

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

ｃ．運用体制に関する社内規則

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

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

※運用体制は2023年1月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

※上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

（４）【分配方針】

①収益分配方針

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

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

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

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

②収益の分配方式

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

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

2)売買損益に評価損益を加減した額からみなし配当等収益を控除して得た利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときはその全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配

することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

③収益分配金の支払い

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

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

（５）【投資制限】

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

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

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

④マザーファンド受益証券以外の投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。（約款「運用の基本方針」2.運用方法（3）投資制限）

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

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

⑦投資する株式等の範囲（約款第20条）

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

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

⑧信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

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

1.信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

2.株式分割により取得する株券

3.有償増資により取得する株券

4.売出しにより取得する株券

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

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

⑨先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

2.先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（信託財産の組入ヘッジ対象有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

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

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

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

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

1.先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記（2）投資対象③運用の指図範囲等1.～4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

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

3.コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ⑨で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

⑩スワップ取引の運用指図（約款第24条）

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

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

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

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

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

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

⑪金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図（約款第25条）

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

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

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

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

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

ととなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

6）上記5）においてマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象外貨建資産の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

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

⑫デリバティブ取引等にかかる投資制限（約款第26条）

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

⑬有価証券の貸付の指図および範囲（約款第27条）

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

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

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

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

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

⑭公社債の空売りの指図および範囲（約款第28条）

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

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

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

⑮公社債の借入れの指図および範囲（約款第29条）

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

2)上記1)の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

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

4)上記1)の借入れにかかる品借料は信託財産中から支弁します。

⑯特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

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

⑰外国為替予約取引の指図（約款第31条）

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

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

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

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

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

⑱資金の借入れ（約款第37条）

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

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

内における、当該有価証券等の売却代金または解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。

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

4)借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

3【投資リスク】

＜基準価額の主な変動要因＞

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。

各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。

各ファンドは短期金融資産等の保有比率を増加させることにより、基準価額の下落リスクの低減をめざして運用を行いますが、当手法が効果的に機能しない場合等により、基準価額の下落リスクを低減できない場合や、市場全体の上昇に追随できない場合があります。

○株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

○不動産投資信託証券（リート）の価格変動リスク

リートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

○為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

各ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。
為替ヘッジを行わない場合、為替変動の影響を受けます。このため為替相場が当該実質組入資産の通貨に対して円高になった場合には基準価額が下がる要因となります。
為替ヘッジを行う場合、為替リスクの低減をめざしますが、為替リスクを完全に排除できるものではなく為替相場の影響を受ける場合があります。なお、実質組入通貨の直接ヘッジのほか、先進国通貨を用いた代替ヘッジを行う場合があり、その場合、通貨間の値動きが異なる場合が想定されますので、十分な為替ヘッジ効果が得られない可能性や、円と当該代替通貨との為替変動の影響を受ける可能性があります。また、為替ヘッジには円金利がヘッジ対象通貨の金利よりも低い場合、その金利差相当分程度のコストがかかることにご留意ください。

○信用リスク

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

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

○流動性リスク

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

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

○カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

投資対象国・地域の政治経済情勢、通貨規制、資本規制、税制、また取引規制等の要因によって資産価格や通貨価値が大きく変動する場合があります。海外に投資する場合には、これらの影響を受

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

＜その他の留意点＞

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

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

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

○収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のことで、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。当該方式は、運用の効率化に資するものですが、一方で、各ファンドが主要投資対象とするマザーファンドに対し、他のベビーファンドにより多額の追加設定・一部解約等がなされた場合には、マザーファンドにおける売買ならびに組入比率の変化等により、各ファンドの基準価額や運用が影響を受ける場合があります。

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

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

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

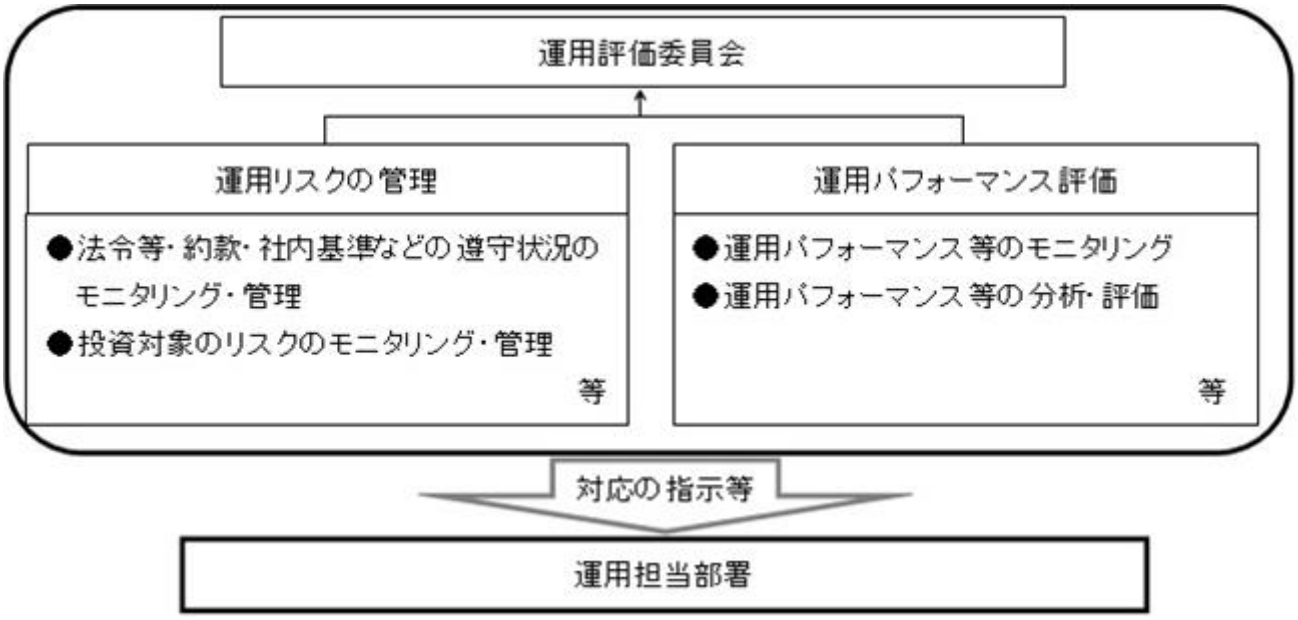
○注意事項

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



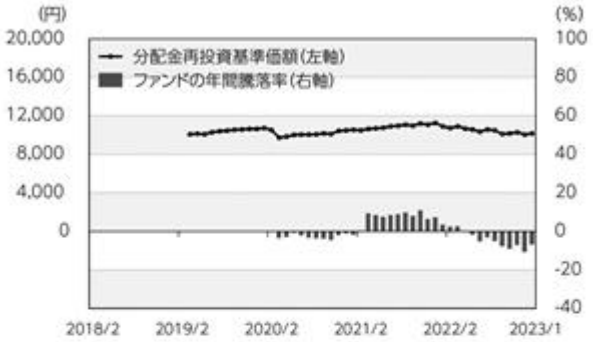
- **流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。**

※リスク管理体制は2023年1月31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

ターゲット・イヤー2040

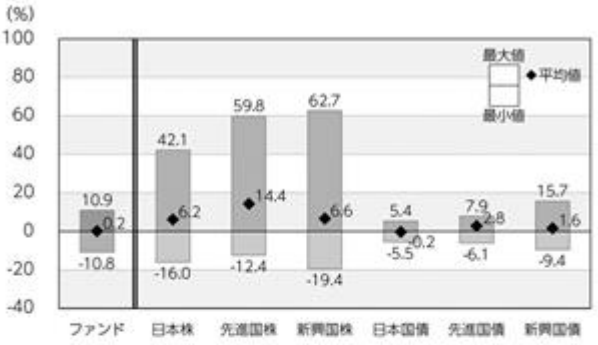


ターゲット・イヤー2050

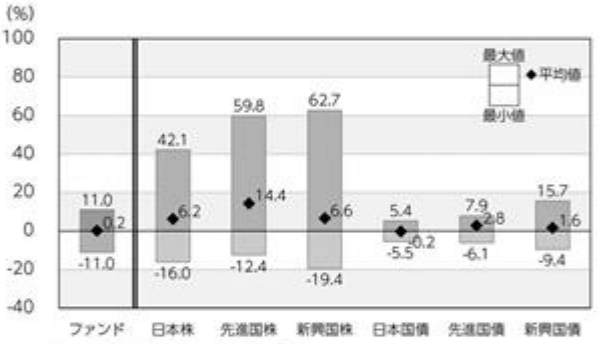
ターゲット・イヤー2060

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

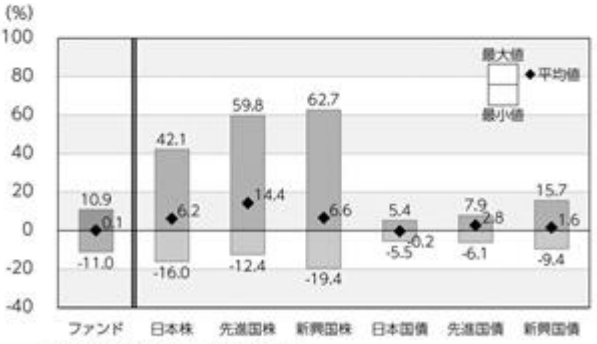
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2020年3月～2023年1月
代表的な資産クラス:2018年2月～2023年1月



ファンド:2020年3月～2023年1月
代表的な資産クラス:2018年2月～2023年1月



ファンド:2020年3月～2023年1月
代表的な資産クラス:2018年2月～2023年1月

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	「東証株価指数(TOPIX)」は、日本の株式市場を広範に網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIコクサイ・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要先進国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)	「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、新興国の株価指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
日本国債	NOMURA-BPI国債	「NOMURA-BPI国債」は、野村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。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ベース)	「JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド」は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが公表している新興国の現地通貨建ての国債で構成されている時価総額加重平均指数です。同指数に関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。また、同社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(注)海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2023年4月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（２）【換金（解約）手数料】

ありません。

（３）【信託報酬等】

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

[ターゲット・イヤー２０４０]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期 （設定日から2020年決算日まで） 年率0.913% （税抜0.83%）	0.40%	0.40%	0.03%
第2計算期から第11計算期まで （2020年決算日翌日から2030年決算日まで） 年率0.825% （税抜0.75%）	0.36%	0.36%	0.03%
第12計算期から第21計算期まで （2030年決算日翌日から2040年決算日まで） 年率0.737% （税抜0.67%）	0.32%	0.32%	0.03%
第22計算期から第36計算期まで （2040年決算日翌日から償還日まで） 年率0.649% （税抜0.59%）	0.28%	0.28%	0.03%

[ターゲット・イヤー２０５０]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第11計算期まで（設定日から2030年決算日まで）	0.40%	0.40%	0.03%
年率0.913%（税抜0.83%）			
第12計算期から第21計算期まで（2030年決算日翌日から2040年決算日まで）	0.36%	0.36%	0.03%
年率0.825%（税抜0.75%）			
第22計算期から第31計算期まで（2040年決算日翌日から2050年決算日まで）	0.32%	0.32%	0.03%
年率0.737%（税抜0.67%）			
第32計算期から第46計算期まで（2050年決算日翌日から償還日まで）	0.28%	0.28%	0.03%
年率0.649%（税抜0.59%）			

[ターゲット・イヤー２０６０]

計算期間	運用管理費用（信託報酬）の配分（税抜）		
信託報酬	委託会社	販売会社	受託会社
第1計算期から第21計算期まで（設定日から2040年決算日まで）	0.40%	0.40%	0.03%
年率0.913%（税抜0.83%）			
第22計算期から第31計算期まで（2040年決算日翌日から2050年決算日まで）	0.36%	0.36%	0.03%
年率0.825%（税抜0.75%）			
第32計算期から第41計算期まで（2050年決算日翌日から2060年決算日まで）	0.32%	0.32%	0.03%
年率0.737%（税抜0.67%）			

第42計算期から第56計算期まで（2060年決算日翌日から償還日まで） 年率0.649%（税抜0.59%）	0.28%	0.28%	0.03%

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

※信託報酬＝運用期間中の基準価額×信託報酬率

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

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

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

◆税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

（４）【その他の手数料等】

・信託財産留保額

ありません。

・その他の費用

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

①信託財産に関する租税、特定資産の価格等の調査に要する費用および当該費用にかかる消費税等に相当する金額、信託事務の処理に要する諸費用ならびに受託会社の立て替えた立替金の利息および借入金の利息等は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

②監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用は、受益者の負担とし、毎日計上（ファンドの基準価額に反映）され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、当該監査に要する費用にかかる消費税等相当額とともに信託財産から支払われます。

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

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

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

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

（５）【課税上の取扱い】

◇各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

○個人の受益者に対する課税

①収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

②解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③損益通算について

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

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

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

○法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税15.315%（復興特別所得税を含みます。））の税率による源泉徴収が行われます。なお、地方税の源泉徴収は行われません。
買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。
なお、益金不算入制度の適用はありません。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税（復興特別所得税を含みます。）および地方税がかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
※上記は、2023年1月末現在のものです。税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になる場合があります。
※課税上の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

◇個別元本方式について

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

＜個別元本について＞

①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
ただし、同一ファンドの受益権を複数の販売会社で取得する場合については販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は当該支店等毎に、「分配金受取コース」と「分配金再投資コース」の両コースで同一ファンドの受益権を取得する場合はコース別に個別元本の算出が行われる場合があります。
③収益分配金に元本払戻金（特別分配金）が含まれる場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の＜収益分配金の課税について＞を参照。）

＜収益分配金の課税について＞

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

※税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

５【運用状況】

（１）【投資状況】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		1,967,360,248	96.18
	内　日本	1,967,360,248	96.18
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		78,178,222	3.82
純資産総額		2,045,538,470	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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		890,302,427	98.41
	内　日本	890,302,427	98.41
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		14,403,684	1.59
純資産総額		904,706,111	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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券		537,065,290	96.70
	内　日本	537,065,290	96.70
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,352,368	3.30
純資産総額		555,417,658	100.00

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

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		311,522,734,650	77.45
	内　日本	311,522,734,650	77.45
地方債証券		32,681,454,691	8.13
	内　日本	32,681,454,691	8.13
特殊債券		30,090,264,599	7.48
	内　日本	30,090,264,599	7.48
社債券		25,454,613,260	6.33
	内　日本	24,764,906,260	6.16
	内　フランス	689,707,000	0.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,475,703,316	0.62
純資産総額		402,224,770,516	100.00

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		375,629,740,780	97.67
	内　日本	375,629,740,780	97.67
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,951,655,112	2.33
純資産総額		384,581,395,892	100.00

その他資産の投資状況

2023年1月31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）		8,889,750,000	2.31
	内　日本	8,889,750,000	2.31

（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

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		251,016,552,440	98.92
	内　アメリカ	125,061,380,789	49.28
	内　フランス	21,594,478,167	8.51
	内　イタリア	19,400,875,694	7.65
	内　ドイツ	16,716,183,122	6.59
	内　スペイン	12,717,932,684	5.01
	内　イギリス	12,402,402,006	4.89
	内　中国	10,014,411,690	3.95
	内　カナダ	5,259,432,712	2.07
	内　ベルギー	4,684,517,163	1.85
	内　オーストラリア	4,151,224,186	1.64
	内　オランダ	4,041,709,912	1.59
	内　オーストリア	2,995,150,830	1.18
	内　メキシコ	2,101,928,799	0.83
	内　アイルランド	1,595,332,201	0.63
	内　マレーシア	1,448,485,808	0.57
	内　フィンランド	1,289,998,220	0.51
	内　シンガポール	1,177,761,171	0.46
	内　ポーランド	1,134,457,797	0.45
	内　デンマーク	831,710,236	0.33
	内　イスラエル	808,021,736	0.32
	内　ニュージーランド	569,452,756	0.22
	内　ノルウェー	516,452,667	0.20
	内　スウェーデン	503,252,094	0.20
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		2,749,080,696	1.08
純資産総額		253,765,633,136	100.00

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		785,326,757,944	95.50
	内　アメリカ	540,597,641,142	65.74
	内　イギリス	35,843,798,163	4.36
	内　カナダ	30,410,455,313	3.70
	内　フランス	27,870,212,082	3.39
	内　スイス	27,389,134,220	3.33
	内　ドイツ	20,968,629,287	2.55
	内　オーストラリア	18,898,014,226	2.30
	内　オランダ	16,041,155,516	1.95
	内　アイルランド	14,687,694,419	1.79
	内　スウェーデン	7,695,442,622	0.94
	内　デンマーク	7,034,184,785	0.86
	内　スペイン	6,373,489,172	0.78
	内　香港	5,599,582,914	0.68
	内　イタリア	4,432,445,910	0.54
	内　ジャージィー	3,295,316,696	0.40
	内　フィンランド	3,083,208,632	0.37
	内　シンガポール	2,831,485,311	0.34
	内　ベルギー	2,007,551,318	0.24
	内　ノルウェー	1,739,658,099	0.21
	内　イスラエル	1,681,861,648	0.20
	内　ケイマン諸島	1,624,556,806	0.20
	内　オランダ領キュラソー	1,304,084,103	0.16
	内　バミューダ	1,243,449,114	0.15
	内　ルクセンブルグ	609,160,144	0.07
	内　ニュージーランド	606,801,738	0.07
	内　オーストリア	456,019,239	0.06
	内　ポルトガル	411,671,855	0.05
	内　リベリア	225,886,073	0.03
	内　パナマ	183,646,472	0.02
	内　マン島	180,520,925	0.02
投資信託受益証券		1,539,021,811	0.19
	内　オーストラリア	1,088,996,180	0.13
	内　シンガポール	450,025,631	0.05
投資証券		17,380,761,989	2.11
	内　アメリカ	16,194,194,994	1.97
	内　イギリス	396,601,801	0.05
	内　フランス	322,115,581	0.04
	内　香港	281,048,317	0.03
	内　ベルギー	112,611,466	0.01
	内　カナダ	74,189,830	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		18,077,732,961	2.20
純資産総額		822,324,274,705	100.00

その他資産の投資状況

2023年1月31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）		18,301,678,694	2.23
	内　アメリカ	13,416,067,012	1.63

	内　ドイツ	2,895,618,293	0.35
	内　イギリス	851,373,358	0.10
	内　カナダ	677,754,257	0.08
	内　オーストラリア	460,865,774	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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券		191,404,816,950	97.76
	内　日本	191,404,816,950	97.76
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		4,379,006,636	2.24
純資産総額		195,783,823,586	100.00

その他資産の投資状況

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引（買建）		4,240,486,500	2.17
	内　日本	4,240,486,500	2.17

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券		7,693,151,791	10.74
	内　オーストラリア	4,937,448,030	6.90
	内　シンガポール	2,687,799,067	3.75
	内　香港	67,904,694	0.09
投資証券		63,603,631,041	88.83
	内　アメリカ	54,511,940,772	76.13
	内　イギリス	3,394,712,972	4.74
	内　カナダ	1,358,015,404	1.90
	内　フランス	1,334,035,051	1.86
	内　香港	1,030,182,135	1.44
	内　ベルギー	777,645,300	1.09
	内　スペイン	299,957,137	0.42
	内　ニュージーランド	280,467,189	0.39
	内　韓国	171,952,877	0.24
	内　ガーンジィ	153,405,276	0.21
	内　オランダ	134,324,503	0.19
	内　イスラエル	87,753,927	0.12
	内　ドイツ	34,141,304	0.05
	内　アイルランド	27,495,357	0.04
	内　イタリア	7,601,837	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		303,690,774	0.42

純資産総額	71,600,473,606	100.00

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券		129,974,389,703	97.32
	内　サウジアラビア	14,746,204,040	11.04
	内　カタール	12,708,541,770	9.52
	内　メキシコ	12,069,427,093	9.04
	内　アラブ首長国連邦	11,853,291,477	8.88
	内　チリ	8,974,517,585	6.72
	内　ドミニカ共和国	7,763,685,415	5.81
	内　パナマ	7,479,129,188	5.60
	内　ブラジル	7,073,297,149	5.30
	内　コロンビア	7,035,486,447	5.27
	内　インドネシア	6,806,266,617	5.10
	内　オマーン	5,975,798,681	4.47
	内　南アフリカ	5,743,915,862	4.30
	内　ペルー	5,205,628,808	3.90
	内　フィリピン	4,599,361,410	3.44
	内　ハンガリー	4,543,730,917	3.40
	内　ウルグアイ	3,647,553,403	2.73
	内　ルーマニア	2,930,070,547	2.19
	内　中国	818,483,294	0.61
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		3,577,387,809	2.68
純資産総額		133,551,777,512	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

2023年1月31日現在

資産の種類		時価合計（円）	投資比率（%）
株式		92,596,103,831	91.12
	内　ケイマン諸島	18,311,055,506	18.02
	内　台湾	13,208,909,881	13.00
	内　インド	12,066,629,975	11.87
	内　中国	11,517,337,064	11.33
	内　韓国	11,117,733,434	10.94
	内　ブラジル	4,558,863,043	4.49
	内　サウジアラビア	3,598,938,725	3.54
	内　南アフリカ	3,225,263,122	3.17
	内　タイ	2,011,324,370	1.98
	内　メキシコ	1,799,533,516	1.77
	内　インドネシア	1,692,590,605	1.67
	内　マレーシア	1,414,612,583	1.39
	内　アラブ首長国連邦	1,103,972,303	1.09
	内　香港	1,066,403,807	1.05
	内　カタール	877,436,854	0.86

	内　クエート	808,255,619	0.80
	内　フィリピン	685,606,338	0.67
	内　ポーランド	607,652,888	0.60
	内　トルコ	540,485,977	0.53
	内　チリ	517,488,411	0.51
	内　バミューダ	455,689,732	0.45
	内　アメリカ	424,670,239	0.42
	内　ギリシャ	314,352,359	0.31
	内　ハンガリー	169,462,764	0.17
	内　チェコ	146,759,755	0.14
	内　コロンビア	105,515,185	0.10
	内　エジプト	75,889,620	0.07
	内　ルクセンブルグ	67,271,991	0.07
	内　オランダ	61,574,869	0.06
	内　シンガポール	25,914,393	0.03
	内　ペルー	18,908,903	0.02
	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		589,493,407	0.58
	内　メキシコ	428,285,869	0.42
	内　ブラジル	161,207,538	0.16
投資証券		93,761,108	0.09
	内　メキシコ	53,374,363	0.05
	内　南アフリカ	40,386,745	0.04
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		8,339,396,078	8.21
純資産総額		101,618,754,424	100.00

その他資産の投資状況

2023年1月31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）		8,309,373,360	8.18
	内　アメリカ	8,309,373,360	8.18

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

2023年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	607,579,349	1.2347 750,238,980	1.2341 749,813,674	－ －	36.66

2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	427,259,606	1.2108 517,368,656	1.2155 519,334,051	－ －	25.39
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	29,873,525	5.9025 176,331,468	5.9911 178,975,275	－ －	8.75
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	79,069,288	1.9484 154,066,507	1.9630 155,213,012	－ －	7.59
5	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	90,344,235	1.4092 127,322,130	1.4285 129,056,739	－ －	6.31
6	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	43,369,508	2.3100 100,187,900	2.2762 98,717,674	－ －	4.83
7	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	21,858,666	3.2349 70,712,784	3.3613 73,473,534	－ －	3.59
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	37,554,612	1.5846 59,512,793	1.6716 62,776,289	－ －	3.07

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	96.18
合計	96.18

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

2023年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	270,274,590	1.2348 333,745,574	1.2341 333,545,871	－ －	36.87
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	192,748,380	1.2111 233,437,591	1.2155 234,285,655	－ －	25.90
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	13,325,336	5.9025 78,654,128	5.9911 79,833,420	－ －	8.82

4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	34,832,728	1.9491 67,894,079	1.9630 68,376,645	－ －	7.56
5	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	16,535,911	3.2349 53,493,672	3.3613 55,582,157	－ －	6.14
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	38,359,871	1.4094 54,064,814	1.4285 54,797,075	－ －	6.06
7	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	17,935,212	2.3099 41,429,273	2.2762 40,824,129	－ －	4.51
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	13,793,656	1.5846 21,858,806	1.6716 23,057,475	－ －	2.55

（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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	98.41
合計	98.41

（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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

2023年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	161,227,928	1.2347 199,084,245	1.2341 198,971,385	－ －	35.82
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	116,592,753	1.2108 141,182,164	1.2155 141,718,491	－ －	25.52
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	8,232,922	5.9025 48,595,645	5.9911 49,324,258	－ －	8.88
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	20,411,537	1.9484 39,771,879	1.9630 40,067,847	－ －	7.21
5	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	10,207,719	3.2349 33,021,970	3.3613 34,311,205	－ －	6.18

6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	23,864,626	1.4092 33,632,417	1.4285 34,090,618	－ －	6.14
7	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド 日本	親投資信託受益証券	10,618,723	2.3100 24,530,312	2.2762 24,170,337	－ －	4.35
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	8,621,171	1.5846 13,661,969	1.6716 14,411,149	－ －	2.59

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	96.70
合計	96.70

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31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	３３５回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,610,000,000	100.86 4,649,682,000	100.86 4,649,876,500	0.5 2024/9/20	1.16
2	３３４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	4,420,000,000	100.94 4,461,956,000	100.87 4,458,763,400	0.6 2024/6/20	1.11
3	４３７回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	3,850,000,000	100.16 3,856,466,000	100.05 3,852,271,500	0.005 2024/6/1	0.96
4	４３８回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	3,800,000,000	100.17 3,806,808,000	100.05 3,802,128,000	0.005 2024/7/1	0.95
5	３６８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,750,000,000	99.22 3,720,830,000	99.71 3,739,387,500	0.2 2032/9/20	0.93
6	４３５回　利付国庫債券（２年） 日本	国債証券	3,720,000,000	100.11 3,724,426,800	100.06 3,722,343,600	0.005 2024/4/1	0.93
7	３４８回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,470,000,000	99.71 3,460,132,000	99.74 3,461,220,900	0.1 2027/9/20	0.86
8	３５０回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	3,460,000,000	99.45 3,441,288,000	99.41 3,439,793,600	0.1 2028/3/20	0.86

9	３４２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,420,000,000	100.22 3,427,803,000	100.23 3,428,002,800	0.1 2026/3/20	0.85
10	１５３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,410,000,000	99.42 3,390,475,000	99.43 3,390,665,300	0.005 2027/6/20	0.84
11	３４５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,380,000,000	99.97 3,379,088,000	100.05 3,381,960,400	0.1 2026/12/20	0.84
12	１４８回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,310,000,000	99.84 3,304,760,000	99.88 3,306,061,100	0.005 2026/6/20	0.82
13	３４４回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,270,000,000	100.02 3,270,654,000	100.14 3,274,708,800	0.1 2026/9/20	0.81
14	３４７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,230,000,000	99.85 3,225,330,000	99.84 3,225,058,100	0.1 2027/6/20	0.80
15	３６０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,200,000,000	97.58 3,122,560,000	97.13 3,108,160,000	0.1 2030/9/20	0.77
16	１４３回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	3,100,000,000	100.43 3,113,564,000	100.23 3,107,254,000	0.1 2025/3/20	0.77
17	３６５回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,230,000,000	97.53 3,150,436,000	96.14 3,105,580,400	0.1 2031/12/20	0.77
18	３４０回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,040,000,000	101.02 3,071,098,000	101.02 3,071,190,400	0.4 2025/9/20	0.76
19	３３６回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	101.38 3,041,400,000	100.98 3,029,640,000	0.5 2024/12/20	0.75
20	３６７回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	3,000,000,000	98.77 2,963,100,000	98.90 2,967,210,000	0.2 2032/6/20	0.74
21	３４９回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	2,950,000,000	99.72 2,941,950,000	99.58 2,937,846,000	0.1 2027/12/20	0.73
22	１４２回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	2,930,000,000	100.35 2,940,255,000	100.23 2,936,885,500	0.1 2024/12/20	0.73
23	１４６回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	2,900,000,000	100.45 2,913,050,000	100.24 2,907,076,000	0.1 2025/12/20	0.72
24	３６２回　利付国庫債券 （１０年） 日本	国債証券	2,960,000,000	97.88 2,897,392,000	96.64 2,860,780,800	0.1 2031/3/20	0.71
25	１４１回　利付国庫債券 （５年） 日本	国債証券	2,810,000,000	100.16 2,814,496,000	100.21 2,815,957,200	0.1 2024/9/20	0.70

26	１５４回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,800,000,000	99.65 2,790,444,000	99.74 2,792,916,000	0.1 2027/9/20	0.69
27	１４９回　利付国庫債券（５年） 日本	国債証券	2,710,000,000	99.72 2,702,566,000	99.80 2,704,580,000	0.005 2026/9/20	0.67
28	３６６回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,780,000,000	99.02 2,753,008,000	97.12 2,700,102,800	0.2 2032/3/20	0.67
29	３６４回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,800,000,000	96.90 2,713,235,000	96.25 2,695,028,000	0.1 2031/9/20	0.67
30	３５３回　利付国庫債券（１０年） 日本	国債証券	2,710,000,000	98.98 2,682,435,000	98.90 2,680,217,100	0.1 2028/12/20	0.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	77.45
地方債証券	8.13
特殊債券	7.48
社債券	6.33
合計	99.38

（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。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,263,800	2,161.51 15,700,839,658	1,896.50 13,775,796,700	－ －	3.58
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	935,800	12,066.67 11,291,995,298	11,580.00 10,836,564,000	－ －	2.82
3	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,272,200	757.06 6,262,560,665	952.70 7,880,924,940	－ －	2.05
4	キーエンス 日本	株式 電気機器	132,300	54,670.60 7,232,921,205	59,280.00 7,842,744,000	－ －	2.04
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,700,100	3,663.73 6,228,719,747	3,892.00 6,616,789,200	－ －	1.72
6	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	952,100	4,275.72 4,070,916,553	5,652.00 5,381,269,200	－ －	1.40

7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,174,100	3,629.74 4,261,685,589	4,090.00 4,802,069,000	－ －	1.25
8	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	767,100	5,399.08 4,141,638,724	6,144.00 4,713,062,400	－ －	1.23
9	任天堂 日本	株式 その他製品	835,200	5,871.47 4,903,854,823	5,625.00 4,698,000,000	－ －	1.22
10	第一三共 日本	株式 医薬品	1,155,800	3,011.06 3,480,190,115	4,064.00 4,697,171,200	－ －	1.22
11	日立製作所 日本	株式 電気機器	649,700	6,218.17 4,039,948,260	6,782.00 4,406,265,400	－ －	1.15
12	信越化学工業 日本	株式 化学	223,600	18,049.35 4,035,835,084	19,075.00 4,265,170,000	－ －	1.11
13	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	93,300	53,419.15 4,984,007,072	45,170.00 4,214,361,000	－ －	1.10
14	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,006,800	5,086.74 5,121,338,250	4,144.00 4,172,179,200	－ －	1.08
15	ＫＤＤＩ 日本	株式 情報・通信業	1,025,200	4,057.93 4,160,196,633	4,059.00 4,161,286,800	－ －	1.08
16	ＨＯＹＡ 日本	株式 精密機器	282,500	14,155.97 3,999,062,843	14,200.00 4,011,500,000	－ －	1.04
17	三井物産 日本	株式 卸売業	1,024,100	3,107.07 3,181,955,948	3,820.00 3,912,062,000	－ －	1.02
18	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,884,300	1,614.35 3,041,933,064	2,027.50 3,820,418,250	－ －	0.99
19	三菱商事 日本	株式 卸売業	875,100	4,134.43 3,618,045,180	4,336.00 3,794,433,600	－ －	0.99
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	862,500	3,803.29 3,280,339,098	4,183.00 3,607,837,500	－ －	0.94
21	ダイキン工業 日本	株式 機械	159,500	22,024.41 3,512,893,857	22,470.00 3,583,965,000	－ －	0.93
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,311,900	2,493.33 3,271,009,362	2,714.00 3,560,496,600	－ －	0.93
23	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,075,300	3,352.20 3,604,627,480	3,207.00 3,448,487,100	－ －	0.90
24	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,131,200	1,476.87 3,147,513,699	1,486.50 3,168,028,800	－ －	0.82
25	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	143,900	20,602.04 2,964,634,908	21,580.00 3,105,362,000	－ －	0.81
26	ファナック 日本	株式 電気機器	129,800	21,744.76 2,822,470,921	22,905.00 2,973,069,000	－ －	0.77
27	村田製作所 日本	株式 電気機器	401,200	8,008.39 3,212,967,639	7,394.00 2,966,472,800	－ －	0.77

28	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	482,400	5,601.32 2,702,076,904	6,127.00 2,955,664,800	－ －	0.77
29	ＳＭＣ 日本	株式 機械	43,300	64,079.90 2,774,659,804	65,350.00 2,829,655,000	－ －	0.74
30	富士通 日本	株式 電気機器	133,100	17,216.89 2,291,568,444	18,510.00 2,463,681,000	－ －	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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	97.67
合計	97.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
電気機器	国内	16.98
情報・通信業		8.71
輸送用機器		7.24
銀行業		6.42
化学		6.06
卸売業		5.79
医薬品		5.24
サービス業		5.20
機械		5.12
小売業		4.44
食料品		3.34
陸運業		2.90
精密機器		2.55
保険業		2.36
その他製品		2.26
建設業		1.91
不動産業		1.86
電気・ガス業		1.21
その他金融業		1.11
鉄鋼		0.83
証券、商品先物取引業		0.74
非鉄金属		0.73
ガラス・土石製品		0.70
ゴム製品		0.69
海運業		0.59
金属製品		0.56
空運業		0.50
石油・石炭製品		0.48
繊維製品		0.46
鉱業		0.30
パルプ・紙		0.17
倉庫・運輸関連業		0.14

水産・農林業	0.09
合計	97.67

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

2023年1月31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	2,909,481,000	97.99 2,851,145,905	98.10 2,854,473,624	3.25 2024/8/31	1.12
2	US T N/B 0.375 08/15/24 アメリカ	国債証券	2,348,460,000	92.94 2,182,752,662	93.84 2,203,882,931	0.375 2024/8/15	0.87
3	US T N/B 0.625 10/15/24 アメリカ	国債証券	2,262,349,800	92.93 2,102,547,247	93.79 2,122,013,413	0.625 2024/10/15	0.84
4	US T N/B 2.25 11/15/24 アメリカ	国債証券	2,189,286,600	95.77 2,096,701,669	96.37 2,109,924,960	2.25 2024/11/15	0.83
5	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,667,406,600	94.79 1,580,657,227	94.82 1,581,105,267	2.875 2032/5/15	0.62
6	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,737,860,400	81.99 1,424,907,438	83.94 1,458,784,452	1.375 2031/11/15	0.57
7	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	1,435,170,000	95.33 1,368,206,272	95.62 1,372,437,370	2.75 2028/2/15	0.54
8	US T N/B 0.875 09/30/26 アメリカ	国債証券	1,523,889,600	87.80 1,338,127,457	89.94 1,370,607,732	0.875 2026/9/30	0.54
9	US T N/B 4.25 10/15/25 アメリカ	国債証券	1,352,973,900	100.37 1,358,034,022	100.53 1,360,187,997	4.25 2025/10/15	0.54
10	FRANCE OAT 0.5 05/25/29 フランス	国債証券	1,500,536,000	90.39 1,356,409,517	87.82 1,317,857,746	0.5 2029/5/25	0.52
11	US T N/B 1.25 12/31/26 アメリカ	国債証券	1,429,951,200	88.62 1,267,279,951	90.76 1,297,959,996	1.25 2026/12/31	0.51
12	US T N/B 1.0 12/15/24 アメリカ	国債証券	1,364,716,200	93.17 1,271,587,966	94.06 1,283,686,175	1 2024/12/15	0.51
13	US T N/B 2.5 03/31/27 アメリカ	国債証券	1,273,387,200	93.05 1,184,912,257	95.09 1,210,911,640	2.5 2027/3/31	0.48
14	US T N/B 4.0 12/15/25 アメリカ	国債証券	1,205,542,800	99.69 1,201,817,672	100.07 1,206,390,440	4 2025/12/15	0.48
15	US T N/B 6.125 11/15/27 アメリカ	国債証券	1,085,510,400	108.40 1,176,725,838	110.46 1,199,149,770	6.125 2027/11/15	0.47
16	US T N/B 2.875 04/30/29 アメリカ	国債証券	1,222,503,900	94.80 1,159,055,947	95.60 1,168,732,822	2.875 2029/4/30	0.46
17	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	1,271,208,800	91.02 1,157,114,497	90.81 1,154,471,153	0.75 2028/5/25	0.45
18	US T N/B 2.875 05/15/28 アメリカ	国債証券	1,192,495,800	93.43 1,114,196,525	96.01 1,144,982,294	2.875 2028/5/15	0.45
19	US T N/B 2.25 02/15/27 アメリカ	国債証券	1,213,371,000	93.65 1,136,397,353	94.32 1,144,455,312	2.25 2027/2/15	0.45
20	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,286,434,200	86.39 1,111,370,362	86.66 1,114,876,130	1.625 2031/5/15	0.44
21	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,171,620,600	89.99 1,054,435,107	93.66 1,097,341,680	2.75 2032/8/15	0.43

22	US T N/B 2.25 03/31/24 アメリカ	国債証券	1,110,299,700	98.54 1,094,184,828	97.21 1,079,332,740	2.25 2024/3/31	0.43
23	US T N/B 3.125 08/31/27 アメリカ	国債証券	1,102,471,500	95.48 1,052,661,837	97.49 1,074,866,637	3.125 2027/8/31	0.42
24	US T N/B 0.25 08/31/25 アメリカ	国債証券	1,176,839,400	89.14 1,049,070,729	90.76 1,068,211,603	0.25 2025/8/31	0.42
25	US T N/B 3.875 09/30/29 アメリカ	国債証券	1,052,892,900	100.72 1,060,557,960	101.31 1,066,773,808	3.875 2029/9/30	0.42
26	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	991,572,000	103.92 1,030,511,032	104.72 1,038,439,265	4.125 2032/11/15	0.41
27	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,251,207,300	82.77 1,035,694,051	82.28 1,029,509,005	0.875 2030/11/15	0.41
28	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	805,476,400	131.40 1,058,406,841	125.41 1,010,155,202	5.75 2032/10/25	0.40
29	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,197,714,600	83.43 999,313,995	83.56 1,000,887,045	1.25 2031/8/15	0.39
30	SPAIN 4.65 07/30/25 スペイン	国債証券	930,049,200	106.52 990,753,511	104.31 970,163,152	4.65 2025/7/30	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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	98.92
合計	98.92

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31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	2,000,134	21,293.77 42,590,405,160	18,657.20 37,316,920,066	－ －	4.54
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフトウェア	881,904	37,307.92 32,902,008,977	31,666.37 27,926,701,631	－ －	3.40
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 インターネット販売・通信販売	1,141,595	18,866.44 21,537,839,593	13,118.75 14,976,309,109	－ －	1.82

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	744,329	16,792.49 12,499,138,375	12,647.76 9,414,095,892	－ －	1.14
5	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	691,660	16,835.90 11,644,722,719	12,779.53 8,839,094,215	－ －	1.07
6	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	310,242	29,222.65 9,066,094,888	25,000.66 7,756,255,194	－ －	0.94
7	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	519,382	10,962.32 5,693,633,610	14,816.17 7,695,253,668	－ －	0.94
8	UNITEDHEALTH GROUP INC アメリカ	株式 ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	116,509	63,276.63 7,372,297,243	63,381.02 7,384,459,410	－ －	0.90
9	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	331,953	35,661.57 11,837,967,740	21,744.13 7,218,029,252	－ －	0.88
10	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	327,095	21,942.52 7,177,288,791	21,136.13 6,913,525,713	－ －	0.84
11	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	365,043	18,904.43 6,900,932,373	18,152.29 6,626,366,800	－ －	0.81
12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 各種金融サービス	161,951	40,882.93 6,621,031,657	40,097.34 6,493,805,136	－ －	0.79
13	VISA INC アメリカ	株式 情報技術サービス	203,526	28,669.27 5,834,943,099	29,890.67 6,083,529,927	－ －	0.74
14	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	296,779	19,959.82 5,923,657,262	18,397.57 5,460,013,821	－ －	0.66
15	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	284,533	26,449.42 7,525,733,742	19,186.91 5,459,311,396	－ －	0.66

16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	341,882	16,428.51 5,616,613,632	15,683.05 5,361,752,773	－ －	0.65
17	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗燃料	231,639	19,124.13 4,429,895,685	22,727.87 5,264,662,005	－ －	0.64
18	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売り	127,583	43,936.76 5,605,584,901	40,998.89 5,230,761,740	－ －	0.64
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 情報技術サービス	107,466	47,372.79 5,090,964,884	48,420.02 5,203,506,557	－ －	0.63
20	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	100,641	34,048.00 3,426,625,108	44,425.03 4,470,979,947	－ －	0.54
21	MERCK & CO.INC. アメリカ	株式 医薬品	315,672	10,638.56 3,358,297,990	13,841.56 4,369,393,654	－ －	0.53
22	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・半導体製造装置	50,605	78,262.23 3,960,460,263	85,417.30 4,322,542,668	－ －	0.53
23	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテクノロジー	220,198	19,048.68 4,194,482,369	19,002.95 4,184,412,795	－ －	0.51
24	BANK OF AMERICA CORP アメリカ	株式 銀行	900,868	5,747.89 5,178,090,907	4,605.59 4,149,029,552	－ －	0.50
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	510,854	7,957.23 4,064,983,680	7,911.70 4,041,724,000	－ －	0.49
26	PFIZER INC アメリカ	株式 医薬品	698,945	6,503.71 4,545,736,329	5,681.96 3,971,383,473	－ －	0.48
27	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・アパレル・贅沢品	34,454	93,130.21 3,208,708,332	113,078.12 3,895,993,822	－ －	0.47
28	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・半導体製造装置	50,259	73,944.65 3,716,384,483	75,861.78 3,812,737,276	－ －	0.46
29	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	171,495	21,876.21 3,751,660,892	22,112.05 3,792,106,975	－ －	0.46
30	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	206,349	13,155.65 2,714,655,304	18,297.34 3,775,638,843	－ －	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

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	95.50
投資信託受益証券	0.19
投資証券	2.11

合計	97.80

（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

2023年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
ソフトウェア	外国	6.48
銀行		6.20
石油・ガス・消耗燃料		5.35
医薬品		5.27
コンピュータ・周辺機器		4.76
半導体・半導体製造装置		4.51
情報技術サービス		3.72
保険		3.37
資本市場		3.33
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.02
ヘルスケア機器・用品		2.36
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス		2.31
インターネット販売・通信販売		2.23
化学		2.08
バイオテクノロジー		2.06
ホテル・レストラン・レジャー		1.95
電力		1.85
機械		1.83
金属・鉱業		1.82
飲料		1.75
食品		1.69
航空宇宙・防衛		1.68
専門小売り		1.67
自動車		1.54
ライフサイエンス・ツール／サービス		1.50
食品・生活必需品小売り		1.50
繊維・アパレル・贅沢品		1.42
娯楽		1.18
各種電気通信サービス		1.16
家庭用品		1.11
各種金融サービス		1.07
陸運・鉄道		1.02
コングロマリット		0.93
電気設備		0.85
総合公益事業		0.81
メディア		0.80
専門サービス		0.70
タバコ		0.68
通信機器		0.66
パーソナル用品		0.64
建設関連製品		0.58
航空貨物・物流サービス		0.55
電子装置・機器・部品		0.55
商業サービス・用品		0.48

複合小売り	0.47
消費者金融	0.42
商社・流通業	0.38
不動産管理・開発	0.36
エネルギー設備・サービス	0.31
家庭用耐久財	0.30
無線通信サービス	0.29
建設・土木	0.28
建設資材	0.26
容器・包装	0.26
自動車部品	0.20
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.16
ガス	0.14
運送インフラ	0.12
水道	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	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
各種消費者サービス	0.02
レジャー用品	0.02
合計	95.50

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （%） 償還日	投資比率 （%）
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	21,821	691,456.43 15,088,270,918	567,000.00 12,372,507,000	－ －	6.32
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 日本	投資証券	18,706	632,458.25 11,830,764,210	557,000.00 10,419,242,000	－ －	5.32
3	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	94,380	106,632.50 10,063,975,517	100,300.00 9,466,314,000	－ －	4.84
4	日本プロロジスリート投資法人 日本	投資証券	31,530	337,418.93 10,638,819,126	294,300.00 9,279,279,000	－ －	4.74
5	野村不動産マスターファンド投資法人 日本	投資証券	60,490	167,861.43 10,153,938,161	151,900.00 9,188,431,000	－ －	4.69
6	ＧＬＰ投資法人 日本	投資証券	60,374	164,052.09 9,904,481,227	146,700.00 8,856,865,800	－ －	4.52
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	28,196	311,577.86 8,785,249,601	282,800.00 7,973,828,800	－ －	4.07
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	37,271	186,085.48 6,935,592,235	178,700.00 6,660,327,700	－ －	3.40

9	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本	投資証券	41,843	147,684.62 6,179,567,726	147,800.00 6,184,395,400	－ －	3.16
10	アドバンス・レジデンス投資法人 日本	投資証券	18,703	355,527.34 6,649,427,845	317,500.00 5,938,202,500	－ －	3.03
11	ジャパン・ホテル・リート投資法人 日本	投資証券	60,322	69,196.15 4,174,050,230	82,200.00 4,958,468,400	－ －	2.53
12	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	82,331	43,316.94 3,566,327,004	55,300.00 4,552,904,300	－ －	2.33
13	日本プライムリアルティ投資法人 日本	投資証券	12,792	406,054.15 5,194,244,800	352,000.00 4,502,784,000	－ －	2.30
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	27,953	178,792.92 4,997,798,605	143,900.00 4,022,436,700	－ －	2.05
15	積水ハウス・リート投資法人 日本	投資証券	56,209	79,815.13 4,486,328,949	71,000.00 3,990,839,000	－ －	2.04
16	アクティビア・プロパティーズ投資法人 日本	投資証券	9,875	416,714.02 4,115,050,992	389,000.00 3,841,375,000	－ －	1.96
17	日本アコモデーションファンド投資法人 日本	投資証券	6,459	659,426.25 4,259,234,208	583,000.00 3,765,597,000	－ －	1.92
18	日本ロジスティクスファンド投資法人 日本	投資証券	12,613	323,671.86 4,082,473,210	296,100.00 3,734,709,300	－ －	1.91
19	ラサールロジポート投資法人 日本	投資証券	22,899	172,743.20 3,955,646,619	157,300.00 3,602,012,700	－ －	1.84
20	フロンティア不動産投資法人 日本	投資証券	6,940	527,272.72 3,659,272,746	501,000.00 3,476,940,000	－ －	1.78
21	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	10,884	333,103.30 3,625,496,413	308,500.00 3,357,714,000	－ －	1.72
22	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 日本	投資証券	7,389	531,903.76 3,930,236,911	453,500.00 3,350,911,500	－ －	1.71
23	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	21,996	153,836.86 3,383,795,678	147,600.00 3,246,609,600	－ －	1.66
24	イオンリート投資法人 日本	投資証券	20,706	154,450.67 3,198,055,745	143,600.00 2,973,381,600	－ －	1.52
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	25,921	116,251.57 3,013,357,019	108,700.00 2,817,612,700	－ －	1.44
26	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	17,501	163,771.46 2,866,164,386	155,200.00 2,716,155,200	－ －	1.39
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 日本	投資証券	13,718	213,924.60 2,934,617,798	193,600.00 2,655,804,800	－ －	1.36

28	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,426	454,875.26 2,923,028,483	408,500.00 2,625,021,000	－ －	1.34
29	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	8,702	330,113.24 2,872,645,478	288,900.00 2,514,007,800	－ －	1.28
30	東急リアル・エステート投資法人 日本	投資証券	12,541	196,924.85 2,469,634,610	195,800.00 2,455,527,800	－ －	1.25

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資証券	97.76
合計	97.76

（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

2023年1月31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	371,047	14,784.17 5,485,624,052	16,672.76 6,186,378,062	－ －	8.64
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	37,205	82,599.84 3,073,127,351	94,572.48 3,518,569,274	－ －	4.91
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	63,568	39,417.27 2,505,677,068	38,996.17 2,478,909,062	－ －	3.46
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	252,224	8,483.15 2,139,656,269	8,841.95 2,230,152,476	－ －	3.11
5	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	131,492	13,284.91 1,746,859,612	16,432.69 2,160,768,128	－ －	3.02
6	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	190,068	9,690.86 1,841,923,038	9,722.62 1,847,959,774	－ －	2.58
7	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	387,425	4,000.60 1,549,935,430	4,420.32 1,712,543,870	－ －	2.39
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	115,666	15,667.73 1,812,224,025	14,486.08 1,675,547,403	－ －	2.34
9	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	688,653	1,626.77 1,120,283,008	1,851.47 1,275,020,507	－ －	1.78
10	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	56,297	24,360.40 1,371,417,875	22,606.53 1,272,680,207	－ －	1.78
11	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	60,091	18,073.03 1,086,026,667	20,533.36 1,233,870,652	－ －	1.72

12	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	136,900	9,006.96 1,233,053,919	8,096.96 1,108,474,946	－ －	1.55
13	VENTAS INC アメリカ	投資証券	160,896	6,111.07 983,246,817	6,690.50 1,076,474,945	－ －	1.50
14	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	53,904	21,527.43 1,160,414,656	19,961.90 1,076,026,796	－ －	1.50
15	MID AMERICA アメリカ	投資証券	46,489	21,229.28 986,928,446	21,103.52 981,081,657	－ －	1.37
16	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	233,836	4,408.51 1,030,868,885	4,148.94 970,172,936	－ －	1.35
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	49,877	19,515.36 973,368,051	19,262.59 960,760,241	－ －	1.34
18	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	83,759	10,655.20 892,469,135	11,058.63 926,260,393	－ －	1.29
19	LINK REIT 香港	投資証券	848,620	1,010.62 857,632,528	1,070.59 908,528,328	－ －	1.27
20	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	117,078	6,365.81 745,296,928	7,105.39 831,885,576	－ －	1.16
21	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	216,512	3,243.19 702,190,290	3,540.95 766,659,422	－ －	1.07
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	26,084	32,298.61 842,477,085	28,643.38 747,134,023	－ －	1.04
23	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	249,147	2,591.24 645,601,503	2,884.69 718,712,282	－ －	1.00
24	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	103,742	6,149.78 637,991,319	6,865.33 712,223,210	－ －	0.99
25	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証券	288,079	2,197.05 632,926,146	2,417.60 696,462,411	－ －	0.97
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	42,922	16,492.27 707,881,248	15,627.69 670,771,993	－ －	0.94
27	UDR INC アメリカ	投資証券	123,303	5,625.70 693,665,855	5,396.23 665,372,482	－ －	0.93
28	SEGRO PLC イギリス	投資証券	487,318	1,499.57 730,769,205	1,354.02 659,839,740	－ －	0.92
29	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	70,501	8,863.65 624,896,531	8,826.29 622,262,659	－ －	0.87
30	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC アメリカ	投資証券	73,957	7,375.00 545,433,352	8,124.36 600,853,802	－ －	0.84

（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。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	10.74
投資証券	88.83
合計	99.58

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年1月31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	3,679,254,000	86.76 3,192,488,173	92.73 3,412,060,135	6 2033/2/22	2.55
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,348,460,000	99.93 2,346,976,556	100.23 2,353,861,458	4.375 2029/4/16	1.76
3	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,478,930,000	90.30 2,238,639,486	94.36 2,339,199,037	5.5 2029/2/22	1.75
4	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 カタール	国債証券	2,087,520,000	100.67 2,101,587,275	103.51 2,160,791,952	5.103 2048/4/23	1.62
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,087,520,000	99.80 2,083,388,015	100.18 2,091,421,574	4.817 2049/3/14	1.57
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,609,400,000	70.96 1,851,745,053	77.12 2,012,426,243	5.875 2060/1/30	1.51
7	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,348,460,000	83.89 1,970,309,666	84.88 1,993,548,841	2.783 2031/1/23	1.49
8	OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 オマーン	国債証券	1,826,580,000	98.24 1,794,588,756	100.79 1,841,009,982	5.625 2028/1/17	1.38
9	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,826,580,000	100.23 1,830,788,962	99.94 1,825,656,718	4.375 2031/1/23	1.37
10	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55 ウルグアイ	国債証券	1,826,580,000	95.67 1,747,620,860	99.74 1,821,896,685	4.975 2055/4/20	1.36
11	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,826,580,000	96.56 1,763,927,001	98.17 1,793,199,250	3.75 2030/4/16	1.34
12	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,826,580,000	92.98 1,698,406,272	94.46 1,725,387,468	4.4 2050/4/16	1.29
13	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,217,990,000	72.71 1,612,867,530	76.92 1,706,277,527	5.75 2049/9/30	1.28
14	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25 サウジアラビア	国債証券	1,696,110,000	100.32 1,701,653,670	99.34 1,684,915,674	4 2025/4/17	1.26

15	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	1,565,640,000	98.78 1,546,656,615	102.81 1,609,650,140	6 2029/8/1	1.21
16	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30 サウジアラビア	国債証券	1,565,640,000	98.81 1,547,093,689	100.40 1,571,991,801	4.5 2030/4/17	1.18
17	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,565,640,000	98.95 1,549,211,217	99.79 1,562,352,156	4 2029/3/14	1.17
18	SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52 南アフリカ	国債証券	1,696,110,000	86.51 1,467,401,308	91.01 1,543,782,360	7.3 2052/4/20	1.16
19	SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32 サウジアラビア	国債証券	1,435,170,000	104.52 1,500,180,591	107.13 1,537,497,621	5.5 2032/10/25	1.15
20	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	2,087,520,000	71.42 1,491,095,965	73.51 1,534,565,239	4.75 2050/1/14	1.15
21	HUNGARY 2.125 09/22/31 ハンガリー	国債証券	1,957,050,000	73.97 1,447,791,667	77.45 1,515,917,230	2.125 2031/9/22	1.14
22	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,565,640,000	96.70 1,513,997,364	96.25 1,506,928,500	2.5 2025/4/16	1.13
23	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,696,110,000	86.15 1,461,217,030	88.70 1,504,494,940	3.875 2030/6/12	1.13
24	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31 オマーン	国債証券	1,435,170,000	99.14 1,422,931,914	103.94 1,491,816,159	6.25 2031/1/25	1.12
25	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,565,640,000	86.20 1,349,733,025	91.54 1,433,294,885	4.85 2029/9/30	1.07
26	PANAMA 2.252 09/29/32 パナマ	国債証券	1,826,580,000	74.44 1,359,878,372	76.96 1,405,861,490	2.252 2032/9/29	1.05
27	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,696,110,000	77.87 1,320,807,826	81.53 1,382,875,203	3 2034/1/15	1.04
28	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25 サウジアラビア	国債証券	1,435,170,000	96.72 1,388,213,847	96.29 1,381,925,193	2.9 2025/10/22	1.03
29	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,435,170,000	96.73 1,388,337,793	96.15 1,380,022,157	2.125 2024/9/30	1.03
30	STATE OF QATAR 4.5 04/23/28 カタール	国債証券	1,304,700,000	100.61 1,312,669,107	102.13 1,332,490,110	4.5 2028/4/23	1.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
国債証券	97.32
合計	97.32

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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

2023年1月31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	2,555,294	2,302.77 5,884,257,768	2,354.23 6,015,751,837	－ －	5.92
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	648,100	5,484.22 3,554,328,695	6,446.88 4,178,222,928	－ －	4.11
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	495,712	6,750.24 3,346,177,210	6,716.12 3,329,266,234	－ －	3.28
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	1,538,668	1,560.23 2,400,690,676	1,814.84 2,792,451,619	－ －	2.75
5	MEITUAN ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	526,110	2,822.91 1,485,161,900	2,888.77 1,519,813,415	－ －	1.50
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガス・消耗燃料	316,568	4,177.29 1,322,398,672	3,799.19 1,202,704,354	－ －	1.18
7	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱業	396,789	2,125.47 843,365,606	2,418.50 959,635,876	－ －	0.94
8	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	223,735	3,851.50 861,715,568	3,952.70 884,359,571	－ －	0.87
9	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術サービス	350,646	2,653.53 930,450,583	2,477.46 868,714,244	－ －	0.85
10	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	9,981,530	90.07 899,065,269	85.58 854,229,318	－ －	0.84

11	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 各種金融サービス	179,804	3,889.50 699,348,636	4,263.60 766,612,694	－ －	0.75
12	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	536,948	1,300.53 698,322,086	1,325.83 711,904,451	－ －	0.70
13	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	659,000	871.39 574,249,106	1,013.98 668,216,115	－ －	0.66
14	PINDUODUO INC ADR ケイマン諸島	株式 インターネット販売・通信販売	52,294	7,137.36 373,241,576	12,675.16 662,834,843	－ －	0.65
15	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	204,748	3,457.46 707,909,597	2,850.93 583,724,058	－ －	0.57
16	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 インターネット販売・通信販売	22,668	14,565.65 330,174,254	25,194.62 571,111,716	－ －	0.56
17	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装置・機器・部品	1,303,150	454.77 592,641,884	425.32 554,258,833	－ －	0.55
18	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・半導体製造装置	56,210	10,723.73 602,781,410	9,623.26 540,924,006	－ －	0.53
19	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術サービス	95,636	5,626.72 538,117,664	5,528.17 528,692,687	－ －	0.52
20	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コンピュータ・周辺機器	86,098	6,126.72 527,498,704	6,079.52 523,435,373	－ －	0.52
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	229,350	2,314.50 530,831,399	2,266.06 519,722,007	－ －	0.51
22	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・半導体製造装置	158,073	3,311.01 523,382,195	3,204.00 506,467,219	－ －	0.50

23	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	202,700	2,427.00 491,952,978	2,342.65 474,856,168	－ －	0.47
24	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	5,808,900	68.88 400,123,186	75.69 439,675,641	－ －	0.43
25	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	376,500	1,057.84 398,276,966	1,115.55 420,004,575	－ －	0.41
26	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	8,265,200	49.41 408,399,569	50.11 414,222,895	－ －	0.41
27	SAMSUNG SDI CO LTD 韓国	株式 電子装置・機器・部品	5,633	64,422.01 362,889,211	72,890.69 410,593,313	－ －	0.40
28	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,857,235	73.53 430,696,948	69.92 409,596,443	－ －	0.40
29	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信サービス	2,871,978	138.04 396,453,503	138.36 397,391,365	－ －	0.39
30	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	229,007	2,449.70 560,999,650	1,643.03 376,265,829	－ －	0.37

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年1月31日現在

種類	投資比率（%）
株式	91.12
投資信託受益証券	0.58
投資証券	0.09
合計	91.79

（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

2023年1月31日現在

業種	国内／外国	投資比率（%）
銀行	外国	13.89
半導体・半導体製造装置		8.51
インターネット販売・通信販売		6.69
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.52
コンピュータ・周辺機器		4.79
石油・ガス・消耗燃料		4.16
金属・鉱業		4.01
化学		2.93
保険		2.55
電子装置・機器・部品		2.51
自動車		2.49
情報技術サービス		2.07
食品		1.71

不動産管理・開発	1.68
無線通信サービス	1.52
各種金融サービス	1.46
飲料	1.32
食品・生活必需品小売り	1.28
各種電気通信サービス	1.21
医薬品	1.17
ホテル・レストラン・レジャー	1.16
繊維・アパレル・贅沢品	1.10
コングロマリット	1.09
電気設備	1.00
娯楽	0.98
電力	0.95
資本市場	0.88
ライフサイエンス・ツール／サービス	0.85
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.82
建設資材	0.78
専門小売り	0.76
ヘルスケア・プロバイダー／ヘルスケア・サービス	0.73
パーソナル用品	0.71
バイオテクノロジー	0.68
運送インフラ	0.65
ガス	0.54
建設・土木	0.54
消費者金融	0.53
自動車部品	0.51
機械	0.46
海運業	0.36
家庭用耐久財	0.35
タバコ	0.31
旅客航空輸送業	0.28
航空貨物・物流サービス	0.28
ソフトウェア	0.26
陸運・鉄道	0.25
ヘルスケア機器・用品	0.24
商社・流通業	0.18
複合小売り	0.18
各種消費者サービス	0.17
航空宇宙・防衛	0.16
紙製品・林産品	0.16
通信機器	0.14
メディア	0.13
水道	0.12
家庭用品	0.09
エネルギー設備・サービス	0.07
商業サービス・用品	0.07
建設関連製品	0.04
容器・包装	0.04
総合公益事業	0.03
レジャー用品	0.03

合計	91.12

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

②【投資不動産物件】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
該当事項はありません。

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
該当事項はありません。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
該当事項はありません。

（参考）
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ先物　０５０３月	買建	450	8,560,603,500	8,889,750,000	2.31

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31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	510	13,152,940,009	13,416,067,012	1.63
	ＥＵＲＥＸ取引所	DJ EURO STOXX 50 Mar23	買建	491	2,831,587,874	2,895,618,293	0.35
	ＩＣＥ－ＥＵ	FTSE 100 INDEX FUTURE Mar23	買建	68	843,616,271	851,373,358	0.10
	モントリオール取引所	S&P/TSE 60 IX FUT Mar23	買建	28	660,386,385	677,754,257	0.08
	シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Mar23	買建	27	446,099,518	460,865,774	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。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	ＴＲＥＩＴ先物　０５０３月	買建	2,337	4,474,887,600	4,240,486,500	2.17

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建／売建	数量	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）

株価指数先物取引	ＩＣＥ－ＵＳ	MINI MSCI EMG MKT Mar23	買建	1,216	7,879,038,287	8,309,373,360	8.18

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

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
直近日（2023年1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(2020年1月14日)	17	17	1.0702	1.0702
第2計算期間末(2021年1月12日)	181	181	1.0566	1.0566
第3計算期間末(2022年1月11日)	908	908	1.1159	1.1159
第4計算期間末(2023年1月11日)	1,992	1,992	1.0115	1.0115
2022年1月末日	945	－	1.0913	－
2月末日	954	－	1.0738	－
3月末日	1,032	－	1.0912	－
4月末日	1,052	－	1.0665	－
5月末日	1,507	－	1.0591	－
6月末日	1,550	－	1.0342	－
7月末日	1,668	－	1.0601	－
8月末日	1,709	－	1.0511	－
9月末日	1,681	－	1.0119	－
10月末日	1,784	－	1.0186	－
11月末日	1,874	－	1.0289	－
12月末日	1,943	－	1.0060	－
2023年1月末日	2,045	－	1.0167	－

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
直近日（2023年1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(2020年1月14日)	14	14	1.0698	1.0698
第2計算期間末(2021年1月12日)	97	97	1.0590	1.0590
第3計算期間末(2022年1月11日)	376	376	1.1173	1.1173
第4計算期間末(2023年1月11日)	880	880	1.0111	1.0111
2022年1月末日	385	－	1.0917	－

2月末日	398	－	1.0742	－
3月末日	440	－	1.0955	－
4月末日	457	－	1.0701	－
5月末日	646	－	1.0617	－
6月末日	681	－	1.0370	－
7月末日	719	－	1.0624	－
8月末日	750	－	1.0518	－
9月末日	748	－	1.0103	－
10月末日	770	－	1.0177	－
11月末日	812	－	1.0292	－
12月末日	859	－	1.0047	－
2023年1月末日	904	－	1.0169	－

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）
直近日（2023年1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(2020年1月14日)	14	14	1.0699	1.0699
第2計算期間末(2021年1月12日)	96	96	1.0560	1.0560
第3計算期間末(2022年1月11日)	324	324	1.1141	1.1141
第4計算期間末(2023年1月11日)	543	543	1.0083	1.0083
2022年1月末日	328	－	1.0886	－
2月末日	325	－	1.0717	－
3月末日	348	－	1.0931	－
4月末日	345	－	1.0673	－
5月末日	427	－	1.0590	－
6月末日	441	－	1.0334	－
7月末日	467	－	1.0587	－
8月末日	477	－	1.0483	－
9月末日	480	－	1.0072	－
10月末日	500	－	1.0149	－
11月末日	522	－	1.0264	－
12月末日	537	－	1.0020	－
2023年1月末日	555	－	1.0142	－

②【分配の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

	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

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

	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

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

	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

③【収益率の推移】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

	収益率（%）
第1計算期間	7.0
第2計算期間	△1.3
第3計算期間	5.6
第4計算期間	△9.4

（注）収益率は期間騰落率です。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

	収益率（%）
第1計算期間	7.0
第2計算期間	△1.0
第3計算期間	5.5
第4計算期間	△9.5

（注）収益率は期間騰落率です。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

	収益率（%）
第1計算期間	7.0
第2計算期間	△1.3
第3計算期間	5.5
第4計算期間	△9.5

（注）収益率は期間騰落率です。

（４）【設定及び解約の実績】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	15,978,994	0
第2計算期間	166,986,041	10,985,689
第3計算期間	681,883,755	39,784,704
第4計算期間	1,284,576,861	129,179,109

（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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	13,549,161	0

第2計算期間	88,254,390	9,900,540
第3計算期間	276,898,986	31,426,491
第4計算期間	603,241,361	69,560,474

（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。

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

	設定口数	解約口数
第1計算期間	13,529,038	0
第2計算期間	93,411,729	15,869,764
第3計算期間	269,230,751	69,224,021
第4計算期間	327,388,419	79,755,585

（注1）本邦外における設定及び解約はありません。

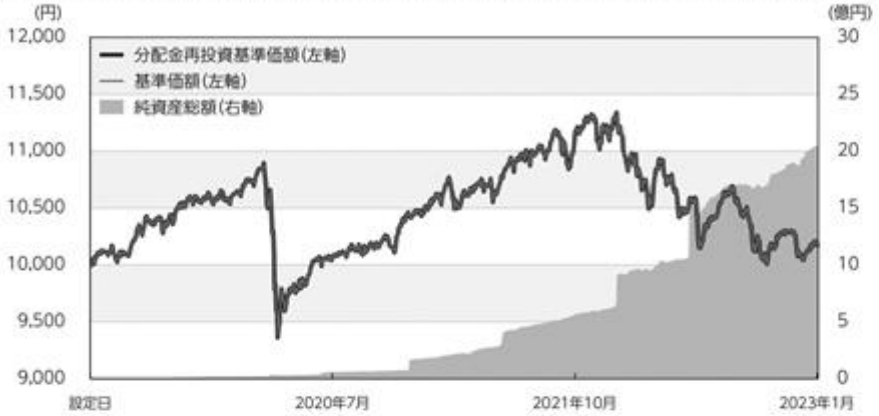
（注2）第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

＜＜参考情報＞＞

データの基準日:2023年1月31日

ターゲット・イヤー2040

基準価額・純資産の推移 《2019年3月18日～2023年1月31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:2019年3月18日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
設定来累計	0円

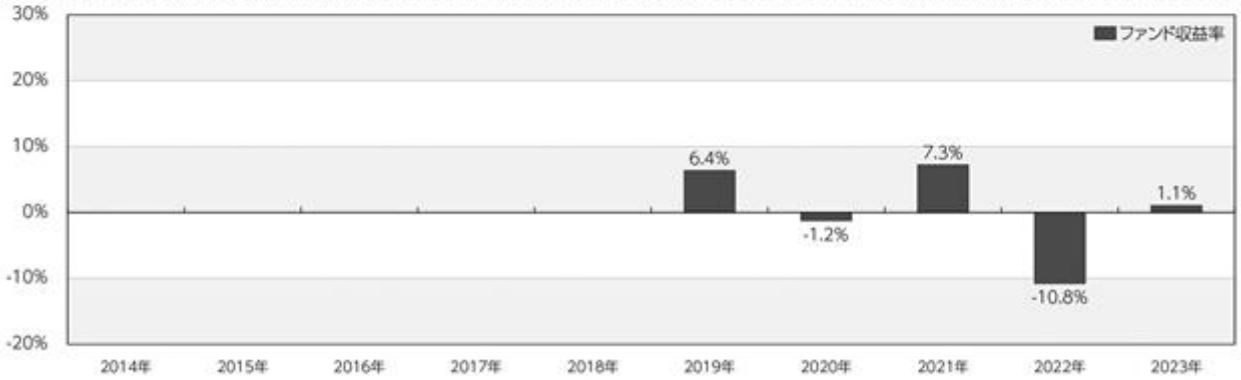
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	36.66
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.39
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.75
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.59
5	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	6.31
6	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.83
7	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.59
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.07

年間収益率の推移(暦年ベース)



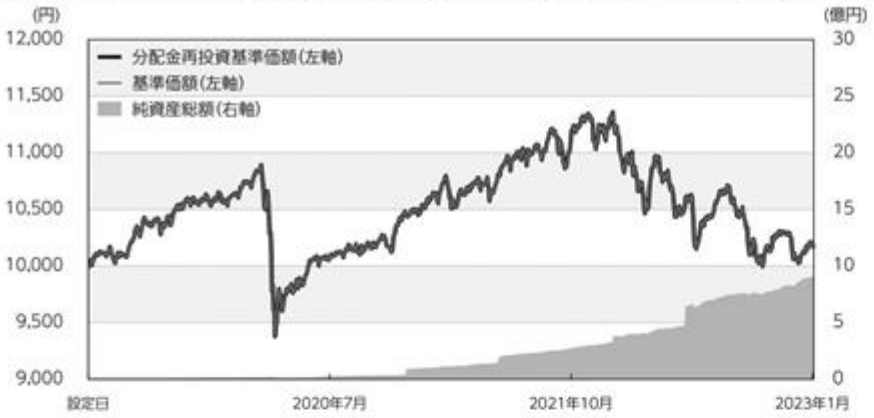
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2023年1月31日

ターゲット・イヤー2050

基準価額・純資産の推移 《2019年3月18日～2023年1月31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:2019年3月18日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
設定来累計	0円

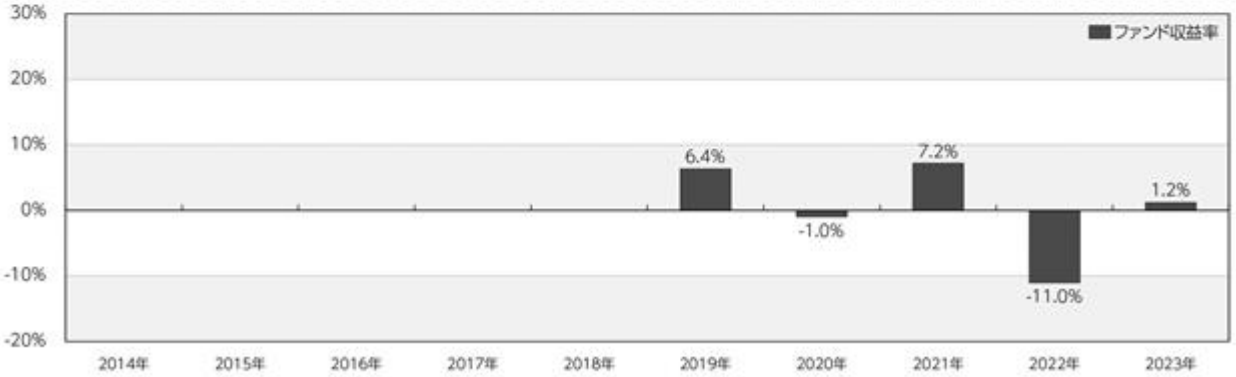
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	36.87
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.90
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.82
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.56
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.14
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	6.06
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.51
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.55

年間収益率の推移(暦年ベース)



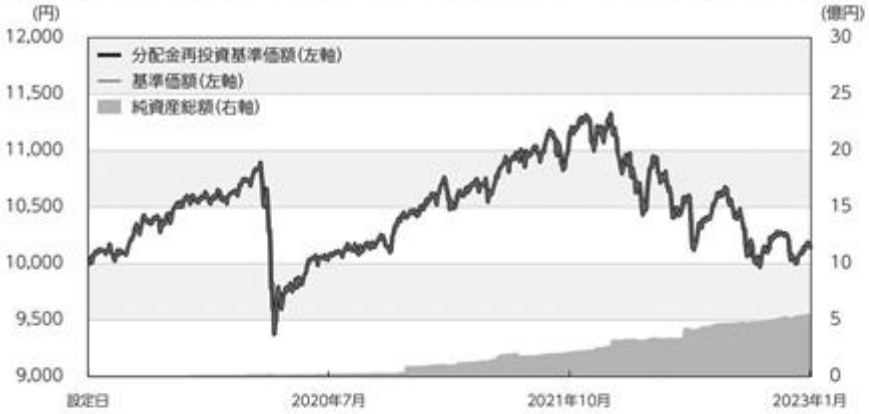
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2023年1月31日

ターゲット・イヤー2060

基準価額・純資産の推移 《2019年3月18日～2023年1月31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:2019年3月18日)

分配の推移(税引前)

2020年 1月	0円
2021年 1月	0円
2022年 1月	0円
2023年 1月	0円
設定来累計	0円

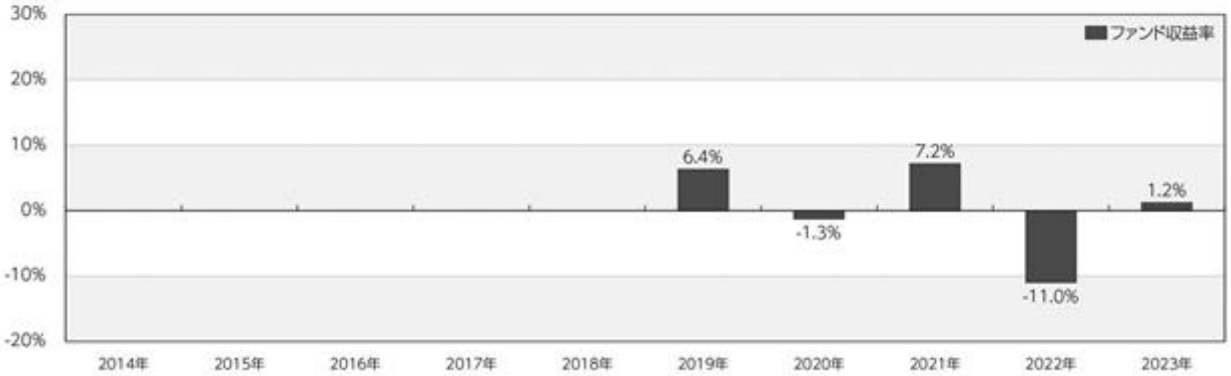
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	35.82
2	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25.52
3	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.88
4	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	7.21
5	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.18
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	6.14
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	4.35
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	2.59

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。
※2019年は設定日から年末までの収益率、および2023年については年初から基準日までの収益率を表示しています。
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

データの基準日:2023年1月31日

主要な資産の状況

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	335回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	1.16
2	334回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	1.11
3	437回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2024/6/1	0.96
4	438回　利付国庫債券(2年)	国債証券	日本	0.005	2024/7/1	0.95
5	368回　利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.2	2032/9/20	0.93

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.58
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.82
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	2.05
4	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.04
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.72

■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	1.12
2	US T N/B 0.375 08/15/24	国債証券	アメリカ	0.375	2024/8/15	0.87
3	US T N/B 0.625 10/15/24	国債証券	アメリカ	0.625	2024/10/15	0.84
4	US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	アメリカ	2.25	2024/11/15	0.83
5	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.62

■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	4.54
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	3.40
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	インターネット販売・通信販売	1.82
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	1.14
5	ALPHABET INC-CL C	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	1.07

■J-REITインデックスファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人	投資証券	日本	6.32
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.32
3	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.84
4	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.74
5	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.69

○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:2023年1月31日

■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	8.64
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	4.91
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.46
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.11
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	アメリカ	3.02

■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	2.55
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	1.76
3	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.75
4	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	国債証券	カタール	5.103	2048/4/23	1.62
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.57

■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	5.92
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	4.11
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.28
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	2.75
5	MEITUAN	株式	ケイマン諸島	インターネット販売・通信販売	1.50

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

各ファンドは、収益の分配が行われた場合に収益分配金を受領する「分配金受取コース」と、収益分配金を無手数料で再投資する「分配金再投資コース」があり、「分配金再投資コース」を取得申込者が選択した場合には、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。

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額※とします。

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

※「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口当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各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額としますが、2023年4月11日現在の各販売会社における申込手数料は無手数料です。なお、申込手数料は変更になる場合があります。

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

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

※詳しくは販売会社にお問い合わせください。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

※取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

※確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

※当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

※海外休業日には、解約の受付を行いません。

※解約の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権

の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

※各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

・販売会社へのお問い合わせ

・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

※解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

３【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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

＜主な投資対象の時価評価方法の原則＞

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

※外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

※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】

ターゲット・イヤー２０４０：2019年3月18日（設定日）から原則として2055年1月8日までです。

ターゲット・イヤー２０５０：2019年3月18日（設定日）から原則として2065年1月9日までです。

ターゲット・イヤー２０６０：2019年3月18日（設定日）から原則として2075年1月11日までです。

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

（４）【計算期間】

a.計算期間は、原則として毎年1月12日から翌年1月11日までとします。

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

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

（５）【その他】

イ.償還規定

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ロ.信託約款の変更等

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

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

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

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

e.書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。

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

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

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

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

ハ.関係法人との契約の更改

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

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

ニ.公告

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

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

ホ.運用報告書

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

（URL　http://www.am-one.co.jp/）

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

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

（２）当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間（2022年1月12日から2023年1月11日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

１【財務諸表】

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	23,738,062	36,634,494
親投資信託受益証券	886,838,927	1,955,741,218
派生商品評価勘定	601,886	7,763,837
流動資産合計	911,178,875	2,000,139,549
資産合計	911,178,875	2,000,139,549
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	336,875	678,282
未払解約金	145,844	30,777
未払受託者報酬	91,578	292,302
未払委託者報酬	2,198,854	7,016,085
その他未払費用	10,787	34,604
流動負債合計	2,783,938	8,052,050
負債合計	2,783,938	8,052,050
純資産の部		
元本等		
元本	814,078,397	1,969,476,149
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	94,316,540	22,611,350
（分配準備積立金）	19,512,288	36,201,535
元本等合計	908,394,937	1,992,087,499
純資産合計	908,394,937	1,992,087,499
負債純資産合計	911,178,875	2,000,139,549

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
営業収益		
受取利息	48	318
有価証券売買等損益	23,778,095	△101,957,709
為替差損益	△3,482,392	△9,098,284
営業収益合計	20,295,751	△111,055,675
営業費用		
支払利息	2,603	16,624
受託者報酬	137,070	474,299
委託者報酬	3,291,580	11,385,083
その他費用	16,094	56,115
営業費用合計	3,447,347	11,932,121
営業利益又は営業損失（△）	16,848,404	△122,987,796
経常利益又は経常損失（△）	16,848,404	△122,987,796
当期純利益又は当期純損失（△）	16,848,404	△122,987,796
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,024,873	△6,138,732
期首剰余金又は期首欠損金（△）	9,736,542	94,316,540
剰余金増加額又は欠損金減少額	71,429,995	56,950,377
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	71,429,995	56,950,377
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,673,528	11,806,503
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,673,528	11,806,503
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	94,316,540	22,611,350

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
１．　期首元本額	171,979,346円	814,078,397円
期中追加設定元本額	681,883,755円	1,284,576,861円
期中一部解約元本額	39,784,704円	129,179,109円
２．　受益権の総数	814,078,397口	1,969,476,149口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（6,673,892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（9,149,639円）、信託約款に規定される収益調整金（74,804,252円）及び分配準備積立金（3,688,757円）より分配対象収益は94,316,540円（1万口当たり1,158.56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（18,503,952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（163,936,975円）及び分配準備積立金（17,697,583円）より分配対象収益は200,138,510円（1万口当たり1,016.20円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	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3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	20,987,510	△71,799,913
合計	20,987,510	△71,799,913

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第3期 2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	34,388,495	－	34,587,136	△198,641
アメリカ・ドル	9,246,853	－	9,177,752	69,101
イギリス・ポンド	8,630,271	－	8,830,886	△200,615
オーストラリア・ドル	4,596,320	－	4,559,455	36,865
カナダ・ドル	8,820,181	－	8,868,113	△47,932
ユーロ	3,094,870	－	3,150,930	△56,060
買建	20,386,278	－	20,849,930	463,652
イギリス・ポンド	8,492,796	－	8,830,886	338,090
カナダ・ドル	8,732,751	－	8,868,114	135,363
ユーロ	3,160,731	－	3,150,930	△9,801
合計	54,774,773	－	55,437,066	265,011

種類	第4期 2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

売建	395,728,328	－	389,240,337	6,487,991
イギリス・ポンド	162,235,356	－	158,783,314	3,452,042
オーストラリア・ドル	62,600,089	－	61,765,567	834,522
カナダ・ドル	23,712,234	－	22,481,583	1,230,651
ユーロ	147,180,649	－	146,209,873	970,776
買建	80,923,961	－	81,521,525	597,564
イギリス・ポンド	10,237,090	－	10,197,534	△39,556
オーストラリア・ドル	12,106,299	－	12,176,562	70,263
カナダ・ドル	12,662,381	－	12,629,331	△33,050
ユーロ	45,918,191	－	46,518,098	599,907
合計	476,652,289	－	470,761,862	7,085,555

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1159円 (11,159円)	1.0115円 (10,115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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	21,858,666	70,712,784	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	607,579,349	750,238,980	
	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	43,369,508	100,187,900	

	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	29,873,525	176,331,468	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	37,554,612	59,512,793	
	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	427,259,606	517,368,656	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	90,344,235	127,322,130	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	79,069,288	154,066,507	
親投資信託受益証券　合計		1,336,908,789	1,955,741,218	
合計			1,955,741,218	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,194,670	18,643,703
親投資信託受益証券	368,257,748	861,887,937
派生商品評価勘定	124,645	4,275,687
流動資産合計	378,577,063	884,807,327
資産合計	378,577,063	884,807,327
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	71,124	528,334
未払解約金	318,725	30,692
未払受託者報酬	44,858	127,976
未払委託者報酬	1,197,513	3,413,913
その他未払費用	5,246	15,099
流動負債合計	1,637,466	4,116,014
負債合計	1,637,466	4,116,014
純資産の部		
元本等		
元本	337,375,506	871,056,393
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	39,564,091	9,634,920
（分配準備積立金）	10,327,520	16,832,735
元本等合計	376,939,597	880,691,313
純資産合計	376,939,597	880,691,313
負債純資産合計	378,577,063	884,807,327

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
営業収益		
受取利息	32	160
有価証券売買等損益	13,324,195	△47,119,811
為替差損益	△2,145,102	△2,193,132
営業収益合計	11,179,125	△49,312,783
営業費用		
支払利息	1,225	8,446
受託者報酬	67,906	205,975
委託者報酬	1,813,334	5,495,104
その他費用	7,888	24,277
営業費用合計	1,890,353	5,733,802
営業利益又は営業損失（△）	9,288,772	△55,046,585
経常利益又は経常損失（△）	9,288,772	△55,046,585
当期純利益又は当期純損失（△）	9,288,772	△55,046,585
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（△）	848,045	△3,499,539
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,418,247	39,564,091
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,946,720	27,878,770
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	27,946,720	27,878,770
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,241,603	6,260,895
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,241,603	6,260,895
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	39,564,091	9,634,920

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
１．　期首元本額	91,903,011円	337,375,506円
期中追加設定元本額	276,898,986円	603,241,361円
期中一部解約元本額	31,426,491円	69,560,474円
２．　受益権の総数	337,375,506口	871,056,393口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（3,281,322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（5,159,405円）、信託約款に規定される収益調整金（29,236,571円）及び分配準備積立金（1,886,793円）より分配対象収益は39,564,091円（1万口当たり1,172.70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（7,648,655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（79,736,900円）及び分配準備積立金（9,184,080円）より分配対象収益は96,569,635円（1万口当たり1,108.64円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	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3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	12,242,947	△32,149,207
合計	12,242,947	△32,149,207

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第3期 2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	11,700,826	－	11,711,770	△10,944
アメリカ・ドル	3,845,111	－	3,816,377	28,734
イギリス・ポンド	1,543,326	－	1,581,416	△38,090
オーストラリア・ドル	1,901,422	－	1,890,100	11,322
カナダ・ドル	2,854,309	－	2,868,024	△13,715
ユーロ	1,556,658	－	1,555,853	805
買建	5,940,829	－	6,005,294	64,465
イギリス・ポンド	1,588,093	－	1,581,417	△6,676
カナダ・ドル	2,792,043	－	2,868,024	75,981
ユーロ	1,560,693	－	1,555,853	△4,840
合計	17,641,655	－	17,717,064	53,521

種類	第4期 2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

売建	190,727,761	－	187,223,398	3,504,363
アメリカ・ドル	3,758,032	－	3,530,862	227,170
イギリス・ポンド	78,584,690	－	76,898,390	1,686,300
オーストラリア・ドル	28,842,471	－	28,484,782	357,689
カナダ・ドル	14,586,369	－	13,797,078	789,291
ユーロ	64,956,199	－	64,512,286	443,913
買建	60,878,266	－	61,121,256	242,990
アメリカ・ドル	3,635,942	－	3,530,862	△105,080
イギリス・ポンド	15,996,547	－	16,146,097	149,550
オーストラリア・ドル	6,750,206	－	6,761,723	11,517
カナダ・ドル	9,617,381	－	9,479,358	△138,023
ユーロ	24,878,190	－	25,203,216	325,026
合計	251,606,027	－	248,344,654	3,747,353

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1173円 (11,173円)	1.0111円 (10,111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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	16,535,911	53,493,672	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	260,718,800	321,935,574	

	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	17,202,404	39,739,273	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	13,325,336	78,654,128	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	13,793,656	21,858,806	
	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	188,890,570	228,727,591	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	38,192,588	53,824,814	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	32,668,247	63,654,079	
親投資信託受益証券　合計		581,327,512	861,887,937	
合計			861,887,937	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

【投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,728,896	9,538,105
親投資信託受益証券	314,549,108	533,480,601
派生商品評価勘定	101,313	2,715,018
流動資産合計	325,379,317	545,733,724
資産合計	325,379,317	545,733,724
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	66,908	240,478
未払解約金	－	30,689
未払受託者報酬	36,558	81,976
未払委託者報酬	976,212	2,187,333
その他未払費用	4,243	9,643
流動負債合計	1,083,921	2,550,119
負債合計	1,083,921	2,550,119
純資産の部		
元本等		
元本	291,077,733	538,710,567
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	33,217,663	4,473,038
（分配準備積立金）	8,340,748	11,995,373
元本等合計	324,295,396	543,183,605
純資産合計	324,295,396	543,183,605
負債純資産合計	325,379,317	545,733,724

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
営業収益		
受取利息	20	92
有価証券売買等損益	12,769,603	△33,628,507
為替差損益	△2,144,519	△1,642,186
営業収益合計	10,625,104	△35,270,601
営業費用		
支払利息	1,064	5,058
受託者報酬	59,512	140,255
委託者報酬	1,589,474	3,742,538
その他費用	6,891	16,459
営業費用合計	1,656,941	3,904,310
営業利益又は営業損失（△）	8,968,163	△39,174,911
経常利益又は経常損失（△）	8,968,163	△39,174,911
当期純利益又は当期純損失（△）	8,968,163	△39,174,911
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	1,890,193	△3,922,256
期首剰余金又は期首欠損金（△）	5,095,843	33,217,663
剰余金増加額又は欠損金減少額	25,505,608	14,206,018
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	25,505,608	14,206,018
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,461,758	7,697,988
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,461,758	7,697,988
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	33,217,663	4,473,038

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
１．　期首元本額	91,071,003円	291,077,733円
期中追加設定元本額	269,230,751円	327,388,419円
期中一部解約元本額	69,224,021円	79,755,585円
２．　受益権の総数	291,077,733口	538,710,567口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,855,550円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（4,222,420円）、信託約款に規定される収益調整金（24,876,915円）及び分配準備積立金（1,262,778円）より分配対象収益は33,217,663円（1万口当たり1,141.19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（5,240,788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（46,663,508円）及び分配準備積立金（6,754,585円）より分配対象収益は58,658,881円（1万口当たり1,088.87円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自　2021年1月13日 至　2022年1月11日	第4期 自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	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3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
１． 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	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	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	10,325,980	△21,448,856
合計	10,325,980	△21,448,856

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	第3期 2022年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	9,870,522	－	9,886,896	△16,374
アメリカ・ドル	3,275,895	－	3,251,414	24,481
イギリス・ポンド	1,342,705	－	1,377,868	△35,163
オーストラリア・ドル	1,623,187	－	1,616,533	6,654
カナダ・ドル	2,283,447	－	2,294,419	△10,972
ユーロ	1,345,288	－	1,346,662	△1,374
買建	4,968,171	－	5,018,950	50,779
イギリス・ポンド	1,383,685	－	1,377,868	△5,817
カナダ・ドル	2,233,634	－	2,294,419	60,785
ユーロ	1,350,852	－	1,346,663	△4,189
合計	14,838,693	－	14,905,846	34,405

種類	第4期 2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				

売建	116,331,096	－	113,968,568	2,362,528
アメリカ・ドル	2,425,894	－	2,279,250	146,644
イギリス・ポンド	47,250,169	－	46,129,414	1,120,755
オーストラリア・ドル	17,690,570	－	17,427,590	262,980
カナダ・ドル	9,112,362	－	8,596,188	516,174
ユーロ	39,852,101	－	39,536,126	315,975
買建	35,380,323	－	35,492,335	112,012
アメリカ・ドル	2,347,082	－	2,279,250	△67,832
イギリス・ポンド	8,244,496	－	8,321,573	77,077
オーストラリア・ドル	3,913,137	－	3,913,244	107
カナダ・ドル	5,999,123	－	5,907,426	△91,697
ユーロ	14,876,485	－	15,070,842	194,357
合計	151,711,419	－	149,460,903	2,474,540

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第3期 2022年1月11日現在	第4期 2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1141円 (11,141円)	1.0083円 (10,083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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	10,207,719	33,021,970	
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	161,227,928	199,084,245	

	Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド	10,618,723	24,530,312	
	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,232,922	48,595,645	
	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	8,621,171	13,661,969	
	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	116,592,753	141,182,164	
	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	23,864,626	33,632,417	
	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	20,411,537	39,771,879	
親投資信託受益証券　合計		359,777,379	533,480,601	
合計			533,480,601	

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

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）」、「投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）」は、「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド」受益証券、「為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド」受益証券、「外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券、「エマージング債券パッシブ・マザーファンド」受益証券及び「エマージング株式パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券であります。

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,053,655,090
国債証券	454,459,252,500
地方債証券	33,085,236,568
特殊債券	30,336,795,621
社債券	26,305,786,990
未収利息	573,223,919
前払費用	218,738,821
流動資産合計	549,032,689,509
資産合計	549,032,689,509
負債の部	
流動負債	
未払金	890,550,000
未払解約金	3,570,847,000
流動負債合計	4,461,397,000
負債合計	4,461,397,000
純資産の部	
元本等	
元本	441,014,150,576
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	103,557,141,933
元本等合計	544,571,292,509
純資産合計	544,571,292,509
負債純資産合計	549,032,689,509

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	369,783,791,323円
同期中追加設定元本額	1,169,484,119,608円
同期中一部解約元本額	1,098,253,760,355円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ国内債券パッシブ・ファンド	25,571,332,599円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	58,809,581円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	124,020,616円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	75,850,769円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	742,020,244円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	171,025,697円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	48,241,237円
たわらノーロード　国内債券	17,364,958,987円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,616,037,121円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,199,717,259円
たわらノーロード　バランス（標準型）	2,109,138,614円
たわらノーロード　バランス（積極型）	269,480,830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）	104,558,442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）	1,542,760,375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）	1,666,622,304円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	476,258,871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）	85,583,914円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	26,216,858円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	17,817,056円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	148,222,785円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,644,448円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	62,284円
ＤＩＡＭ国内債券インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	13,867,302,113円
Ｏｎｅグローバルバランス	17,028,893円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	9,659,577,766円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	13,589,090,732円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	5,756,072,336円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	2,332,626,189円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	2,419,618,075円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	410,790,143円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	97,387,528円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	3,538,729,678円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	13,441,521円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	4,592,822,348円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	1,937,579,442円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	377,779,353円
投資のソムリエ	80,029,834,906円
クルーズコントロール	169,807,558円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	5,784,022,021円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	5,545,357,902円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	1,253,348,629円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	6,328,603,093円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	27,477,190,803円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	486,265,731円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	243,888,522円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	43,535,284円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,900,114,047円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	3,357,257,288円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	6,230,472,381円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,384,001,424円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	607,579,349円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	260,718,800円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	161,227,928円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	1,170,539,158円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	34,161,306円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,906,690,506円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	1,951,282,575円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	1,531,718,947円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	1,187,822,769円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	1,876,345,673円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	4,856,348,265円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	1,872,779,890円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	1,693,642,819円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	1,920,698,394円
ＤＩＡＭ国内債券パッシブファンド（適格機関投資家向け）	9,123,851,273円
Ｏｎｅコアポートフォリオ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	2,647,924,770円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	2,137,889,400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）	572,063,871円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	259,022,731円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅡ（適格機関投資家限定）	5,397,074,453円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅢ（適格機関投資家限定）	5,408,411,752円
Ｏｎｅ収益追求型マルチアセット戦略ファンドⅣ（適格機関投資家限定）	5,364,968,629円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	3,234,781,518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）	42,202,559円
ＡＭＯｎｅコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,052,664,270円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	73,817,129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）	144,547,692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）	94,214,793円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,938,554円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	81,650,343円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	29,866,214円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	321,234円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	23,373,943円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	104,660,524円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,040,314,338円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	2,081,148,646円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,076,894,090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）	63,014,352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）	146,651,765円
ＤＩＡＭ　アクサ　グローバル　バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,806,576,968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）	146,600,056円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	530,150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）	1,969,194,963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）	42,545,996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）	289,097,684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）	442,250,998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）	775,955,494円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	275,148,153円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	95,648,909円
コアサテライト戦略ファンド（適格機関投資家限定）	905,339,373円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	371,987,197円
コア資産形成ファンド	248,361,857円
ＭＨＡＭ日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）	46,931,506,941円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	49,382,497,717円
ＭＨＡＭ日本債券パッシブファンド［適格機関投資家限定］	11,120,562,428円
ＭＨＡＭ動的パッケージ４資産ファンド［適格機関投資家限定］	1,689,593,873円
計	441,014,150,576円
２．　受益権の総数	441,014,150,576口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△11,417,672,250
地方債証券	△1,136,858,716
特殊債券	△1,432,220,894
社債券	△950,302,050
合計	△14,937,053,910

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年2月15日から2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2348円

（1万口当たり純資産額）	(12,348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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	４３５回　利付国庫債券（２年）	3,720,000,000	3,720,446,400	
	４３７回　利付国庫債券（２年）	3,850,000,000	3,850,000,000	
	４３８回　利付国庫債券（２年）	3,800,000,000	3,799,696,000	
	４３９回　利付国庫債券（２年）	3,900,000,000	3,899,376,000	
	４４０回　利付国庫債券（２年）	1,700,000,000	1,699,711,000	
	４４１回　利付国庫債券（２年）	1,100,000,000	1,099,802,000	
	４４２回　利付国庫債券（２年）	1,500,000,000	1,499,715,000	
	１３９回　利付国庫債券（５年）	2,550,000,000	2,553,162,000	
	１４０回　利付国庫債券（５年）	5,390,000,000	5,396,575,800	
	１４１回　利付国庫債券（５年）	2,810,000,000	2,814,018,300	
	１４２回　利付国庫債券（５年）	5,230,000,000	5,238,054,200	
	１４３回　利付国庫債券（５年）	3,100,000,000	3,104,712,000	
	１４４回　利付国庫債券（５年）	5,000,000,000	5,007,900,000	
	１４５回　利付国庫債券（５年）	4,850,000,000	4,857,808,500	
	１４６回　利付国庫債券（５年）	4,400,000,000	4,407,084,000	
	１４７回　利付国庫債券（５年）	3,350,000,000	3,344,673,500	
	１４８回　利付国庫債券（５年）	4,910,000,000	4,897,381,300	
	１４９回　利付国庫債券（５年）	4,410,000,000	4,392,977,400	
	１５０回　利付国庫債券（５年）	4,020,000,000	3,997,930,200	
	１５１回　利付国庫債券（５年）	3,500,000,000	3,475,255,000	

１５２回　利付国庫債券（５年）	2,730,000,000	2,721,482,400	
１５３回　利付国庫債券（５年）	4,710,000,000	4,668,552,000	
１５４回　利付国庫債券（５年）	5,000,000,000	4,969,850,000	
１回　利付国庫債券（４０年）	110,000,000	130,846,100	
２回　利付国庫債券（４０年）	630,000,000	720,354,600	
３回　利付国庫債券（４０年）	540,000,000	619,569,000	
４回　利付国庫債券（４０年）	720,000,000	822,276,000	
５回　利付国庫債券（４０年）	1,010,000,000	1,108,000,300	
６回　利付国庫債券（４０年）	1,040,000,000	1,111,416,800	
７回　利付国庫債券（４０年）	1,210,000,000	1,232,602,800	
８回　利付国庫債券（４０年）	1,190,000,000	1,121,563,100	
９回　利付国庫債券（４０年）	1,950,000,000	1,335,672,000	
１０回　利付国庫債券（４０年）	1,770,000,000	1,428,336,900	
１１回　利付国庫債券（４０年）	1,280,000,000	993,561,600	
１２回　利付国庫債券（４０年）	1,540,000,000	1,061,753,000	
１３回　利付国庫債券（４０年）	1,970,000,000	1,348,465,000	
１４回　利付国庫債券（４０年）	2,050,000,000	1,500,641,000	
１５回　利付国庫債券（４０年）	1,640,000,000	1,308,457,600	
３３３回　利付国庫債券（１０年）	6,330,000,000	6,375,322,800	
３３４回　利付国庫債券（１０年）	4,420,000,000	4,457,083,800	
３３５回　利付国庫債券（１０年）	4,610,000,000	4,647,709,800	
３３６回　利付国庫債券（１０年）	3,000,000,000	3,027,870,000	
３３７回　利付国庫債券（１０年）	1,900,000,000	1,910,298,000	
３３８回　利付国庫債券（１０年）	4,630,000,000	4,667,364,100	
３３９回　利付国庫債券（１０年）	5,080,000,000	5,125,110,400	
３４０回　利付国庫債券（１０年）	5,240,000,000	5,290,618,400	
３４１回　利付国庫債券（１０年）	5,220,000,000	5,258,993,400	
３４２回　利付国庫債券（１０年）	3,420,000,000	3,424,890,600	
３４３回　利付国庫債券（１０年）	4,190,000,000	4,192,849,200	
３４４回　利付国庫債券（１０年）	3,270,000,000	3,268,790,100	

３４５回　利付国庫債券（１０年）	5,880,000,000	5,869,592,400	
３４６回　利付国庫債券（１０年）	3,990,000,000	3,977,551,200	
３４７回　利付国庫債券（１０年）	4,530,000,000	4,509,071,400	
３４８回　利付国庫債券（１０年）	4,570,000,000	4,542,442,900	
３４９回　利付国庫債券（１０年）	4,750,000,000	4,714,090,000	
３５０回　利付国庫債券（１０年）	6,160,000,000	6,103,328,000	
３５１回　利付国庫債券（１０年）	3,920,000,000	3,876,997,600	
３５２回　利付国庫債券（１０年）	4,660,000,000	4,600,119,000	
３５３回　利付国庫債券（１０年）	4,110,000,000	4,049,048,700	
３５４回　利付国庫債券（１０年）	3,700,000,000	3,638,506,000	
３５５回　利付国庫債券（１０年）	3,330,000,000	3,267,296,100	
３５６回　利付国庫債券（１０年）	3,900,000,000	3,818,802,000	
３５７回　利付国庫債券（１０年）	3,820,000,000	3,731,299,600	
３５８回　利付国庫債券（１０年）	3,350,000,000	3,262,732,500	
３５９回　利付国庫債券（１０年）	4,570,000,000	4,438,932,400	
３６０回　利付国庫債券（１０年）	4,800,000,000	4,649,232,000	
３６１回　利付国庫債券（１０年）	4,620,000,000	4,465,276,200	
３６２回　利付国庫債券（１０年）	4,760,000,000	4,590,448,800	
３６３回　利付国庫債券（１０年）	4,470,000,000	4,302,598,500	
３６４回　利付国庫債券（１０年）	4,600,000,000	4,422,854,000	
３６５回　利付国庫債券（１０年）	4,030,000,000	3,875,489,800	
３６６回　利付国庫債券（１０年）	4,180,000,000	4,068,101,400	
３６７回　利付国庫債券（１０年）	4,200,000,000	4,110,540,000	
３６８回　利付国庫債券（１０年）	4,400,000,000	4,311,868,000	
１回　利付国庫債券（３０年）	110,000,000	127,277,700	
２回　利付国庫債券（３０年）	100,000,000	113,546,000	
４回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	236,456,000	

６回　利付国庫債券（３０年）	200,000,000	231,828,000	
８回　利付国庫債券（３０年）	500,000,000	558,195,000	
１１回　利付国庫債券（３０年）	250,000,000	276,462,500	
１２回　利付国庫債券（３０年）	230,000,000	263,722,600	
１３回　利付国庫債券（３０年）	150,000,000	170,415,000	
１４回　利付国庫債券（３０年）	340,000,000	400,778,400	
１５回　利付国庫債券（３０年）	260,000,000	309,550,800	
１６回　利付国庫債券（３０年）	240,000,000	285,900,000	
１７回　利付国庫債券（３０年）	270,000,000	318,807,900	
１８回　利付国庫債券（３０年）	400,000,000	467,904,000	
１９回　利付国庫債券（３０年）	280,000,000	327,686,800	
２０回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	394,389,600	
２１回　利付国庫債券（３０年）	310,000,000	363,236,300	
２２回　利付国庫債券（３０年）	290,000,000	347,135,800	
２３回　利付国庫債券（３０年）	350,000,000	419,132,000	
２４回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,162,671,100	
２５回　利付国庫債券（３０年）	330,000,000	387,212,100	
２６回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	735,586,600	
２７回　利付国庫債券（３０年）	620,000,000	743,863,600	
２８回　利付国庫債券（３０年）	770,000,000	924,077,000	
２９回　利付国庫債券（３０年）	860,000,000	1,019,117,200	
３０回　利付国庫債券（３０年）	880,000,000	1,029,309,600	
３１回　利付国庫債券（３０年）	720,000,000	830,491,200	
３２回　利付国庫債券（３０年）	970,000,000	1,133,299,500	
３３回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,320,620,600	
３４回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,381,176,000	

３５回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,633,302,000	
３６回　利付国庫債券（３０年）	1,770,000,000	1,981,532,700	
３７回　利付国庫債券（３０年）	2,260,000,000	2,492,079,400	
３８回　利付国庫債券（３０年）	1,450,000,000	1,573,453,000	
３９回　利付国庫債券（３０年）	1,500,000,000	1,653,315,000	
４０回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,440,762,400	
４１回　利付国庫債券（３０年）	1,170,000,000	1,244,961,900	
４２回　利付国庫債券（３０年）	1,320,000,000	1,403,028,000	
４３回　利付国庫債券（３０年）	1,250,000,000	1,327,137,500	
４４回　利付国庫債券（３０年）	1,400,000,000	1,484,686,000	
４５回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,400,030,400	
４６回　利付国庫債券（３０年）	1,570,000,000	1,601,996,600	
４７回　利付国庫債券（３０年）	1,460,000,000	1,515,012,800	
４８回　利付国庫債券（３０年）	1,180,000,000	1,176,955,600	
４９回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,383,981,300	
５０回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,104,478,200	
５１回　利付国庫債券（３０年）	1,290,000,000	999,053,400	
５２回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,078,683,200	
５３回　利付国庫債券（３０年）	1,560,000,000	1,291,102,800	
５４回　利付国庫債券（３０年）	1,350,000,000	1,167,790,500	
５５回　利付国庫債券（３０年）	1,420,000,000	1,224,735,800	
５６回　利付国庫債券（３０年）	1,260,000,000	1,083,524,400	
５７回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,140,342,000	
５８回　利付国庫債券（３０年）	1,740,000,000	1,486,116,600	
５９回　利付国庫債券（３０年）	1,420,000,000	1,179,352,600	

６０回　利付国庫債券（３０年）	1,200,000,000	1,043,268,000	
６１回　利付国庫債券（３０年）	1,040,000,000	856,648,000	
６２回　利付国庫債券（３０年）	1,270,000,000	987,602,800	
６３回　利付国庫債券（３０年）	1,310,000,000	986,783,700	
６４回　利付国庫債券（３０年）	1,030,000,000	772,129,200	
６５回　利付国庫債券（３０年）	950,000,000	716,518,500	
６６回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,043,375,700	
６７回　利付国庫債券（３０年）	1,570,000,000	1,233,030,900	
６８回　利付国庫債券（３０年）	1,370,000,000	1,073,148,400	
６９回　利付国庫債券（３０年）	1,330,000,000	1,068,960,900	
７０回　利付国庫債券（３０年）	1,610,000,000	1,290,914,100	
７１回　利付国庫債券（３０年）	1,300,000,000	1,039,831,000	
７２回　利付国庫債券（３０年）	1,490,000,000	1,188,915,700	
７３回　利付国庫債券（３０年）	1,390,000,000	1,108,566,700	
７４回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,313,720,800	
７５回　利付国庫債券（３０年）	1,520,000,000	1,421,625,600	
７６回　利付国庫債券（３０年）	1,420,000,000	1,356,014,800	
６７回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,127,000	
７０回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	51,711,500	
７１回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,254,400	
７２回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	476,178,200	
７３回　利付国庫債券（２０年）	380,000,000	394,565,400	
７４回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,610,800	
７５回　利付国庫債券（２０年）	180,000,000	188,130,600	
７６回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	72,856,000	

７７回　利付国庫債券（２０年）	40,000,000	41,719,200	
７８回　利付国庫債券（２０年）	250,000,000	261,345,000	
７９回　利付国庫債券（２０年）	50,000,000	52,390,500	
８０回　利付国庫債券（２０年）	90,000,000	94,522,500	
８１回　利付国庫債券（２０年）	400,000,000	421,048,000	
８２回　利付国庫債券（２０年）	140,000,000	147,742,000	
８３回　利付国庫債券（２０年）	70,000,000	74,218,900	
８４回　利付国庫債券（２０年）	170,000,000	179,747,800	
８５回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	628,344,100	
８６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	128,560,800	
８７回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	128,179,200	
８８回　利付国庫債券（２０年）	590,000,000	634,875,400	
８９回　利付国庫債券（２０年）	10,000,000	10,726,300	
９０回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	506,166,500	
９１回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	118,869,300	
９２回　利付国庫債券（２０年）	1,160,000,000	1,249,018,400	
９３回　利付国庫債券（２０年）	370,000,000	398,123,700	
９４回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	723,713,900	
９５回　利付国庫債券（２０年）	550,000,000	600,776,000	
９６回　利付国庫債券（２０年）	120,000,000	130,023,600	
９７回　利付国庫債券（２０年）	660,000,000	720,627,600	
９８回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	173,955,200	
９９回　利付国庫債券（２０年）	750,000,000	817,860,000	
１００回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	912,120,200	
１０１回　利付国庫債券（２０年）	230,000,000	255,106,800	

１０２回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	556,455,000	
１０３回　利付国庫債券（２０年）	160,000,000	177,209,600	
１０４回　利付国庫債券（２０年）	110,000,000	120,653,500	
１０５回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	703,827,200	
１０６回　利付国庫債券（２０年）	500,000,000	552,660,000	
１０７回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	661,452,000	
１０８回　利付国庫債券（２０年）	690,000,000	752,638,200	
１０９回　利付国庫債券（２０年）	350,000,000	382,718,000	
１１０回　利付国庫債券（２０年）	440,000,000	486,455,200	
１１１回　利付国庫債券（２０年）	460,000,000	512,591,800	
１１２回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	819,957,000	
１１３回　利付国庫債券（２０年）	2,170,000,000	2,411,065,300	
１１４回　利付国庫債券（２０年）	1,110,000,000	1,235,696,400	
１１５回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	403,192,800	
１１６回　利付国庫債券（２０年）	530,000,000	594,744,800	
１１７回　利付国庫債券（２０年）	1,070,000,000	1,193,264,000	
１１８回　利付国庫債券（２０年）	555,000,000	616,005,600	
１１９回　利付国庫債券（２０年）	470,000,000	514,725,200	
１２０回　利付国庫債券（２０年）	670,000,000	724,129,300	
１２１回　利付国庫債券（２０年）	640,000,000	706,592,000	
１２２回　利付国庫債券（２０年）	570,000,000	625,084,800	
１２３回　利付国庫債券（２０年）	1,050,000,000	1,177,795,500	
１２４回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	668,448,000	
１２５回　利付国庫債券（２０年）	600,000,000	679,386,000	
１２６回　利付国庫債券（２０年）	510,000,000	569,246,700	

１２７回　利付国庫債券（２０年）	540,000,000	598,492,800	
１２８回　利付国庫債券（２０年）	1,370,000,000	1,521,549,400	
１２９回　利付国庫債券（２０年）	760,000,000	837,930,400	
１３０回　利付国庫債券（２０年）	910,000,000	1,005,140,500	
１３１回　利付国庫債券（２０年）	790,000,000	866,045,400	
１３２回　利付国庫債券（２０年）	830,000,000	912,078,700	
１３３回　利付国庫債券（２０年）	1,030,000,000	1,140,642,600	
１３４回　利付国庫債券（２０年）	900,000,000	998,784,000	
１３５回　利付国庫債券（２０年）	740,000,000	814,747,400	
１３６回　利付国庫債券（２０年）	360,000,000	393,213,600	
１３７回　利付国庫債券（２０年）	880,000,000	971,643,200	
１３８回　利付国庫債券（２０年）	920,000,000	998,844,000	
１３９回　利付国庫債券（２０年）	1,000,000,000	1,095,160,000	
１４０回　利付国庫債券（２０年）	2,450,000,000	2,710,386,000	
１４１回　利付国庫債券（２０年）	1,560,000,000	1,726,576,800	
１４２回　利付国庫債券（２０年）	1,330,000,000	1,484,532,700	
１４３回　利付国庫債券（２０年）	1,630,000,000	1,787,278,700	
１４４回　利付国庫債券（２０年）	1,350,000,000	1,467,301,500	
１４５回　利付国庫債券（２０年）	2,150,000,000	2,377,577,500	
１４６回　利付国庫債券（２０年）	2,140,000,000	2,365,727,200	
１４７回　利付国庫債券（２０年）	2,490,000,000	2,724,582,900	
１４８回　利付国庫債券（２０年）	2,360,000,000	2,554,487,600	
１４９回　利付国庫債券（２０年）	2,440,000,000	2,638,274,400	
１５０回　利付国庫債券（２０年）	2,500,000,000	2,671,725,000	
１５１回　利付国庫債券（２０年）	2,460,000,000	2,570,011,200	

１５２回　利付国庫債券（２０年）	2,240,000,000	2,335,558,400	
１５３回　利付国庫債券（２０年）	2,200,000,000	2,316,534,000	
１５４回　利付国庫債券（２０年）	2,230,000,000	2,318,040,400	
１５５回　利付国庫債券（２０年）	2,380,000,000	2,411,749,200	
１５６回　利付国庫債券（２０年）	2,040,000,000	1,910,766,000	
１５７回　利付国庫債券（２０年）	2,360,000,000	2,142,714,800	
１５８回　利付国庫債券（２０年）	2,780,000,000	2,620,511,400	
１５９回　利付国庫債券（２０年）	2,260,000,000	2,152,039,800	
１６０回　利付国庫債券（２０年）	2,280,000,000	2,193,656,400	
１６１回　利付国庫債券（２０年）	2,010,000,000	1,900,173,600	
１６２回　利付国庫債券（２０年）	2,370,000,000	2,231,426,100	
１６３回　利付国庫債券（２０年）	2,340,000,000	2,194,101,000	
１６４回　利付国庫債券（２０年）	2,740,000,000	2,521,183,600	
１６５回　利付国庫債券（２０年）	2,230,000,000	2,043,995,700	
１６６回　利付国庫債券（２０年）	1,980,000,000	1,862,823,600	
１６７回　利付国庫債券（２０年）	2,050,000,000	1,861,748,500	
１６８回　利付国庫債券（２０年）	1,690,000,000	1,503,711,300	
１６９回　利付国庫債券（２０年）	1,960,000,000	1,706,121,200	
１７０回　利付国庫債券（２０年）	1,600,000,000	1,386,288,000	
１７１回　利付国庫債券（２０年）	1,740,000,000	1,500,541,200	
１７２回　利付国庫債券（２０年）	1,380,000,000	1,206,396,000	
１７３回　利付国庫債券（２０年）	2,020,000,000	1,757,824,200	
１７４回　利付国庫債券（２０年）	1,970,000,000	1,706,433,700	
１７５回　利付国庫債券（２０年）	2,130,000,000	1,871,247,600	
１７６回　利付国庫債券（２０年）	1,900,000,000	1,662,994,000	

	１７７回　利付国庫債券（２０年)	1,950,000,000	1,669,141,500	
	１７８回　利付国庫債券（２０年)	2,200,000,000	1,913,802,000	
	１７９回　利付国庫債券（２０年)	2,050,000,000	1,779,154,000	
	１８０回　利付国庫債券（２０年)	2,040,000,000	1,869,027,600	
	１８１回　利付国庫債券（２０年)	2,200,000,000	2,050,730,000	
	１８２回　利付国庫債券（２０年)	2,180,000,000	2,101,759,800	
国債証券　合計		460,745,000,000	454,459,252,500	
地方債証券	７６０回　東京都公募公債	100,000,000	99,323,000	
	７８３回　東京都公募公債	110,000,000	108,742,700	
	７９６回　東京都公募公債	200,000,000	192,930,000	
	８０２回　東京都公募公債	400,000,000	385,584,000	
	８１３回　東京都公募公債	300,000,000	287,913,000	
	１回　東京都公募公債　３０年	200,000,000	227,278,000	
	１４回　東京都公募公債　３０年	100,000,000	110,765,000	
	５回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	104,265,000	
	７回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	105,352,000	
	９回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	215,322,000	
	１０回　東京都公募公債　２０年	300,000,000	323,136,000	
	１８回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,185,000	
	２１回　東京都公募公債　２０年	100,000,000	110,630,000	
	３１回　東京都公募公債　２０年	200,000,000	206,822,000	
	２８年度６回　北海道公募公債	100,000,000	99,405,000	
	３０年度８回　北海道公募公債	400,000,000	395,144,000	
	３０年度１４回　北海道公募公債	400,000,000	392,820,000	
	令和２年度１９回　北海道公募公債	100,000,000	95,437,000	
	３６回２号　宮城県公募公債　１０年	250,000,000	239,465,000	
	２０８回　神奈川県公募公債	300,000,000	301,791,000	
	２１３回　神奈川県公募公債	100,000,000	100,835,000	
	２３７回　神奈川県公募公債	200,000,000	195,844,000	
	２５１回　神奈川県公募公債　１０年	200,000,000	191,718,000	
	２５８回　神奈川県公募公債　１０年	300,000,000	288,345,000	
	３回　神奈川県公募公債　３０年	100,000,000	119,600,000	
	１１回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	109,530,000	

１６回　神奈川県公募公債　２０年	300,000,000	331,725,000	
１９回　神奈川県公募公債　２０年	100,000,000	109,146,000	
４１３回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,111,000	
４１９回　大阪府公募公債　１０年	100,000,000	99,474,000	
４６４回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	189,848,000	
４６７回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	190,844,000	
４６９回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	190,026,000	
４７２回　大阪府公募公債　１０年	200,000,000	189,206,000	
４７４回　大阪府公募公債　１０年	300,000,000	284,115,000	
１０回　大阪府公募公債　２０年	200,000,000	218,532,000	
１３回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	102,004,000	
１４回　大阪府公募公債　２０年	100,000,000	93,059,000	
１９０回　大阪府公募公債　５年	300,000,000	296,715,000	
２６年度１１回　京都府公募公債	350,000,000	352,271,500	
２９年度１３回　京都府公募公債	109,330,000	108,192,968	
令和２年度１回　京都府公募公債	400,000,000	385,464,000	
令和２年度１４回　京都府公募公債	200,000,000	192,044,000	
２６年度１７回　兵庫県公募公債	200,000,000	201,312,000	
令和元年度１６回　兵庫県公募公債	200,000,000	192,900,000	
令和３年度２回　兵庫県公募公債	100,000,000	95,587,000	
２回　兵庫県公募公債　３０年	100,000,000	115,752,000	
１回　兵庫県公募公債　１５年	200,000,000	210,204,000	
１回　兵庫県公募公債（１２年）	300,000,000	304,203,000	
５回　兵庫県公募公債　１５年	300,000,000	313,914,000	
９回　兵庫県公募公債　１５年	100,000,000	102,854,000	
５回　兵庫県公募公債　１２年	100,000,000	101,577,000	
令和元年度　９回　静岡県公募公債	200,000,000	193,058,000	
令和２年度　１０回　静岡県公募公債	100,000,000	95,875,000	

令和２年度　１４回　静岡県公募公債	200,000,000	190,806,000	
２回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,744,000	
４回　静岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,804,000	
８回　静岡県公募公債　１５年	200,000,000	202,370,000	
１回　静岡県公募公債　２０年	100,000,000	105,391,000	
７回　静岡県公募公債　２０年	300,000,000	331,137,000	
２２年度１４回　愛知県公募公債	300,000,000	331,602,000	
２４年度１２回　愛知県公募公債　３０年	100,000,000	111,879,000	
２６年度４回　愛知県公募公債　２０年	200,000,000	213,870,000	
２７年度８回　愛知県公募公債　３０年	150,000,000	151,500,000	
２７年度１５回　愛知県公募公債　１０年	100,000,000	100,861,000	
３０年度１９回　愛知県公募公債	200,000,000	194,950,000	
令和元年度７回　愛知県公募公債	300,000,000	216,726,000	
３０年度３回　広島県公募公債	100,000,000	98,825,000	
令和２年　７回　広島県公募公債	200,000,000	192,026,000	
２７年度　２回　広島県公募公債　３０年	100,000,000	83,621,000	
令和２年　２回　広島県公募公債	100,000,000	86,171,000	
２６年度５回　埼玉県公募公債	400,000,000	402,932,000	
令和元年度第８回　埼玉県公募公債	200,000,000	193,246,000	
６回　埼玉県公募公債　３０年	200,000,000	175,156,000	
１２回　埼玉県公募公債　３０年	300,000,000	223,758,000	
９回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	110,542,000	
１３回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	107,691,000	
１４回　埼玉県公募公債　２０年	300,000,000	320,898,000	
１５回　埼玉県公募公債　２０年	100,000,000	102,338,000	
２５年度１１回　福岡県公募公債	200,000,000	201,290,000	
２８年度８回　福岡県公募公債	100,000,000	99,795,000	
３０年度６回　福岡県公募公債	200,000,000	196,592,000	
令和元年度１回　福岡県公募公債	200,000,000	193,394,000	
令和２年５回　福岡県公募公債	100,000,000	95,793,000	
２４年度１回　福岡県公募公債　１５年	100,000,000	104,599,000	

令和元年３回　福岡県公募公債　３０年	200,000,000	147,182,000	
２０回２号　福岡県公募公債	100,000,000	109,004,000	
２１年度２回　福岡県公募公債（２０年）	100,000,000	110,934,000	
２４年度２回　福岡県公募公債（２０年）	300,000,000	325,365,000	
２７年度４回　千葉県公募公債	200,000,000	202,230,000	
２７年度９回　千葉県公募公債	100,000,000	99,729,000	
令和３年　５回　千葉県公募公債	200,000,000	189,454,000	
１４回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	103,291,000	
１８回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	101,889,000	
２１回　千葉県公募公債　２０年	100,000,000	91,711,000	
２５年度２回　新潟県公募公債	100,000,000	100,621,000	
令和３年度１回　長野県公募公債　１０年	200,000,000	191,506,000	
５回　群馬県公募公債　２０年	100,000,000	106,738,000	
１３２回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,640,000	
１４２回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	502,025,000	
１４４回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	402,760,000	
１４６回　共同発行市場公募地方債	600,000,000	605,616,000	
１４８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	504,955,000	
１５０回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,784,000	
１５３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,863,000	
１５７回　共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,588,400	
１５９回　共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,074,000	
１６０回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,195,000	
１６６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,990,000	
１６９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	497,780,000	
１７３回　共同発行市場公募地方債	400,000,000	397,632,000	
１７４回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,028,000	
１７８回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,184,000	

１７９回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	495,980,000	
１８９回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,351,000	
１９４回　共同発行市場公募地方債	300,000,000	291,876,000	
１９６回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	483,785,000	
２０３回　共同発行市場公募地方債	100,000,000	96,252,000	
２２７回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	477,160,000	
２２８回　共同発行市場公募地方債	500,000,000	474,450,000	
３０年度３回　堺市公募公債	100,000,000	98,212,000	
２６年度１回　長崎県公募公債	100,000,000	100,709,000	
令和元年度１回　島根県公募公債	200,000,000	180,242,000	
令和２年度１回　福島県公募公債	200,000,000	191,416,000	
２６年度１回　静岡市公募公債	100,000,000	100,699,000	
２６年度１回　浜松市公募公債	100,000,000	100,385,000	
２９年度４回　大阪市公募公債	200,000,000	198,106,000	
令和２年　２回　大阪市公募公債	300,000,000	288,654,000	
６回　大阪市公募公債　２０年	200,000,000	219,856,000	
４８８回　名古屋市公募公債　１０年	450,000,000	453,510,000	
５１１回　名古屋市公募公債　１０年	200,000,000	192,014,000	
１６回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	106,635,000	
１７回　名古屋市公募公債　２０年	100,000,000	102,517,000	
５回　京都市公募公債　３０年定時償還	200,000,000	177,064,000	
４回　京都市公募公債　２０年	100,000,000	108,370,000	
９回　京都市公募公債　２０年	200,000,000	221,938,000	
２４年度１２回　神戸市公募公債	200,000,000	217,564,000	
２６年度４回　神戸市公募公債	100,000,000	100,712,000	
３０年度７回　神戸市公募公債　３０年	300,000,000	296,490,000	
令和３年度６回　神戸市公募公債　３０年	200,000,000	155,480,000	
令和元年度３回　横浜市公募公債	400,000,000	385,840,000	
２回　横浜市公募公債　３０年	100,000,000	117,318,000	
１７回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	109,120,000	

	２９回　横浜市公募公債　２０年	100,000,000	106,752,000	
	２３年度７回　札幌市公募公債　３０年	100,000,000	111,454,000	
	２６年度４回　札幌市公募公債　１０年	100,000,000	100,581,000	
	２９年度５回　札幌市公募公債　２０年	300,000,000	277,800,000	
	第９１回　川崎市公募公債	200,000,000	196,894,000	
	６回　川崎市公募公債　２０年	200,000,000	220,560,000	
	５回　川崎市公募公債　３０年	100,000,000	111,629,000	
	６回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	108,826,000	
	１１回　北九州市公募公債　２０年	300,000,000	331,134,000	
	１７回　北九州市公募公債　２０年	100,000,000	106,467,000	
	２２年度８回　福岡市公募公債	100,000,000	114,312,000	
	３０年度７回　福岡市公募公債	200,000,000	184,808,000	
	２０１９年度５回　福岡市公募公債　２０年	100,000,000	85,266,000	
	２６年度３回　広島市公募公債	100,000,000	100,590,000	
	２９年度２回　広島市公募公債	200,000,000	185,968,000	
	２９年度６回　広島市公募公債	300,000,000	297,438,000	
	３０年度２回　仙台市公募公債　２０年	100,000,000	92,833,000	
	令和３年度３回　仙台市公募公債　５年	300,000,000	296,643,000	
	１７回　さいたま市公募公債	200,000,000	193,262,000	
	令和２年度１回　高知県公募公債	200,000,000	191,416,000	
	２６年度１回　相模原市公募公債	100,000,000	100,655,000	
	２６年度１回　三重県公募公債	100,000,000	100,605,000	
	３０年度３回　岡山県公募公債　１０年	200,000,000	195,368,000	
地方債証券　合計		33,239,330,000	33,085,236,568	
特殊債券	９回　新関西国際空港社債	200,000,000	206,822,000	
	１２回　新関西国際空港社債	200,000,000	204,572,000	
	７８回　日本政策投資銀行債券	300,000,000	297,990,000	
	１２５回　日本政策投資銀行債券	500,000,000	423,050,000	
	１２７回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,572,000	
	１３１回　日本政策投資銀行債券	100,000,000	76,037,000	
	１５６回　日本政策投資銀行債券	400,000,000	381,944,000	
	３３回　政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	298,860,000	
	１回　高速道路機構債	300,000,000	372,102,000	

１９回　高速道路機構債	150,000,000	179,202,000	
２６回　高速道路機構債	200,000,000	236,998,000	
３６回　高速道路機構債	300,000,000	363,960,000	
５０回　高速道路機構債	300,000,000	264,222,000	
７５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,556,000	
１２４回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,331,000	
１３９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,573,000	
１５５回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	102,809,000	
１５９回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,070,000	
１６２回　日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	98,996,000	
１６９回　高速道路機構債	100,000,000	90,859,000	
１７２回　高速道路機構債	200,000,000	179,310,000	
２１０回　高速道路機構債	100,000,000	91,352,000	
９７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,541,000	
１１６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,380,000	
１２１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	544,320,000	
１５３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,780,000	
１８８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,618,000	
２１１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,655,000	
２１８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,787,000	
２２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	201,614,000	
２３９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	308,340,000	
２４１回政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	503,700,000	
２５０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	103,830,000	
２５４回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,838,000	
２６０回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	196,258,000	
第２６２回　政保道路債	500,000,000	507,390,000	
２６８回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	95,849,000	
２７１回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	298,845,000	

２８６回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	182,046,000	
３００回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,496,000	
３０９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	795,576,000	
３１９回政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	187,748,000	
３３７回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	92,650,000	
３９８回　政保道路債	300,000,000	224,136,000	
４１３回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	141,988,000	
４１８回　高速道路機構債	200,000,000	153,924,000	
４２０回　政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	156,202,000	
２８回　日本道路・機構承継債	500,000,000	595,510,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	217,362,000	
１回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	330,882,000	
２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	331,452,000	
１３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	110,572,000	
７９回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	313,752,000	
１９回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	217,564,000	
２３回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	108,571,000	
２４回　地方公共団体金融機構債券２０年	200,000,000	217,728,000	
Ｆ１４７回　地方公共団体金融機構債券	200,000,000	207,674,000	
Ｆ１７４回　地方公共団体金融機構債券	300,000,000	326,166,000	
３６回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	106,663,000	
６４回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,220,000	
３９回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	523,950,000	
４２回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	299,961,000	
７１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,628,000	
４４回　地方公共団体金融機構債券　２０年	200,000,000	205,810,000	
２８８回　政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	301,722,000	

８３回　地方公共団体金融機構債券　１０年	400,000,000	398,232,000	
９１回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,453,000	
５９回　地方公共団体金融機構債券　２０年	100,000,000	93,471,000	
９６回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	496,015,000	
９８回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,398,000	
１０３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,126,000	
１１３回　政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	98,916,000	
７７回　地方公共団体金融機構債券　２０年	300,000,000	248,706,000	
１０回　地方公共団体金融機構債券　３０年	300,000,000	218,769,000	
Ｆ５３８回　地方公共団体金融機構債券	500,000,000	497,210,000	
１５回　日本政策金融公庫債券	200,000,000	217,186,000	
４０回　政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,609,630	
２３回　国際協力銀行債券	100,000,000	105,487,000	
９３回　都市再生債券	100,000,000	102,920,000	
１０９回　都市再生機構債券	200,000,000	202,650,000	
１６５回　都市再生機構債券	200,000,000	152,388,000	
１１回　独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	107,401,000	
２１回　政保中部国際空港債券	100,000,000	100,738,000	
３９回　住宅金融支援機構債券	200,000,000	219,390,000	
６１回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,728,000	
７５回　住宅金融支援機構債券	350,000,000	385,714,000	
８０回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,755,000	
１１５回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,916,000	
１２４回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,700,000	
１４８回　住宅金融支援機構債券	250,000,000	267,015,000	
１５９回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,873,000	
１７２回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,826,000	
１８７回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,529,000	
２２２回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,436,000	
２３０回　住宅金融支援機構債券	300,000,000	296,634,000	

２３３回　住宅金融支援機構債券	100,000,000	90,693,000	
３２１回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,895,000	
３２５回　住宅金融支援機構債券	500,000,000	494,895,000	
２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	29,712,000	29,840,652	
４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,132,000	45,845,085	
４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,170,000	10,215,358	
４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,640,000	48,859,366	
５１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,046,000	29,153,760	
４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	9,878,000	9,917,907	
２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,383,000	17,104,015	
２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	101,900,000	106,978,696	
３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,088,000	161,685,443	
３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,684,000	22,511,461	
４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,633,000	19,373,289	
５２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	21,835,000	22,590,491	
５３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,949,000	23,730,183	
６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,311,000	29,190,905	
６４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,152,000	70,752,177	
７６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	31,516,000	32,326,591	
８２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,534,000	38,114,275	
８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,095,000	38,694,996	
８６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	41,820,000	42,415,935	
９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,497,000	43,811,918	
９３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,900,000	48,387,528	
９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,272,000	55,082,969	

９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,179,000	57,320,803	
１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	214,500,000	206,968,905	
１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,846,000	70,672,275	
１１８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,496,000	70,421,164	
１１９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,740,000	70,587,623	
１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,190,000	219,226,990	
１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	227,262,000	219,151,019	
１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	154,106,000	148,476,507	
１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	231,438,000	222,453,576	
１３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	230,994,000	222,040,672	
１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	399,035,000	384,729,595	
１３９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,826,000	76,879,622	
１４２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,171,000	78,234,187	
１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	263,157,000	249,012,311	
１５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	351,856,000	334,164,680	
１６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	270,273,000	256,853,945	
１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	277,440,000	263,917,574	
１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	842,580,000	798,799,543	
６回　沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	417,856,000	
２１回　沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,046,000	
い第８２８号　利付商工債	100,000,000	99,945,000	
い第８４３号　利付商工債	100,000,000	99,713,000	
い第８５１号　利付商工債	300,000,000	298,092,000	
い第８５４号　利付商工債	300,000,000	297,531,000	
い第８５５号　利付商工債	200,000,000	198,278,000	
３６９回　利附信金中金債（５年）	400,000,000	398,328,000	
３７７回　利附信金中金債（５年）	300,000,000	297,942,000	
７回　広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	100,000,000	100,551,000	

	１５回　国際協力機構債	100,000,000	109,136,000	
	７２回　東日本高速道路社債	200,000,000	196,788,000	
	７７回　東日本高速道路社債	300,000,000	294,003,000	
	８５回　中日本高速道路債券	300,000,000	298,344,000	
	８７回　中日本高速道路債券	400,000,000	396,600,000	
	７１回　鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,673,000	
	７８回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,496,000	
	９０回　鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	190,420,000	
特殊債券　合計		30,405,236,000	30,336,795,621	
社債券	２５回　フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債（２０１７）	300,000,000	290,553,000	
	2回　ＢＰＣＥ　ＳＡ円貨社債（ソーシャルボンド）	100,000,000	99,372,000	
	6回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	200,000,000	200,302,000	
	１１回　クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債（２０１６）	100,000,000	97,860,000	
	２５回　首都高速道路社債	100,000,000	99,696,000	
	２７回　首都高速道路社債	400,000,000	397,144,000	
	１６回　成田国際空港社債	100,000,000	100,625,000	
	３７回　成田国際空港社債	100,000,000	83,245,000	
	５７回　東日本高速道路社債	100,000,000	99,168,000	
	６７回　東日本高速道路社債	200,000,000	193,024,000	
	７９回　東日本高速道路社債	300,000,000	296,892,000	
	８３回　東日本高速道路社債	200,000,000	197,928,000	
	９０回　中日本高速道路債券	200,000,000	197,798,000	
	９１回　中日本高速道路債券	500,000,000	493,825,000	
	２５回　西日本高速道路社債	200,000,000	201,192,000	
	２６回　西日本高速道路社債	100,000,000	100,840,000	
	３３回　西日本高速道路債券	300,000,000	298,311,000	
	３４回　西日本高速道路債券	200,000,000	199,070,000	
	６１回　西日本高速道路債券	500,000,000	494,650,000	
	６２回　西日本高速道路債券	500,000,000	493,820,000	
	２４回　大和ハウス工業社債	200,000,000	198,068,000	
	１０回　キリンホールディングス社債	100,000,000	100,640,000	
	3回　ダイドーグループＨＤ社債	300,000,000	289,872,000	
	9回　野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	93,569,000	
	１２回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,066,000	
	１４回　セブン＆アイ・ホールディングス社債	200,000,000	198,960,000	
	３０回　東レ社債	300,000,000	297,753,000	
	４２回　王子ホールディングス社債	200,000,000	198,490,000	

４９回　住友化学社債	100,000,000	100,795,000	
２３回　三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	186,292,000	
４０回　三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	98,935,000	
１７回　ダイセル社債	300,000,000	289,665,000	
１６回　武田薬品工業社債	500,000,000	467,890,000	
４回　住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,511,000	
４回　ＥＮＥＯＳホールディングス社債	300,000,000	292,389,000	
１４回　ブリヂストン社債	300,000,000	293,586,000	
３５回　三菱マテリアル社債	300,000,000	297,099,000	
１７回　パナソニック社債	100,000,000	99,862,000	
１９回　パナソニック社債	100,000,000	96,262,000	
２３回　パナソニック社債	200,000,000	190,826,000	
２９回　三菱重工業社債	100,000,000	100,616,000	
５８回　川崎重工業社債	300,000,000	284,760,000	
５回　三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	97,813,000	
１６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	201,050,000	
２６回　トヨタ自動車社債	200,000,000	198,424,000	
２６回　豊田通商社債	100,000,000	91,820,000	
７３回　三井物産社債	400,000,000	388,000,000	
１２回　新生銀行社債	400,000,000	397,644,000	
１３回　新生銀行社債	200,000,000	199,148,000	
８８回　三菱東京ＵＦＪ銀行社債	100,000,000	107,605,000	
１２回　りそな銀行劣後社債	100,000,000	106,280,000	
２０回　三井住友信託銀行社債	300,000,000	295,797,000	
１０回　三井住友信託銀行社債	200,000,000	200,790,000	
１１回　セブン銀行社債	200,000,000	200,904,000	
２８回　芙蓉総合リース社債	300,000,000	296,010,000	
１７回　ＮＴＴファイナンス社債	300,000,000	296,295,000	
１８回　ＮＴＴファイナンス社債	400,000,000	387,320,000	
６９回　ホンダファイナンス社債	300,000,000	296,814,000	
８１回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	98,810,000	
９６回　トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,273,000	
８０回　日立キャピタル社債	200,000,000	191,752,000	
８６回　日立キャピタル社債	300,000,000	285,846,000	
２３回　三井住友ファイナンス＆リース社債	100,000,000	97,088,000	
２７回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	197,400,000	
２９回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	198,804,000	

３１回　三井住友ファイナンス＆リース社債	200,000,000	191,366,000	
５６回　三菱ＵＦＪリース社債	300,000,000	296,199,000	
3回　野村ホールディングス社債	300,000,000	294,492,000	
７２回　三菱地所社債	100,000,000	103,366,000	
１０６回　住友不動産社債	100,000,000	99,955,000	
１０８回　住友不動産社債	200,000,000	198,590,000	
８０回　東京急行電鉄社債	100,000,000	102,299,000	
４３回　京浜急行電鉄社債	100,000,000	88,907,000	
３９回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	312,630,000	
４２回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	209,456,000	
６５回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	108,980,000	
７１回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	107,439,000	
７３回　東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	217,998,000	
１０７回　東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	93,800,000	
１２５回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	86,017,000	
１２７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	89,769,000	
１４７回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,792,000	
１６０回　東日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,246,000	
１６３回　東日本旅客鉄道社債	300,000,000	296,766,000	
１６５回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,712,000	
１７１回　東日本旅客鉄道社債	200,000,000	150,356,000	
２１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	109,080,000	
６０回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	191,426,000	
７０回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	77,057,000	
７１回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	71,784,000	
７４回　西日本旅客鉄道社債	100,000,000	94,327,000	
７５回　西日本旅客鉄道社債	200,000,000	167,186,000	
１４回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,283,000	
３２回　東海旅客鉄道社債	100,000,000	107,960,000	
4回　東京地下鉄社債	120,000,000	128,095,200	
４７回　東京地下鉄社債	100,000,000	70,700,000	
7回　ニッコンＨＤ社債	300,000,000	288,306,000	
6回　横浜高速鉄道社債	200,000,000	191,630,000	
１２回　ソフトバンク社債	400,000,000	387,708,000	
３０回　光通信社債	200,000,000	180,290,000	
５２７回　中部電力社債	100,000,000	90,305,000	
５３２回　中部電力社債	200,000,000	190,014,000	
４９７回　関西電力社債	100,000,000	101,319,000	
５０８回　関西電力社債	300,000,000	296,820,000	
５３０回　関西電力社債	400,000,000	383,508,000	
５３１回　関西電力社債	200,000,000	170,430,000	
５４１回　関西電力社債	300,000,000	277,992,000	
３９６回　中国電力社債	200,000,000	188,160,000	
４２５回　中国電力社債	100,000,000	94,676,000	
３０７回　北陸電力社債	100,000,000	101,848,000	

	３１１回　北陸電力社債	100,000,000	100,623,000	
	４８８回　東北電力社債	100,000,000	98,864,000	
	５２１回　東北電力社債	400,000,000	380,720,000	
	５２５回　東北電力社債	200,000,000	195,010,000	
	５３６回　東北電力社債	300,000,000	276,513,000	
	３２０回　四国電力社債	300,000,000	281,589,000	
	４２６回　九州電力社債	400,000,000	403,268,000	
	４２８回　九州電力社債	100,000,000	100,901,000	
	４６３回　九州電力社債	100,000,000	88,834,000	
	４６６回　九州電力社債	100,000,000	87,590,000	
	４９１回　九州電力社債	300,000,000	278,553,000	
	４９２回　九州電力社債	100,000,000	82,091,000	
	４９３回　九州電力社債	200,000,000	196,634,000	
	５０７回　九州電力社債	200,000,000	189,256,000	
	３２１回　北海道電力社債	261,000,000	263,711,790	
	３４０回　北海道電力社債	300,000,000	296,514,000	
	３５０回　北海道電力社債	200,000,000	176,838,000	
	１３回　電源開発社債	200,000,000	207,870,000	
	５４回　電源開発社債	100,000,000	98,167,000	
	７５回　電源開発社債	200,000,000	185,164,000	
	４１回　東京瓦斯社債	200,000,000	180,404,000	
	５２回　東京瓦斯社債	100,000,000	85,177,000	
	５５回　東京瓦斯社債	100,000,000	81,660,000	
	５７回　東京瓦斯社債	300,000,000	200,550,000	
	７回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	197,790,000	
	８回　ファーストリテイリング社債	200,000,000	182,548,000	
社債券　合計		27,281,000,000	26,305,786,990	
合計			544,187,071,679	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,030,245,593
株式	353,679,998,270
派生商品評価勘定	31,691,230
未収配当金	605,141,059
前払金	258,565,000
差入委託証拠金	506,220,000
流動資産合計	367,111,861,152
資産合計	367,111,861,152
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	163,940,810
未払解約金	898,304,000
流動負債合計	1,062,244,810
負債合計	1,062,244,810
純資産の部	
元本等	
元本	113,153,180,874
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	252,896,435,468
元本等合計	366,049,616,342
純資産合計	366,049,616,342
負債純資産合計	367,111,861,152

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	140,692,906,135円
同期中追加設定元本額	126,890,517,939円
同期中一部解約元本額	154,430,243,200円
元本の内訳	
ファンド名	
MHAMスリーウェイオープン	234,935,632円
MHAM　ＴＯＰＩＸオープン	2,646,476,823円
MHAM日本株式インデックスファンド（ファンドラップ）	4,049,495,093円
Ｏｎｅ　ＤＣ　国内株式インデックスファンド	24,547,694,881円
ＤＩAM国内株式パッシブ・ファンド	4,902,547,555円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,104,079円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	16,922,410円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	44,353,151円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	26,541,745円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	23,505,480円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	28,002,416円
たわらノーロード　ＴＯＰＩＸ	1,707,918,547円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	1,439,950,089円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	52,388,240円
たわらノーロード　バランス（標準型）	346,773,204円
たわらノーロード　バランス（積極型）	543,071,139円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	4,367,064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）	193,888,523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）	469,423,866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）	327,070,843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）	459,325,287円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	410,901円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	1,749,277円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	33,093,014円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,215,832円

たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	12,566,600円
ＤＩＡＭ国内株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	33,744,062,427円
Ｏｎｅグローバルバランス	7,018,835円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	1,076,599,868円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	3,606,198,196円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	3,964,822,453円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	343,582,135円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	1,077,764,148円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	1,129,817,863円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	31,667,873円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	1,150,216,258円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	15,484,653円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	306,201,964円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	356,000,978円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	576,024,312円
投資のソムリエ	5,743,698,687円
クルーズコントロール	69,192,978円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	415,188,129円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	371,916,647円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	877,958,248円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	324,548,775円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,409,352,556円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	30,810,443円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	15,446,613円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,231,146円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	50,981,785円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	497,025,127円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	115,999,581円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	276,065,472円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	21,858,666円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	16,535,911円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	10,207,719円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	366,281,074円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,140,049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）	20,273,145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）	20,796,102円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	14,888,210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）	12,721,954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）	20,102,661円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	47,431,579円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２１－０６（適格機関投資家限定）	181,854,539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）	17,957,278円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（内外株式債券型・シグナルヘッジ付き）２０２２－０５（適格機関投資家限定）	114,572,400円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（日米資産投資・シグナルヘッジ付き）２０２２－１０（適格機関投資家限定）	515,358,737円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	152,825,216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）	9,586,119円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	30,257,311円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	294,994,531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）	34,611,881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）	3,027,914円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	3,768,730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）	46,249,953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）	90,479,527円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,440,855円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	20,890,766円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	4,584,891円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	92,241円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	5,991,744円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	26,778,118円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	437,275,013円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	533,483,788円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,565,625,264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）	16,123,588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）	22,544,617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）	230,745,406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）	56,367,147円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	67,452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）	283,402,510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）	16,362,589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）	55,466,457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）	127,280,342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）	178,296,635円
ＤＩＡＭ世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	32,164,906円
ＤＩＡＭ国内バランス３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	15,753,322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）	11,309,625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）	922,255,638円
ＤＩＡＭ世界アセットバランスファンド７ＶＡ（１３０６）（適格機関投資家限定）	1,220,307,862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）	48,743,066円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	24,646,311円
コア資産形成ファンド	16,525,883円
ＭＨＡＭトピックスファンド	776,349,832円
ＭＨＡＭ　ＴＯＰＩＸファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	50,742,120円

MHAM動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	3,198,759,908円
MHAM日本株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,497,351,931円
計	113,153,180,874円
２．　受益権の総数	113,153,180,874口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△3,037,199,780
合計	△3,037,199,780

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年2月8日から2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

株式関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	13,918,750,000	－	13,786,740,000	△132,010,000
合計	13,918,750,000	－	13,786,740,000	△132,010,000

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	3.2350円
（1万口当たり純資産額）	(32,350円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年1月11日現在

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
極洋	6,900	3,725.00	25,702,500	
ニッスイ	181,100	522.00	94,534,200	
マルハニチロ	26,800	2,418.00	64,802,400	
雪国まいたけ	15,400	993.00	15,292,200	
カネコ種苗	5,900	1,453.00	8,572,700	
サカタのタネ	22,900	4,145.00	94,920,500	
ホクト	16,200	1,859.00	30,115,800	
ホクリヨウ	2,500	743.00	1,857,500	
ショーボンドホールディングス	24,600	5,410.00	133,086,000	
ミライト・ワン	62,700	1,514.00	94,927,800	

タマホーム	12,700	2,483.00	31,534,100	
サンヨーホームズ	2,100	707.00	1,484,700	
日本アクア	7,600	818.00	6,216,800	
ファーストコーポレーション	4,800	702.00	3,369,600	
ベステラ	4,000	944.00	3,776,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	30,800	164.00	5,051,200	
キャンディル	2,700	500.00	1,350,000	
住石ホールディングス	28,200	392.00	11,054,400	
日鉄鉱業	7,200	3,270.00	23,544,000	
三井松島ホールディングス	8,000	3,100.00	24,800,000	
ＩＮＰＥＸ	669,900	1,378.00	923,122,200	
石油資源開発	20,900	3,825.00	79,942,500	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8,100	1,999.00	16,191,900	
ダイセキ環境ソリューション	3,800	944.00	3,587,200	
第一カッター興業	4,700	1,022.00	4,803,400	
明豊ファシリティワークス	6,600	714.00	4,712,400	
安藤・間	104,800	843.00	88,346,400	
東急建設	51,600	632.00	32,611,200	
コムシスホールディングス	61,300	2,332.00	142,951,600	
ビーアールホールディングス	28,800	329.00	9,475,200	
高松コンストラクショングループ	11,700	1,912.00	22,370,400	
東建コーポレーション	5,800	7,500.00	43,500,000	
ソネック	1,900	939.00	1,784,100	
ヤマウラ	9,300	1,008.00	9,374,400	
オリエンタル白石	65,300	285.00	18,610,500	
大成建設	126,100	4,090.00	515,749,000	
大林組	453,100	955.00	432,710,500	
清水建設	381,000	684.00	260,604,000	
飛島建設	14,000	1,006.00	14,084,000	
長谷工コーポレーション	130,700	1,456.00	190,299,200	
松井建設	11,800	548.00	6,466,400	
錢高組	1,500	2,632.00	3,948,000	
鹿島建設	281,000	1,491.00	418,971,000	
不動テトラ	8,600	1,478.00	12,710,800	
大末建設	4,700	1,148.00	5,395,600	
鉄建建設	9,200	1,758.00	16,173,600	
西松建設	21,500	3,880.00	83,420,000	
三井住友建設	102,200	410.00	41,902,000	
大豊建設	5,200	4,015.00	20,878,000	
佐田建設	8,100	439.00	3,555,900	
ナカノフドー建設	9,200	320.00	2,944,000	
奥村組	20,500	2,945.00	60,372,500	
東鉄工業	17,500	2,566.00	44,905,000	
イチケン	2,700	1,781.00	4,808,700	
富士ピー・エス	5,900	438.00	2,584,200	
淺沼組	10,100	3,000.00	30,300,000	
戸田建設	155,900	695.00	108,350,500	
熊谷組	21,900	2,551.00	55,866,900	
北野建設	2,200	2,459.00	5,409,800	
植木組	3,700	1,325.00	4,902,500	

矢作建設工業	17,400	763.00	13,276,200	
ピーエス三菱	16,100	606.00	9,756,600	
日本ハウスホールディングス	25,000	365.00	9,125,000	
大東建託	46,600	13,640.00	635,624,000	
新日本建設	17,800	754.00	13,421,200	
東亜道路工業	2,200	5,760.00	12,672,000	
日本道路	2,400	5,770.00	13,848,000	
東亜建設工業	10,900	2,325.00	25,342,500	
日本国土開発	38,000	552.00	20,976,000	
若築建設	5,600	2,743.00	15,360,800	
東洋建設	41,100	844.00	34,688,400	
五洋建設	179,600	611.00	109,735,600	
世紀東急工業	16,800	790.00	13,272,000	
福田組	4,400	4,455.00	19,602,000	
日本ドライケミカル	3,200	1,470.00	4,704,000	
住友林業	97,100	2,343.00	227,505,300	
日本基礎技術	8,000	508.00	4,064,000	
巴コーポレーション	14,200	396.00	5,623,200	
大和ハウス工業	354,100	3,009.00	1,065,486,900	
ライト工業	24,100	1,834.00	44,199,400	
積水ハウス	396,900	2,385.00	946,606,500	
日特建設	12,100	911.00	11,023,100	
北陸電気工事	8,600	660.00	5,676,000	
ユアテック	28,000	724.00	20,272,000	
日本リーテック	8,200	898.00	7,363,600	
四電工	5,300	1,732.00	9,179,600	
中電工	19,600	2,055.00	40,278,000	
関電工	69,500	840.00	58,380,000	
きんでん	89,300	1,393.00	124,394,900	
東京エネシス	12,500	928.00	11,600,000	
トーエネック	4,300	3,450.00	14,835,000	
住友電設	12,000	2,342.00	28,104,000	
日本電設工業	20,900	1,545.00	32,290,500	
エクシオグループ	58,400	2,229.00	130,173,600	
新日本空調	7,000	1,848.00	12,936,000	
日本工営	9,500	3,300.00	31,350,000	
九電工	30,800	3,175.00	97,790,000	
三機工業	28,200	1,520.00	42,864,000	
日揮ホールディングス	125,300	1,660.00	207,998,000	
中外炉工業	4,200	1,614.00	6,778,800	
ヤマト	10,700	688.00	7,361,600	
太平電業	7,800	3,305.00	25,779,000	
高砂熱学工業	30,500	1,733.00	52,856,500	
三晃金属工業	1,500	3,075.00	4,612,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	43,200	1,671.00	72,187,200	
朝日工業社	5,200	1,975.00	10,270,000	
明星工業	21,900	796.00	17,432,400	
大氣社	15,300	3,320.00	50,796,000	
ダイダン	8,200	2,137.00	17,523,400	
日比谷総合設備	11,000	1,893.00	20,823,000	

ニップン	34,400	1,578.00	54,283,200	
日清製粉グループ本社	117,500	1,602.00	188,235,000	
日東富士製粉	2,100	4,260.00	8,946,000	
昭和産業	11,200	2,435.00	27,272,000	
鳥越製粉	10,300	582.00	5,994,600	
中部飼料	17,700	1,022.00	18,089,400	
フィード・ワン	18,500	710.00	13,135,000	
東洋精糖	1,600	853.00	1,364,800	
日本甜菜製糖	7,500	1,634.00	12,255,000	
ＤＭ三井製糖ホールディングス	12,600	1,967.00	24,784,200	
塩水港精糖	15,700	196.00	3,077,200	
ウェルネオシュガー	6,500	1,765.00	11,472,500	
ＬＩＦＵＬＬ	45,300	219.00	9,920,700	
ＭＩＸＩ	30,200	2,481.00	74,926,200	
ジェイエイシーリクルートメント	11,900	2,315.00	27,548,500	
日本M&Aセンターホールディングス	227,700	1,721.00	391,871,700	
メンバーズ	4,000	1,997.00	7,988,000	
中広	1,000	373.00	373,000	
ＵＴグループ	19,400	2,445.00	47,433,000	
アイティメディア	5,000	1,586.00	7,930,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	8,400	1,350.00	11,340,000	
オープンアップグループ	48,500	1,689.00	81,916,500	
コシダカホールディングス	39,800	1,000.00	39,800,000	
アルトナー	3,200	1,029.00	3,292,800	
パソナグループ	16,100	1,906.00	30,686,600	
ＣＤＳ	3,300	1,752.00	5,781,600	
リンクアンドモチベーション	38,100	640.00	24,384,000	
エス・エム・エス	50,400	3,350.00	168,840,000	
サニーサイドアップグループ	4,700	518.00	2,434,600	
パーソルホールディングス	148,600	2,774.00	412,216,400	
リニカル	7,500	658.00	4,935,000	
クックパッド	36,400	198.00	7,207,200	
エスクリ	5,300	318.00	1,685,400	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,500	643.00	4,179,500	
森永製菓	23,500	3,740.00	87,890,000	
中村屋	2,700	3,065.00	8,275,500	
江崎グリコ	36,400	3,500.00	127,400,000	
名糖産業	5,000	1,637.00	8,185,000	
井村屋グループ	7,000	2,230.00	15,610,000	
不二家	8,600	2,497.00	21,474,200	
山崎製パン	85,200	1,496.00	127,459,200	
第一屋製パン	2,400	377.00	904,800	
モロゾフ	4,200	3,385.00	14,217,000	
亀田製菓	8,000	4,290.00	34,320,000	
寿スピリッツ	13,400	7,810.00	104,654,000	
カルビー	58,300	2,901.00	169,128,300	
森永乳業	23,100	4,700.00	108,570,000	
六甲バター	9,400	1,245.00	11,703,000	
ヤクルト本社	90,800	8,900.00	808,120,000	
明治ホールディングス	78,900	6,470.00	510,483,000	

雪印メグミルク	30,700	1,702.00	52,251,400	
プリマハム	17,200	2,083.00	35,827,600	
日本ハム	49,700	3,575.00	177,677,500	
林兼産業	3,800	468.00	1,778,400	
丸大食品	12,800	1,406.00	17,996,800	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	14,000	2,885.00	40,390,000	
柿安本店	4,900	2,050.00	10,045,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	99,000	680.00	67,320,000	
学情	5,900	1,297.00	7,652,300	
スタジオアリス	6,600	2,160.00	14,256,000	
クロスキャット	7,400	1,377.00	10,189,800	
シミックホールディングス	7,300	1,778.00	12,979,400	
エプコ	2,700	683.00	1,844,100	
システナ	217,900	401.00	87,377,900	
ＮＪＳ	2,500	2,054.00	5,135,000	
デジタルアーツ	8,000	5,600.00	44,800,000	
日鉄ソリューションズ	22,100	3,215.00	71,051,500	
綜合警備保障	49,200	3,400.00	167,280,000	
キューブシステム	7,700	1,029.00	7,923,300	
いちご	146,500	280.00	41,020,000	
日本駐車場開発	151,500	281.00	42,571,500	
コア	5,700	1,445.00	8,236,500	
カカクコム	99,100	2,076.00	205,731,600	
アイロムグループ	4,800	2,380.00	11,424,000	
セントケア・ホールディング	8,300	811.00	6,731,300	
サイネックス	2,100	558.00	1,171,800	
ルネサンス	9,300	876.00	8,146,800	
ディップ	23,200	3,690.00	85,608,000	
ＳＢＳホールディングス	11,500	2,749.00	31,613,500	
デジタルホールディングス	10,400	1,242.00	12,916,800	
新日本科学	14,000	2,456.00	34,384,000	
キャリアデザインセンター	2,600	1,498.00	3,894,800	
ベネフィット・ワン	61,500	1,975.00	121,462,500	
エムスリー	262,400	3,640.00	955,136,000	
ツカダ・グローバルホールディング	8,500	365.00	3,102,500	
ブラス	1,600	1,016.00	1,625,600	
アウトソーシング	79,000	948.00	74,892,000	
ウェルネット	11,800	613.00	7,233,400	
ワールドホールディングス	5,900	2,463.00	14,531,700	
ディー・エヌ・エー	56,500	1,764.00	99,666,000	
博報堂ＤＹホールディングス	169,300	1,342.00	227,200,600	
ぐるなび	24,300	382.00	9,282,600	
タカミヤ	18,000	362.00	6,516,000	
ジャパンベストレスキューシステム	8,100	832.00	6,739,200	
ファンコミュニケーションズ	26,000	407.00	10,582,000	
ライク	4,900	2,060.00	10,094,000	
ビジネス・ブレークスルー	5,000	376.00	1,880,000	
エスプール	38,100	638.00	24,307,800	
ＷＤＢホールディングス	6,700	2,117.00	14,183,900	
手間いらず	2,000	5,020.00	10,040,000	

ティア	8,000	417.00	3,336,000	
ＣＤＧ	1,500	1,047.00	1,570,500	
アドウェイズ	18,200	498.00	9,063,600	
バリューコマース	10,000	1,868.00	18,680,000	
インフォマート	137,800	366.00	50,434,800	
サッポロホールディングス	41,900	3,130.00	131,147,000	
アサヒグループホールディングス	293,900	4,089.00	1,201,757,100	
キリンホールディングス	574,000	1,939.50	1,113,273,000	
宝ホールディングス	86,800	1,010.00	87,668,000	
オエノンホールディングス	38,000	244.00	9,272,000	
養命酒製造	4,300	1,787.00	7,684,100	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	99,600	1,349.00	134,360,400	
サントリー食品インターナショナル	89,500	4,360.00	390,220,000	
ダイドーグループホールディングス	7,200	4,625.00	33,300,000	
伊藤園	47,300	4,380.00	207,174,000	
キーコーヒー	14,200	2,058.00	29,223,600	
ユニカフェ	4,400	901.00	3,964,400	
ジャパンフーズ	1,500	1,072.00	1,608,000	
日清オイリオグループ	17,900	3,095.00	55,400,500	
不二製油グループ本社	29,600	1,971.00	58,341,600	
かどや製油	1,200	3,485.00	4,182,000	
Ｊ－オイルミルズ	12,900	1,494.00	19,272,600	
ローソン	33,800	5,000.00	169,000,000	
サンエー	10,500	4,030.00	42,315,000	
カワチ薬品	10,700	2,218.00	23,732,600	
エービーシー・マート	19,800	7,140.00	141,372,000	
ハードオフコーポレーション	5,400	1,298.00	7,009,200	
高千穂交易	4,800	2,214.00	10,627,200	
アスクル	32,900	1,669.00	54,910,100	
ゲオホールディングス	14,300	1,987.00	28,414,100	
アダストリア	16,500	2,227.00	36,745,500	
ジーフット	7,100	293.00	2,080,300	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,800	405.00	729,000	
オルバヘルスケアホールディングス	2,100	1,558.00	3,271,800	
伊藤忠食品	2,600	4,825.00	12,545,000	
くら寿司	16,000	3,120.00	49,920,000	
キャンドゥ	4,800	2,218.00	10,646,400	
エレマテック	12,200	1,560.00	19,032,000	
ＩＫホールディングス	4,500	390.00	1,755,000	
パルグループホールディングス	13,300	2,524.00	33,569,200	
エディオン	54,000	1,260.00	68,040,000	
あらた	10,500	4,030.00	42,315,000	
サーラコーポレーション	28,700	715.00	20,520,500	
ワッツ	6,600	711.00	4,692,600	
トーメンデバイス	1,800	5,650.00	10,170,000	
ハローズ	6,100	3,055.00	18,635,500	
ＪＰホールディングス	38,100	322.00	12,268,200	
フジオフードグループ本社	11,400	1,384.00	15,777,600	
あみやき亭	3,300	2,871.00	9,474,300	

東京エレクトロン　デバイス	5,000	7,010.00	35,050,000	
ひらまつ	29,200	188.00	5,489,600	
円谷フィールズホールディングス	11,700	2,397.00	28,044,900	
双日	145,100	2,469.00	358,251,900	
アルフレッサ　ホールディングス	137,100	1,591.00	218,126,100	
大黒天物産	4,800	5,150.00	24,720,000	
ハニーズホールディングス	12,100	1,452.00	17,569,200	
ファーマライズホールディングス	3,000	612.00	1,836,000	
キッコーマン	84,200	6,790.00	571,718,000	
味の素	311,300	3,917.00	1,219,362,100	
ブルドックソース	5,000	1,809.00	9,045,000	
キユーピー	68,400	2,163.00	147,949,200	
ハウス食品グループ本社	38,900	2,642.00	102,773,800	
カゴメ	59,300	2,913.00	172,740,900	
焼津水産化学工業	5,700	822.00	4,685,400	
アリアケジャパン	11,100	4,330.00	48,063,000	
ピエトロ	1,600	1,803.00	2,884,800	
エバラ食品工業	3,200	3,005.00	9,616,000	
やまみ	1,100	1,379.00	1,516,900	
ニチレイ	58,400	2,693.00	157,271,200	
横浜冷凍	37,200	1,064.00	39,580,800	
東洋水産	64,300	4,910.00	315,713,000	
イートアンドホールディングス	5,300	2,246.00	11,903,800	
大冷	1,600	1,885.00	3,016,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	645.00	5,160,000	
日清食品ホールディングス	44,700	10,230.00	457,281,000	
永谷園ホールディングス	6,200	2,003.00	12,418,600	
一正蒲鉾	5,400	716.00	3,866,400	
フジッコ	13,000	1,862.00	24,206,000	
ロック・フィールド	15,600	1,482.00	23,119,200	
日本たばこ産業	837,600	2,584.00	2,164,358,400	
ケンコーマヨネーズ	8,600	1,328.00	11,420,800	
わらべや日洋ホールディングス	9,400	1,973.00	18,546,200	
なとり	8,000	2,044.00	16,352,000	
イフジ産業	2,100	918.00	1,927,800	
ファーマフーズ	19,500	1,249.00	24,355,500	
北の達人コーポレーション	54,500	302.00	16,459,000	
ユーグレナ	81,900	954.00	78,132,600	
紀文食品	9,900	939.00	9,296,100	
ピックルスホールディングス	7,400	1,125.00	8,325,000	
スター・マイカ・ホールディングス	11,500	725.00	8,337,500	
ＳＲＥホールディングス	6,100	3,590.00	21,899,000	
ＡＤワークスグループ	31,700	143.00	4,533,100	
片倉工業	11,800	1,689.00	19,930,200	
グンゼ	9,700	4,125.00	40,012,500	
ヒューリック	296,800	1,036.00	307,484,800	
神栄	1,700	786.00	1,336,200	
ラサ商事	6,200	1,166.00	7,229,200	
アルペン	11,200	1,955.00	21,896,000	
ハブ	4,500	620.00	2,790,000	

ラクーンホールディングス	12,800	1,102.00	14,105,600	
クオールホールディングス	18,700	1,142.00	21,355,400	
アルコニックス	17,900	1,325.00	23,717,500	
神戸物産	105,700	3,665.00	387,390,500	
ソリトンシステムズ	6,600	1,090.00	7,194,000	
ジンズホールディングス	8,000	4,000.00	32,000,000	
ビックカメラ	90,800	1,196.00	108,596,800	
ＤＣＭホールディングス	83,400	1,171.00	97,661,400	
ペッパーフードサービス	28,500	175.00	4,987,500	
ハイパー	2,100	443.00	930,300	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	193,700	1,911.00	370,160,700	
東京一番フーズ	3,200	477.00	1,526,400	
ＤＤホールディングス	8,600	695.00	5,977,000	
あい　ホールディングス	21,900	2,106.00	46,121,400	
ディーブイエックス	3,900	1,048.00	4,087,200	
きちりホールディングス	3,800	572.00	2,173,600	
アークランドサービスホールディングス	11,200	2,152.00	24,102,400	
Ｊ．フロント　リテイリング	169,900	1,130.00	191,987,000	
ドトール・日レスホールディングス	24,200	1,672.00	40,462,400	
マツキヨココカラ＆カンパニー	82,900	6,460.00	535,534,000	
ブロンコビリー	7,300	2,418.00	17,651,400	
ＺＯＺＯ	90,300	3,225.00	291,217,500	
トレジャー・ファクトリー	4,100	2,484.00	10,184,400	
物語コーポレーション	7,600	6,460.00	49,096,000	
三越伊勢丹ホールディングス	230,100	1,335.00	307,183,500	
東洋紡	55,800	996.00	55,576,800	
ユニチカ	39,000	241.00	9,399,000	
富士紡ホールディングス	5,000	3,190.00	15,950,000	
日清紡ホールディングス	106,100	955.00	101,325,500	
倉敷紡績	9,700	2,113.00	20,496,100	
ダイワボウホールディングス	55,800	1,918.00	107,024,400	
シキボウ	7,200	952.00	6,854,400	
日東紡績	15,400	1,929.00	29,706,600	
トヨタ紡織	54,300	1,800.00	97,740,000	
マクニカホールディングス	33,500	3,255.00	109,042,500	
Ｈａｍｅｅ	5,400	712.00	3,844,800	
マーケットエンタープライズ	1,300	967.00	1,257,100	
ラクト・ジャパン	5,200	2,184.00	11,356,800	
ウエルシアホールディングス	70,900	3,045.00	215,890,500	
クリエイトＳＤホールディングス	22,600	3,210.00	72,546,000	
グリムス	5,600	2,173.00	12,168,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,800	815.00	16,137,000	
八洲電機	11,100	1,058.00	11,743,800	
メディアスホールディングス	8,600	688.00	5,916,800	
レスターホールディングス	13,000	2,049.00	26,637,000	
ジューテックホールディングス	2,600	1,177.00	3,060,200	
丸善ＣＨＩホールディングス	16,300	329.00	5,362,700	
大光	5,900	659.00	3,888,100	

ＯＣＨＩホールディングス	3,200	1,239.00	3,964,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	67,400	842.00	56,750,800	
黒谷	3,900	600.00	2,340,000	
ミサワ	2,300	648.00	1,490,400	
ティーライフ	1,600	1,293.00	2,068,800	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2,300	732.00	1,683,600	
エー・ピーホールディングス	1,800	455.00	819,000	
三洋貿易	14,000	1,093.00	15,302,000	
チムニー	4,300	1,121.00	4,820,300	
シュッピン	10,100	1,229.00	12,412,900	
ビューティガレージ	2,300	3,490.00	8,027,000	
オイシックス・ラ・大地	18,300	2,420.00	44,286,000	
ウイン・パートナーズ	10,000	991.00	9,910,000	
ネクステージ	31,100	2,576.00	80,113,600	
ジョイフル本田	43,800	1,909.00	83,614,200	
鳥貴族ホールディングス	5,000	2,078.00	10,390,000	
ホットランド	10,500	1,454.00	15,267,000	
すかいらーくホールディングス	186,800	1,537.00	287,111,600	
ＳＦＰホールディングス	7,500	1,797.00	13,477,500	
綿半ホールディングス	10,700	1,327.00	14,198,900	
日本毛織	34,100	941.00	32,088,100	
ダイトウボウ	21,500	81.00	1,741,500	
トーア紡コーポレーション	4,100	342.00	1,402,200	
ダイドーリミテッド	19,700	270.00	5,319,000	
ヨシックスホールディングス	2,500	2,157.00	5,392,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,600	1,110.00	49,506,000	
三栄建築設計	6,100	1,474.00	8,991,400	
野村不動産ホールディングス	79,400	2,837.00	225,257,800	
三重交通グループホールディングス	27,300	477.00	13,022,100	
サムティ	20,100	2,125.00	42,712,500	
ディア・ライフ	19,100	602.00	11,498,200	
コーセーアールイー	4,200	814.00	3,418,800	
地主	9,700	1,798.00	17,440,600	
プレサンスコーポレーション	16,700	1,531.00	25,567,700	
フィル・カンパニー	2,100	992.00	2,083,200	
ＴＨＥグローバル社	7,500	210.00	1,575,000	
ハウスコム	1,900	1,096.00	2,082,400	
ＪＰＭＣ	6,400	998.00	6,387,200	
サンセイランディック	3,900	821.00	3,201,900	
エストラスト	1,500	580.00	870,000	
フージャースホールディングス	19,500	749.00	14,605,500	
オープンハウスグループ	46,600	5,050.00	235,330,000	
東急不動産ホールディングス	382,500	637.00	243,652,500	
飯田グループホールディングス	111,300	2,044.00	227,497,200	
イーグランド	1,800	1,474.00	2,653,200	
ムゲンエステート	8,400	477.00	4,006,800	
帝国繊維	14,500	1,523.00	22,083,500	
日本コークス工業	116,900	88.00	10,287,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,100	1,505.00	9,180,500	

ミタチ産業	3,600	1,035.00	3,726,000	
ＢＥＥＮＯＳ	7,700	2,027.00	15,607,900	
あさひ	11,400	1,347.00	15,355,800	
日本調剤	9,300	1,152.00	10,713,600	
コスモス薬品	15,500	13,410.00	207,855,000	
シップヘルスケアホールディングス	49,100	2,566.00	125,990,600	
トーエル	6,000	755.00	4,530,000	
ソフトクリエイトホールディングス	5,300	3,225.00	17,092,500	
セブン&アイ・ホールディングス	471,100	5,749.00	2,708,353,900	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	102,800	931.00	95,706,800	
明治電機工業	5,000	1,060.00	5,300,000	
ツルハホールディングス	33,500	9,660.00	323,610,000	
デリカフーズホールディングス	5,500	505.00	2,777,500	
スターティアホールディングス	2,500	950.00	2,375,000	
サンマルクホールディングス	11,100	1,691.00	18,770,100	
フェリシモ	3,100	1,003.00	3,109,300	
トリドールホールディングス	33,900	2,701.00	91,563,900	
帝人	124,200	1,276.00	158,479,200	
東レ	867,000	742.10	643,400,700	
クラレ	205,800	1,038.00	213,620,400	
旭化成	808,200	933.50	754,454,700	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	14,000	297.00	4,158,000	
稲葉製作所	7,800	1,385.00	10,803,000	
宮地エンジニアリンググループ	3,800	3,525.00	13,395,000	
トーカロ	36,600	1,168.00	42,748,800	
アルファ	4,900	924.00	4,527,600	
ＳＵＭＣＯ	253,700	1,869.00	474,165,300	
川田テクノロジーズ	3,200	3,300.00	10,560,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	8,800	3,750.00	33,000,000	
ジェイテックコーポレーション	1,600	3,085.00	4,936,000	
信和	7,300	790.00	5,767,000	
ビーロット	8,500	533.00	4,530,500	
ファーストブラザーズ	2,400	894.00	2,145,600	
Ａｎｄ　Ｄｏホールディングス	7,500	800.00	6,000,000	
シーアールイー	5,700	1,125.00	6,412,500	
プロパティエージェント	1,500	1,173.00	1,759,500	
ケイアイスター不動産	6,000	4,850.00	29,100,000	
アグレ都市デザイン	2,100	1,569.00	3,294,900	
グッドコムアセット	11,700	784.00	9,172,800	
ジェイ・エス・ビー	3,100	4,250.00	13,175,000	
ロードスターキャピタル	5,400	1,640.00	8,856,000	
テンポイノベーション	4,000	1,065.00	4,260,000	
グローバル・リンク・マネジメント	2,300	1,104.00	2,539,200	
フェイスネットワーク	1,600	1,386.00	2,217,600	
住江織物	2,200	1,838.00	4,043,600	
日本フエルト	7,300	400.00	2,920,000	
イチカワ	1,500	1,309.00	1,963,500	
エコナックホールディングス	23,000	87.00	2,001,000	
日東製網	1,500	1,403.00	2,104,500	

芦森工業	2,200	1,277.00	2,809,400	
アツギ	7,400	397.00	2,937,800	
ウイルプラスホールディングス	2,400	1,106.00	2,654,400	
ＪＭホールディングス	11,500	1,659.00	19,078,500	
コメダホールディングス	33,500	2,412.00	80,802,000	
サツドラホールディングス	6,100	757.00	4,617,700	
アレンザホールディングス	10,300	1,007.00	10,372,100	
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,711.00	6,330,700	
バロックジャパンリミテッド	8,800	840.00	7,392,000	
クスリのアオキホールディングス	13,700	7,600.00	104,120,000	
ダイニック	3,300	616.00	2,032,800	
共和レザー	7,500	498.00	3,735,000	
ピーバンドットコム	1,600	513.00	820,800	
力の源ホールディングス	7,500	1,016.00	7,620,000	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	78,500	2,923.00	229,455,500	
アセンテック	4,600	449.00	2,065,400	
セーレン	24,900	2,357.00	58,689,300	
ソトー	4,200	814.00	3,418,800	
東海染工	1,300	1,121.00	1,457,300	
小松マテーレ	18,700	764.00	14,286,800	
ワコールホールディングス	24,800	2,371.00	58,800,800	
ホギメディカル	17,400	3,350.00	58,290,000	
クラウディアホールディングス	3,000	395.00	1,185,000	
ＴＳＩホールディングス	46,300	430.00	19,909,000	
マツオカコーポレーション	3,600	1,068.00	3,844,800	
ワールド	16,600	1,296.00	21,513,600	
ＴＩＳ	145,600	3,515.00	511,784,000	
ＪＮＳホールディングス	5,700	314.00	1,789,800	
グリー	69,400	709.00	49,204,600	
GMOペパボ	1,700	1,951.00	3,316,700	
コーエーテクモホールディングス	81,100	2,345.00	190,179,500	
三菱総合研究所	6,300	4,745.00	29,893,500	
ボルテージ	3,800	316.00	1,200,800	
電算	800	1,531.00	1,224,800	
ＡＧＳ	5,400	686.00	3,704,400	
ファインデックス	10,400	514.00	5,345,600	
ブレインパッド	12,800	763.00	9,766,400	
ＫＬａｂ	25,400	458.00	11,633,200	
ポールトゥウィンホールディングス	22,100	842.00	18,608,200	
ネクソン	334,800	3,035.00	1,016,118,000	
アイスタイル	41,400	513.00	21,238,200	
エムアップホールディングス	15,900	1,378.00	21,910,200	
エイチーム	9,600	719.00	6,902,400	
エニグモ	16,400	641.00	10,512,400	
テクノスジャパン	10,700	469.00	5,018,300	
ｅｎｉｓｈ	9,700	364.00	3,530,800	
コロプラ	50,200	633.00	31,776,600	
オルトプラス	9,800	203.00	1,989,400	
ブロードリーフ	75,600	438.00	33,112,800	

クロス・マーケティンググループ	5,100	760.00	3,876,000	
デジタルハーツホールディングス	8,000	1,785.00	14,280,000	
システム情報	11,400	835.00	9,519,000	
メディアドゥ	5,200	1,714.00	8,912,800	
じげん	37,600	376.00	14,137,600	
ブイキューブ	15,500	747.00	11,578,500	
エンカレッジ・テクノロジ	3,100	493.00	1,528,300	
サイバーリンクス	4,200	981.00	4,120,200	
ディー・エル・イー	9,300	260.00	2,418,000	
フィックスターズ	14,500	1,203.00	17,443,500	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	6,100	1,604.00	9,784,400	
オプティム	10,700	1,053.00	11,267,100	
セレス	5,100	976.00	4,977,600	
ＳＨＩＦＴ	9,500	24,650.00	234,175,000	
特種東海製紙	6,400	2,797.00	17,900,800	
ティーガイア	13,400	1,608.00	21,547,200	
セック	1,600	2,742.00	4,387,200	
テクマトリックス	23,600	1,779.00	41,984,400	
プロシップ	5,600	1,480.00	8,288,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,700	2,126.00	84,402,200	
GMOペイメントゲートウェイ	29,600	11,420.00	338,032,000	
ザッパラス	4,800	371.00	1,780,800	
システムリサーチ	4,100	2,151.00	8,819,100	
インターネットイニシアティブ	72,300	2,380.00	172,074,000	
さくらインターネット	14,500	490.00	7,105,000	
ヴィンクス	3,900	1,477.00	5,760,300	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	4,135.00	16,540,000	
ＳＲＡホールディングス	6,500	2,982.00	19,383,000	
システムインテグレータ	4,000	433.00	1,732,000	
朝日ネット	13,900	581.00	8,075,900	
ｅＢＡＳＥ	18,100	572.00	10,353,200	
アバントグループ	16,300	1,368.00	22,298,400	
アドソル日進	5,400	1,327.00	7,165,800	
ＯＤＫソリューションズ	2,700	601.00	1,622,700	
フリービット	7,900	997.00	7,876,300	
コムチュア	17,200	2,356.00	40,523,200	
サイバーコム	1,900	1,485.00	2,821,500	
アステリア	10,100	768.00	7,756,800	
アイル	7,200	1,766.00	12,715,200	
王子ホールディングス	539,200	517.00	278,766,400	
日本製紙	67,200	927.00	62,294,400	
三菱製紙	15,600	280.00	4,368,000	
北越コーポレーション	81,800	785.00	64,213,000	
中越パルプ工業	5,100	987.00	5,033,700	
巴川製紙所	4,100	676.00	2,771,600	
大王製紙	57,100	974.00	55,615,400	
阿波製紙	3,200	371.00	1,187,200	
マークラインズ	7,000	2,551.00	17,857,000	

メディカル・データ・ビジョン	19,200	905.00	17,376,000	
ｇｕｍｉ	21,100	976.00	20,593,600	
ショーケース	3,100	310.00	961,000	
モバイルファクトリー	2,500	902.00	2,255,000	
テラスカイ	5,500	2,347.00	12,908,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,600	1,783.00	11,767,800	
ＰＣＩホールディングス	5,300	1,029.00	5,453,700	
アイビーシー	1,800	400.00	720,000	
ネオジャパン	4,400	1,018.00	4,479,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	3,300	2,458.00	8,111,400	
ラクス	61,100	1,659.00	101,364,900	
ランドコンピュータ	3,200	925.00	2,960,000	
ダブルスタンダード	5,200	2,275.00	11,830,000	
オープンドア	9,100	1,778.00	16,179,800	
マイネット	4,200	370.00	1,554,000	
アカツキ	6,000	2,217.00	13,302,000	
ベネフィットジャパン	800	1,207.00	965,600	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	4,100	2,185.00	8,958,500	
カナミックネットワーク	18,600	540.00	10,044,000	
ノムラシステムコーポレーション	12,300	114.00	1,402,200	
レンゴー	117,700	882.00	103,811,400	
トーモク	7,500	1,620.00	12,150,000	
ザ・パック	9,600	2,436.00	23,385,600	
チェンジ	31,600	2,100.00	66,360,000	
シンクロ・フード	8,000	457.00	3,656,000	
オークネット	6,600	1,783.00	11,767,800	
キャピタル・アセット・プランニング	2,400	572.00	1,372,800	
セグエグループ	3,600	829.00	2,984,400	
エイトレッド	1,800	1,430.00	2,574,000	
マクロミル	29,300	1,108.00	32,464,400	
ビーグリー	2,000	1,166.00	2,332,000	
オロ	4,000	1,950.00	7,800,000	
ユーザーローカル	4,700	1,308.00	6,147,600	
テモナ	2,400	263.00	631,200	
ニーズウェル	4,100	751.00	3,079,100	
マネーフォワード	31,100	4,370.00	135,907,000	
サインポスト	4,900	645.00	3,160,500	
レゾナック・ホールディングス	125,000	2,120.00	265,000,000	
住友化学	960,100	473.00	454,127,300	
住友精化	5,300	4,005.00	21,226,500	
日産化学	61,400	5,890.00	361,646,000	
ラサ工業	4,900	1,901.00	9,314,900	
クレハ	11,100	8,290.00	92,019,000	
多木化学	5,000	4,485.00	22,425,000	
テイカ	8,500	1,168.00	9,928,000	
石原産業	23,400	1,061.00	24,827,400	
片倉コープアグリ	2,500	1,594.00	3,985,000	
日本曹達	13,900	4,120.00	57,268,000	
東ソー	172,600	1,584.00	273,398,400	

トクヤマ	41,800	1,783.00	74,529,400	
セントラル硝子	20,800	2,770.00	57,616,000	
東亞合成	66,400	1,116.00	74,102,400	
大阪ソーダ	7,700	3,940.00	30,338,000	
関東電化工業	24,900	933.00	23,231,700	
デンカ	47,000	3,030.00	142,410,000	
イビデン	74,900	5,170.00	387,233,000	
信越化学工業	218,400	16,650.00	3,636,360,000	
日本カーバイド工業	4,900	1,290.00	6,321,000	
電算システムホールディングス	6,200	2,129.00	13,199,800	
堺化学工業	9,800	1,771.00	17,355,800	
第一稀元素化学工業	11,700	1,042.00	12,191,400	
エア・ウォーター	122,000	1,540.00	187,880,000	
日本酸素ホールディングス	125,500	2,024.00	254,012,000	
日本化学工業	4,400	1,706.00	7,506,400	
東邦アセチレン	2,600	1,131.00	2,940,600	
日本パーカライジング	64,100	923.00	59,164,300	
高圧ガス工業	18,800	657.00	12,351,600	
チタン工業	1,500	1,470.00	2,205,000	
四国化成ホールディングス	15,400	1,299.00	20,004,600	
戸田工業	2,700	2,515.00	6,790,500	
ステラ　ケミファ	7,600	2,517.00	19,129,200	
保土谷化学工業	3,700	2,853.00	10,556,100	
日本触媒	19,600	5,280.00	103,488,000	
大日精化工業	8,900	1,686.00	15,005,400	
カネカ	29,500	3,275.00	96,612,500	
協和キリン	156,600	2,941.00	460,560,600	
三菱瓦斯化学	96,600	1,824.00	176,198,400	
三井化学	108,700	3,040.00	330,448,000	
ＪＳＲ	120,700	2,796.00	337,477,200	
東京応化工業	22,600	6,250.00	141,250,000	
大阪有機化学工業	9,700	1,999.00	19,390,300	
三菱ケミカルグループ	873,200	686.80	599,713,760	
ＫＨネオケム	21,500	2,712.00	58,308,000	
ダイセル	190,100	946.00	179,834,600	
住友ベークライト	19,100	3,985.00	76,113,500	
積水化学工業	264,600	1,869.00	494,537,400	
日本ゼオン	77,600	1,343.00	104,216,800	
アイカ工業	32,600	2,988.00	97,408,800	
ＵＢＥ	66,600	1,932.00	128,671,200	
積水樹脂	18,800	1,827.00	34,347,600	
タキロンシーアイ	28,400	512.00	14,540,800	
旭有機材	8,400	2,760.00	23,184,000	
ニチバン	8,000	1,833.00	14,664,000	
リケンテクノス	27,900	481.00	13,419,900	
大倉工業	5,900	1,810.00	10,679,000	
積水化成品工業	18,100	380.00	6,878,000	
群栄化学工業	2,600	2,367.00	6,154,200	
タイガースポリマー	6,000	400.00	2,400,000	
ミライアル	4,000	1,459.00	5,836,000	

ダイキアクシス	4,800	655.00	3,144,000	
ダイキョーニシカワ	28,500	552.00	15,732,000	
竹本容器	4,500	733.00	3,298,500	
森六ホールディングス	6,500	1,716.00	11,154,000	
恵和	8,600	1,574.00	13,536,400	
日本化薬	98,800	1,138.00	112,434,400	
カーリットホールディングス	11,600	766.00	8,885,600	
ソルクシーズ	10,600	352.00	3,731,200	
ＣＬホールディングス	3,800	786.00	2,986,800	
プレステージ・インターナショナル	55,800	688.00	38,390,400	
フェイス	3,800	510.00	1,938,000	
プロトコーポレーション	16,200	1,178.00	19,083,600	
ハイマックス	4,100	1,438.00	5,895,800	
アミューズ	7,200	1,705.00	12,276,000	
野村総合研究所	265,800	3,170.00	842,586,000	
ドリームインキュベータ	4,100	2,505.00	10,270,500	
サイバネットシステム	10,900	985.00	10,736,500	
クイック	10,100	2,068.00	20,886,800	
ＴＡＣ	6,600	202.00	1,333,200	
ＣＥホールディングス	6,600	501.00	3,306,600	
日本システム技術	5,300	1,647.00	8,729,100	
電通グループ	130,500	4,170.00	544,185,000	
インテージホールディングス	17,600	1,390.00	24,464,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,446.00	6,651,600	
東邦システムサイエンス	3,800	1,002.00	3,807,600	
ぴあ	4,500	3,100.00	13,950,000	
イオンファンタジー	5,700	2,760.00	15,732,000	
ソースネクスト	65,900	304.00	20,033,600	
シーティーエス	14,700	785.00	11,539,500	
ネクシィーズグループ	4,200	644.00	2,704,800	
インフォコム	16,700	2,096.00	35,003,200	
メディカルシステムネットワーク	11,800	414.00	4,885,200	
日本精化	7,300	2,257.00	16,476,100	
扶桑化学工業	11,900	3,500.00	41,650,000	
トリケミカル研究所	17,300	2,156.00	37,298,800	
シンプレクス・ホールディングス	21,700	2,144.00	46,524,800	
ＨＥＲＯＺ	4,400	995.00	4,378,000	
ラクスル	18,200	3,350.00	60,970,000	
メルカリ	58,300	2,792.00	162,773,600	
ＩＰＳ	4,300	2,738.00	11,773,400	
ＦＩＧ	14,900	384.00	5,721,600	
システムサポート	5,500	1,411.00	7,760,500	
ＡＤＥＫＡ	45,100	2,162.00	97,506,200	
日油	40,100	5,210.00	208,921,000	
ミヨシ油脂	4,600	915.00	4,209,000	
新日本理化	17,800	245.00	4,361,000	
ハリマ化成グループ	9,100	810.00	7,371,000	
イーソル	8,100	779.00	6,309,900	
アルテリア・ネットワークス	12,000	1,243.00	14,916,000	
東海ソフト	2,000	931.00	1,862,000	

ウイングアーク１ｓｔ	13,200	2,071.00	27,337,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,480.00	5,328,000	
サーバーワークス	2,400	2,480.00	5,952,000	
東名	900	1,696.00	1,526,400	
ヴィッツ	1,200	933.00	1,119,600	
トビラシステムズ	3,200	816.00	2,611,200	
Ｓａｎｓａｎ	48,300	1,303.00	62,934,900	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	2,300	976.00	2,244,800	
ギフティ	13,900	1,807.00	25,117,300	
花王	315,100	5,103.00	1,607,955,300	
第一工業製薬	4,700	1,962.00	9,221,400	
石原ケミカル	5,800	1,221.00	7,081,800	
日華化学	5,200	809.00	4,206,800	
ニイタカ	2,400	1,962.00	4,708,800	
三洋化成工業	7,900	4,020.00	31,758,000	
メドレー	13,000	4,080.00	53,040,000	
ベース	4,500	3,670.00	16,515,000	
ＪＭＤＣ	21,300	3,965.00	84,454,500	
武田薬品工業	1,146,600	4,099.00	4,699,913,400	
アステラス製薬	1,241,700	1,914.50	2,377,234,650	
住友ファーマ	96,100	904.00	86,874,400	
塩野義製薬	165,600	6,295.00	1,042,452,000	
わかもと製薬	12,000	218.00	2,616,000	
日本新薬	30,500	7,070.00	215,635,000	
中外製薬	405,700	3,301.00	1,339,215,700	
科研製薬	22,200	3,660.00	81,252,000	
エーザイ	157,600	8,329.00	1,312,650,400	
理研ビタミン	11,100	1,839.00	20,412,900	
ロート製薬	125,400	2,183.00	273,748,200	
小野薬品工業	249,900	2,904.00	725,709,600	
久光製薬	28,800	3,665.00	105,552,000	
有機合成薬品工業	9,700	290.00	2,813,000	
持田製薬	15,500	3,250.00	50,375,000	
参天製薬	243,700	1,041.00	253,691,700	
扶桑薬品工業	4,200	1,965.00	8,253,000	
日本ケミファ	1,300	1,681.00	2,185,300	
ツムラ	40,700	2,707.00	110,174,900	
テルモ	403,600	3,651.00	1,473,543,600	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	38,800	2,810.00	109,028,000	
キッセイ薬品工業	19,900	2,459.00	48,934,100	
生化学工業	24,600	829.00	20,393,400	
栄研化学	21,000	1,643.00	34,503,000	
鳥居薬品	6,900	2,879.00	19,865,100	
ＪＣＲファーマ	43,700	1,535.00	67,079,500	
東和薬品	19,800	2,014.00	39,877,200	
富士製薬工業	8,200	1,022.00	8,380,400	
ゼリア新薬工業	17,900	2,094.00	37,482,600	
第一三共	1,128,700	3,952.00	4,460,622,400	
キョーリン製薬ホールディングス	28,100	1,657.00	46,561,700	

大幸薬品	23,400	373.00	8,728,200	
ダイト	9,700	2,428.00	23,551,600	
大塚ホールディングス	296,500	4,087.00	1,211,795,500	
大正製薬ホールディングス	28,800	5,320.00	153,216,000	
ペプチドリーム	62,700	2,050.00	128,535,000	
大日本塗料	15,900	766.00	12,179,400	
日本ペイントホールディングス	572,600	1,152.00	659,635,200	
関西ペイント	118,400	1,633.00	193,347,200	
神東塗料	11,400	130.00	1,482,000	
中国塗料	24,000	966.00	23,184,000	
日本特殊塗料	8,100	860.00	6,966,000	
藤倉化成	17,600	422.00	7,427,200	
太陽ホールディングス	19,600	2,272.00	44,531,200	
ＤＩＣ	50,500	2,345.00	118,422,500	
サカタインクス	28,800	1,030.00	29,664,000	
東洋インキＳＣホールディングス	25,300	1,787.00	45,211,100	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	11,400	1,264.00	14,409,600	
アルプス技研	11,500	2,064.00	23,736,000	
サニックス	21,300	209.00	4,451,700	
日本空調サービス	14,300	685.00	9,795,500	
オリエンタルランド	140,500	19,085.00	2,681,442,500	
フォーカスシステムズ	9,500	1,009.00	9,585,500	
ダスキン	29,500	2,950.00	87,025,000	
パーク２４	99,100	2,121.00	210,191,100	
明光ネットワークジャパン	17,500	605.00	10,587,500	
ファルコホールディングス	5,900	1,707.00	10,071,300	
クレスコ	10,000	1,709.00	17,090,000	
フジ・メディア・ホールディングス	124,300	1,052.00	130,763,600	
秀英予備校	3,000	432.00	1,296,000	
田谷	1,600	532.00	851,200	
ラウンドワン	111,000	489.00	54,279,000	
リゾートトラスト	52,500	2,292.00	120,330,000	
オービック	43,200	19,730.00	852,336,000	
ジャストシステム	18,500	2,940.00	54,390,000	
ＴＤＣソフト	11,000	1,450.00	15,950,000	
Ｚホールディングス	1,843,900	341.00	628,769,900	
ビー・エム・エル	16,400	3,250.00	53,300,000	
トレンドマイクロ	74,900	6,110.00	457,639,000	
りらいあコミュニケーションズ	21,900	969.00	21,221,100	
ＩＤホールディングス	8,600	908.00	7,808,800	
リソー教育	60,300	350.00	21,105,000	
日本オラクル	24,700	8,410.00	207,727,000	
早稲田アカデミー	7,400	1,131.00	8,369,400	
アルファシステムズ	4,200	3,905.00	16,401,000	
フューチャー	32,100	1,587.00	50,942,700	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,000	1,415.00	11,320,000	
ＳＢテクノロジー	5,400	1,873.00	10,114,200	
トーセ	3,500	766.00	2,681,000	
ユー・エス・エス	136,600	2,017.00	275,522,200	
オービックビジネスコンサルタント	25,400	4,280.00	108,712,000	

伊藤忠テクノソリューションズ	69,500	3,055.00	212,322,500	
アイティフォー	17,100	828.00	14,158,800	
東京個別指導学院	15,800	514.00	8,121,200	
東計電算	1,600	5,150.00	8,240,000	
サイバーエージェント	317,700	1,188.00	377,427,600	
楽天グループ	614,100	618.00	379,513,800	
エックスネット	1,700	998.00	1,696,600	
クリーク・アンド・リバー社	7,700	1,970.00	15,169,000	
モーニングスター	21,700	460.00	9,982,000	
テー・オー・ダブリュー	28,500	286.00	8,151,000	
大塚商会	73,300	4,180.00	306,394,000	
サイボウズ	17,800	2,377.00	42,310,600	
山田コンサルティンググループ	6,600	1,153.00	7,609,800	
セントラルスポーツ	5,000	2,390.00	11,950,000	
パラカ	4,600	1,863.00	8,569,800	
電通国際情報サービス	15,800	3,980.00	62,884,000	
ＡＣＣＥＳＳ	15,400	882.00	13,582,800	
デジタルガレージ	23,000	4,300.00	98,900,000	
イーエムシステムズ	21,600	864.00	18,662,400	
ウェザーニューズ	4,600	6,890.00	31,694,000	
ＣＩＪ	11,800	879.00	10,372,200	
ビジネスエンジニアリング	2,600	2,375.00	6,175,000	
日本エンタープライズ	13,700	124.00	1,698,800	
WOWOW	7,300	1,261.00	9,205,300	
スカラ	12,700	710.00	9,017,000	
インテリジェント　ウェイブ	6,900	735.00	5,071,500	
フルキャストホールディングス	12,600	2,690.00	33,894,000	
エン・ジャパン	24,100	2,322.00	55,960,200	
あすか製薬ホールディングス	13,200	1,288.00	17,001,600	
サワイグループホールディングス	29,600	3,925.00	116,180,000	
富士フイルムホールディングス	248,700	6,718.00	1,670,766,600	
コニカミノルタ	291,300	519.00	151,184,700	
資生堂	270,500	6,548.00	1,771,234,000	
ライオン	155,500	1,439.00	223,764,500	
高砂香料工業	8,600	2,518.00	21,654,800	
マンダム	28,000	1,391.00	38,948,000	
ミルボン	19,100	5,610.00	107,151,000	
ファンケル	56,600	2,605.00	147,443,000	
コーセー	26,200	13,510.00	353,962,000	
コタ	10,900	1,666.00	18,159,400	
シーボン	1,500	1,562.00	2,343,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	66,300	1,781.00	118,080,300	
ノエビアホールディングス	11,500	5,420.00	62,330,000	
アジュバンホールディングス	3,200	965.00	3,088,000	
新日本製薬	7,400	1,372.00	10,152,800	
エステー	10,000	1,500.00	15,000,000	
アグロ　カネショウ	4,800	1,553.00	7,454,400	
コニシ	21,700	1,727.00	37,475,900	
長谷川香料	26,800	2,836.00	76,004,800	
星光ＰＭＣ	6,500	531.00	3,451,500	

小林製薬	37,700	8,630.00	325,351,000	
荒川化学工業	11,100	946.00	10,500,600	
メック	10,700	2,305.00	24,663,500	
日本高純度化学	3,500	2,384.00	8,344,000	
タカラバイオ	34,900	1,705.00	59,504,500	
ＪＣＵ	14,500	3,190.00	46,255,000	
新田ゼラチン	7,900	841.00	6,643,900	
ＯＡＴアグリオ	5,200	1,467.00	7,628,400	
デクセリアルズ	37,200	2,661.00	98,989,200	
アース製薬	11,700	4,855.00	56,803,500	
北興化学工業	12,900	804.00	10,371,600	
大成ラミック	4,200	2,959.00	12,427,800	
クミアイ化学工業	51,500	847.00	43,620,500	
日本農薬	23,700	703.00	16,661,100	
富士興産	3,100	1,194.00	3,701,400	
ニチレキ	15,400	1,294.00	19,927,600	
ユシロ化学工業	6,600	773.00	5,101,800	
ビーピー・カストロール	5,000	863.00	4,315,000	
富士石油	26,300	256.00	6,732,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	4,300	1,178.00	5,065,400	
出光興産	143,800	3,015.00	433,557,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	2,340,900	453.40	1,061,364,060	
コスモエネルギーホールディングス	51,200	3,600.00	184,320,000	
テスホールディングス	13,500	1,101.00	14,863,500	
インフロニア・ホールディングス	132,800	1,009.00	133,995,200	
横浜ゴム	73,600	2,020.00	148,672,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	74,400	1,492.00	111,004,800	
ブリヂストン	413,700	4,748.00	1,964,247,600	
住友ゴム工業	127,100	1,115.00	141,716,500	
藤倉コンポジット	9,200	830.00	7,636,000	
オカモト	7,200	3,680.00	26,496,000	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ　ＧＲＯＵＰ	2,100	1,096.00	2,301,600	
アキレス	8,300	1,240.00	10,292,000	
フコク	6,700	1,024.00	6,860,800	
ニッタ	13,100	2,796.00	36,627,600	
クリエートメディック	4,400	869.00	3,823,600	
住友理工	25,100	618.00	15,511,800	
三ツ星ベルト	18,800	3,485.00	65,518,000	
バンドー化学	20,500	950.00	19,475,000	
ＡＧＣ	131,800	4,545.00	599,031,000	
日本板硝子	66,000	649.00	42,834,000	
石塚硝子	1,900	1,435.00	2,726,500	
有沢製作所	21,100	1,301.00	27,451,100	
日本山村硝子	4,800	526.00	2,524,800	
日本電気硝子	52,900	2,397.00	126,801,300	
オハラ	6,100	1,126.00	6,868,600	
住友大阪セメント	18,200	3,130.00	56,966,000	
太平洋セメント	82,500	2,023.00	166,897,500	
リソルホールディングス	1,200	4,595.00	5,514,000	
日本ヒューム	11,500	636.00	7,314,000	

日本コンクリート工業	25,300	223.00	5,641,900	
三谷セキサン	5,400	3,900.00	21,060,000	
アジアパイルホールディングス	20,300	559.00	11,347,700	
東海カーボン	108,500	1,096.00	118,916,000	
日本カーボン	7,400	4,285.00	31,709,000	
東洋炭素	8,000	3,880.00	31,040,000	
ノリタケカンパニーリミテド	6,400	3,985.00	25,504,000	
ＴＯＴＯ	85,400	5,010.00	427,854,000	
日本碍子	153,300	1,701.00	260,763,300	
日本特殊陶業	98,500	2,470.00	243,295,000	
ダントーホールディングス	9,200	208.00	1,913,600	
ＭＡＲＵＷＡ	4,800	16,670.00	80,016,000	
品川リフラクトリーズ	3,700	3,895.00	14,411,500	
黒崎播磨	2,500	5,440.00	13,600,000	
ヨータイ	8,500	1,382.00	11,747,000	
東京窯業	11,800	269.00	3,174,200	
ニッカトー	5,700	490.00	2,793,000	
フジミインコーポレーテッド	10,400	6,610.00	68,744,000	
クニミネ工業	3,900	825.00	3,217,500	
エーアンドエーマテリアル	2,300	873.00	2,007,900	
ニチアス	32,700	2,363.00	77,270,100	
日本製鉄	596,900	2,455.00	1,465,389,500	
神戸製鋼所	268,000	653.00	175,004,000	
中山製鋼所	27,500	849.00	23,347,500	
合同製鐵	6,500	2,224.00	14,456,000	
ＪＦＥホールディングス	356,200	1,563.00	556,740,600	
東京製鐵	37,300	1,234.00	46,028,200	
共英製鋼	15,200	1,282.00	19,486,400	
大和工業	22,000	4,645.00	102,190,000	
東京鐵鋼	6,300	1,531.00	9,645,300	
大阪製鐵	6,100	1,142.00	6,966,200	
淀川製鋼所	15,200	2,527.00	38,410,400	
丸一鋼管	40,500	2,728.00	110,484,000	
モリ工業	3,100	2,761.00	8,559,100	
大同特殊鋼	16,800	4,395.00	73,836,000	
日本高周波鋼業	4,100	310.00	1,271,000	
日本冶金工業	9,700	4,310.00	41,807,000	
山陽特殊製鋼	13,100	2,112.00	27,667,200	
愛知製鋼	7,700	2,179.00	16,778,300	
日本金属	2,700	901.00	2,432,700	
大平洋金属	9,500	1,905.00	18,097,500	
新日本電工	85,300	374.00	31,902,200	
栗本鐵工所	6,300	1,724.00	10,861,200	
虹　技	1,600	912.00	1,459,200	
日本鋳鉄管	1,400	946.00	1,324,400	
日本製鋼所	35,900	2,638.00	94,704,200	
三菱製鋼	8,200	1,022.00	8,380,400	
日亜鋼業	13,900	247.00	3,433,300	
日本精線	1,700	4,265.00	7,250,500	
エンビプロ・ホールディングス	9,200	720.00	6,624,000	

大紀アルミニウム工業所	18,900	1,299.00	24,551,100	
日本軽金属ホールディングス	36,000	1,551.00	55,836,000	
三井金属鉱業	38,800	3,175.00	123,190,000	
東邦亜鉛	7,800	2,101.00	16,387,800	
三菱マテリアル	89,000	2,133.00	189,837,000	
住友金属鉱山	154,500	4,930.00	761,685,000	
ＤＯＷＡホールディングス	29,900	4,205.00	125,729,500	
古河機械金属	19,500	1,260.00	24,570,000	
エス・サイエンス	80,700	26.00	2,098,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,400	3,900.00	75,660,000	
東邦チタニウム	24,100	2,652.00	63,913,200	
ＵＡＣＪ	18,600	2,336.00	43,449,600	
ＣＫサンエツ	2,500	4,005.00	10,012,500	
古河電気工業	44,400	2,439.00	108,291,600	
住友電気工業	460,300	1,502.00	691,370,600	
フジクラ	142,800	979.00	139,801,200	
昭和電線ホールディングス	14,800	1,761.00	26,062,800	
タツタ電線	27,300	717.00	19,574,100	
カナレ電気	2,000	1,391.00	2,782,000	
平河ヒューテック	7,700	1,124.00	8,654,800	
いよぎんホールディングス	151,500	695.00	105,292,500	
しずおかフィナンシャルグループ	287,600	1,041.00	299,391,600	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	107,200	928.00	99,481,600	
リョービ	14,100	1,165.00	16,426,500	
アーレスティ	14,500	440.00	6,380,000	
アサヒホールディングス	53,800	1,950.00	104,910,000	
東洋製罐グループホールディングス	88,100	1,574.00	138,669,400	
ホッカンホールディングス	7,200	1,370.00	9,864,000	
コロナ	7,600	872.00	6,627,200	
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,844.00	32,638,800	
駒井ハルテック	2,000	1,500.00	3,000,000	
高田機工	600	2,462.00	1,477,200	
三和ホールディングス	122,800	1,221.00	149,938,800	
文化シヤッター	38,400	1,097.00	42,124,800	
三協立山	18,200	543.00	9,882,600	
アルインコ	10,300	974.00	10,032,200	
東洋シヤッター	2,100	504.00	1,058,400	
ＬＩＸＩＬ	194,200	2,065.00	401,023,000	
日本フイルコン	8,800	446.00	3,924,800	
ノーリツ	19,500	1,427.00	27,826,500	
長府製作所	13,300	1,929.00	25,655,700	
リンナイ	24,100	9,600.00	231,360,000	
ユニプレス	23,100	764.00	17,648,400	
ダイニチ工業	6,500	651.00	4,231,500	
日東精工	19,200	495.00	9,504,000	
三洋工業	1,500	1,880.00	2,820,000	
岡部	21,500	711.00	15,286,500	
ジーテクト	14,800	1,439.00	21,297,200	
東プレ	23,400	1,152.00	26,956,800	
高周波熱錬	21,800	656.00	14,300,800	

東京製綱	7,800	868.00	6,770,400	
サンコール	11,800	641.00	7,563,800	
モリテックスチール	9,900	267.00	2,643,300	
パイオラックス	18,300	1,720.00	31,476,000	
エイチワン	13,700	614.00	8,411,800	
日本発条	117,800	843.00	99,305,400	
中央発條	7,400	724.00	5,357,600	
アドバネクス	1,600	1,099.00	1,758,400	
三浦工業	54,300	3,130.00	169,959,000	
タクマ	40,200	1,224.00	49,204,800	
テクノプロ・ホールディングス	89,000	3,455.00	307,495,000	
アトラグループ	3,100	184.00	570,400	
インターワークス	3,600	351.00	1,263,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	1,784.00	12,309,600	
ＫｅｅＰｅｒ技研	9,600	3,350.00	32,160,000	
ファーストロジック	1,900	855.00	1,624,500	
三機サービス	2,200	916.00	2,015,200	
Ｇｕｎｏｓｙ	8,000	605.00	4,840,000	
デザインワン・ジャパン	3,700	217.00	802,900	
イー・ガーディアン	5,000	2,600.00	13,000,000	
リブセンス	6,000	280.00	1,680,000	
ジャパンマテリアル	40,600	2,235.00	90,741,000	
ベクトル	20,900	1,310.00	27,379,000	
ウチヤマホールディングス	5,700	266.00	1,516,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,226.00	13,608,600	
キャリアリンク	4,800	2,713.00	13,022,400	
ＩＢＪ	8,000	993.00	7,944,000	
アサンテ	6,500	1,614.00	10,491,000	
バリューＨＲ	11,500	1,522.00	17,503,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	12,200	4,625.00	56,425,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,092.00	5,241,600	
ＥＲＩホールディングス	3,800	1,170.00	4,446,000	
アビスト	1,900	2,925.00	5,557,500	
シグマクシス・ホールディングス	20,000	1,209.00	24,180,000	
ウィルグループ	11,100	1,205.00	13,375,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	144.00	2,044,800	
メドピア	10,500	1,375.00	14,437,500	
レアジョブ	2,300	941.00	2,164,300	
リクルートホールディングス	983,400	4,188.00	4,118,479,200	
エラン	17,600	956.00	16,825,600	
ツガミ	28,900	1,228.00	35,489,200	
オークマ	12,900	4,685.00	60,436,500	
芝浦機械	13,000	2,723.00	35,399,000	
アマダ	208,100	1,054.00	219,337,400	
アイダエンジニアリング	26,800	778.00	20,850,400	
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	3,600	1,082.00	3,895,200	
ＦＵＪＩ	56,600	2,044.00	115,690,400	
牧野フライス製作所	14,400	4,300.00	61,920,000	

オーエスジー	62,300	1,860.00	115,878,000	
ダイジェット工業	1,300	824.00	1,071,200	
旭ダイヤモンド工業	37,600	700.00	26,320,000	
ＤＭＧ森精機	79,000	1,868.00	147,572,000	
ソディック	35,900	735.00	26,386,500	
ディスコ	20,900	39,400.00	823,460,000	
日東工器	6,300	1,489.00	9,380,700	
日進工具	11,000	1,008.00	11,088,000	
パンチ工業	11,000	388.00	4,268,000	
冨士ダイス	6,100	575.00	3,507,500	
土木管理総合試験所	5,600	304.00	1,702,400	
日本郵政	1,740,600	1,085.50	1,889,421,300	
ベルシステム２４ホールディングス	17,800	1,354.00	24,101,200	
鎌倉新書	15,000	988.00	14,820,000	
ＳＭＮ	3,100	466.00	1,444,600	
一蔵	1,600	450.00	720,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	1,800	680.00	1,224,000	
エアトリ	8,400	2,584.00	21,705,600	
アトラエ	10,500	1,218.00	12,789,000	
ストライク	6,400	4,225.00	27,040,000	
ソラスト	36,500	684.00	24,966,000	
セラク	4,800	1,162.00	5,577,600	
インソース	33,100	1,433.00	47,432,300	
豊田自動織機	94,500	7,450.00	704,025,000	
豊和工業	7,100	947.00	6,723,700	
ニデックオーケーケー	5,200	916.00	4,763,200	
石川製作所	3,300	1,457.00	4,808,100	
東洋機械金属	8,900	552.00	4,912,800	
津田駒工業	2,300	588.00	1,352,400	
エンシュウ	2,600	674.00	1,752,400	
島精機製作所	20,800	1,822.00	37,897,600	
オプトラン	19,200	2,537.00	48,710,400	
ＮＣホールディングス	2,500	2,086.00	5,215,000	
イワキ	8,500	1,223.00	10,395,500	
フリュー	13,500	1,053.00	14,215,500	
ヤマシンフィルタ	31,000	506.00	15,686,000	
日阪製作所	12,600	817.00	10,294,200	
やまびこ	21,400	1,087.00	23,261,800	
野村マイクロ・サイエンス	4,500	4,305.00	19,372,500	
平田機工	6,100	5,810.00	35,441,000	
ペガサスミシン製造	14,300	775.00	11,082,500	
マルマエ	6,200	1,613.00	10,000,600	
タツモ	7,100	1,691.00	12,006,100	
ナブテスコ	81,900	3,455.00	282,964,500	
三井海洋開発	16,400	1,363.00	22,353,200	
レオン自動機	13,700	1,035.00	14,179,500	
ＳＭＣ	42,300	60,710.00	2,568,033,000	
ホソカワミクロン	10,000	2,678.00	26,780,000	
ユニオンツール	5,700	3,250.00	18,525,000	
オイレス工業	18,200	1,455.00	26,481,000	

日精エー・エス・ビー機械	5,800	4,335.00	25,143,000	
サトーホールディングス	18,500	1,904.00	35,224,000	
技研製作所	13,500	2,905.00	39,217,500	
日本エアーテック	6,500	1,057.00	6,870,500	
カワタ	3,800	823.00	3,127,400	
日精樹脂工業	9,700	932.00	9,040,400	
オカダアイヨン	4,100	1,535.00	6,293,500	
ワイエイシイホールディングス	5,400	2,014.00	10,875,600	
小松製作所	611,300	2,889.50	1,766,351,350	
住友重機械工業	77,100	2,667.00	205,625,700	
日立建機	52,000	2,939.00	152,828,000	
日工	19,300	615.00	11,869,500	
巴工業	5,500	2,290.00	12,595,000	
井関農機	12,100	1,183.00	14,314,300	
ＴＯＷＡ	13,200	1,862.00	24,578,400	
丸山製作所	2,100	1,548.00	3,250,800	
北川鉄工所	5,100	1,123.00	5,727,300	
シンニッタン	14,400	224.00	3,225,600	
ローツェ	6,700	7,870.00	52,729,000	
タカキタ	3,800	395.00	1,501,000	
クボタ	690,500	1,837.50	1,268,793,750	
荏原実業	6,400	2,226.00	14,246,400	
東洋エンジニアリング	16,800	591.00	9,928,800	
三菱化工機	4,300	2,092.00	8,995,600	
月島機械	17,700	962.00	17,027,400	
帝国電機製作所	9,900	2,274.00	22,512,600	
東京機械製作所	3,000	548.00	1,644,000	
新東工業	26,300	666.00	17,515,800	
澁谷工業	12,200	2,314.00	28,230,800	
アイチコーポレーション	18,400	763.00	14,039,200	
小森コーポレーション	30,200	806.00	24,341,200	
鶴見製作所	10,000	1,990.00	19,900,000	
日本ギア工業	4,400	362.00	1,592,800	
酒井重工業	1,900	3,435.00	6,526,500	
荏原製作所	53,300	4,870.00	259,571,000	
石井鐵工所	1,000	2,181.00	2,181,000	
酉島製作所	11,200	1,471.00	16,475,200	
北越工業	13,000	1,299.00	16,887,000	
ダイキン工業	155,700	21,510.00	3,349,107,000	
オルガノ	17,900	3,020.00	54,058,000	
トーヨーカネツ	4,900	2,570.00	12,593,000	
栗田工業	72,900	5,590.00	407,511,000	
椿本チエイン	18,400	3,005.00	55,292,000	
大同工業	5,200	743.00	3,863,600	
日機装	32,200	959.00	30,879,800	
木村化工機	9,900	728.00	7,207,200	
レイズネクスト	18,300	1,257.00	23,003,100	
アネスト岩田	22,200	857.00	19,025,400	
ダイフク	67,200	6,560.00	440,832,000	
サムコ	4,300	3,345.00	14,383,500	

加藤製作所	6,000	708.00	4,248,000	
油研工業	1,600	1,797.00	2,875,200	
タダノ	68,800	910.00	62,608,000	
フジテック	47,800	3,000.00	143,400,000	
ＣＫＤ	36,000	1,950.00	70,200,000	
平和	43,300	2,334.00	101,062,200	
理想科学工業	11,500	2,048.00	23,552,000	
ＳＡＮＫＹＯ	25,500	4,965.00	126,607,500	
日本金銭機械	14,300	1,116.00	15,958,800	
マースグループホールディングス	7,600	2,258.00	17,160,800	
フクシマガリレイ	9,600	4,200.00	40,320,000	
オーイズミ	5,000	484.00	2,420,000	
ダイコク電機	7,100	1,971.00	13,994,100	
竹内製作所	23,600	2,830.00	66,788,000	
アマノ	36,900	2,377.00	87,711,300	
ＪＵＫＩ	20,100	621.00	12,482,100	
サンデン	19,300	192.00	3,705,600	
ジャノメ	13,100	581.00	7,611,100	
ブラザー工業	174,400	1,989.00	346,881,600	
マックス	16,100	1,912.00	30,783,200	
モリタホールディングス	22,700	1,163.00	26,400,100	
グローリー	33,800	2,164.00	73,143,200	
新晃工業	13,000	1,475.00	19,175,000	
大和冷機工業	19,900	1,128.00	22,447,200	
セガサミーホールディングス	104,800	1,933.00	202,578,400	
日本ピストンリング	4,500	1,227.00	5,521,500	
リケン	5,100	2,262.00	11,536,200	
ＴＰＲ	15,300	1,235.00	18,895,500	
ツバキ・ナカシマ	32,000	1,028.00	32,896,000	
ホシザキ	83,900	4,475.00	375,452,500	
大豊工業	11,200	611.00	6,843,200	
日本精工	239,700	701.00	168,029,700	
ＮＴＮ	257,100	262.00	67,360,200	
ジェイテクト	116,100	922.00	107,044,200	
不二越	9,600	3,695.00	35,472,000	
ミネベアミツミ	226,900	2,078.00	471,498,200	
日本トムソン	31,800	533.00	16,949,400	
ＴＨＫ	75,300	2,598.00	195,629,400	
ユーシン精機	10,500	666.00	6,993,000	
前澤給装工業	9,200	918.00	8,445,600	
イーグル工業	14,400	1,072.00	15,436,800	
前澤工業	8,300	616.00	5,112,800	
日本ピラー工業	12,000	2,976.00	35,712,000	
キッツ	48,000	797.00	38,256,000	
日立製作所	655,100	6,565.00	4,300,731,500	
東芝	251,100	4,558.00	1,144,513,800	
三菱電機	1,348,600	1,286.50	1,734,973,900	
富士電機	79,200	5,200.00	411,840,000	
東洋電機製造	4,700	848.00	3,985,600	
安川電機	154,500	4,500.00	695,250,000	

シンフォニア　テクノロジー	14,300	1,475.00	21,092,500	
明電舎	19,700	1,828.00	36,011,600	
オリジン	2,700	1,235.00	3,334,500	
山洋電気	5,600	5,750.00	32,200,000	
デンヨー	9,900	1,508.00	14,929,200	
ＰＨＣホールディングス	18,100	1,491.00	26,987,100	
ソシオネクスト	13,300	6,880.00	91,504,000	
ベイカレント・コンサルティング	105,000	4,470.00	469,350,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	2,700	1,921.00	5,186,700	
アイモバイル	6,900	1,169.00	8,066,100	
キャリアインデックス	4,700	313.00	1,471,100	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4,400	1,070.00	4,708,000	
船場	1,500	703.00	1,054,500	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,100	1,613.00	75,972,300	
フルテック	1,600	1,106.00	1,769,600	
グリーンズ	5,000	1,098.00	5,490,000	
ツナググループ・ホールディングス	3,800	470.00	1,786,000	
ＧＡＭＥＷＩＴＨ	4,100	319.00	1,307,900	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	1,500	615.00	922,500	
ウェルビー	9,700	721.00	6,993,700	
エル・ティー・エス	1,600	2,750.00	4,400,000	
ミダックホールディングス	8,000	2,674.00	21,392,000	
日総工産	9,900	572.00	5,662,800	
キュービーネットホールディングス	6,900	1,348.00	9,301,200	
ＲＰＡホールディングス	17,900	272.00	4,868,800	
三櫻工業	19,600	637.00	12,485,200	
マキタ	162,300	3,195.00	518,548,500	
東芝テック	19,400	3,555.00	68,967,000	
芝浦メカトロニクス	2,300	10,860.00	24,978,000	
マブチモーター	32,300	3,655.00	118,056,500	
日本電産	317,000	7,085.00	2,245,945,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	481.00	4,617,600	
トレックス・セミコンダクター	6,000	2,636.00	15,816,000	
東光高岳	7,800	1,978.00	15,428,400	
ダブル・スコープ	42,600	1,415.00	60,279,000	
宮越ホールディングス	5,700	767.00	4,371,900	
ダイヘン	11,700	3,985.00	46,624,500	
ヤーマン	25,300	1,410.00	35,673,000	
ＪＶＣケンウッド	118,800	353.00	41,936,400	
ミマキエンジニアリング	12,300	606.00	7,453,800	
Ｉ－ＰＥＸ	7,200	1,117.00	8,042,400	
日新電機	31,200	1,298.00	40,497,600	
大崎電気工業	30,900	519.00	16,037,100	
オムロン	119,600	6,662.00	796,775,200	
日東工業	17,600	2,264.00	39,846,400	
ＩＤＥＣ	19,200	2,912.00	55,910,400	
正興電機製作所	4,900	952.00	4,664,800	
不二電機工業	2,500	1,141.00	2,852,500	

ジーエス・ユアサ　コーポレーション	42,800	2,164.00	92,619,200	
サクサホールディングス	2,600	1,180.00	3,068,000	
メルコホールディングス	3,600	3,010.00	10,836,000	
テクノメディカ	3,200	1,700.00	5,440,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,000	1,373.00	5,492,000	
日本電気	184,500	4,555.00	840,397,500	
富士通	130,000	18,500.00	2,405,000,000	
沖電気工業	59,000	706.00	41,654,000	
岩崎通信機	5,700	768.00	4,377,600	
電気興業	6,000	1,935.00	11,610,000	
サンケン電気	12,000	6,880.00	82,560,000	
ナカヨ	2,000	1,063.00	2,126,000	
アイホン	7,900	1,813.00	14,322,700	
ルネサスエレクトロニクス	851,100	1,256.50	1,069,407,150	
セイコーエプソン	173,800	1,972.00	342,733,600	
ワコム	103,400	602.00	62,246,800	
アルバック	30,900	5,840.00	180,456,000	
アクセル	4,800	1,713.00	8,222,400	
ＥＩＺＯ	9,600	3,385.00	32,496,000	
ジャパンディスプレイ	501,300	44.00	22,057,200	
日本信号	29,700	1,007.00	29,907,900	
京三製作所	27,400	402.00	11,014,800	
能美防災	17,700	1,553.00	27,488,100	
ホーチキ	9,800	1,382.00	13,543,600	
星和電機	5,200	434.00	2,256,800	
エレコム	31,100	1,358.00	42,233,800	
パナソニック　ホールディングス	1,541,300	1,110.00	1,710,843,000	
シャープ	157,200	1,003.00	157,671,600	
アンリツ	91,800	1,272.00	116,769,600	
富士通ゼネラル	36,900	3,335.00	123,061,500	
ソニーグループ	913,900	11,100.00	10,144,290,000	
ＴＤＫ	206,600	4,370.00	902,842,000	
帝国通信工業	5,800	1,413.00	8,195,400	
タムラ製作所	55,900	733.00	40,974,700	
アルプスアルパイン	116,500	1,213.00	141,314,500	
池上通信機	4,200	529.00	2,221,800	
日本電波工業	15,600	1,532.00	23,899,200	
鈴木	7,600	859.00	6,528,400	
メイコー	14,200	2,628.00	37,317,600	
日本トリム	2,700	2,657.00	7,173,900	
ローランド　ディー．ジー．	7,300	2,809.00	20,505,700	
フォスター電機	12,000	893.00	10,716,000	
ＳＭＫ	3,100	2,350.00	7,285,000	
ヨコオ	10,400	2,173.00	22,599,200	
ティアック	20,100	118.00	2,371,800	
ホシデン	31,200	1,556.00	48,547,200	
ヒロセ電機	21,600	16,470.00	355,752,000	
日本航空電子工業	26,700	2,150.00	57,405,000	
ＴＯＡ	15,000	765.00	11,475,000	

マクセル	28,300	1,394.00	39,450,200	
古野電気	16,900	941.00	15,902,900	
スミダコーポレーション	11,900	1,470.00	17,493,000	
アイコム	5,000	2,589.00	12,945,000	
リオン	5,300	1,792.00	9,497,600	
横河電機	142,600	2,156.00	307,445,600	
新電元工業	4,900	3,225.00	15,802,500	
アズビル	90,200	3,445.00	310,739,000	
東亜ディーケーケー	6,000	785.00	4,710,000	
日本光電工業	59,600	3,150.00	187,740,000	
チノー	5,300	1,799.00	9,534,700	
共和電業	12,200	336.00	4,099,200	
日本電子材料	8,400	1,433.00	12,037,200	
堀場製作所	28,800	5,850.00	168,480,000	
アドバンテスト	101,700	8,700.00	884,790,000	
小野測器	4,900	379.00	1,857,100	
エスペック	10,400	1,889.00	19,645,600	
キーエンス	129,200	55,220.00	7,134,424,000	
日置電機	6,700	6,260.00	41,942,000	
シスメックス	111,300	8,315.00	925,459,500	
日本マイクロニクス	21,300	1,348.00	28,712,400	
メガチップス	10,700	2,549.00	27,274,300	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,000	3,600.00	21,600,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10,900	661.00	7,204,900	
澤藤電機	1,500	1,120.00	1,680,000	
デンソー	266,400	6,662.00	1,774,756,800	
原田工業	5,700	850.00	4,845,000	
コーセル	17,300	1,005.00	17,386,500	
イリソ電子工業	11,800	4,370.00	51,566,000	
オプテックスグループ	23,600	1,901.00	44,863,600	
千代田インテグレ	5,200	2,196.00	11,419,200	
レーザーテック	63,700	23,950.00	1,525,615,000	
スタンレー電気	91,800	2,586.00	237,394,800	
岩崎電気	4,200	2,270.00	9,534,000	
ウシオ電機	67,400	1,682.00	113,366,800	
岡谷電機産業	10,000	252.00	2,520,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	11,800	480.00	5,664,000	
エノモト	3,300	1,729.00	5,705,700	
日本セラミック	13,000	2,349.00	30,537,000	
遠藤照明	5,700	748.00	4,263,600	
古河電池	9,500	1,080.00	10,260,000	
双信電機	5,200	373.00	1,939,600	
山一電機	11,200	1,770.00	19,824,000	
図研	11,200	3,030.00	33,936,000	
日本電子	32,200	3,680.00	118,496,000	
カシオ計算機	96,200	1,335.00	128,427,000	
ファナック	126,800	20,825.00	2,640,610,000	
日本シイエムケイ	27,500	471.00	12,952,500	
エンプラス	3,800	3,690.00	14,022,000	
大真空	15,700	707.00	11,099,900	

ローム	59,600	9,830.00	585,868,000	
浜松ホトニクス	103,700	6,550.00	679,235,000	
三井ハイテック	13,200	6,560.00	86,592,000	
新光電気工業	45,800	3,680.00	168,544,000	
京セラ	200,600	6,555.00	1,314,933,000	
協栄産業	1,200	1,693.00	2,031,600	
太陽誘電	62,800	4,220.00	265,016,000	
村田製作所	391,700	7,050.00	2,761,485,000	
双葉電子工業	24,500	532.00	13,034,000	
日東電工	94,000	7,770.00	730,380,000	
北陸電気工業	4,800	1,259.00	6,043,200	
東海理化電機製作所	36,400	1,414.00	51,469,600	
ニチコン	26,200	1,264.00	33,116,800	
日本ケミコン	12,700	1,603.00	20,358,100	
ＫＯＡ	19,400	1,910.00	37,054,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	59,000	384.00	22,656,000	
日立造船	107,000	815.00	87,205,000	
三菱重工業	228,200	5,001.00	1,141,228,200	
川崎重工業	97,300	2,892.00	281,391,600	
ＩＨＩ	82,200	3,735.00	307,017,000	
名村造船所	33,100	385.00	12,743,500	
サノヤスホールディングス	17,700	125.00	2,212,500	
スプリックス	4,600	880.00	4,048,000	
マネジメントソリューションズ	7,300	3,540.00	25,842,000	
プロレド・パートナーズ	3,200	510.00	1,632,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	3,900	359.00	1,400,100	
テノ．ホールディングス	1,600	612.00	979,200	
フロンティア・マネジメント	4,500	1,336.00	6,012,000	
ピアラ	1,900	537.00	1,020,300	
コプロ・ホールディングス	2,000	1,049.00	2,098,000	
ギークス	1,700	896.00	1,523,200	
カーブスホールディングス	40,700	852.00	34,676,400	
フォーラムエンジニアリング	7,700	842.00	6,483,400	
ＦＡＳＴ　ＦＩＴＮＥＳＳ　ＪＡＰＡＮ	4,600	1,146.00	5,271,600	
日本車輌製造	4,900	1,932.00	9,466,800	
三菱ロジスネクスト	20,600	671.00	13,822,600	
近畿車輌	1,500	1,059.00	1,588,500	
一家ホールディングス	3,000	623.00	1,869,000	
フルサト・マルカホールディングス	13,500	3,205.00	43,267,500	
ヤマエグループホールディングス	7,700	1,430.00	11,011,000	
ジャパンクラフトホールディングス	4,400	611.00	2,688,400	
ＦＰＧ	51,600	1,049.00	54,128,400	
島根銀行	4,300	465.00	1,999,500	
じもとホールディングス	8,300	435.00	3,610,500	
全国保証	33,200	4,955.00	164,506,000	
めぶきフィナンシャルグループ	631,300	326.00	205,803,800	
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,500	1,177.00	12,358,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,300	2,549.00	41,548,700	

九州フィナンシャルグループ	223,700	446.00	99,770,200	
かんぽ生命保険	154,400	2,198.00	339,371,200	
ゆうちょ銀行	362,300	1,136.00	411,572,800	
あんしん保証	5,400	269.00	1,452,600	
富山第一銀行	31,600	584.00	18,454,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	701,400	545.00	382,263,000	
ジェイリース	4,300	2,687.00	11,554,100	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,500	976.00	78,568,000	
イントラスト	4,800	848.00	4,070,400	
日本モーゲージサービス	7,100	896.00	6,361,600	
ＣＡＳＡ	4,800	885.00	4,248,000	
アルヒ	15,600	1,010.00	15,756,000	
プレミアグループ	21,400	1,598.00	34,197,200	
日産自動車	1,835,200	430.20	789,503,040	
いすゞ自動車	375,600	1,540.00	578,424,000	
トヨタ自動車	7,094,300	1,837.50	13,035,776,250	
日野自動車	166,400	502.00	83,532,800	
三菱自動車工業	503,900	498.00	250,942,200	
エフテック	8,800	510.00	4,488,000	
レシップホールディングス	5,100	455.00	2,320,500	
ＧＭＢ	2,400	701.00	1,682,400	
ファルテック	2,000	589.00	1,178,000	
武蔵精密工業	31,500	1,576.00	49,644,000	
日産車体	22,800	817.00	18,627,600	
新明和工業	40,500	1,031.00	41,755,500	
極東開発工業	22,700	1,450.00	32,915,000	
トピー工業	10,500	1,562.00	16,401,000	
ティラド	3,200	2,599.00	8,316,800	
曙ブレーキ工業	78,900	150.00	11,835,000	
タチエス	20,300	1,125.00	22,837,500	
ＮＯＫ	50,000	1,177.00	58,850,000	
フタバ産業	34,600	348.00	12,040,800	
ＫＹＢ	12,300	3,460.00	42,558,000	
市光工業	18,500	364.00	6,734,000	
大同メタル工業	25,200	479.00	12,070,800	
プレス工業	57,500	419.00	24,092,500	
ミクニ	14,800	331.00	4,898,800	
太平洋工業	29,600	1,009.00	29,866,400	
河西工業	17,100	132.00	2,257,200	
アイシン	99,600	3,550.00	353,580,000	
マツダ	427,200	1,013.00	432,753,600	
今仙電機製作所	8,100	643.00	5,208,300	
本田技研工業	1,050,300	3,140.00	3,297,942,000	
スズキ	237,200	4,291.00	1,017,825,200	
ＳＵＢＡＲＵ	408,800	2,070.50	846,420,400	
安永	5,600	657.00	3,679,200	
ヤマハ発動機	202,900	3,025.00	613,772,500	
小糸製作所	155,300	2,076.00	322,402,800	

ＴＢＫ	12,800	240.00	3,072,000	
エクセディ	21,100	1,613.00	34,034,300	
ミツバ	24,100	456.00	10,989,600	
豊田合成	37,600	2,045.00	76,892,000	
愛三工業	21,400	683.00	14,616,200	
盟和産業	1,500	927.00	1,390,500	
日本プラスト	10,100	404.00	4,080,400	
ヨロズ	12,000	705.00	8,460,000	
エフ・シー・シー	22,900	1,332.00	30,502,800	
新家工業	2,700	2,087.00	5,634,900	
シマノ	52,900	21,580.00	1,141,582,000	
テイ・エス　テック	59,200	1,514.00	89,628,800	
三十三フィナンシャルグループ	11,300	1,578.00	17,831,400	
第四北越フィナンシャルグループ	19,800	2,777.00	54,984,600	
ひろぎんホールディングス	165,900	647.00	107,337,300	
マーキュリアホールディングス	7,500	601.00	4,507,500	
おきなわフィナンシャルグループ	12,000	2,318.00	27,816,000	
ダイレクトマーケティングミックス	15,200	1,560.00	23,712,000	
ポピンズ	1,800	1,723.00	3,101,400	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	10,400	2,235.00	23,244,000	
十六フィナンシャルグループ	16,500	2,849.00	47,008,500	
北國フィナンシャルホールディングス	10,800	4,345.00	46,926,000	
ネットプロテクションズホールディングス	42,000	514.00	21,588,000	
プロクレアホールディングス	15,600	2,148.00	33,508,800	
あいちフィナンシャルグループ	17,700	2,277.00	40,302,900	
ジャムコ	7,000	1,403.00	9,821,000	
小野建	12,500	1,458.00	18,225,000	
はるやまホールディングス	5,600	436.00	2,441,600	
南陽	2,500	1,932.00	4,830,000	
ノジマ	44,600	1,372.00	61,191,200	
佐鳥電機	8,400	1,270.00	10,668,000	
カッパ・クリエイト	21,500	1,406.00	30,229,000	
エコートレーディング	2,400	700.00	1,680,000	
伯東	7,800	4,195.00	32,721,000	
コンドーテック	10,600	983.00	10,419,800	
中山福	7,200	321.00	2,311,200	
ライトオン	10,400	592.00	6,156,800	
ナガイレーベン	17,300	1,894.00	32,766,200	
三菱食品	12,500	3,015.00	37,687,500	
良品計画	176,300	1,406.00	247,877,800	
パリミキホールディングス	17,300	265.00	4,584,500	
松田産業	10,500	2,265.00	23,782,500	
第一興商	26,300	3,865.00	101,649,500	
メディパルホールディングス	141,700	1,688.00	239,189,600	
アドヴァングループ	12,900	837.00	10,797,300	
ＳＰＫ	6,000	1,387.00	8,322,000	
萩原電気ホールディングス	5,200	2,459.00	12,786,800	
アルビス	4,600	2,368.00	10,892,800	
アズワン	19,900	5,570.00	110,843,000	

スズデン	4,800	2,237.00	10,737,600	
尾家産業	3,300	926.00	3,055,800	
シモジマ	9,400	942.00	8,854,800	
ドウシシャ	14,400	1,634.00	23,529,600	
小津産業	3,100	1,524.00	4,724,400	
コナカ	14,800	339.00	5,017,200	
高速	7,100	1,720.00	12,212,000	
ハウス　オブ　ローゼ	1,600	1,624.00	2,598,400	
Ｇ－７ホールディングス	17,100	1,546.00	26,436,600	
たけびし	5,200	1,527.00	7,940,400	
イオン北海道	20,100	1,112.00	22,351,200	
コジマ	26,200	549.00	14,383,800	
ヒマラヤ	4,400	924.00	4,065,600	
コーナン商事	18,400	3,320.00	61,088,000	
ネットワンシステムズ	48,200	3,380.00	162,916,000	
エコス	5,000	1,820.00	9,100,000	
ワタミ	16,500	961.00	15,856,500	
マルシェ	4,700	390.00	1,833,000	
リックス	2,600	2,180.00	5,668,000	
システムソフト	45,000	92.00	4,140,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	306,500	2,300.00	704,950,000	
丸文	12,100	956.00	11,567,600	
西松屋チェーン	30,200	1,499.00	45,269,800	
ゼンショーホールディングス	74,900	3,255.00	243,799,500	
ハピネット	11,500	1,977.00	22,735,500	
幸楽苑ホールディングス	8,800	1,051.00	9,248,800	
ハークスレイ	4,800	811.00	3,892,800	
橋本総業ホールディングス	5,400	1,025.00	5,535,000	
日本ライフライン	40,100	904.00	36,250,400	
サイゼリヤ	22,700	2,924.00	66,374,800	
タカショー	11,800	715.00	8,437,000	
ＶＴホールディングス	52,000	471.00	24,492,000	
アルゴグラフィックス	11,800	3,640.00	42,952,000	
魚力	4,300	2,114.00	9,090,200	
ＩＤＯＭ	41,300	678.00	28,001,400	
日本エム・ディ・エム	7,600	856.00	6,505,600	
ポプラ	3,200	140.00	448,000	
フジ・コーポレーション	7,700	1,305.00	10,048,500	
ユナイテッドアローズ	14,500	1,769.00	25,650,500	
進和	9,100	2,004.00	18,236,400	
エスケイジャパン	3,300	603.00	1,989,900	
ダイトロン	5,300	2,268.00	12,020,400	
ハイデイ日高	20,100	1,954.00	39,275,400	
シークス	19,300	1,309.00	25,263,700	
ＹＵ－ＷＡ　ＣＲＥＡＴＩＯＮ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	8,000	198.00	1,584,000	
コロワイド	62,900	1,789.00	112,528,100	
ピーシーデポコーポレーション	15,200	270.00	4,104,000	
田中商事	4,100	555.00	2,275,500	

オーハシテクニカ	6,700	1,425.00	9,547,500	
壱番屋	10,900	4,630.00	50,467,000	
白銅	4,900	2,555.00	12,519,500	
トップカルチャー	4,600	183.00	841,800	
ＰＬＡＮＴ	3,200	647.00	2,070,400	
スギホールディングス	27,600	5,840.00	161,184,000	
ダイコー通産	1,500	1,090.00	1,635,000	
薬王堂ホールディングス	7,600	2,781.00	21,135,600	
島津製作所	157,400	3,790.00	596,546,000	
ＪＭＳ	11,900	490.00	5,831,000	
クボテック	3,100	200.00	620,000	
長野計器	9,400	1,096.00	10,302,400	
ブイ・テクノロジー	6,200	2,667.00	16,535,400	
スター精密	24,500	1,610.00	39,445,000	
東京計器	9,900	1,249.00	12,365,100	
愛知時計電機	5,000	1,354.00	6,770,000	
インターアクション	7,700	1,600.00	12,320,000	
オーバル	11,300	461.00	5,209,300	
東京精密	28,300	4,435.00	125,510,500	
マニー	56,700	1,962.00	111,245,400	
ニコン	200,900	1,216.00	244,294,400	
トプコン	67,900	1,562.00	106,059,800	
オリンパス	807,700	2,406.00	1,943,326,200	
理研計器	7,900	4,395.00	34,720,500	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	22,100	9,040.00	199,784,000	
キヤノン電子	14,300	1,526.00	21,821,800	
タムロン	9,700	3,025.00	29,342,500	
ＨＯＹＡ	276,000	13,335.00	3,680,460,000	
シード	6,500	501.00	3,256,500	
ノーリツ鋼機	12,200	2,397.00	29,243,400	
Ａ＆Ｄホロンホールディングス	18,700	1,025.00	19,167,500	
朝日インテック	170,600	2,220.00	378,732,000	
キヤノン	708,800	2,910.00	2,062,608,000	
リコー	323,900	990.00	320,661,000	
シチズン時計	141,900	580.00	82,302,000	
リズム	4,100	1,621.00	6,646,100	
大研医器	9,800	449.00	4,400,200	
メニコン	44,300	2,780.00	123,154,000	
シンシア	1,200	501.00	601,200	
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	19,200	120.00	2,304,000	
中本パックス	4,000	1,595.00	6,380,000	
スノーピーク	22,100	2,293.00	50,675,300	
パラマウントベッドホールディングス	29,800	2,515.00	74,947,000	
トランザクション	9,900	1,192.00	11,800,800	
粧美堂	3,700	351.00	1,298,700	
ニホンフラッシュ	12,100	880.00	10,648,000	
前田工繊	14,000	3,130.00	43,820,000	
永大産業	14,000	220.00	3,080,000	
アートネイチャー	13,200	740.00	9,768,000	
バンダイナムコホールディングス	117,800	8,233.00	969,847,400	

アイフィスジャパン	3,800	592.00	2,249,600	
ＳＨＯＥＩ	13,500	5,090.00	68,715,000	
フランスベッドホールディングス	16,000	954.00	15,264,000	
マーベラス	21,000	684.00	14,364,000	
パイロットコーポレーション	20,100	4,715.00	94,771,500	
萩原工業	8,400	1,158.00	9,727,200	
エイベックス	22,000	1,628.00	35,816,000	
フジシールインターナショナル	26,000	1,652.00	42,952,000	
タカラトミー	59,600	1,225.00	73,010,000	
広済堂ホールディングス	8,500	1,956.00	16,626,000	
エステールホールディングス	3,100	624.00	1,934,400	
レック	18,400	959.00	17,645,600	
タカノ	4,800	668.00	3,206,400	
三光合成	17,700	480.00	8,496,000	
プロネクサス	10,800	953.00	10,292,400	
ホクシン	9,900	149.00	1,475,100	
ウッドワン	4,400	911.00	4,008,400	
大建工業	7,800	2,093.00	16,325,400	
きもと	19,100	225.00	4,297,500	
凸版印刷	169,000	1,921.00	324,649,000	
大日本印刷	153,200	2,606.00	399,239,200	
共同印刷	3,700	2,745.00	10,156,500	
ＮＩＳＳＨＡ	24,500	1,854.00	45,423,000	
光村印刷	600	1,158.00	694,800	
藤森工業	10,300	3,075.00	31,672,500	
ヴィア・ホールディングス	18,400	99.00	1,821,600	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	8,800	2,021.00	17,784,800	
前澤化成工業	8,200	1,339.00	10,979,800	
未来工業	4,800	1,450.00	6,960,000	
アシックス	119,300	2,911.00	347,282,300	
ツツミ	2,700	1,868.00	5,043,600	
ウェーブロックホールディングス	4,000	612.00	2,448,000	
ＪＳＰ	9,100	1,508.00	13,722,800	
ニチハ	16,200	2,646.00	42,865,200	
ローランド	9,500	3,530.00	33,535,000	
エフピコ	24,400	3,545.00	86,498,000	
小松ウオール工業	4,800	1,834.00	8,803,200	
ヤマハ	81,400	4,830.00	393,162,000	
河合楽器製作所	3,600	2,541.00	9,147,600	
クリナップ	14,500	641.00	9,294,500	
ピジョン	82,300	2,044.00	168,221,200	
天馬	11,100	2,068.00	22,954,800	
兼松サステック	600	1,561.00	936,600	
キングジム	11,500	880.00	10,120,000	
象印マホービン	38,600	1,448.00	55,892,800	
リンテック	25,800	2,137.00	55,134,600	
信越ポリマー	24,000	1,148.00	27,552,000	
東リ	29,400	230.00	6,762,000	
イトーキ	26,400	627.00	16,552,800	
任天堂	815,700	5,547.00	4,524,687,900	

三菱鉛筆	18,300	1,377.00	25,199,100	
松風	5,800	2,233.00	12,951,400	
タカラスタンダード	25,000	1,346.00	33,650,000	
コクヨ	62,200	1,783.00	110,902,600	
ナカバヤシ	14,000	474.00	6,636,000	
ニフコ	46,700	3,080.00	143,836,000	
立川ブラインド工業	6,000	1,152.00	6,912,000	
グローブライド	10,500	2,570.00	26,985,000	
オカムラ	38,900	1,405.00	54,654,500	
バルカー	10,900	2,656.00	28,950,400	
ＭＵＴＯＨホールディングス	1,000	1,611.00	1,611,000	
伊藤忠商事	842,200	4,055.00	3,415,121,000	
丸紅	1,079,200	1,507.00	1,626,354,400	
スクロール	20,100	711.00	14,291,100	
高島	2,000	2,920.00	5,840,000	
ヨンドシーホールディングス	11,700	1,711.00	20,018,700	
三陽商会	4,900	1,365.00	6,688,500	
長瀬産業	64,200	1,979.00	127,051,800	
ナイガイ	4,100	261.00	1,070,100	
蝶理	7,300	2,170.00	15,841,000	
豊田通商	119,700	4,930.00	590,121,000	
オンワードホールディングス	83,800	312.00	26,145,600	
三共生興	19,600	478.00	9,368,800	
兼松	53,100	1,469.00	78,003,900	
美津濃	12,700	2,709.00	34,404,300	
ツカモトコーポレーション	1,800	1,350.00	2,430,000	
ルックホールディングス	3,800	2,581.00	9,807,800	
三井物産	1,000,000	3,808.00	3,808,000,000	
日本紙パルプ商事	7,200	4,665.00	33,588,000	
東京エレクトロン	91,100	42,990.00	3,916,389,000	
カメイ	14,500	1,195.00	17,327,500	
東都水産	600	5,150.00	3,090,000	
ＯＵＧホールディングス	1,900	2,382.00	4,525,800	
スターゼン	10,500	2,069.00	21,724,500	
セイコーグループ	19,900	3,010.00	59,899,000	
山善	36,800	1,016.00	37,388,800	
椿本興業	2,000	3,815.00	7,630,000	
住友商事	846,400	2,174.00	1,840,073,600	
ＢＩＰＲＯＧＹ	47,700	3,250.00	155,025,000	
内田洋行	5,900	4,550.00	26,845,000	
三菱商事	854,700	4,289.00	3,665,808,300	
第一実業	4,800	4,355.00	20,904,000	
キヤノンマーケティングジャパン	31,600	2,893.00	91,418,800	
西華産業	5,300	1,570.00	8,321,000	
佐藤商事	9,500	1,220.00	11,590,000	
菱洋エレクトロ	11,600	2,402.00	27,863,200	
東京産業	12,500	736.00	9,200,000	
ユアサ商事	12,200	3,520.00	42,944,000	
神鋼商事	3,500	5,140.00	17,990,000	
トルク	7,400	203.00	1,502,200	

阪和興業	24,500	3,705.00	90,772,500	
正栄食品工業	9,100	3,885.00	35,353,500	
カナデン	11,100	1,106.00	12,276,600	
菱電商事	11,100	1,695.00	18,814,500	
ニプロ	107,700	1,021.00	109,961,700	
岩谷産業	31,000	5,600.00	173,600,000	
ナイス	3,800	1,380.00	5,244,000	
ニチモウ	1,500	2,902.00	4,353,000	
極東貿易	8,000	1,387.00	11,096,000	
アステナホールディングス	23,600	426.00	10,053,600	
兼松エレクトロニクス	8,200	4,370.00	35,834,000	
三愛オブリ	37,600	1,246.00	46,849,600	
稲畑産業	27,900	2,398.00	66,904,200	
ＧＳＩクレオス	7,900	1,489.00	11,763,100	
明和産業	18,100	661.00	11,964,100	
クワザワホールディングス	4,600	425.00	1,955,000	
キムラタン	75,800	21.00	1,591,800	
ゴールドウイン	22,900	9,250.00	211,825,000	
ユニ・チャーム	269,900	4,802.00	1,296,059,800	
デサント	22,300	3,225.00	71,917,500	
キング	5,600	494.00	2,766,400	
ワキタ	25,100	1,158.00	29,065,800	
ヤマトインターナショナル	10,300	240.00	2,472,000	
東邦ホールディングス	33,900	2,061.00	69,867,900	
サンゲツ	34,300	2,134.00	73,196,200	
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,059.00	18,638,400	
シナネンホールディングス	4,500	3,840.00	17,280,000	
伊藤忠エネクス	33,900	1,048.00	35,527,200	
サンリオ	38,700	4,565.00	176,665,500	
サンワ　テクノス	7,000	1,561.00	10,927,000	
リョーサン	14,400	2,873.00	41,371,200	
新光商事	18,300	1,184.00	21,667,200	
トーホー	5,800	1,645.00	9,541,000	
三信電気	5,400	2,327.00	12,565,800	
東陽テクニカ	15,000	1,354.00	20,310,000	
モスフードサービス	20,000	3,050.00	61,000,000	
加賀電子	11,100	4,140.00	45,954,000	
三益半導体工業	11,900	2,454.00	29,202,600	
都築電気	6,700	1,303.00	8,730,100	
ソーダニッカ	10,000	700.00	7,000,000	
立花エレテック	10,000	1,743.00	17,430,000	
木曽路	20,600	2,081.00	42,868,600	
ＳＲＳホールディングス	22,600	882.00	19,933,200	
千趣会	25,200	385.00	9,702,000	
タカキュー	9,700	74.00	717,800	
リテールパートナーズ	20,100	1,272.00	25,567,200	
ケーヨー	22,100	888.00	19,624,800	
上新電機	12,100	1,931.00	23,365,100	
日本瓦斯	73,100	1,992.00	145,615,200	
ロイヤルホールディングス	26,200	2,400.00	62,880,000	

東天紅	600	754.00	452,400	
いなげや	13,200	1,237.00	16,328,400	
チヨダ	13,000	770.00	10,010,000	
ライフコーポレーション	11,900	2,559.00	30,452,100	
リンガーハット	17,700	2,247.00	39,771,900	
ＭｒＭａｘＨＤ	19,100	656.00	12,529,600	
テンアライド	14,500	255.00	3,697,500	
ＡＯＫＩホールディングス	25,300	674.00	17,052,200	
オークワ	21,900	882.00	19,315,800	
コメリ	21,000	2,662.00	55,902,000	
青山商事	29,200	867.00	25,316,400	
しまむら	16,000	12,490.00	199,840,000	
はせがわ	6,400	328.00	2,099,200	
高島屋	103,000	1,767.00	182,001,000	
松屋	23,100	1,027.00	23,723,700	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	66,400	1,221.00	81,074,400	
近鉄百貨店	4,500	2,523.00	11,353,500	
丸井グループ	100,800	2,124.00	214,099,200	
クレディセゾン	80,600	1,674.00	134,924,400	
アクシアル　リテイリング	9,300	3,315.00	30,829,500	
井筒屋	6,500	382.00	2,483,000	
イオン	463,300	2,691.50	1,246,971,950	
イズミ	20,800	2,864.00	59,571,200	
フォーバル	5,300	986.00	5,225,800	
平和堂	22,800	2,070.00	47,196,000	
フジ	20,900	1,818.00	37,996,200	
ヤオコー	15,500	6,720.00	104,160,000	
ゼビオホールディングス	18,400	907.00	16,688,800	
ケーズホールディングス	108,600	1,115.00	121,089,000	
ＰＡＬＴＡＣ	21,500	4,610.00	99,115,000	
三谷産業	24,100	305.00	7,350,500	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	5,100	512.00	2,611,200	
日産東京販売ホールディングス	17,600	289.00	5,086,400	
ＳＢＩ新生銀行	37,500	2,257.00	84,637,500	
あおぞら銀行	79,900	2,604.00	208,059,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,079,900	908.00	7,336,549,200	
りそなホールディングス	1,624,200	717.90	1,166,013,180	
三井住友トラスト・ホールディングス	231,200	4,599.00	1,063,288,800	
三井住友フィナンシャルグループ	929,800	5,345.00	4,969,781,000	
千葉銀行	354,600	945.00	335,097,000	
群馬銀行	246,900	492.00	121,474,800	
武蔵野銀行	16,300	2,067.00	33,692,100	
千葉興業銀行	29,600	450.00	13,320,000	
筑波銀行	55,700	230.00	12,811,000	
七十七銀行	40,700	2,109.00	85,836,300	
秋田銀行	8,400	1,844.00	15,489,600	
山形銀行	14,100	1,150.00	16,215,000	
岩手銀行	8,500	1,947.00	16,549,500	
東邦銀行	100,800	228.00	22,982,400	
東北銀行	6,200	1,005.00	6,231,000	

ふくおかフィナンシャルグループ	101,500	2,915.00	295,872,500	
スルガ銀行	112,000	416.00	46,592,000	
八十二銀行	260,900	548.00	142,973,200	
山梨中央銀行	13,000	1,099.00	14,287,000	
大垣共立銀行	24,200	1,847.00	44,697,400	
福井銀行	11,300	1,489.00	16,825,700	
清水銀行	5,000	1,524.00	7,620,000	
富山銀行	1,800	1,737.00	3,126,600	
滋賀銀行	21,100	2,620.00	55,282,000	
南都銀行	19,000	2,530.00	48,070,000	
百五銀行	119,800	373.00	44,685,400	
京都銀行	40,200	5,790.00	232,758,000	
紀陽銀行	45,500	1,527.00	69,478,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	80,800	956.00	77,244,800	
山陰合同銀行	79,500	760.00	60,420,000	
鳥取銀行	4,200	1,137.00	4,775,400	
百十四銀行	11,500	1,892.00	21,758,000	
四国銀行	20,100	952.00	19,135,200	
阿波銀行	18,700	2,057.00	38,465,900	
大分銀行	7,600	1,996.00	15,169,600	
宮崎銀行	8,100	2,459.00	19,917,900	
佐賀銀行	7,400	1,730.00	12,802,000	
琉球銀行	29,100	877.00	25,520,700	
セブン銀行	455,800	260.00	118,508,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,840,200	1,904.50	3,504,660,900	
高知銀行	4,400	699.00	3,075,600	
山口フィナンシャルグループ	140,500	858.00	120,549,000	
芙蓉総合リース	11,600	8,480.00	98,368,000	
みずほリース	18,800	3,310.00	62,228,000	
東京センチュリー	23,700	4,430.00	104,991,000	
ＳＢＩホールディングス	184,100	2,599.00	478,475,900	
日本証券金融	50,900	1,127.00	57,364,300	
アイフル	210,700	382.00	80,487,400	
日本アジア投資	10,100	231.00	2,333,100	
長野銀行	4,000	1,380.00	5,520,000	
名古屋銀行	8,200	3,330.00	27,306,000	
北洋銀行	192,700	257.00	49,523,900	
大光銀行	3,900	1,204.00	4,695,600	
愛媛銀行	17,200	887.00	15,256,400	
トマト銀行	4,300	1,019.00	4,381,700	
京葉銀行	59,000	586.00	34,574,000	
栃木銀行	58,300	301.00	17,548,300	
北日本銀行	4,500	2,064.00	9,288,000	
東和銀行	23,200	574.00	13,316,800	
福島銀行	13,200	257.00	3,392,400	
大東銀行	4,900	689.00	3,376,100	
リコーリース	12,000	3,780.00	45,360,000	
イオンフィナンシャルサービス	73,000	1,415.00	103,295,000	
アコム	227,000	307.00	69,689,000	
ジャックス	13,400	3,980.00	53,332,000	

オリエントコーポレーション	33,200	1,139.00	37,814,800	
オリックス	851,100	2,133.50	1,815,821,850	
三菱ＨＣキャピタル	496,000	643.00	318,928,000	
ジャフコ　グループ	42,400	2,247.00	95,272,800	
九州リースサービス	5,900	742.00	4,377,800	
トモニホールディングス	102,800	376.00	38,652,800	
大和証券グループ本社	909,600	597.00	543,031,200	
野村ホールディングス	2,343,400	495.70	1,161,623,380	
岡三証券グループ	111,700	401.00	44,791,700	
丸三証券	42,300	412.00	17,427,600	
東洋証券	42,200	289.00	12,195,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	138,400	366.00	50,654,400	
光世証券	2,600	363.00	943,800	
水戸証券	34,300	223.00	7,648,900	
いちよし証券	23,400	613.00	14,344,200	
松井証券	75,300	775.00	58,357,500	
ＳＯＭＰＯホールディングス	218,400	5,703.00	1,245,535,200	
日本取引所グループ	357,600	1,847.00	660,487,200	
マネックスグループ	142,000	475.00	67,450,000	
極東証券	15,900	594.00	9,444,600	
岩井コスモホールディングス	14,500	1,308.00	18,966,000	
アイザワ証券グループ	18,300	709.00	12,974,700	
フィデアホールディングス	13,000	1,401.00	18,213,000	
池田泉州ホールディングス	162,500	248.00	40,300,000	
アニコム　ホールディングス	43,100	599.00	25,816,900	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	259,000	4,146.00	1,073,814,000	
マネーパートナーズグループ	13,100	276.00	3,615,600	
スパークス・グループ	14,100	1,705.00	24,040,500	
小林洋行	2,700	221.00	596,700	
第一生命ホールディングス	647,800	2,872.00	1,860,481,600	
東京海上ホールディングス	1,281,200	2,745.00	3,516,894,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	5,900	371.00	2,188,900	
イー・ギャランティ	20,500	2,398.00	49,159,000	
アサックス	5,800	596.00	3,456,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	6,200	2,145.00	13,299,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	341,500	1,912.00	652,948,000	
アドバンスクリエイト	7,400	1,090.00	8,066,000	
三井不動産	553,000	2,362.00	1,306,186,000	
三菱地所	767,800	1,655.50	1,271,092,900	
平和不動産	20,600	3,560.00	73,336,000	
東京建物	121,200	1,578.00	191,253,600	
京阪神ビルディング	16,400	1,300.00	21,320,000	
住友不動産	230,000	3,030.00	696,900,000	
太平洋興発	4,800	820.00	3,936,000	
テーオーシー	23,000	643.00	14,789,000	
東京楽天地	1,800	4,070.00	7,326,000	
レオパレス２１	143,300	310.00	44,423,000	
スターツコーポレーション	18,200	2,501.00	45,518,200	

フジ住宅	17,800	648.00	11,534,400	
空港施設	15,500	515.00	7,982,500	
明和地所	6,400	716.00	4,582,400	
ゴールドクレスト	12,000	1,640.00	19,680,000	
リログループ	73,900	2,102.00	155,337,800	
エスリード	5,900	1,846.00	10,891,400	
日神グループホールディングス	20,300	433.00	8,789,900	
日本エスコン	28,600	756.00	21,621,600	
ＭＩＲＡＲＴＨホールディングス	64,200	372.00	23,882,400	
ＡＶＡＮＴＩＡ	6,300	787.00	4,958,100	
イオンモール	66,000	1,685.00	111,210,000	
毎日コムネット	4,800	691.00	3,316,800	
ファースト住建	5,100	1,026.00	5,232,600	
ランド	766,300	9.00	6,896,700	
カチタス	34,200	3,000.00	102,600,000	
東祥	9,300	1,115.00	10,369,500	
トーセイ	21,100	1,358.00	28,653,800	
穴吹興産	3,000	1,998.00	5,994,000	
サンフロンティア不動産	21,100	1,082.00	22,830,200	
ＦＪネクストホールディングス	13,300	963.00	12,807,900	
インテリックス	3,100	507.00	1,571,700	
ランドビジネス	4,800	223.00	1,070,400	
サンネクスタグループ	4,300	948.00	4,076,400	
グランディハウス	10,800	563.00	6,080,400	
東武鉄道	141,800	2,955.00	419,019,000	
相鉄ホールディングス	42,600	2,176.00	92,697,600	
東急	362,200	1,594.00	577,346,800	
京浜急行電鉄	146,500	1,337.00	195,870,500	
小田急電鉄	195,700	1,615.00	316,055,500	
京王電鉄	68,400	4,620.00	316,008,000	
京成電鉄	83,300	3,550.00	295,715,000	
富士急行	15,900	4,485.00	71,311,500	
東日本旅客鉄道	219,100	7,229.00	1,583,873,900	
西日本旅客鉄道	165,000	5,440.00	897,600,000	
東海旅客鉄道	99,500	15,640.00	1,556,180,000	
西武ホールディングス	156,100	1,405.00	219,320,500	
鴻池運輸	22,000	1,519.00	33,418,000	
西日本鉄道	34,500	2,383.00	82,213,500	
ハマキョウレックス	10,100	3,010.00	30,401,000	
サカイ引越センター	6,000	4,210.00	25,260,000	
近鉄グループホールディングス	128,900	4,175.00	538,157,500	
阪急阪神ホールディングス	172,000	3,755.00	645,860,000	
南海電気鉄道	61,600	2,740.00	168,784,000	
京阪ホールディングス	53,200	3,445.00	183,274,000	
神戸電鉄	3,600	3,135.00	11,286,000	
名古屋鉄道	142,400	2,124.00	302,457,600	
山陽電気鉄道	9,700	2,108.00	20,447,600	
アルプス物流	10,400	1,122.00	11,668,800	
トランコム	3,800	7,310.00	27,778,000	
ヤマトホールディングス	165,100	2,062.00	340,436,200	

山九	32,800	4,695.00	153,996,000	
日新	9,800	2,097.00	20,550,600	
丸運	6,300	218.00	1,373,400	
丸全昭和運輸	7,900	2,943.00	23,249,700	
センコーグループホールディングス	68,400	942.00	64,432,800	
トナミホールディングス	2,400	3,570.00	8,568,000	
ニッコンホールディングス	41,300	2,305.00	95,196,500	
日本石油輸送	800	2,152.00	1,721,600	
福山通運	9,700	3,010.00	29,197,000	
セイノーホールディングス	80,300	1,150.00	92,345,000	
エスライン	3,900	791.00	3,084,900	
神奈川中央交通	3,800	3,170.00	12,046,000	
ＡＺ－ＣＯＭ丸和ホールディングス	31,100	1,588.00	49,386,800	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	12,300	1,146.00	14,095,800	
日本郵船	345,100	3,073.00	1,060,492,300	
商船三井	227,300	3,240.00	736,452,000	
川崎汽船	109,900	2,774.00	304,862,600	
ＮＳユナイテッド海運	6,900	3,775.00	26,047,500	
明治海運	12,400	685.00	8,494,000	
飯野海運	47,300	885.00	41,860,500	
共栄タンカー	2,200	931.00	2,048,200	
九州旅客鉄道	91,100	2,813.00	256,264,300	
ＳＧホールディングス	247,500	1,838.00	454,905,000	
ＮＩＰＰＯＮ　ＥＸＰＲＥＳＳホールディングス	48,100	7,240.00	348,244,000	
日本航空	316,900	2,592.00	821,404,800	
ＡＮＡホールディングス	351,000	2,730.50	958,405,500	
ビーウィズ	4,100	1,077.00	4,415,700	
パスコ	2,400	1,350.00	3,240,000	
ＴＲＥホールディングス	28,000	1,431.00	40,068,000	
人・夢・技術グループ	5,800	1,589.00	9,216,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	3,600	3,550.00	12,780,000	
シルバーライフ	3,100	1,823.00	5,651,300	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,549.00	1,858,800	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	6,600	3,645.00	24,057,000	
コーア商事ホールディングス	9,600	616.00	5,913,600	
ＫＰＰグループホールディングス	31,700	827.00	26,215,900	
ナルミヤ・インターナショナル	2,000	897.00	1,794,000	
ブックオフグループホールディングス	8,000	1,323.00	10,584,000	
ギフトホールディングス	2,700	4,250.00	11,475,000	
三菱倉庫	27,700	2,921.00	80,911,700	
三井倉庫ホールディングス	12,000	3,565.00	42,780,000	
住友倉庫	35,400	1,900.00	67,260,000	
澁澤倉庫	5,100	2,044.00	10,424,400	
ヤマタネ	6,000	1,677.00	10,062,000	
東陽倉庫	17,400	252.00	4,384,800	
乾汽船	16,400	1,993.00	32,685,200	
日本トランスシティ	25,900	491.00	12,716,900	
ケイヒン	2,200	1,458.00	3,207,600	

中央倉庫	6,200	936.00	5,803,200	
川西倉庫	2,100	995.00	2,089,500	
安田倉庫	8,900	927.00	8,250,300	
ファイズホールディングス	2,200	852.00	1,874,400	
東洋埠頭	3,800	1,254.00	4,765,200	
上組	61,800	2,606.00	161,050,800	
サンリツ	3,000	723.00	2,169,000	
キムラユニティー	6,100	776.00	4,733,600	
キユーソー流通システム	7,700	915.00	7,045,500	
東海運	7,700	282.00	2,171,400	
エーアイテイー	8,000	1,389.00	11,112,000	
内外トランスライン	4,700	2,095.00	9,846,500	
ショーエイコーポレーション	3,900	562.00	2,191,800	
日本コンセプト	4,100	1,508.00	6,182,800	
ＴＢＳホールディングス	66,200	1,494.00	98,902,800	
日本テレビホールディングス	114,500	1,021.00	116,904,500	
朝日放送グループホールディングス	12,100	633.00	7,659,300	
テレビ朝日ホールディングス	31,300	1,307.00	40,909,100	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	114,900	482.00	55,381,800	
テレビ東京ホールディングス	9,300	1,850.00	17,205,000	
日本ＢＳ放送	4,700	902.00	4,239,400	
ビジョン	17,100	1,392.00	23,803,200	
スマートバリュー	3,200	419.00	1,340,800	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	11,500	2,206.00	25,369,000	
ワイヤレスゲート	5,600	235.00	1,316,000	
コネクシオ	8,500	1,909.00	16,226,500	
日本通信	119,500	224.00	26,768,000	
クロップス	2,000	944.00	1,888,000	
日本電信電話	1,660,300	3,727.00	6,187,938,100	
ＫＤＤＩ	1,001,300	3,900.00	3,905,070,000	
ソフトバンク	2,081,500	1,463.00	3,045,234,500	
光通信	15,300	18,370.00	281,061,000	
エムティーアイ	11,800	510.00	6,018,000	
GMOインターネットグループ	48,100	2,444.00	117,556,400	
ファイバーゲート	6,900	882.00	6,085,800	
アイドママーケティングコミュニケーション	3,000	272.00	816,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	68,500	2,423.00	165,975,500	
学研ホールディングス	21,600	924.00	19,958,400	
ゼンリン	22,100	802.00	17,724,200	
昭文社ホールディングス	5,500	284.00	1,562,000	
インプレスホールディングス	11,300	212.00	2,395,600	
東京電力ホールディングス	1,164,500	435.00	506,557,500	
中部電力	476,000	1,280.00	609,280,000	
関西電力	498,800	1,210.00	603,548,000	
中国電力	205,700	666.00	136,996,200	
北陸電力	121,800	518.00	63,092,400	
東北電力	315,800	662.00	209,059,600	
四国電力	110,300	723.00	79,746,900	

九州電力	297,800	714.00	212,629,200	
北海道電力	124,600	446.00	55,571,600	
沖縄電力	30,200	1,026.00	30,985,200	
電源開発	97,200	2,028.00	197,121,600	
エフオン	9,400	496.00	4,662,400	
イーレックス	22,900	2,136.00	48,914,400	
レノバ	34,400	2,240.00	77,056,000	
東京瓦斯	273,100	2,489.00	679,745,900	
大阪瓦斯	261,600	2,023.00	529,216,800	
東邦瓦斯	50,700	2,363.00	119,804,100	
北海道瓦斯	7,700	1,629.00	12,543,300	
広島ガス	27,400	337.00	9,233,800	
西部ガスホールディングス	12,000	1,674.00	20,088,000	
静岡ガス	29,400	1,061.00	31,193,400	
メタウォーター	16,200	1,632.00	26,438,400	
アイネット	7,800	1,337.00	10,428,600	
松竹	7,400	11,380.00	84,212,000	
東宝	81,000	4,830.00	391,230,000	
エイチ・アイ・エス	34,700	2,070.00	71,829,000	
東映	3,700	17,180.00	63,566,000	
ラックランド	4,200	2,901.00	12,184,200	
エヌ・ティ・ティ・データ	406,600	1,921.00	781,078,600	
共立メンテナンス	22,700	5,880.00	133,476,000	
イチネンホールディングス	14,100	1,240.00	17,484,000	
建設技術研究所	6,700	3,135.00	21,004,500	
スペース	9,700	881.00	8,545,700	
アインホールディングス	18,700	5,870.00	109,769,000	
燦ホールディングス	5,800	1,746.00	10,126,800	
ピー・シー・エー	7,800	1,356.00	10,576,800	
スバル興業	600	9,360.00	5,616,000	
東京テアトル	4,900	1,119.00	5,483,100	
タナベコンサルティンググループ	5,200	635.00	3,302,000	
ビジネスブレイン太田昭和	5,500	1,869.00	10,279,500	
ナガワ	3,600	7,610.00	27,396,000	
東京都競馬	11,200	3,810.00	42,672,000	
常磐興産	4,700	1,215.00	5,710,500	
カナモト	24,300	2,250.00	54,675,000	
ＤＴＳ	28,500	2,943.00	83,875,500	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,200	6,400.00	417,280,000	
シーイーシー	18,100	1,484.00	26,860,400	
カプコン	128,700	4,130.00	531,531,000	
西尾レントオール	12,300	3,005.00	36,961,500	
アイ・エス・ビー	6,500	1,172.00	7,618,000	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	75,400	22.00	1,658,800	
日本空港ビルデング	45,000	6,500.00	292,500,000	
トランス・コスモス	16,500	3,230.00	53,295,000	
乃村工藝社	58,000	935.00	54,230,000	
ジャステック	7,900	1,147.00	9,061,300	

ＳＣＳＫ	105,700	2,035.00	215,099,500	
藤田観光	5,800	3,075.00	17,835,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	7,900	1,628.00	12,861,200	
日本管財	13,900	2,459.00	34,180,100	
トーカイ	11,700	1,882.00	22,019,400	
白洋舎	1,200	1,761.00	2,113,200	
セコム	135,200	7,405.00	1,001,156,000	
ＮＳＷ	5,000	2,030.00	10,150,000	
セントラル警備保障	7,100	2,235.00	15,868,500	
アイネス	9,100	1,322.00	12,030,200	
丹青社	25,600	712.00	18,227,200	
メイテック	53,000	2,398.00	127,094,000	
ＴＫＣ	23,200	3,445.00	79,924,000	
富士ソフト	14,500	7,520.00	109,040,000	
応用地質	12,800	2,157.00	27,609,600	
船井総研ホールディングス	27,900	2,658.00	74,158,200	
ＮＳＤ	46,300	2,236.00	103,526,800	
進学会ホールディングス	4,500	297.00	1,336,500	
丸紅建材リース	800	1,718.00	1,374,400	
オオバ	8,200	651.00	5,338,200	
コナミグループ	55,400	5,990.00	331,846,000	
いであ	3,000	1,683.00	5,049,000	
学究社	5,200	1,830.00	9,516,000	
ベネッセホールディングス	49,500	1,933.00	95,683,500	
イオンディライト	14,500	2,953.00	42,818,500	
ナック	6,000	934.00	5,604,000	
福井コンピュータホールディングス	8,900	2,733.00	24,323,700	
ダイセキ	27,100	4,470.00	121,137,000	
ステップ	5,400	1,784.00	9,633,600	
日鉄物産	9,400	9,260.00	87,044,000	
泉州電業	6,700	3,110.00	20,837,000	
元気寿司	4,400	3,090.00	13,596,000	
トラスコ中山	28,700	2,016.00	57,859,200	
ヤマダホールディングス	560,500	461.00	258,390,500	
オートバックスセブン	47,400	1,410.00	66,834,000	
モリト	9,800	723.00	7,085,400	
アークランズ	19,900	1,564.00	31,123,600	
ニトリホールディングス	55,200	16,465.00	908,868,000	
グルメ杵屋	11,200	998.00	11,177,600	
愛眼	7,400	166.00	1,228,400	
ケーユーホールディングス	8,000	1,310.00	10,480,000	
吉野家ホールディングス	53,400	2,280.00	121,752,000	
加藤産業	16,600	3,460.00	57,436,000	
北恵	3,100	672.00	2,083,200	
イノテック	8,500	1,305.00	11,092,500	
イエローハット	24,100	1,708.00	41,162,800	
松屋フーズホールディングス	6,400	3,900.00	24,960,000	
ＪＢＣＣホールディングス	9,500	1,777.00	16,881,500	
ＪＫホールディングス	10,800	1,011.00	10,918,800	
サガミホールディングス	22,000	1,207.00	26,554,000	

日伝	8,000	1,695.00	13,560,000	
関西フードマーケット	12,300	1,249.00	15,362,700	
ミロク情報サービス	11,700	1,453.00	17,000,100	
北沢産業	7,000	190.00	1,330,000	
杉本商事	6,000	1,949.00	11,694,000	
因幡電機産業	35,400	2,680.00	94,872,000	
王将フードサービス	8,900	5,940.00	52,866,000	
プレナス	4,300	2,633.00	11,321,900	
ミニストップ	10,000	1,409.00	14,090,000	
アークス	25,000	2,091.00	52,275,000	
バローホールディングス	25,900	1,763.00	45,661,700	
東テク	4,600	3,425.00	15,755,000	
ミスミグループ本社	206,200	2,975.00	613,445,000	
アルテック	7,700	309.00	2,379,300	
ベルク	6,700	5,420.00	36,314,000	
大　庄	7,400	1,041.00	7,703,400	
タキヒヨー	3,300	852.00	2,811,600	
ファーストリテイリング	20,500	81,450.00	1,669,725,000	
ソフトバンクグループ	749,200	5,969.00	4,471,974,800	
蔵王産業	2,100	1,747.00	3,668,700	
スズケン	42,500	3,415.00	145,137,500	
サンドラッグ	51,900	3,750.00	194,625,000	
サックスバー　ホールディングス	12,900	741.00	9,558,900	
ジェコス	8,900	832.00	7,404,800	
ヤマザワ	2,400	1,287.00	3,088,800	
やまや	2,700	2,506.00	6,766,200	
グローセル	14,900	410.00	6,109,000	
ベルーナ	32,800	668.00	21,910,400	
合計	151,587,400		353,679,998,270	

（２）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	885,508,127
コール・ローン	2,942,736,724
国債証券	251,751,200,775
派生商品評価勘定	10,968,406
未収入金	949,161
未収利息	1,256,490,745
前払費用	503,145,758
流動資産合計	257,350,999,696
資産合計	257,350,999,696
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,148,017,042
未払金	1,959,202,380
未払解約金	44,833,000
流動負債合計	4,152,052,422
負債合計	4,152,052,422
純資産の部	
元本等	
元本	209,096,112,873
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	44,102,834,401
元本等合計	253,198,947,274
純資産合計	253,198,947,274
負債純資産合計	257,350,999,696

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	354,922,285,046円
同期中追加設定元本額	653,310,146,213円
同期中一部解約元本額	799,136,318,386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＞	9,398,178,730円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	1,144,697,867円
たわらノーロード　バランス（標準型）	3,022,684,590円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,443,288,826円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	53,638,214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）	1,511,908,390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）	1,760,002,970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）	466,706,724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）	59,016,894円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	3,689,977円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	14,904,663円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	128,681,386円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,367,101円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	91,804円
投資のソムリエ	91,926,179,238円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	6,643,327,810円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	7,271,393,798円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	31,574,202,011円
ワールドアセットバランス（基本コース）	2,225,029,548円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	1,440,931,286円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	351,922,333円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	176,436,225円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	50,012,631円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	1,006,025,687円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	3,540,139,153円

９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	5,539,816,538円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	427,259,606円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	188,890,570円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	116,592,753円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	24,462,147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）	19,872,899,787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）	7,180,857,018円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	2,431,269,913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）	48,461,787円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	84,835,019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）	508,098,396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）	44,020,528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）	298,671,014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）	570,893,246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）	802,232,677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）	29,825,738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	209,096,112,873円
２．　受益権の総数	209,096,112,873口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△3,875,121,742
合計	△3,875,121,742

（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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	248,014,736,982	－	250,158,396,868	△2,143,659,886
アメリカ・ドル	124,534,249,964	－	125,112,285,027	△578,035,063
イギリス・ポンド	11,903,047,510	－	12,078,460,946	△175,413,436
イスラエル・シュケル	844,971,546	－	863,840,062	△18,868,516
オーストラリア・ドル	3,958,893,171	－	4,041,431,236	△82,538,065
オフショア・人民元	10,103,667,733	－	10,339,718,352	△236,050,619
カナダ・ドル	5,154,170,952	－	5,223,521,460	△69,350,508

シンガポール・ドル	1,178,097,889	－	1,192,324,184	△14,226,295
スウェーデン・クローナ	505,581,838	－	508,620,542	△3,038,704
デンマーク・クローネ	819,950,739	－	828,310,990	△8,360,251
ニュージーランド・ドル	560,613,458	－	567,571,515	△6,958,057
ノルウェー・クローネ	502,133,764	－	498,070,902	4,062,862
ポーランド・ズロチ	1,104,136,872	－	1,115,502,673	△11,365,801
マレーシア・リンギット	1,351,293,811	－	1,378,454,922	△27,161,111
メキシコ・ペソ	2,011,998,085	－	2,069,636,171	△57,638,086
ユーロ	83,481,929,650	－	84,340,647,886	△858,718,236
買建	1,999,998,000	－	2,006,609,250	6,611,250
アメリカ・ドル	1,056,995,000	－	1,060,838,244	3,843,244
イギリス・ポンド	92,561,000	－	92,652,460	91,460
オーストラリア・ドル	33,470,000	－	33,376,363	△93,637
オフショア・人民元	77,337,000	－	77,448,549	111,549
カナダ・ドル	39,452,000	－	39,404,152	△47,848
ユーロ	700,183,000	－	702,889,482	2,706,482
合計	250,014,734,982	－	252,165,006,118	△2,137,048,636

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	1.2109円
（1万口当たり純資産額）	(12,109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

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 02/15/24	4,870,000.000	4,636,011.690	
		US T N/B 0.25 05/15/24	550,000.000	518,998.040	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,000,000.000	3,650,000.000	

		US T N/B 0.25 06/30/25	5,000,000.000	4,560,156.250	
		US T N/B 0.25 08/31/25	9,020,000.000	8,168,737.500	
		US T N/B 0.25 09/30/25	2,000,000.000	1,809,765.620	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,810,000.000	2,532,512.500	
		US T N/B 0.375 01/31/26	4,000,000.000	3,590,312.480	
		US T N/B 0.375 04/15/24	7,740,000.000	7,339,092.140	
		US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,309,665.620	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,000,000.000	2,576,601.540	
		US T N/B 0.375 08/15/24	18,000,000.000	16,879,218.660	
		US T N/B 0.375 09/15/24	60,000.000	56,123.430	
		US T N/B 0.375 09/30/27	7,760,000.000	6,634,496.810	
		US T N/B 0.375 11/30/25	3,020,000.000	2,723,898.420	
		US T N/B 0.375 12/31/25	3,400,000.000	3,063,320.300	
		US T N/B 0.5 02/28/26	5,000,000.000	4,494,335.900	
		US T N/B 0.5 03/31/25	6,790,000.000	6,274,649.590	
		US T N/B 0.5 05/31/27	3,830,000.000	3,324,170.670	
		US T N/B 0.5 06/30/27	3,170,000.000	2,746,507.810	
		US T N/B 0.5 08/31/27	2,520,000.000	2,172,417.180	
		US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,573,554.680	
		US T N/B 0.625 03/31/27	2,630,000.000	2,309,468.750	
		US T N/B 0.625 05/15/30	5,150,000.000	4,170,494.150	
		US T N/B 0.625 07/31/26	3,000,000.000	2,675,507.790	
		US T N/B 0.625 08/15/30	9,110,000.000	7,338,531.980	
		US T N/B 0.625 10/15/24	17,340,000.000	16,261,668.750	
		US T N/B 0.625 11/30/27	5,130,000.000	4,420,216.380	
		US T N/B 0.625 12/31/27	3,160,000.000	2,717,600.000	
		US T N/B 0.75 01/31/28	3,270,000.000	2,822,290.990	
		US T N/B 0.75 03/31/26	5,140,000.000	4,650,294.510	
		US T N/B 0.75 04/30/26	6,650,000.000	6,002,144.490	
		US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,700,468.750	
		US T N/B 0.75 08/31/26	5,000,000.000	4,471,679.650	
		US T N/B 0.75 11/15/24	4,040,000.000	3,786,868.750	
		US T N/B 0.75 12/31/23	4,940,000.000	4,754,171.080	
		US T N/B 0.875 01/31/24	6,000,000.000	5,765,859.360	
		US T N/B 0.875 06/30/26	3,250,000.000	2,933,125.000	
		US T N/B 0.875 09/30/26	11,680,000.000	10,474,587.440	
		US T N/B 0.875 11/15/30	9,590,000.000	7,844,694.890	
		US T N/B 1.0 07/31/28	3,670,000.000	3,168,672.230	
		US T N/B 1.0 12/15/24	16,260,000.000	15,281,224.090	
		US T N/B 1.125 02/15/31	8,230,000.000	6,859,190.620	
		US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,521,009.370	
		US T N/B 1.125 02/29/28	5,380,000.000	4,726,203.890	
		US T N/B 1.125 05/15/40	1,930,000.000	1,254,650.770	
		US T N/B 1.125 08/15/40	3,760,000.000	2,427,843.730	
		US T N/B 1.125 08/31/28	4,370,000.000	3,793,876.940	
		US T N/B 1.125 10/31/26	4,000,000.000	3,614,218.720	
		US T N/B 1.25 03/31/28	3,880,000.000	3,423,948.400	
		US T N/B 1.25 04/30/28	4,000,000.000	3,523,906.240	
		US T N/B 1.25 05/15/50	6,370,000.000	3,614,975.000	

		US T N/B 1.25 05/31/28	3,850,000.000	3,384,691.380	
		US T N/B 1.25 06/30/28	5,000,000.000	4,389,843.750	
		US T N/B 1.25 08/15/31	8,680,000.000	7,203,043.750	
		US T N/B 1.25 08/31/24	5,400,000.000	5,131,265.590	
		US T N/B 1.25 09/30/28	7,120,000.000	6,211,087.500	
		US T N/B 1.25 11/30/26	4,000,000.000	3,626,406.240	
		US T N/B 1.25 12/31/26	10,960,000.000	9,922,225.000	
		US T N/B 1.375 08/15/50	6,850,000.000	4,007,250.000	
		US T N/B 1.375 08/31/26	2,750,000.000	2,518,613.260	
		US T N/B 1.375 10/31/28	4,000,000.000	3,510,312.480	
		US T N/B 1.375 11/15/31	13,320,000.000	11,099,306.240	
		US T N/B 1.375 11/15/40	4,330,000.000	2,917,675.750	
		US T N/B 1.375 12/31/28	3,900,000.000	3,419,660.120	
		US T N/B 1.5 01/31/27	5,290,000.000	4,829,398.000	
		US T N/B 1.5 02/15/25	5,580,000.000	5,275,715.620	
		US T N/B 1.5 02/15/30	4,730,000.000	4,113,067.560	
		US T N/B 1.5 02/29/24	20,000.000	19,307.030	
		US T N/B 1.5 08/15/26	4,990,000.000	4,590,215.220	
		US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,530,625.000	
		US T N/B 1.625 02/15/26	3,900,000.000	3,635,835.910	
		US T N/B 1.625 05/15/26	2,000,000.000	1,857,656.240	
		US T N/B 1.625 05/15/31	9,860,000.000	8,483,066.370	
		US T N/B 1.625 08/15/29	4,400,000.000	3,886,609.360	
		US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,533,201.540	
		US T N/B 1.625 11/15/50	7,310,000.000	4,574,460.930	
		US T N/B 1.75 01/31/29	4,000,000.000	3,570,937.480	
		US T N/B 1.75 03/15/25	6,100,000.000	5,793,808.540	
		US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,493,032.790	
		US T N/B 1.75 08/15/41	7,990,000.000	5,672,900.000	
		US T N/B 1.75 11/15/29	2,900,000.000	2,578,960.920	
		US T N/B 1.875 02/15/32	6,010,000.000	5,210,857.810	
		US T N/B 1.875 02/15/41	5,330,000.000	3,909,846.430	
		US T N/B 1.875 02/15/51	6,700,000.000	4,469,632.770	
		US T N/B 1.875 02/28/27	4,690,000.000	4,342,280.440	
		US T N/B 1.875 02/28/29	6,000,000.000	5,400,468.720	
		US T N/B 1.875 06/30/26	2,920,000.000	2,730,770.300	
		US T N/B 1.875 11/15/51	5,690,000.000	3,783,405.440	
		US T N/B 2.0 02/15/50	6,540,000.000	4,522,052.310	
		US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	6,641,337.500	
		US T N/B 2.0 05/31/24	6,440,000.000	6,222,146.840	
		US T N/B 2.0 08/15/25	2,190,000.000	2,079,302.330	
		US T N/B 2.0 08/15/51	6,310,000.000	4,334,181.250	
		US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	3,865,886.700	
		US T N/B 2.0 11/15/41	6,490,000.000	4,809,191.370	
		US T N/B 2.125 02/29/24	5,000,000.000	4,862,109.350	
		US T N/B 2.125 03/31/24	4,600,000.000	4,467,390.600	
		US T N/B 2.125 05/15/25	2,500,000.000	2,387,695.300	
		US T N/B 2.125 05/31/26	50,000.000	47,132.810	
		US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	5,953,085.930	

		US T N/B 2.125 09/30/24	2,400,000.000	2,311,312.480	
		US T N/B 2.25 01/31/24	6,160,000.000	6,006,240.600	
		US T N/B 2.25 02/15/27	9,300,000.000	8,746,359.370	
		US T N/B 2.25 02/15/52	6,020,000.000	4,390,367.150	
		US T N/B 2.25 03/31/24	8,510,000.000	8,268,661.670	
		US T N/B 2.25 03/31/26	7,000,000.000	6,643,437.500	
		US T N/B 2.25 04/30/24	5,000,000.000	4,852,343.750	
		US T N/B 2.25 05/15/41	6,220,000.000	4,846,254.650	
		US T N/B 2.25 08/15/27	3,640,000.000	3,406,670.280	
		US T N/B 2.25 08/15/46	4,130,000.000	3,055,232.000	
		US T N/B 2.25 08/15/49	3,030,000.000	2,231,547.640	
		US T N/B 2.25 11/15/24	16,780,000.000	16,173,035.850	
		US T N/B 2.25 11/15/25	2,320,000.000	2,210,525.000	
		US T N/B 2.25 11/15/27	3,340,000.000	3,117,420.290	
		US T N/B 2.375 02/15/42	5,560,000.000	4,397,178.090	
		US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,656,585.890	
		US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,701,093.720	
		US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,074,693.750	
		US T N/B 2.375 05/15/27	5,000,000.000	4,715,234.350	
		US T N/B 2.375 05/15/29	3,450,000.000	3,189,767.560	
		US T N/B 2.375 05/15/51	8,560,000.000	6,430,700.000	
		US T N/B 2.375 08/15/24	4,000,000.000	3,872,031.240	
		US T N/B 2.375 11/15/49	5,000,000.000	3,785,546.840	
		US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	5,796,562.500	
		US T N/B 2.5 02/15/45	1,710,000.000	1,342,884.370	
		US T N/B 2.5 02/15/46	3,130,000.000	2,443,111.700	
		US T N/B 2.5 02/28/26	3,520,000.000	3,368,200.000	
		US T N/B 2.5 03/31/27	9,760,000.000	9,257,893.670	
		US T N/B 2.5 04/30/24	7,100,000.000	6,910,574.200	
		US T N/B 2.5 05/15/46	2,360,000.000	1,842,090.630	
		US T N/B 2.625 01/31/26	1,280,000.000	1,231,800.000	
		US T N/B 2.625 02/15/29	4,530,000.000	4,257,315.190	
		US T N/B 2.625 04/15/25	2,280,000.000	2,204,475.000	
		US T N/B 2.625 05/31/27	3,000,000.000	2,859,257.790	
		US T N/B 2.625 07/31/29	1,500,000.000	1,406,132.800	
		US T N/B 2.625 12/31/25	2,000,000.000	1,926,328.120	
		US T N/B 2.75 02/15/24	3,470,000.000	3,399,244.510	
		US T N/B 2.75 02/15/28	11,000,000.000	10,483,945.230	
		US T N/B 2.75 02/28/25	10,000.000	9,707.030	
		US T N/B 2.75 04/30/27	2,740,000.000	2,625,262.500	
		US T N/B 2.75 05/15/25	6,500,000.000	6,299,921.870	
		US T N/B 2.75 05/31/29	3,000,000.000	2,835,000.000	
		US T N/B 2.75 06/30/25	70,000.000	67,812.500	
		US T N/B 2.75 07/31/27	2,000,000.000	1,913,828.120	
		US T N/B 2.75 08/15/32	8,980,000.000	8,357,012.500	
		US T N/B 2.75 08/15/42	2,180,000.000	1,823,535.910	
		US T N/B 2.75 08/15/47	4,590,000.000	3,741,208.560	
		US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,901,093.750	
		US T N/B 2.75 11/15/42	1,030,000.000	858,923.430	

		US T N/B 2.75 11/15/47	2,160,000.000	1,760,062.500	
		US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,810,975.000	
		US T N/B 2.875 04/30/29	9,370,000.000	8,922,728.850	
		US T N/B 2.875 05/15/28	9,140,000.000	8,756,548.390	
		US T N/B 2.875 05/15/32	12,780,000.000	12,039,159.370	
		US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,519,542.180	
		US T N/B 2.875 05/15/49	3,050,000.000	2,562,476.560	
		US T N/B 2.875 05/15/52	7,200,000.000	6,033,937.460	
		US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,420,964.820	
		US T N/B 2.875 06/15/25	4,000,000.000	3,887,187.480	
		US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,179,053.120	
		US T N/B 2.875 08/15/28	3,860,000.000	3,686,903.120	
		US T N/B 2.875 08/15/45	2,400,000.000	2,011,781.230	
		US T N/B 2.875 11/15/46	1,020,000.000	852,337.500	
		US T N/B 2.875 11/30/25	1,140,000.000	1,104,864.830	
		US T N/B 3.0 02/15/47	5,020,000.000	4,287,393.740	
		US T N/B 3.0 02/15/48	3,080,000.000	2,633,640.600	
		US T N/B 3.0 02/15/49	5,530,000.000	4,754,935.930	
		US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	872,812.500	
		US T N/B 3.0 05/15/45	1,930,000.000	1,653,165.620	
		US T N/B 3.0 05/15/47	3,710,000.000	3,165,673.430	
		US T N/B 3.0 07/15/25	5,000,000.000	4,871,289.050	
		US T N/B 3.0 08/15/48	5,880,000.000	5,034,750.000	
		US T N/B 3.0 08/15/52	4,340,000.000	3,739,859.370	
		US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,946,562.500	
		US T N/B 3.0 10/31/25	1,040,000.000	1,011,765.620	
		US T N/B 3.0 11/15/44	1,320,000.000	1,134,168.750	
		US T N/B 3.0 11/15/45	870,000.000	745,277.330	
		US T N/B 3.125 02/15/42	2,610,000.000	2,331,667.950	
		US T N/B 3.125 02/15/43	2,760,000.000	2,442,815.610	
		US T N/B 3.125 05/15/48	5,220,000.000	4,566,276.530	
		US T N/B 3.125 08/15/44	1,650,000.000	1,448,648.430	
		US T N/B 3.125 08/31/27	8,450,000.000	8,222,906.250	
		US T N/B 3.125 08/31/29	5,890,000.000	5,689,832.000	
		US T N/B 3.125 11/15/28	5,380,000.000	5,209,773.410	
		US T N/B 3.125 11/15/41	1,080,000.000	967,106.250	
		US T N/B 3.25 05/15/42	4,950,000.000	4,495,992.180	
		US T N/B 3.25 06/30/27	3,000,000.000	2,932,851.540	
		US T N/B 3.25 06/30/29	4,860,000.000	4,728,058.580	
		US T N/B 3.25 08/31/24	22,300,000.000	21,887,101.450	
		US T N/B 3.375 05/15/44	2,900,000.000	2,653,273.420	
		US T N/B 3.375 08/15/42	3,480,000.000	3,217,368.750	
		US T N/B 3.375 11/15/48	2,840,000.000	2,608,140.610	
		US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	864,690.620	
		US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,959,687.500	
		US T N/B 3.625 02/15/44	2,160,000.000	2,058,243.730	
		US T N/B 3.625 08/15/43	1,000,000.000	954,062.500	
		US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	982,968.750	
		US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	971,875.000	

		US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	2,603,381.250	
		US T N/B 3.875 09/30/29	8,070,000.000	8,154,798.020	
		US T N/B 3.875 11/30/27	4,970,000.000	5,004,557.000	
		US T N/B 3.875 11/30/29	2,000,000.000	2,021,250.000	
		US T N/B 4.0 10/31/29	5,030,000.000	5,121,954.680	
		US T N/B 4.0 11/15/42	3,000,000.000	3,036,562.500	
		US T N/B 4.0 12/15/25	12,420,000.000	12,427,762.500	
		US T N/B 4.125 09/30/27	2,730,000.000	2,771,483.190	
		US T N/B 4.125 10/31/27	1,500,000.000	1,524,257.820	
		US T N/B 4.125 11/15/32	7,600,000.000	7,918,843.710	
		US T N/B 4.25 05/15/39	2,000,000.000	2,128,437.500	
		US T N/B 4.25 10/15/25	10,370,000.000	10,431,571.870	
		US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	1,056,718.750	
		US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	809,531.250	
		US T N/B 4.375 05/15/40	2,220,000.000	2,387,020.290	
		US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	933,142.960	
		US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,293,843.730	
		US T N/B 4.5 02/15/36	1,410,000.000	1,546,593.750	
		US T N/B 4.5 08/15/39	1,030,000.000	1,128,252.330	
		US T N/B 4.5 11/15/25	2,000,000.000	2,026,406.240	
		US T N/B 4.75 02/15/41	20,000.000	22,492.180	
		US T N/B 5.0 05/15/37	750,000.000	862,382.810	
		US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,831,882.800	
		US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	2,562,474.200	
		US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,916,478.880	
		US T N/B 6.125 11/15/27	8,320,000.000	9,176,700.000	
		US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,323,281.200	
アメリカ・ドル　小計			1,052,270,000.000 (139,320,548,000)	950,623,474.180 (125,862,547,982)	
イギリス・ポンド		UK TREASURY 0.125 01/30/26	2,960,000.000	2,685,985.990	
		UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,120,000.000	1,081,152.250	
		UK TREASURY 0.125 01/31/28	730,000.000	617,691.830	
		UK TREASURY 0.25 01/31/25	4,980,000.000	4,651,415.600	
		UK TREASURY 0.25 07/31/31	3,350,000.000	2,539,300.000	
		UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,270,000.000	1,132,763.800	
		UK TREASURY 0.375 10/22/30	2,240,000.000	1,765,120.000	
		UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,700,000.000	1,420,520.000	
		UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,610,000.000	583,335.200	
		UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,410,000.000	1,321,663.500	
		UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,120,000.000	1,453,699.270	

		UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,120,000.000	504,784.000	
		UK TREASURY 0.875 01/31/46	3,300,000.000	1,751,640.000	
		UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,860,000.000	1,404,686.880	
		UK TREASURY 0.875 10/22/29	1,770,000.000	1,495,650.000	
		UK TREASURY 1.0 01/31/32	3,350,000.000	2,681,876.000	
		UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,990,000.000	1,930,101.000	
		UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,770,000.000	1,182,183.000	
		UK TREASURY 1.125 10/22/73	2,010,000.000	895,334.400	
		UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,290,000.000	1,172,266.860	
		UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,270,000.000	692,564.520	
		UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,370,000.000	1,524,287.770	
		UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,040,000.000	973,126.540	
		UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,720,000.000	1,059,372.080	
		UK TREASURY 1.5 07/31/53	1,870,000.000	1,079,447.020	
		UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,320,000.000	1,197,081.610	
		UK TREASURY 1.625 10/22/54	880,000.000	523,091.360	
		UK TREASURY 1.625 10/22/71	2,550,000.000	1,427,719.500	
		UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	329,343.510	
		UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,510,000.000	927,034.300	
		UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,760,000.000	1,341,648.000	
		UK TREASURY 2.0 09/07/25	910,000.000	878,140.900	
		UK TREASURY 2.5 07/22/65	950,000.000	713,079.500	
		UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,050,000.000	1,037,477.700	
		UK TREASURY 3.25 01/22/44	3,060,000.000	2,733,742.800	
		UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,630,000.000	1,510,032.970	
		UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,310,000.000	1,258,517.000	
		UK TREASURY 3.75 07/22/52	770,000.000	746,938.500	
		UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,390,000.000	1,458,985.700	
		UK TREASURY 4.125 01/29/27	1,470,000.000	1,497,315.240	
		UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,120,000.000	1,170,416.800	

	UK TREASURY 4.25 06/07/32	3,000,000.000	3,167,820.000	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,020,000.000	1,057,587.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,550,000.000	2,640,528.060	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	200,000.000	207,070.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,110,000.000	2,188,703.000	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	450,000.000	470,542.500	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,650,000.000	1,770,285.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	830,000.000	888,722.500	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	860,000.000	934,097.600	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,760,000.000	1,933,712.000	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,580,000.000	1,630,474.040	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,637,557.500	
イギリス・ポンド　小計		89,870,000.000 (14,468,171,300)	74,877,632.100 (12,054,549,992)	
イスラエル・シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	2,390,000.000	2,252,001.400	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,770,000.000	1,610,140.680	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,180,000.000	1,097,961.680	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,810,000.000	2,393,380.970	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	90,000.000	75,655.890	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	3,070,000.000	2,391,935.240	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,630,000.000	1,554,473.950	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,350,000.000	2,217,116.900	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	2,260,000.000	2,125,143.540	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	2,280,000.000	2,347,588.320	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	930,000.000	1,186,896.690	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,100,000.000	2,301,369.000	
イスラエル・シュケル　小計		22,860,000.000 (873,647,478)	21,553,664.260 (823,722,853)	

オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	2,270,000.000	2,147,696.660	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	3,490,000.000	3,201,355.350	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,540,000.000	1,387,466.990	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,470,000.000	1,172,812.960	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,710,000.000	1,398,733.330	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	230,000.000	185,664.960	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	3,520,000.000	2,967,832.830	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,580,000.000	957,322.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,430,000.000	2,877,092.360	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	750,280.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,340,000.000	2,172,861.140	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	1,670,000.000	1,382,463.880	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	160,000.000	142,473.660	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,440,000.000	2,358,504.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	912,322.560	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,060,000.000	1,949,790.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,010,000.000	840,233.270	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	5,000,000.000	4,666,937.450	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	2,810,000.000	2,808,062.500	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,500,000.000	3,443,792.990	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	670,000.000	607,112.040	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	680,000.000	665,020.040	
	AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	780,000.000	802,129.300	
	AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,290,000.000	3,508,667.870	
	AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,490,000.000	1,569,130.170	
オーストラリア・ドル　小計		48,890,000.000 (4,465,123,700)	44,875,758.310 (4,098,503,006)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	25,000,000.000	24,865,815.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	5,300,000.000	5,288,639.230	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	34,600,000.000	34,339,872.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	2,000,000.000	1,993,744.920	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	25,000,000.000	25,011,350.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	4,953,507.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	25,000,000.000	24,775,924.250	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	34,000,000.000	34,055,916.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	22,000,000.000	21,836,494.460	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	31,000,000.000	30,778,533.830	

		CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	10,000,000.000	9,750,678.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	39,000,000.000	38,533,841.190	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	23,500,000.000	23,245,488.420	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	27,310,000.000	27,399,942.750	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	9,400,000.000	9,225,348.280	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,000,000.000	14,833,503.300	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	30,000,000.000	29,897,100.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	10,000,000.000	9,880,441.800	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	6,000,000.000	5,992,080.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32	10,000,000.000	9,946,700.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.85 06/04/27	10,000,000.000	10,076,135.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	5,500,000.000	5,553,689.350	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	12,000,000.000	12,198,501.600	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,500,000.000	9,616,755.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 10/22/25	16,000,000.000	16,240,699.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.25 06/06/26	8,000,000.000	8,200,427.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	17,500,000.000	18,037,152.000	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	28,400,000.000	28,799,599.360	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.39 03/16/50	8,000,000.000	8,126,535.200	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	7,700,000.000	8,041,764.500	
		CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,950,000.000	8,557,028.610	
オフショア・人民元　小計			519,660,000.000 (10,138,982,328)	520,053,209.300 (10,146,654,156)	
カナダ・ドル		CANADA 0.25 03/01/26	2,320,000.000	2,093,438.080	
		CANADA 0.25 04/01/24	600,000.000	572,263.800	
		CANADA 0.5 09/01/25	4,390,000.000	4,039,678.000	
		CANADA 0.5 12/01/30	4,000,000.000	3,274,320.000	
		CANADA 0.75 10/01/24	410,000.000	388,400.380	
		CANADA 1.0 06/01/27	1,910,000.000	1,742,063.250	

	CANADA 1.0 09/01/26	1,860,000.000	1,707,018.720	
	CANADA 1.25 03/01/25	1,400,000.000	1,327,418.400	
	CANADA 1.25 03/01/27	760,000.000	699,792.040	
	CANADA 1.25 06/01/30	3,090,000.000	2,714,614.440	
	CANADA 1.5 04/01/25	2,080,000.000	1,978,483.520	
	CANADA 1.5 05/01/24	1,620,000.000	1,565,410.860	
	CANADA 1.5 06/01/31	4,500,000.000	3,963,978.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	1,040,000.000	999,926.720	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,850,000.000	2,070,898.350	
	CANADA 2.0 06/01/32	3,000,000.000	2,728,203.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	4,260,000.000	3,334,723.740	
	CANADA 2.25 03/01/24	1,550,000.000	1,516,096.850	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,560,000.000	1,510,438.800	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	1,820,123.040	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,300,000.000	1,235,613.600	
	CANADA 2.5 12/01/32	2,200,000.000	2,084,684.800	
	CANADA 2.75 08/01/24	1,260,000.000	1,235,287.620	
	CANADA 2.75 09/01/27	2,160,000.000	2,114,827.920	
	CANADA 2.75 12/01/48	530,000.000	491,517.760	
	CANADA 2.75 12/01/64	580,000.000	528,194.980	
	CANADA 3.0 11/01/24	2,160,000.000	2,124,858.960	
	CANADA 3.5 12/01/45	790,000.000	829,318.300	
	CANADA 4.0 06/01/41	1,110,000.000	1,229,067.480	
	CANADA 5.0 06/01/37	80,000.000	96,384.320	
	CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	883,525.680	
カナダ・ドル　小計		58,000,000.000 (5,718,220,000)	52,900,571.410 (5,215,467,335)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	240,000.000	224,568.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	630,000.000	595,350.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	400,000.000	362,105.140	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	460,000.000	403,420.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	400,000.000	353,340.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	290,000.000	286,228.320	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,030,000.000	1,005,692.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	1,220,000.000	1,132,282.000	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	740,000.000	730,010.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	40,000.000	37,320.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	140,000.000	138,768.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	720,000.000	752,400.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	580,000.000	596,950.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	1,070,000.000	1,071,926.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/27	920,000.000	925,265.250	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,199,400.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	130,000.000	144,226.610	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	750,000.000	748,976.250	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	780,000.000	813,930.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	440,000.000	451,748.000	
シンガポール・ドル　小計		12,180,000.000	11,973,906.070	

		(1,211,179,200)	(1,190,685,220)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	2,050,000.000	1,747,810.110	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	10,680,000.000	9,920,001.550	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	8,310,000.000	7,607,714.420	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,900,000.000	4,662,832.690	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,000,000.000	3,055,020.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	7,220,000.000	7,210,553.700	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,890,000.000	5,927,291.250	
スウェーデン・クローナ　小計		41,050,000.000 (522,156,000)	40,131,223.720 (510,469,166)	
デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	4,530,000.000	4,313,919.000	
	DENMARK 0.0 11/15/31	8,860,000.000	7,103,079.720	
	DENMARK 0.25 11/15/52	6,200,000.000	3,518,924.880	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,390,000.000	4,909,256.190	
	DENMARK 0.5 11/15/29	12,800,000.000	11,225,026.550	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,250,000.000	3,175,249.020	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,500,000.000	9,531,606.740	
デンマーク・クローネ　小計		48,530,000.000 (928,378,900)	43,777,062.100 (837,455,198)	
ニュージーランド・ドル	NEW ZEALAND 0.5 05/15/26	650,000.000	571,060.620	
	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	500,000.000	332,908.790	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,000,000.000	831,139.210	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	1,400,000.000	1,343,183.000	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	500,000.000	414,119.790	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	380,000.000	285,131.760	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	1,200,000.000	1,118,872.720	
	NEW ZEALAND 4.25 05/15/34	800,000.000	797,520.000	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	1,000,000.000	1,006,496.400	
ニュージーランド・ドル　小計		7,430,000.000 (626,869,100)	6,700,432.290 (565,315,472)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	4,140,000.000	3,564,643.500	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,305,365.610	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,720,000.000	4,507,996.480	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,840,000.000	4,611,382.600	
	NORWAY 1.75 03/13/25	6,240,000.000	6,061,536.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,870,000.000	2,650,717.650	
	NORWAY 2.0 04/26/28	6,860,000.000	6,532,092.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	2,560,000.000	2,358,466.560	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,980,000.000	2,970,807.170	
ノルウェー・クローネ　小計		38,940,000.000 (517,123,200)	36,563,007.570 (485,556,741)	

ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	892,265.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	1,700,000.000	1,516,315.000	
	POLAND 07/25/24	220,000.000	201,138.610	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,940,000.000	3,526,023.800	
	POLAND 1.75 04/25/32	5,000,000.000	3,514,500.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	7,510,000.000	7,047,181.230	
	POLAND 2.5 07/25/26	8,400,000.000	7,470,825.600	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,090,000.000	2,681,502.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	4,210,000.000	3,622,662.900	
	POLAND 2.75 10/25/29	1,160,000.000	960,219.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	6,540,000.000	6,135,056.280	
ポーランド・ズロチ　小計		43,870,000.000 (1,329,813,762)	37,567,689.420 (1,138,774,342)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,780,000.000	1,607,823.950	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,830,000.000	1,831,675.180	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	200,000.000	197,625.320	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	2,800,000.000	2,718,947.160	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,985,699.100	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,750,000.000	1,624,390.160	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	3,410,000.000	3,333,369.960	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,010,000.000	1,968,821.750	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,000,000.000	1,007,468.000	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	2,410,000.000	2,399,533.170	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,377,207.570	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	3,500,000.000	3,518,130.000	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	2,090,000.000	2,105,671.650	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	870,000.000	877,338.530	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	3,090,000.000	3,120,067.850	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	420,000.000	424,134.690	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,070,000.000	1,915,070.970	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	670,000.000	677,043.570	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	1,000,000.000	1,015,792.300	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	200,000.000	202,753.100	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,030,000.000	1,054,058.940	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,050,000.000	1,083,094.420	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	1,100,000.000	1,133,024.420	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,000,000.000	2,100,709.800	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	3,010,000.000	3,175,672.200	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	780,000.000	807,901.610	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	380,000.000	401,849.500	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,030,000.000	1,106,293.330	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,000,000.000	1,054,261.200	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	580,000.000	622,339.650	
マレーシア・リンギット　小計		46,430,000.000 (1,405,162,163)	46,447,769.050 (1,405,699,927)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	17,797,400.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	14,710,000.000	13,424,125.350	

	MEXICAN BONDS 05/26/33	6,500,000.000	5,976,425.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	10,000,000.000	9,244,711.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	11,000,000.000	12,252,350.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	24,390,000.000	24,536,425.600	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	41,894,000.000	38,230,202.120	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	26,025,000.000	25,001,957.250	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,300,000.000	28,861,507.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,528,000.000	20,349,992.960	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,011,000.000	3,755,338.860	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	28,040,000.000	27,131,106.660	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,346,000.000	17,866,611.380	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	27,501,000.000	27,472,398.960	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	28,443,000.000	27,825,218.040	
メキシコ・ペソ　小計		314,688,000.000 (2,186,672,506)	299,725,770.680 (2,082,704,463)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,460,000.000	1,198,404.500	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,300,000.000	1,034,870.200	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	550,000.000	323,070.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	1,250,000.000	860,000.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	640,000.000	559,699.200	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,010,000.000	1,837,384.530	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	100,000.000	48,539.200	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,770,000.000	1,612,151.400	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	180,000.000	108,472.140	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	2,830,000.000	2,647,748.000	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	610,000.000	285,594.070	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,400,000.000	1,179,199.900	
	AUSTRIA 07/15/24	490,000.000	471,005.150	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	200,000.000	192,882.200	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,110,000.000	842,698.680	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	80,000.000	51,264.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	2,160,000.000	2,120,509.970	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	570,000.000	458,712.200	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,660,000.000	1,567,596.100	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	820,000.000	840,759.940	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	160,000.000	192,465.280	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	1,858,230.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	440,000.000	470,892.620	

		BELGIUM 0.0 10/22/27	1,380,000.000	1,219,508.760	
		BELGIUM 0.0 10/22/31	1,290,000.000	1,012,249.220	
		BELGIUM 0.1 06/22/30	1,700,000.000	1,406,920.000	
		BELGIUM 0.4 06/22/40	100,000.000	62,920.500	
		BELGIUM 0.5 10/22/24	2,620,000.000	2,522,342.120	
		BELGIUM 0.65 06/22/71	2,090,000.000	961,924.590	
		BELGIUM 0.8 06/22/25	2,290,000.000	2,192,365.850	
		BELGIUM 0.8 06/22/27	1,030,000.000	951,318.300	
		BELGIUM 0.9 06/22/29	3,630,000.000	3,263,953.160	
		BELGIUM 1.0 06/22/26	1,000,000.000	948,779.330	
		BELGIUM 1.0 06/22/31	1,110,000.000	963,696.450	
		BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,058,401.760	
		BELGIUM 1.4 06/22/53	510,000.000	339,263.220	
		BELGIUM 1.45 06/22/37	280,000.000	225,605.240	
		BELGIUM 1.6 06/22/47	1,330,000.000	982,534.520	
		BELGIUM 1.7 06/22/50	280,000.000	206,341.800	
		BELGIUM 1.9 06/22/38	80,000.000	67,819.440	
		BELGIUM 2.15 06/22/66	190,000.000	155,496.000	
		BELGIUM 2.25 06/22/57	1,090,000.000	911,802.440	
		BELGIUM 2.6 06/22/24	60,000.000	59,873.640	
		BELGIUM 3.0 06/22/34	1,540,000.000	1,535,769.620	
		BELGIUM 3.75 06/22/45	900,000.000	984,163.500	
		BELGIUM 4.0 03/28/32	1,250,000.000	1,362,510.000	
		BELGIUM 4.25 03/28/41	1,750,000.000	1,997,781.970	
		BELGIUM 4.5 03/28/26	1,920,000.000	2,030,780.160	
		BELGIUM 5.0 03/28/35	2,630,000.000	3,139,526.720	
		BELGIUM 5.5 03/28/28	1,500,000.000	1,708,753.500	
		BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,100,000.000	2,870,786.000	
		BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,670,000.000	1,578,849.730	
		BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,710,000.000	1,564,376.400	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,550,000.000	1,450,288.500	
		BUNDESOBL 0.0 10/10/25	2,740,000.000	2,572,777.800	
		BUNDESOBL 04/05/24	2,280,000.000	2,207,724.000	
		BUNDESOBL 1.3 10/15/27	2,900,000.000	2,765,701.000	
		BUNDESOBL 10/18/24	3,120,000.000	2,982,512.520	
		BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,450,000.000	1,406,398.500	
		BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	3,970,000.000	3,826,841.800	
		BUNDESSCHAT 2.2 12/12/24	2,500,000.000	2,479,925.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	3,690,000.000	3,149,230.500	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,100,000.000	1,753,332.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,650,000.000	2,159,779.150	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	2,670,000.000	1,989,310.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,010,000.000	1,461,832.800	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	4,200,000.000	3,547,656.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	692,580.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,320,000.000	1,915,044.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,000,000.000	826,250.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,500,000.000	1,383,515.000	
		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	570,000.000	315,215.700	

		DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	2,360,000.000	1,253,490.400	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,060,000.000	949,092.200	
		DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	3,000,000.000	2,632,059.000	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,440,000.000	6,842,270.400	
		DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	3,540,000.000	3,139,172.880	
		DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,640,000.000	3,254,851.600	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,300,000.000	1,246,492.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,490,000.000	3,292,815.000	
		DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	1,060,000.000	969,465.400	
		DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,476,225.600	
		DEUTSCHLAND 08/15/26	2,180,000.000	2,004,810.840	
		DEUTSCHLAND 08/15/29	3,930,000.000	3,391,527.120	
		DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,000,000.000	819,320.000	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,020,000.000	1,970,911.980	
		DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,220,000.000	2,137,615.800	
		DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	5,160,000.000	4,197,154.320	
		DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,270,000.000	1,251,796.940	
		DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,950,000.000	1,850,140.500	
		DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,980,000.000	1,962,706.680	
		DEUTSCHLAND 2.1 11/15/29	3,500,000.000	3,454,920.000	
		DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,930,000.000	3,023,789.300	
		DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,400,000.000	2,504,594.400	
		DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,520,000.000	1,727,981.600	
		DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	4,140,000.000	4,929,634.620	
		DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,220,000.000	1,526,744.600	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,390,000.000	2,964,388.700	
		DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,090,000.000	1,449,950.700	
		DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,640,000.000	2,014,789.200	
		DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	870,000.000	1,002,918.600	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,221,595.000	
		DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	400,000.000	501,008.000	
		DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	1,967,410.300	
		FINLAND 0.0 09/15/24	1,330,000.000	1,273,479.250	
		FINLAND 0.0 09/15/26	1,140,000.000	1,033,752.000	
		FINLAND 0.0 09/15/30	880,000.000	709,303.460	
		FINLAND 0.125 04/15/52	560,000.000	276,371.200	
		FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	142,922.160	

		FINLAND 0.25 09/15/40	100,000.000	62,925.500	
		FINLAND 0.5 04/15/26	900,000.000	843,327.000	
		FINLAND 0.5 04/15/43	500,000.000	317,390.000	
		FINLAND 0.5 09/15/27	860,000.000	776,575.700	
		FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	79,610.760	
		FINLAND 0.5 09/15/29	560,000.000	483,995.480	
		FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	831,644.660	
		FINLAND 1.125 04/15/34	570,000.000	472,312.830	
		FINLAND 1.375 04/15/27	400,000.000	378,707.600	
		FINLAND 1.375 04/15/47	450,000.000	342,191.250	
		FINLAND 2.0 04/15/24	100,000.000	99,081.700	
		FINLAND 2.625 07/04/42	870,000.000	832,107.150	
		FINLAND 2.75 07/04/28	200,000.000	200,730.200	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/24	2,000,000.000	1,940,510.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,500,000.000	1,415,652.000	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,550,000.000	2,350,123.350	
		FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,500,000.000	4,047,912.000	
		FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,820,000.000	2,962,028.000	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,760,000.000	2,312,695.080	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,680,000.000	3,808,373.400	
		FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,070,000.000	2,423,685.180	
		FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,590,000.000	3,281,893.340	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/25	6,180,000.000	5,873,360.070	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,220,000.000	3,001,329.800	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/29	10,600,000.000	9,309,435.050	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/40	3,480,000.000	2,277,273.720	
		FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,210,000.000	507,800.700	
		FRANCE OAT 0.5 06/25/44	650,000.000	394,196.400	
		FRANCE OAT 0.75 02/25/28	3,490,000.000	3,179,390.000	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/28	11,190,000.000	10,152,396.060	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,770,000.000	1,568,548.510	
		FRANCE OAT 0.75 05/25/53	3,490,000.000	1,928,511.180	
		FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,800,000.000	4,319,040.000	
		FRANCE OAT 03/25/24	2,000,000.000	1,936,290.000	
		FRANCE OAT 03/25/25	3,920,000.000	3,694,227.600	
		FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,000,000.000	2,803,224.000	
		FRANCE OAT 1.0 11/25/25	5,380,000.000	5,140,375.810	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,010,000.000	3,362,136.380	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,960,000.000	3,189,384.000	
		FRANCE OAT 1.25 05/25/38	100,000.000	77,570.000	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,410,000.000	4,042,558.800	
		FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,220,000.000	2,308,527.480	
		FRANCE OAT 1.75 05/25/66	1,010,000.000	736,879.250	
		FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,690,000.000	2,249,647.000	
		FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,490,000.000	3,427,316.110	
		FRANCE OAT 2.0 05/25/48	3,220,000.000	2,620,832.340	
		FRANCE OAT 2.0 11/25/32	1,900,000.000	1,771,548.600	
		FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,880,000.000	1,867,994.320	
		FRANCE OAT 2.5 05/25/30	4,920,000.000	4,886,455.440	

		FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,590,000.000	4,623,782.400	
		FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,960,000.000	3,042,862.240	
		FRANCE OAT 3.5 04/25/26	5,430,000.000	5,577,424.500	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,640,000.000	1,943,400.000	
		FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	1,949,208.000	
		FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,900,000.000	2,111,190.700	
		FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,780,000.000	4,499,058.060	
		FRANCE OAT 4.75 04/25/35	2,410,000.000	2,836,208.500	
		FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,690,000.000	3,138,761.940	
		FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,690,000.000	7,124,801.780	
		FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,000,000.000	4,354,270.400	
		IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	735,213.970	
		IRISH 0.2 05/15/27	670,000.000	605,589.760	
		IRISH 0.2 10/18/30	1,160,000.000	961,299.910	
		IRISH 0.4 05/15/35	100,000.000	73,700.800	
		IRISH 0.55 04/22/41	1,330,000.000	863,627.520	
		IRISH 0.9 05/15/28	60,000.000	54,998.040	
		IRISH 1.0 05/15/26	2,420,000.000	2,305,988.960	
		IRISH 1.1 05/15/29	420,000.000	383,066.880	
		IRISH 1.3 05/15/33	1,180,000.000	1,018,705.800	
		IRISH 1.35 03/18/31	820,000.000	745,150.400	
		IRISH 1.5 05/15/50	620,000.000	451,330.860	
		IRISH 1.7 05/15/37	80,000.000	67,891.610	
		IRISH 2.0 02/18/45	860,000.000	712,421.420	
		IRISH 2.4 05/15/30	910,000.000	895,197.940	
		IRISH 5.4 03/13/25	1,460,000.000	1,544,404.060	
		ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,794,130.000	
		ITALY BTPS 0.0 01/30/24	2,300,000.000	2,228,217.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,920,000.000	1,725,120.000	
		ITALY BTPS 0.0 04/15/24	2,730,000.000	2,629,590.600	
		ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,000,000.000	1,776,800.000	
		ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,000,000.000	953,050.000	
		ITALY BTPS 0.0 12/15/24	2,000,000.000	1,887,420.000	
		ITALY BTPS 0.25 03/15/28	2,610,000.000	2,197,098.000	
		ITALY BTPS 0.35 02/01/25	2,810,000.000	2,658,004.290	
		ITALY BTPS 0.45 02/15/29	3,000,000.000	2,459,100.000	
		ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,600,000.000	1,469,756.800	
		ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,500,000.000	1,265,550.000	
		ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,000,000.000	1,513,706.000	
		ITALY BTPS 0.85 01/15/27	30,000.000	27,184.500	
		ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.000	1,574,228.000	
		ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,440,000.000	2,249,072.000	
		ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,650,000.000	1,254,330.000	
		ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,750,000.000	1,410,850.000	
		ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,000,000.000	1,782,000.000	
		ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,350,000.000	1,041,330.600	
		ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,000,000.000	908,550.000	
		ITALY BTPS 1.2 08/15/25	2,070,000.000	1,965,258.000	
		ITALY BTPS 1.25 12/01/26	110,000.000	101,602.490	

		ITALY BTPS 1.35 04/01/30	2,800,000.000	2,359,562.960	
		ITALY BTPS 1.45 03/01/36	510,000.000	366,231.000	
		ITALY BTPS 1.45 05/15/25	330,000.000	318,105.480	
		ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,000,000.000	1,943,988.000	
		ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,630,000.000	971,317.000	
		ITALY BTPS 1.5 06/01/25	3,190,000.000	3,072,225.200	
		ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,140,000.000	1,077,756.000	
		ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,640,000.000	1,344,124.320	
		ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,660,000.000	2,248,138.900	
		ITALY BTPS 1.7 09/01/51	300,000.000	176,776.200	
		ITALY BTPS 1.75 05/30/24	2,000,000.000	1,978,000.000	
		ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,000,000.000	980,799.000	
		ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,570,000.000	1,073,723.000	
		ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,400,000.000	1,377,586.000	
		ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,260,000.000	1,220,310.000	
		ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,700,000.000	1,578,195.000	
		ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,680,000.000	1,622,984.160	
		ITALY BTPS 2.05 08/01/27	6,440,000.000	6,061,559.840	
		ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.000	958,656.000	
		ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	824,826.000	
		ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,180,000.000	758,622.000	
		ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,060,000.000	1,961,120.000	
		ITALY BTPS 2.25 09/01/36	340,000.000	269,450.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,250,000.000	1,903,275.000	
		ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,770,000.000	1,250,682.000	
		ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,500,000.000	1,473,846.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,000,000.000	1,980,850.000	
		ITALY BTPS 2.5 12/01/32	2,680,000.000	2,318,682.400	
		ITALY BTPS 2.65 12/01/27	1,500,000.000	1,437,900.000	
		ITALY BTPS 2.7 03/01/47	2,250,000.000	1,721,250.000	
		ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,230,000.000	878,220.000	
		ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,660,000.000	3,495,977.100	
		ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,850,000.000	2,378,040.000	
		ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,890,000.000	2,762,108.830	
		ITALY BTPS 3.1 03/01/40	2,640,000.000	2,227,940.880	
		ITALY BTPS 3.25 03/01/38	1,750,000.000	1,525,300.000	
		ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,940,000.000	1,637,061.240	
		ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,080,000.000	975,713.040	
		ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,270,000.000	1,103,052.150	
		ITALY BTPS 3.5 01/15/26	3,630,000.000	3,645,609.000	
		ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,360,000.000	2,317,855.120	
		ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,200,000.000	1,212,418.800	
		ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,800,000.000	1,658,269.800	
		ITALY BTPS 3.85 12/15/29	1,000,000.000	995,300.000	
		ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,280,000.000	1,239,936.000	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,070,000.000	3,118,911.240	
		ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,720,000.000	1,781,920.000	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/28	3,970,000.000	4,190,009.460	
		ITALY BTPS 4.75 09/01/44	790,000.000	826,941.980	

		ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,620,000.000	1,683,374.400	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,470,000.000	3,672,301.000	
		ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,360,000.000	1,455,064.000	
		ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,450,000.000	1,551,790.000	
		ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,940,000.000	2,121,002.000	
		ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,390,000.000	1,560,136.000	
		ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,300,000.000	2,641,550.000	
		ITALY BTPS 6.5 11/01/27	770,000.000	872,795.000	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/26	500,000.000	462,787.150	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,900,000.000	1,718,658.300	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/29	2,040,000.000	1,755,299.640	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,260,000.000	849,028.320	
		NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,860,000.000	953,493.660	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,140,000.000	945,700.680	
		NETHERLANDS 0.0 07/15/31	980,000.000	791,275.520	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/25	6,200,000.000	5,854,269.520	
		NETHERLANDS 0.25 07/15/29	1,720,000.000	1,491,609.800	
		NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,670,000.000	1,184,681.300	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/26	510,000.000	475,320.000	
		NETHERLANDS 0.5 07/15/32	500,000.000	412,662.000	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,130,000.000	1,971,996.600	
		NETHERLANDS 0.75 07/15/28	200,000.000	182,477.800	
		NETHERLANDS 2.0 01/15/54	210,000.000	190,001.070	
		NETHERLANDS 2.0 07/15/24	70,000.000	69,345.150	
		NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,620,000.000	1,601,417.150	
		NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,470,000.000	1,535,312.100	
		NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,850,000.000	2,149,835.050	
		NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,570,000.000	1,801,575.000	
		NETHERLANDS 5.5 01/15/28	1,800,000.000	2,057,220.000	
		SPAIN 0.0 01/31/25	1,750,000.000	1,653,137.500	
		SPAIN 0.0 01/31/26	3,380,000.000	3,101,139.860	
		SPAIN 0.0 01/31/27	2,000,000.000	1,780,300.000	
		SPAIN 0.0 05/31/24	2,740,000.000	2,635,756.700	
		SPAIN 0.0 05/31/25	2,000,000.000	1,870,437.860	
		SPAIN 0.1 04/30/31	1,490,000.000	1,161,455.000	
		SPAIN 0.25 07/30/24	1,230,000.000	1,182,983.250	
		SPAIN 0.5 04/30/30	2,840,000.000	2,372,942.120	
		SPAIN 0.5 10/31/31	390,000.000	310,393.980	
		SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,307,008.620	
		SPAIN 0.7 04/30/32	3,810,000.000	3,036,189.000	
		SPAIN 0.8 07/30/27	1,500,000.000	1,366,875.000	
		SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	869,750.000	
		SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,246,203.100	

		SPAIN 1.0 07/30/42	1,180,000.000	748,592.000	
		SPAIN 1.0 10/31/50	1,400,000.000	764,260.000	
		SPAIN 1.2 10/31/40	2,780,000.000	1,887,925.800	
		SPAIN 1.25 10/31/30	2,970,000.000	2,605,284.000	
		SPAIN 1.3 10/31/26	1,540,000.000	1,457,779.400	
		SPAIN 1.4 04/30/28	3,000,000.000	2,774,127.000	
		SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,395,164.500	
		SPAIN 1.45 04/30/29	2,930,000.000	2,676,607.740	
		SPAIN 1.45 10/31/27	3,000,000.000	2,806,686.000	
		SPAIN 1.45 10/31/71	550,000.000	271,003.700	
		SPAIN 1.5 04/30/27	1,840,000.000	1,739,904.000	
		SPAIN 1.6 04/30/25	2,520,000.000	2,455,929.000	
		SPAIN 1.85 07/30/35	2,230,000.000	1,867,201.610	
		SPAIN 1.9 10/31/52	580,000.000	389,866.720	
		SPAIN 1.95 04/30/26	1,770,000.000	1,722,420.630	
		SPAIN 1.95 07/30/30	1,660,000.000	1,535,773.900	
		SPAIN 2.35 07/30/33	1,260,000.000	1,148,490.000	
		SPAIN 2.55 10/31/32	1,910,000.000	1,787,706.520	
		SPAIN 2.7 10/31/48	1,530,000.000	1,291,835.610	
		SPAIN 2.75 10/31/24	3,100,000.000	3,098,636.000	
		SPAIN 2.9 10/31/46	2,070,000.000	1,837,683.900	
		SPAIN 3.45 07/30/66	1,330,000.000	1,242,161.480	
		SPAIN 3.8 04/30/24	410,000.000	414,940.500	
		SPAIN 4.2 01/31/37	2,330,000.000	2,505,099.500	
		SPAIN 4.65 07/30/25	6,570,000.000	6,872,528.790	
		SPAIN 4.7 07/30/41	1,940,000.000	2,226,516.660	
		SPAIN 4.9 07/30/40	2,120,000.000	2,479,340.000	
		SPAIN 5.15 10/31/28	5,360,000.000	5,978,008.000	
		SPAIN 5.15 10/31/44	1,500,000.000	1,843,297.500	
		SPAIN 5.75 07/30/32	2,010,000.000	2,435,885.830	
		SPAIN 5.9 07/30/26	1,900,000.000	2,097,945.800	
		SPAIN 6.0 01/31/29	1,140,000.000	1,331,705.820	
	ユーロ　小計		652,020,000.000 (92,749,845,000)	599,881,159.380 (85,333,094,922)	
国債証券　合計			276,461,892,636.600 (276,461,892,637)	251,751,200,775 (251,751,200,775)	
合計				251,751,200,775 (251,751,200,775)	

（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	226銘柄	49.71	49.99
イギリス・ポンド	国債証券	53銘柄	4.76	4.79
イスラエル・シュケル	国債証券	12銘柄	0.33	0.33

オーストラリア・ドル	国債証券	25銘柄	1.62	1.63
オフショア・人民元	国債証券	31銘柄	4.01	4.03
カナダ・ドル	国債証券	31銘柄	2.06	2.07
シンガポール・ドル	国債証券	20銘柄	0.47	0.47
スウェーデン・クローナ	国債証券	7銘柄	0.20	0.20
デンマーク・クローネ	国債証券	7銘柄	0.33	0.33
ニュージーランド・ドル	国債証券	9銘柄	0.22	0.22
ノルウェー・クローネ	国債証券	9銘柄	0.19	0.19
ポーランド・ズロチ	国債証券	11銘柄	0.45	0.45
マレーシア・リンギット	国債証券	30銘柄	0.56	0.56
メキシコ・ペソ	国債証券	15銘柄	0.82	0.83
ユーロ	国債証券	331銘柄	33.70	33.90

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	20,045,538,691
コール・ローン	701,245,493
株式	758,902,393,554
投資信託受益証券	1,387,813,868
投資証券	16,438,191,165
派生商品評価勘定	453,572,789
未収配当金	727,005,199
差入委託証拠金	5,000,860,885
流動資産合計	803,656,621,644
資産合計	803,656,621,644
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,739,693
未払解約金	132,471,000
流動負債合計	290,210,693
負債合計	290,210,693
純資産の部	
元本等	
元本	136,103,425,952
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	667,262,984,999
元本等合計	803,366,410,951
純資産合計	803,366,410,951
負債純資産合計	803,656,621,644

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	110,505,806,204円
同期中追加設定元本額	67,449,577,662円
同期中一部解約元本額	41,851,957,914円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ外国株式パッシブ・ファンド	2,885,896,332円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	1,570,182円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	9,868,791円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	31,635,755円

グローバル８資産ラップファンド（安定型）	19,806,701円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	13,703,681円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	20,015,732円
たわらノーロード　先進国株式	41,780,071,157円
たわらノーロード　先進国株式＜ラップ向け＞	389,136,980円
たわらノーロード　先進国株式＜為替ヘッジあり＞	3,122,498,117円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	803,536,592円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	84,703,395円
たわらノーロード　バランス（標準型）	729,563,804円
たわらノーロード　バランス（積極型）	919,101,327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）	154,199,702円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	458,086,442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）	374,127,446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）	547,399,793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）	650,130円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	20,500,198円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	3,440,777円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,584,238円
たわらノーロード　全世界株式	569,971,854円
ＤＩＡＭ外国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	55,261,932,028円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国株式インデックスファンド	2,740,957,547円
Ｏｎｅグローバルバランス	3,936,160円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞１安定型	157,051,956円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞２安定・成長型	801,207,495円
ＤＩＡＭバランス・ファンド＜ＤＣ年金＞３成長型	1,049,854,726円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス３０インデックスファンド	95,890,173円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス５０インデックスファンド	254,881,313円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　バランス７０インデックスファンド	249,599,739円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	17,255,462円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	625,170,428円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	123,209,099円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	170,887,344円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	197,773,572円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	320,757,125円
投資のソムリエ	5,525,197,498円
クルーズコントロール	19,684,327円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	399,404,474円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	208,870,039円
４資産分散投資・ハイクラス＜ＤＣ年金＞	236,034,860円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	399,920,075円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	1,735,334,229円
ワールドアセットバランス（基本コース）	144,201,865円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	95,332,662円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	24,827,000円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	12,452,181円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	2,750,822円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	57,205,642円
４資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	140,719,146円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	119,987,740円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	156,421,181円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	29,873,525円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	13,325,336円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,232,922円
４資産分散投資・ミドルクラス＜ＤＣ年金＞	103,406,568円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,745,486円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	1,221,926円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	1,199,488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）	758,879円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	1,198,559円
インカム重視マルチアセット運用ファンドII　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	852,212円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	1,104,248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）	449,088,232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）	40,493,896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）	1,109,106,982円
ＤＩＡＭ先進国株式パッシブファンド（適格機関投資家限定）	201,377,880円
外国株式パッシブ・ファンド２（適格機関投資家限定）	1,060,843,381円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	144,027,954円
ＡＭＯｎｅマルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）（適格機関投資家限定）	1,328,457円
ＤＩＡＭワールドバランス２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	7,216,287円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	2,045,203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）	2,912,731円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	4,654,846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）	25,783,979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）	50,456,413円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,920,456円
ＤＩＡＭ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	17,480,514円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家限定）	1,277,021円
ＤＩＡＭ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	34,214円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,340,512円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	22,406,686円
ＤＩＡＭバランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家限定）	163,013,861円
ＤＩＡＭバランスファンド３７．５ＶＡ（適格機関投資家限定）	260,240,407円
ＤＩＡＭバランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	873,451,334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）	45,680,614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）	38,311,434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）	257,785,829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）	10,455,792円
ＤＩＡＭ世界バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	172,664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）	105,292,969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）	9,122,401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）	30,924,908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）	47,291,972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）	99,789,660円
動的パッケージファンド＜ＤＣ年金＞	9,895,958円
コア資産形成ファンド	6,569,591円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,727,423,300円
ＭＨＡＭ外国株式インデックスファンド	140,470,398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）	6,736,066円
ＭＨＡＭ動的パッケージファンド［適格機関投資家限定］	1,261,770,351円
ＭＨＡＭ外国株式パッシブファンド［適格機関投資家限定］	1,400,076,236円
計	136,103,425,952円
２．　受益権の総数	136,103,425,952口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△60,154,235,810
投資信託受益証券	△132,076,139
投資証券	△2,537,503,657
合計	△62,823,815,606

（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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	2,311,216,779	－	2,313,345,425	2,128,646
アメリカ・ドル	1,700,614,930	－	1,701,987,236	1,372,306
イギリス・ポンド	113,533,458	－	113,637,115	103,657
オーストラリア・ドル	59,403,762	－	59,445,638	41,876
カナダ・ドル	76,288,536	－	76,289,464	928
ユーロ	361,376,093	－	361,985,972	609,879
合計	2,311,216,779	－	2,313,345,425	2,128,646

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	28,175,361,223	－	28,469,065,673	293,704,450
合計	28,175,361,223	－	28,469,065,673	293,704,450

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２． 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３． 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額	5.9026円
（1万口当たり純資産額）	(59,026円)

附属明細表

第１ 有価証券明細表

（１）株式

2023年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,118,663	89.870	100,534,243.810	
	ABBOTT LABORATORIES	213,851	113.850	24,346,936.350	
	AES CORP	79,505	27.230	2,164,921.150	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	108,940	144.800	15,774,512.000	
	ADVANCED MICRO DEVICES	195,897	68.050	13,330,790.850	
	ADOBE INC	57,266	338.700	19,395,994.200	
	CHUBB LTD	50,533	224.770	11,358,302.410	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,919	312.670	8,416,763.730	
	ALLSTATE CORP	32,939	141.260	4,652,963.140	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	82,340	211.340	17,401,735.600	

AMGEN INC	65,395	273.880	17,910,382.600	
HESS CORP	33,470	143.620	4,806,961.400	
AMERICAN EXPRESS CO	77,915	152.000	11,843,080.000	
AMERICAN ELECTRIC POWER	62,653	97.280	6,094,883.840	
AFLAC INC	72,673	72.000	5,232,456.000	
AMERICAN INTL GROUP	93,843	63.450	5,954,338.350	
ANALOG DEVICES	63,336	169.220	10,717,717.920	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	82,900	67.310	5,579,999.000	
VALERO ENERGY CORP	48,490	132.010	6,401,164.900	
ANSYS INC	10,831	248.400	2,690,420.400	
APPLE INC	1,959,610	130.730	256,179,815.300	
APPLIED MATERIALS INC	106,803	108.040	11,538,996.120	
ALBEMARLE CORP	13,961	223.900	3,125,867.900	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	69,412	86.230	5,985,396.760	
AMEREN CORP	31,621	89.120	2,818,063.520	
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	111.210	1,104,982.560	
AUTODESK INC	26,907	193.430	5,204,621.010	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50,947	240.780	12,267,018.660	
AUTOZONE INC	2,313	2,435.520	5,633,357.760	
AVERY DENNISON CORP	9,514	189.730	1,805,091.220	
BALL CORP	36,411	56.090	2,042,292.990	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	158,774	316.350	50,228,154.900	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,954	48.010	4,366,701.540	
BAXTER INTERNATIONAL INC	63,174	45.740	2,889,578.760	
BECTON DICKINSON & CO	35,061	255.370	8,953,527.570	
AMETEK INC	27,428	142.810	3,916,992.680	
VERIZON COMM INC	514,992	41.950	21,603,914.400	
WR BERKLEY CORP	29,191	73.350	2,141,159.850	
BEST BUY CO INC	25,405	84.270	2,140,879.350	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	3,021	432.920	1,307,851.320	
YUM! BRANDS INC	33,465	129.400	4,330,371.000	
FIRSTENERGY CORP	67,213	42.590	2,862,601.670	
BOEING CO	68,391	206.690	14,135,735.790	
ROBERT HALF INTL INC	14,456	75.050	1,084,922.800	
BORGWARNER INC	27,800	43.070	1,197,346.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	175,352	46.060	8,076,713.120	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	92.800	1,345,043.200	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	19,529	105.530	2,060,895.370	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,731	1,520.860	4,153,468.660	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	257,999	71.650	18,485,628.350	

ONEOK INC	52,652	69.310	3,649,310.120	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	140.980	1,112,473.180	
UNITED RENTALS INC	8,287	381.470	3,161,241.890	
SEMPRA ENERGY	38,567	157.510	6,074,688.170	
FEDEX CORP	29,483	188.740	5,564,621.420	
VERISIGN INC	11,850	208.000	2,464,800.000	
AMPHENOL CORP	71,112	79.300	5,639,181.600	
BROWN-FORMAN CORP	38,405	65.260	2,506,310.300	
QUANTA SERVICES INC	17,560	139.510	2,449,795.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	5.910	601,431.150	
CSX CORP	263,536	32.400	8,538,566.400	
COTERRA ENERGY INC	99,916	25.080	2,505,893.280	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	56.000	1,510,768.000	
CONSTELLATION BRANDS INC	19,343	220.000	4,255,460.000	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	78.130	2,488,987.410	
CARLISLE COS INC	6,119	238.850	1,461,523.150	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	9.680	1,280,576.880	
CATERPILLAR INC	64,631	250.510	16,190,711.810	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	12,631	124.640	1,574,327.840	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	5.600	543,608.800	
JPMORGAN CHASE & CO	357,732	138.600	49,581,655.200	
CHURCH & DWIGHT CO INC	30,236	81.290	2,457,884.440	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19,878	110.510	2,196,717.780	
CINTAS CORP	11,173	444.970	4,971,649.810	
CISCO SYSTEMS INC	505,907	48.810	24,693,320.670	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	18.810	1,060,206.840	
CLOROX COMPANY	14,322	140.980	2,019,115.560	
COCA-COLA CO/THE	502,166	62.130	31,199,573.580	
COPART INC	54,011	61.620	3,328,157.820	
COGNEX CORP	20,432	51.720	1,056,743.040	
COLGATE-PALMOLIVE CO	96,159	78.310	7,530,211.290	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	32,963	153.160	5,048,613.080	
MOLINA HEALTHCARE INC	7,434	292.000	2,170,728.000	
NRG ENERGY, INC.	28,364	32.860	932,041.040	
COMCAST CORP-CL A	541,547	37.880	20,513,800.360	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	40.440	2,258,290.920	
CONSOLIDATED EDISON INC	43,855	98.090	4,301,736.950	
CMS ENERGY CORP	36,603	64.890	2,375,168.670	
COOPER COS INC	6,342	343.850	2,180,696.700	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	50.860	1,082,351.660	
CORNING INC	95,758	35.840	3,431,966.720	
WOLFSPEED INC	15,684	74.230	1,164,223.320	
SEALED AIR CORP	17,610	53.940	949,883.400	
HEICO CORP-CL A	9,463	122.730	1,161,393.990	

CUMMINS INC	16,869	247.720	4,178,788.680	
DARLING INTERNATIONAL INC	20,032	65.480	1,311,695.360	
DR HORTON INC	40,602	93.580	3,799,535.160	
DANAHER CORP	84,457	266.890	22,540,728.730	
MOODY'S CORP	20,682	297.250	6,147,724.500	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	62,906	61.210	3,850,476.260	
TARGET CORP	55,931	155.970	8,723,558.070	
DEERE & CO	35,044	437.430	15,329,296.920	
MORGAN STANLEY	157,543	88.920	14,008,723.560	
REPUBLIC SERVICES INC	27,024	125.170	3,382,594.080	
COSTAR GROUP INC	47,398	77.830	3,688,986.340	
THE WALT DISNEY CO	223,809	95.560	21,387,188.040	
DOLLAR TREE INC	26,771	145.880	3,905,353.480	
DOVER CORP	17,842	139.300	2,485,390.600	
OMNICOM GROUP	26,570	85.800	2,279,706.000	
DTE ENERGY CO	23,792	120.020	2,855,515.840	
DUKE ENERGY CORP	94,043	105.430	9,914,953.490	
DARDEN RESTAURANTS INC	15,676	150.310	2,356,259.560	
EBAY INC	67,667	45.090	3,051,105.030	
BANK OF AMERICA CORP	883,002	34.120	30,128,028.240	
CITIGROUP INC	233,298	48.190	11,242,630.620	
EASTMAN CHEMICAL CO	16,790	89.630	1,504,887.700	
EATON CORP PLC	47,526	160.410	7,623,645.660	
CADENCE DESIGN SYS INC	32,734	164.320	5,378,850.880	
DISH NETWORK CORP	24,416	14.830	362,089.280	
ECOLAB INC	30,824	152.200	4,691,412.800	
PERKINELMER INC	15,649	133.400	2,087,576.600	
ELECTRONIC ARTS INC	33,011	124.020	4,094,024.220	
SALESFORCE INC	122,661	147.440	18,085,137.840	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	253.060	853,318.320	
EMERSON ELECTRIC CO	71,700	97.820	7,013,694.000	
ATMOS ENERGY CORP	17,567	114.300	2,007,908.100	
ENTERGY CORP	23,769	107.730	2,560,634.370	
EOG RESOURCES INC	71,192	127.610	9,084,811.120	
EQUIFAX INC	15,156	205.000	3,106,980.000	
EQT CORP	40,996	34.040	1,395,503.840	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	28,280	262.450	7,422,086.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	108.540	2,167,977.960	
EXXON MOBIL CORP	509,183	110.090	56,055,956.470	
FMC CORP	15,534	128.700	1,999,225.800	
NEXTERA ENERGY INC	239,711	84.540	20,265,167.940	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	409.280	1,930,164.480	
FAIR ISAAC CORP	2,962	585.860	1,735,317.320	
ASSURANT INC	5,823	126.520	736,725.960	
FASTENAL CO	68,855	48.500	3,339,467.500	
FIFTH THIRD BANCORP	84,362	34.460	2,907,114.520	

M&T BANK CORP	20,766	148.000	3,073,368.000	
FIRST HORIZON CORP	69,634	24.550	1,709,514.700	
FISERV INC	73,824	101.040	7,459,176.960	
FORD MOTOR CO	479,168	12.840	6,152,517.120	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	29.150	1,105,251.400	
FREEPORT-MCMORAN INC	172,370	44.710	7,706,662.700	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,587	801.980	1,272,742.260	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26,269	192.680	5,061,510.920	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	33.320	852,958.680	
GENERAL DYNAMICS CORP	28,725	247.540	7,110,586.500	
GENERAL MILLS INC	72,417	84.050	6,086,648.850	
GENUINE PARTS CO	17,374	169.750	2,949,236.500	
GILEAD SCIENCES INC	151,364	87.140	13,189,858.960	
GARTNER INC	9,564	331.990	3,175,152.360	
MCKESSON CORP	17,325	382.670	6,629,757.750	
NVIDIA CORP	304,283	159.090	48,408,382.470	
GENERAL ELECTRIC CO	132,408	75.270	9,966,350.160	
WW GRAINGER INC	5,466	563.920	3,082,386.720	
HALLIBURTON CO	111,570	40.940	4,567,675.800	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,224	100.530	4,747,428.720	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41,654	357.360	14,885,473.440	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24,320	201.950	4,911,424.000	
HASBRO INC	15,437	64.480	995,377.760	
HENRY SCHEIN INC	17,431	79.970	1,393,957.070	
HEICO CORP	5,185	157.430	816,274.550	
HERSHEY FOODS CORP	18,695	224.780	4,202,262.100	
HP INC	125,955	29.090	3,664,030.950	
F5 INC	6,924	143.940	996,640.560	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	85.240	1,306,047.280	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	31.830	1,391,448.450	
HOLOGIC INC	30,695	80.570	2,473,096.150	
HOME DEPOT INC	125,091	320.630	40,107,927.330	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	111.400	2,548,832.000	
HORMEL FOODS CORP	34,578	45.910	1,587,475.980	
CENTERPOINT ENERGY INC	78,791	30.560	2,407,852.960	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	248.360	894,592.720	
HUBBELL INC	6,903	234.750	1,620,479.250	
HUMANA INC	15,368	481.590	7,401,075.120	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,348	175.380	1,814,832.240	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	181,491	14.470	2,626,174.770	
BIOGEN INC	17,603	281.460	4,954,540.380	
IDEX CORP	9,065	234.800	2,128,462.000	
ILLINOIS TOOL WORKS	37,531	227.480	8,537,551.880	
INTUIT INC	32,479	388.680	12,623,937.720	

IDEXX LABORATORIES INC	10,162	469.110	4,767,095.820	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	27,989	178.930	5,008,071.770	
INTEL CORP	497,669	29.440	14,651,375.360	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	31,979	115.990	3,709,244.210	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	37.620	1,661,035.860	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	35.690	1,630,283.510	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	178.370	1,454,072.240	
INCYTE CORP	24,449	79.550	1,944,917.950	
JOHNSON & JOHNSON	320,456	175.160	56,131,072.960	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	76.200	3,002,432.400	
KLA CORPORATION	17,734	416.270	7,382,132.180	
DEVON ENERGY CORP	74,759	63.130	4,719,535.670	
KELLOGG CO	29,915	70.750	2,116,486.250	
KEYCORP	106,247	18.210	1,934,757.870	
KIMBERLY-CLARK CORP	42,173	135.860	5,729,623.780	
BLACKROCK INC/NEW YORK	18,251	757.280	13,821,117.280	
KROGER CO	82,775	45.980	3,805,994.500	
LAM RESEARCH CORP	16,432	458.610	7,535,879.520	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,890	409.250	2,410,482.500	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	132.730	1,463,879.170	
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,036	87.390	1,750,946.040	
PLUG POWER INC	56,149	14.950	839,427.550	
LENNAR CORP	29,937	96.570	2,891,016.090	
ELI LILLY & CO	98,682	352.750	34,810,075.500	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	45.800	1,289,544.800	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	31.460	564,298.020	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	89,557	178.770	16,010,104.890	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35,535	155.230	5,516,098.050	
LOCKHEED MARTIN CORP	28,941	462.290	13,379,134.890	
LOEWS CORP	23,530	59.040	1,389,211.200	
LOWE'S COS INC	75,785	201.400	15,263,099.000	
DOMINION ENERGY INC	101,828	61.830	6,296,025.240	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	38.850	1,569,578.850	
MCCORMICK & CO INC	29,367	84.370	2,477,693.790	
MCDONALD'S CORPORATION	89,724	268.910	24,127,680.840	
S&P GLOBAL INC	41,825	354.390	14,822,361.750	
EVEREST RE GROUP LTD	5,353	358.950	1,921,459.350	
MARKEL CORPORATION	1,674	1,371.670	2,296,175.580	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	77,695	77.020	5,984,068.900	
MARSH & MCLENNAN COS	61,050	170.390	10,402,309.500	

MASCO CORP	28,937	50.810	1,470,288.970	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,736	343.960	2,660,874.560	
METLIFE INC	81,792	71.570	5,853,853.440	
MEDTRONIC PLC	161,408	78.890	12,733,477.120	
ACTIVISION BLIZZARD INC	94,367	77.690	7,331,372.230	
CVS HEALTH CORP	158,698	90.650	14,385,973.700	
MERCK & CO.INC.	309,456	110.810	34,290,819.360	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	54,362	64.270	3,493,845.740	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	245.290	2,598,356.970	
MICROSOFT CORP	863,965	228.850	197,718,390.250	
MICRON TECH INC	135,654	57.210	7,760,765.340	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	66,120	75.450	4,988,754.000	
3M CO	67,396	128.130	8,635,449.480	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	115.150	726,711.650	
ENTEGRIS INC	17,709	76.440	1,353,675.960	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	6,445	234.130	1,508,967.850	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20,578	262.350	5,398,638.300	
ILLUMINA INC	18,747	194.450	3,645,354.150	
XCEL ENERGY INC	64,922	72.110	4,681,525.420	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11,716	109.770	1,286,065.320	
NETAPP INC	24,953	64.210	1,602,232.130	
NEWELL BRANDS INC	41,984	14.660	615,485.440	
NEWMONT CORP	99,287	53.150	5,277,104.050	
NVR INC	365	4,828.530	1,762,413.450	
NIKE INC-CL B	155,133	125.840	19,521,936.720	
NORDSON CORP	6,447	241.450	1,556,628.150	
NORFOLK SOUTHERN CORP	28,997	254.650	7,384,086.050	
EVERSOURCE ENERGY	43,042	85.690	3,688,268.980	
NISOURCE INC	53,270	27.560	1,468,121.200	
NORTHERN TRUST CORP	24,836	94.840	2,355,446.240	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,823	495.790	8,836,465.170	
WELLS FARGO & CO	462,740	42.360	19,601,666.400	
NUCOR CORP	31,660	151.160	4,785,725.600	
CHENIERE ENERGY INC	27,166	146.510	3,980,090.660	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	98.500	4,595,419.000	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	114,744	64.150	7,360,827.600	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,630	306.600	3,565,758.000	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	826.880	6,414,108.160	
ORACLE CORP	192,714	86.500	16,669,761.000	
PACCAR INC	43,201	100.490	4,341,268.490	
PTC INC	13,665	127.400	1,740,921.000	

EXELON CORP	121,664	43.690	5,315,500.160	
PARKER HANNIFIN CORP	15,434	310.500	4,792,257.000	
PAYCHEX INC	38,461	117.310	4,511,859.910	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	232.250	1,996,421.000	
PPL CORPORATION	88,737	30.170	2,677,195.290	
PEPSICO INC	168,777	177.850	30,016,989.450	
PENTAIR PLC	19,804	47.980	950,195.920	
PFIZER INC	684,875	47.620	32,613,747.500	
ESSENTIAL UTILITIES INC	32,796	48.800	1,600,444.800	
CONOCOPHILLIPS	155,665	118.080	18,380,923.200	
PG&E CORP	178,257	15.940	2,841,416.580	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	27,268	231.160	6,303,270.880	
ALTRIA GROUP INC	218,091	45.990	10,030,005.090	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	49,864	164.940	8,224,568.160	
BROWN & BROWN INC	30,650	59.870	1,835,015.500	
GARMIN LTD	17,835	98.920	1,764,238.200	
PPG INDUSTRIES INC	28,341	129.780	3,678,094.980	
COSTCO WHOLESALE CORP	54,129	481.400	26,057,700.600	
T ROWE PRICE GROUP INC	27,707	117.200	3,247,260.400	
QUEST DIAGNOSTICS	14,536	152.540	2,217,321.440	
PROCTER & GAMBLE CO	291,314	151.890	44,247,683.460	
PROGRESSIVE CORP	70,907	133.020	9,432,049.140	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	60,100	63.670	3,826,567.000	
PULTE GROUP INC	29,050	48.430	1,406,891.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	33,653	105.310	3,543,997.430	
QUALCOMM INC	137,686	116.910	16,096,870.260	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	110.970	2,600,803.890	
EXACT SCIENCES CORP	23,386	60.090	1,405,264.740	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,959	698.950	9,057,693.050	
REPLIGEN CORP	6,730	168.450	1,133,668.500	
RESMED INC	17,366	212.680	3,693,400.880	
US BANCORP	170,632	46.660	7,961,689.120	
SEAGEN INC	16,860	132.500	2,233,950.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	63.070	2,891,822.570	
ROSS STORES INC	42,360	119.790	5,074,304.400	
ROLLINS INC	25,920	36.500	946,080.000	
ROPER TECHNOLOGIES INC	13,120	443.460	5,818,195.200	
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,905	271.660	3,777,432.300	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	58.930	1,619,219.610	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	86.810	1,429,500.270	
ACCENTURE PLC-CL A	77,236	274.930	21,234,493.480	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	168,645	67.310	11,351,494.950	

WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	253.380	3,352,724.160	
THE TRAVELERS COMPANIES INC	29,595	191.220	5,659,155.900	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	75,043	69.000	5,177,967.000	
BOOKING HOLDINGS INC	4,811	2,220.950	10,684,990.450	
SCHLUMBERGER LTD	171,376	55.960	9,590,200.960	
SCHWAB (CHARLES) CORP	175,962	85.620	15,065,866.440	
POOL CORP	4,660	325.060	1,514,779.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26,144	125.500	3,281,072.000	
BUNGE LTD	18,642	97.510	1,817,781.420	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	60.990	882,952.230	
ELEVANCE HEALTH INC	29,398	470.680	13,837,050.640	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	167.260	3,195,335.040	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	87.620	2,581,986.160	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30,476	234.100	7,134,431.600	
CENTENE CORP	70,080	76.120	5,334,489.600	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	252.680	1,852,144.400	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	59.860	889,280.160	
SNAP-ON INC	6,118	244.420	1,495,361.560	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	44,592	99.350	4,430,215.200	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	151.970	1,088,865.050	
EDISON INTERNATIONAL	45,008	68.200	3,069,545.600	
SOUTHERN CO	131,528	71.110	9,352,956.080	
TRUIST FINANCIAL CORP	160,237	46.000	7,370,902.000	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	36.210	713,337.000	
AT&T INC	860,287	19.470	16,749,787.890	
CHEVRON CORP	227,013	176.040	39,963,368.520	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	84.030	1,619,258.100	
STATE STREET CORP	46,198	81.460	3,763,289.080	
STARBUCKS CORP	138,714	106.000	14,703,684.000	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	106.860	2,451,047.820	
STRYKER CORP	41,473	263.810	10,940,992.130	
NETFLIX INC	53,857	327.540	17,640,321.780	
GEN DIGITAL INC	73,086	21.600	1,578,657.600	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	55.310	925,336.300	
SYNOPSYS INC	18,779	327.630	6,152,563.770	
SYSCO CORP	62,521	79.960	4,999,179.160	
INTUITIVE SURGICAL INC	43,844	271.360	11,897,507.840	
TELEFLEX INC	5,532	259.480	1,435,443.360	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	134,781	10.990	1,481,243.190	
TERADYNE INC	18,512	94.780	1,754,567.360	
TEXAS INSTRUMENTS INC	111,714	178.400	19,929,777.600	

TEXTRON INC	25,824	70.840	1,829,372.160	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47,854	568.030	27,182,507.620	
GLOBE LIFE INC	12,153	121.530	1,476,954.090	
DAVITA INC	6,813	79.780	543,541.140	
TRACTOR SUPPLY CO	13,690	221.740	3,035,620.600	
BIO-TECHNE CORP	20,652	86.540	1,787,224.080	
TRIMBLE INC	28,676	52.500	1,505,490.000	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	313.070	1,659,271.000	
TYSON FOODS INC	35,684	65.580	2,340,156.720	
UGI CORP	24,160	40.450	977,272.000	
MARATHON OIL CORP	84,059	27.010	2,270,433.590	
UNION PACIFIC CORP	76,466	212.280	16,232,202.480	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	179,195	99.920	17,905,164.400	
UNITEDHEALTH GROUP INC	114,300	486.000	55,549,800.000	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	147.500	1,194,160.000	
VF CORP	37,887	29.970	1,135,473.390	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	19.890	1,341,918.630	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	31,026	288.750	8,958,757.500	
VULCAN MATERIALS CO	16,452	176.750	2,907,891.000	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	91,706	36.700	3,365,610.200	
WALMART INC	184,019	144.860	26,656,992.340	
WASTE MANAGEMENT INC	50,578	154.910	7,835,037.980	
WATERS CORP	7,511	335.930	2,523,170.230	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	47.470	1,057,868.950	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,653	245.930	2,128,032.290	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	159.020	2,016,214.580	
VAIL RESORTS INC	5,235	250.630	1,312,048.050	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	38.170	1,352,019.570	
WABTEC CORP	20,273	101.240	2,052,438.520	
WHIRLPOOL CORP	6,832	154.700	1,056,910.400	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	97.510	1,836,405.830	
WYNN RESORTS LTD	12,757	97.470	1,243,424.790	
NASDAQ INC	41,596	62.540	2,601,413.840	
CME GROUP INC	44,342	177.500	7,870,705.000	
WILLIAMS COS INC	151,890	32.140	4,881,744.600	
LKQ CORP	31,504	56.170	1,769,579.680	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	54.970	1,597,758.020	
WEC ENERGY GROUP INC	38,318	96.720	3,706,116.960	
CARMAX INC	18,673	67.390	1,258,373.470	
TJX COMPANIES INC	140,433	82.440	11,577,296.520	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	286.930	1,709,528.940	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.760	544,301.240	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	51.000	883,728.000	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15,092	219.500	3,312,694.000	
SIGNATURE BANK	7,996	114.510	915,621.960	
CBRE GROUP INC	41,089	82.730	3,399,292.970	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	20.810	328,360.990	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	22.030	2,359,390.970	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	339.730	1,397,988.950	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5,387	388.170	2,091,071.790	
WESTLAKE CORP	4,187	110.770	463,793.990	
T-MOBILE US INC	75,987	149.560	11,364,615.720	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,972	53.800	2,311,893.600	
MOSAIC CO/THE	42,561	44.830	1,908,009.630	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	321.120	1,346,456.160	
CELANESE CORP	13,841	118.530	1,640,573.730	
DEXCOM INC	48,710	110.880	5,400,964.800	
EXPEDIA GROUP INC	19,186	94.640	1,815,763.040	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	83.000	1,994,241.000	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13,123	319.770	4,196,341.710	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	21.520	775,451.680	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	67,741	106.650	7,224,577.650	
LIVE NATION	20,444	72.560	1,483,416.640	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,304	1,451.430	4,795,524.720	
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	658.800	4,050,302.400	
MASTERCARD INC	105,296	371.010	39,065,868.960	
WESTERN UNION CO	46,712	14.450	674,988.400	
OWENS CORNING	13,227	89.690	1,186,329.630	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	99.980	1,510,497.840	
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	60.650	1,083,269.650	
FIRST SOLAR INC	11,903	171.010	2,035,532.030	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	13,610	139.030	1,892,198.300	
DELTA AIR LINES INC	15,786	38.090	601,288.740	
INSULET CORP	8,834	299.060	2,641,896.040	
DISCOVER FINANCIAL	33,236	105.610	3,510,053.960	
TE CONNECTIVITY LTD	38,762	122.700	4,756,097.400	
MASIMO CORP	5,688	153.450	872,823.600	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,904	309.480	4,303,009.920	
VMWARE INC	24,654	124.260	3,063,506.040	
MERCADOLIBRE INC	5,418	915.780	4,961,696.040	
ULTA BEAUTY INC	6,073	488.620	2,967,389.260	
INVESCO LTD	38,530	19.520	752,105.600	
MSCI INC	9,807	488.080	4,786,600.560	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	189,517	102.190	19,366,742.230	
VISA INC	199,385	221.090	44,082,029.650	
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	35.690	3,312,603.040	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,809	160.770	3,667,002.930	
MARATHON PETROLEUM CORP	60,388	116.500	7,035,202.000	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	16,182	61.290	991,794.780	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	241,328	18.740	4,522,486.720	
XYLEM INC	22,848	112.940	2,580,453.120	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	33,342	91.680	3,056,794.560	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	223.970	1,055,570.610	
SPLUNK INC	20,898	86.520	1,808,094.960	
EPAM SYSTEMS INC	7,090	326.880	2,317,579.200	
HCA HEALTHCARE INC	27,835	250.400	6,969,884.000	
VERISK ANALYTICS INC	18,974	183.540	3,482,487.960	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,792	152.600	1,189,059.200	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	191.930	1,697,428.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	126.730	2,843,060.820	
NXP SEMICONDUCTOR NV	32,109	166.070	5,332,341.630	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	16,343	97.140	1,587,559.020	
TARGA RESOURCES CORP	25,830	74.390	1,921,493.700	
LEAR CORP	6,911	134.930	932,501.230	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	122.490	1,556,725.410	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	53.370	1,405,498.950	
DOLLAR GENERAL CORP	27,899	241.760	6,744,862.240	
FORTINET INC	81,166	48.420	3,930,057.720	
HORIZON PHARMA PLC	27,613	113.060	3,121,925.780	
TESLA INC	325,351	118.850	38,667,966.350	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	109.560	757,497.840	
ENPHASE ENERGY INC	16,090	229.830	3,697,964.700	
GENERAL MOTORS CO	171,210	37.110	6,353,603.100	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	26.710	1,047,833.300	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	225.780	2,181,260.580	
APTIV PLC	34,310	99.640	3,418,648.400	
PHILLIPS 66	59,404	101.570	6,033,664.280	
META PLATFORMS INC	279,047	132.990	37,110,460.530	
IQVIA HOLDINGS INC	22,514	215.510	4,851,992.140	
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,087	141.950	2,851,349.650	
SERVICENOW INC	24,507	380.840	9,333,245.880	

PALO ALTO NETWORKS INC	36,942	134.190	4,957,246.980	
WORKDAY INC	24,052	160.210	3,853,370.920	
ABBVIE INC	215,856	159.640	34,459,251.840	
ZOETIS INC	57,061	154.360	8,807,935.960	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	19.390	1,051,151.290	
CDW CORP	16,465	186.380	3,068,746.700	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	40.550	1,719,847.150	
TWILIO INC	21,090	50.420	1,063,357.800	
SNAP INC	127,318	9.420	1,199,335.560	
TRADE DESK INC A	53,230	44.840	2,386,833.200	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,466	64.550	1,450,180.300	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	40.400	357,338.000	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	40.320	801,198.720	
OKTA INC	17,828	67.990	1,212,125.720	
BLACK KNIGHT INC	17,653	61.920	1,093,073.760	
BAKER HUGHES CO	126,292	30.870	3,898,634.040	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	18,167	98.050	1,781,274.350	
BROADCOM INC	49,306	574.930	28,347,498.580	
ARES MANAGEMENT CORP	19,534	72.430	1,414,847.620	
MONGODB INC	7,891	182.090	1,436,872.190	
BURLINGTON STORES INC	8,453	220.610	1,864,816.330	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	12.980	795,946.580	
VEEVA SYSTEMS INC	16,856	161.200	2,717,187.200	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	44.110	1,067,991.320	
EVERGY INC	28,226	64.180	1,811,544.680	
ALLEGION PLC	10,140	112.040	1,136,085.600	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	62.960	1,153,049.440	
STERIS PLC	12,524	201.520	2,523,836.480	
DOCUSIGN INC	26,362	58.050	1,530,314.100	
WIX.COM LTD	5,855	76.850	449,956.750	
DROPBOX INC	30,479	22.450	684,253.550	
KKR & CO INC	67,430	50.130	3,380,265.900	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	47.190	238,309.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	70.860	1,978,482.060	
MODERNA INC	40,114	189.650	7,607,620.100	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	34,409	129.460	4,454,589.140	
ARAMARK	31,133	44.050	1,371,408.650	
CIGNA CORP	37,115	303.790	11,275,165.850	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	42.490	1,392,397.300	
DOW INC	87,667	56.470	4,950,555.490	
OVINTIV INC	31,603	49.000	1,548,547.000	
AMCOR PLC	172,505	12.120	2,090,760.600	
PINTEREST INC	69,746	25.940	1,809,211.240	
FOX CORP-A	36,501	31.890	1,164,016.890	
FOX CORP-B	15,511	29.980	465,019.780	

CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	9.490	404,141.140	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	25,723	95.670	2,460,919.410	
CHEWY INC	9,648	40.990	395,471.520	
AVANTOR INC	78,214	21.470	1,679,254.580	
DYNATRACE INC	25,429	36.690	932,990.010	
CLOUDFLARE INC	29,770	41.800	1,244,386.000	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	68.770	949,026.000	
CARRIER GLOBAL CORP	101,898	44.000	4,483,512.000	
OTIS WORLDWIDE CORP	50,475	81.670	4,122,293.250	
UBER TECHNOLOGIES INC	181,560	28.040	5,090,942.400	
CORTEVA INC	86,360	61.750	5,332,730.000	
MATCH GROUP INC	35,259	44.970	1,585,597.230	
FERGUSON PLC	25,702	139.450	3,584,143.900	
BILL.COM HOLDINGS INC	11,988	101.650	1,218,580.200	
BLACKSTONE INC	85,115	80.530	6,854,310.950	
PAYLOCITY HOLDING CORP	5,322	187.180	996,171.960	
CARLYLE GROUP INC	24,530	32.560	798,696.800	
DATADOG INC	29,179	66.770	1,948,281.830	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	56.460	1,259,509.680	
INGERSOLL RAND INC	51,479	56.430	2,904,959.970	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	44,135	60.000	2,648,100.000	
PAYCOM SOFTWARE INC	6,341	298.340	1,891,773.940	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	16.450	630,725.900	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	17.530	162,450.510	
UNITY SOFTWARE INC	30,839	31.140	960,326.460	
AON PLC	25,506	307.330	7,838,758.980	
WARNER BROS DISCOVERY INC	275,379	12.560	3,458,760.240	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	2,093.410	1,540,749.760	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	37.240	840,357.840	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	43.230	566,053.620	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	10.060	186,391.680	
AIRBNB INC	47,177	88.540	4,177,051.580	
CONSTELLATION ENERGY CORP	38,995	83.080	3,239,704.600	
ROYALTY PHARMA PLC	41,775	39.260	1,640,086.500	
ROBLOX CORP	45,019	32.010	1,441,058.190	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	25.470	755,338.320	
VIATRIS INC	150,826	11.840	1,785,779.840	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	26,444	45.300	1,197,913.200	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	12,687	88.370	1,121,150.190	
HF SINCLAIR CORP	20,299	51.700	1,049,458.300	
SNOWFLAKE INC	26,591	137.940	3,667,962.540	
DOORDASH INC	29,575	48.040	1,420,783.000	

ARISTA NETWORKS INC	29,367	115.230	3,383,959.410	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	66.520	3,149,988.080	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	202,824	6.700	1,358,920.800	
FNF GROUP	31,004	40.040	1,241,400.160	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	127.500	1,856,527.500	
MARVELL TECHNOLOGY INC	101,624	37.010	3,761,104.240	
APA CORP	40,946	43.240	1,770,505.040	
LUCID GROUP INC	44,910	7.190	322,902.900	
U-HAUL HOLDING CO	11,981	57.190	685,193.390	
ASPEN TECHNOLOGY INC	3,721	202.070	751,902.470	
TOAST INC	32,620	18.320	597,598.400	
GRAB HOLDINGS LTD	168,328	3.720	626,180.160	
CATALENT INC	20,564	48.100	989,128.400	
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	32.840	2,007,115.120	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	63,378	41.260	2,614,976.280	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	120.300	630,011.100	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	178.010	3,953,424.090	
HUBSPOT INC	5,802	289.070	1,677,184.140	
QORVO INC	11,596	96.180	1,115,303.280	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	85.360	1,308,995.600	
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	6,728	285.480	1,920,709.440	
GODADDY INC	19,713	73.040	1,439,837.520	
ETSY INC	15,614	126.930	1,981,885.020	
TRANSUNION	22,126	64.100	1,418,276.600	
ALCOA CORP	19,669	52.980	1,042,063.620	
BLOCK INC	66,910	70.030	4,685,707.300	
DUPONT DE NEMOURS INC	60,266	73.920	4,454,862.720	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	26,221	56.000	1,468,376.000	
WESTROCK CO	27,826	36.710	1,021,492.460	
KRAFT HEINZ CO	87,780	42.330	3,715,727.400	
NOVOCURE LTD	10,423	93.030	969,651.690	
FORTIVE CORP	42,608	66.120	2,817,240.960	
WASTE CONNECTIONS INC	31,039	131.200	4,072,316.800	
ALPHABET INC-CL A	730,399	88.420	64,581,879.580	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	156,384	17.060	2,667,911.040	
PAYPAL HOLDINGS INC	133,121	77.920	10,372,788.320	
SEA LTD ADR	43,908	54.210	2,380,252.680	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	29.900	1,343,227.600	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	40.860	666,876.060	
ALPHABET INC-CL C	678,721	89.240	60,569,062.040	
ZSCALER INC	10,310	104.970	1,082,240.700	

	LINDE PLC	60,875	322.030	19,603,576.250	
	ROKU INC	15,660	47.120	737,899.200	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	14,085	374.640	5,276,804.400	
	VISTRA CORP	41,133	22.400	921,379.200	
アメリカ・ドル　小計		41,434,095		4,119,765,053.530 (545,456,893,086)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	17.545	806,420.830	
	ASHTEAD GROUP	54,304	50.640	2,749,954.560	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.330	803,420.010	
	BARCLAYS PLC	2,022,417	1.716	3,470,467.570	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.236	526,094.250	
	BT GROUP PLC	756,852	1.251	946,821.850	
	BUNZL PLC	38,593	29.330	1,131,932.690	
	AVIVA PLC	348,683	4.584	1,598,362.870	
	CRODA INTERNATIONAL	16,782	67.740	1,136,812.680	
	DIAGEO PLC	278,619	36.315	10,118,048.980	
	SCHRODERS PLC	110,366	4.529	499,847.610	
	DCC PLC	11,135	42.870	477,357.450	
	NATIONAL GRID PLC	436,527	10.225	4,463,488.570	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.505	564,606.960	
	BAE SYSTEMS PLC	379,623	8.394	3,186,555.460	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	262,877	31.535	8,289,826.190	
	HALMA PLC	41,997	20.900	877,737.300	
	NEXT PLC	18,751	62.660	1,174,937.660	
	IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.520	2,213,882.280	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	21.880	437,074.880	
	ANGLO AMERICAN PLC	157,426	34.935	5,499,677.310	
	COMPASS GROUP PLC	212,418	19.175	4,073,115.150	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,445,384	5.641	13,794,411.140	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.583	1,906,716.350	
	UNILEVER PLC	307,132	41.980	12,893,401.360	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	90,569	10.250	928,332.250	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	17.545	743,048.290	
	PEARSON PLC	84,159	9.160	770,896.440	
	PERSIMMON PLC	35,252	12.790	450,873.080	
	PRUDENTIAL PLC	333,971	12.410	4,144,580.110	
	RIO TINTO PLC	137,792	60.730	8,368,108.160	
	VODAFONE GROUP PLC	3,220,482	0.877	2,824,362.710	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	88,653	59.020	5,232,300.060	
	RELX PLC	229,145	23.420	5,366,575.900	
	RENTOKIL INITIAL PLC	312,114	5.110	1,594,902.540	
	ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	1.010	1,133,143.240	

	NATWEST GROUP PLC	670,464	2.754	1,846,457.850	
	ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	11.500	775,652.000	
	SSE PLC	131,574	16.740	2,202,548.760	
	BP PLC	2,266,380	4.751	10,767,571.380	
	SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	7.776	1,002,271.960	
	SMITHS GROUP PLC	51,695	16.280	841,594.600	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	110.750	989,662.000	
	STANDARD CHARTERED PLC	294,895	6.878	2,028,287.810	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,477,863	0.480	4,069,374.240	
	TAYLOR WIMPLEY PLC	569,863	1.062	605,194.500	
	TESCO PLC	934,247	2.421	2,261,811.980	
	3I GROUP PLC	107,283	13.990	1,500,889.170	
	SMITH & NEPHEW PLC	107,679	11.825	1,273,304.170	
	GSK PLC	499,550	14.140	7,063,637.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE PLC	39,268	72.800	2,858,710.400	
	WPP PLC	142,785	8.806	1,257,364.710	
	ASTRAZENECA PLC	189,322	118.020	22,343,782.440	
	WHITBREAD PLC	25,470	28.400	723,348.000	
	INTERTEK GROUP PLC	23,309	42.450	989,467.050	
	BURBERRY GROUP PLC	52,229	22.380	1,168,885.020	
	INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	51.940	1,129,798.880	
	SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.458	472,174.420	
	ADMIRAL GROUP PLC	21,325	22.720	484,504.000	
	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	40.960	465,305.600	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	16.730	308,752.150	
	AVEVA GROUP PLC	11,702	32.170	376,453.340	
	ABRDN PLC	285,831	1.966	561,943.740	
	EXPERIAN PLC	112,709	28.820	3,248,273.380	
	MONDI PLC	58,887	14.720	866,816.640	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.784	324,498.520	
	OCADO GROUP PLC	69,766	7.204	502,594.260	
	INFORMA PLC	186,195	6.434	1,197,978.630	
	GLENCORE PLC	1,187,922	5.341	6,344,691.400	
	ENTAIN PLC	74,451	14.585	1,085,867.830	
	COCA-COLA HBC AG	21,338	19.550	417,157.900	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	6.240	538,031.520	
	M&G PLC	270,401	1.965	531,337.960	
	JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.409	355,321.620	
	HALEON PLC	622,766	3.125	1,946,143.750	
	SHELL PLC	889,720	23.765	21,144,195.800	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.498	609,359.830	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.464	713,271.040	
イギリス・ポンド　小計		34,706,505		225,392,381.990 (36,285,919,577)	

イスラエル・シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	32.240	4,729,704.720	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	29.720	5,359,793.960	
	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	152.700	1,920,049.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	18.260	2,975,357.440	
	ICL GROUP LTD	103,067	26.000	2,679,742.000	
	NICE LTD	7,640	672.000	5,134,080.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	114.000	1,988,160.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	227.000	1,060,544.000	
イスラエル・シュケル　小計		925,709		29,054,765.080 (1,110,394,673)	
オーストラリア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	66.420	1,444,900.680	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	423,771	23.410	9,920,479.110	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	210,104	21.770	4,573,964.080	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	3.960	1,912,105.800	
	ASX LTD	23,664	66.280	1,568,449.920	
	BHP GROUP LTD	619,881	47.800	29,630,311.800	
	AMPOL LTD	31,828	27.470	874,315.160	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	24.210	1,745,081.010	
	CSL LIMITED	58,245	275.630	16,054,069.350	
	REA GROUP LTD	6,134	112.830	692,099.220	
	TRANSURBAN GROUP	379,633	13.250	5,030,137.250	
	COCHLEAR LTD	7,836	208.050	1,630,279.800	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	7.690	1,639,731.010	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	205,033	103.320	21,184,009.560	
	RIO TINTO LIMITED	45,936	118.230	5,431,013.280	
	APA GROUP	164,300	10.440	1,715,292.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	32.060	2,458,200.500	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.630	1,304,104.320	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	28.720	1,745,228.240	
	IGO LTD	91,947	13.910	1,278,982.770	
	ORICA LTD	43,659	14.870	649,209.330	
	LEND LEASE CORP LTD	65,475	8.030	525,764.250	
	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	17.690	890,249.250	
	MACQUARIE GROUP LTD	46,642	173.520	8,093,319.840	
	SUNCORP GROUP LTD	154,162	11.820	1,822,194.840	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	392,866	29.930	11,758,479.380	
	NEWCREST MINING LTD	112,815	22.270	2,512,390.050	

	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	6.330	713,131.470	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	12.770	2,202,658.990	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	11.730	1,590,329.940	
	REECE LTD	31,558	14.390	454,119.620	
	SANTOS LTD	417,358	7.050	2,942,373.900	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	30.460	1,607,496.040	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	27.780	721,863.300	
	WESFARMERS LTD	139,720	46.970	6,562,648.400	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	235,431	35.010	8,242,439.310	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	145,725	33.630	4,900,731.750	
	SEEK LTD	38,405	21.260	816,490.300	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	84.750	1,794,920.250	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.500	1,965,683.500	
	PILBARA MINERALS LTD	327,947	3.870	1,269,154.890	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.700	824,541.300	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	13.380	1,060,137.540	
	XERO LTD	14,590	71.640	1,045,227.600	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	29.500	701,539.500	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.720	1,073,611.200	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.300	1,010,961.000	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	355,854	23.720	8,440,856.880	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	2.880	859,898.880	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	4.450	2,655,288.300	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.580	2,507,443.140	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	50.520	748,857.960	
オーストラリア・ドル　小計		8,516,579		194,796,766.760 (17,790,788,708)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	74.170	3,871,674.000	
	BARRICK GOLD CORP	214,835	26.060	5,598,600.100	
	BANK OF MONTREAL	82,585	127.650	10,541,975.250	
	BANK OF NOVA SCOTIA	144,527	67.610	9,771,470.470	
	NATIONAL BANK OF CANADA	40,967	95.250	3,902,106.750	
	BCE INC	7,697	61.450	472,980.650	
	BROOKFIELD CORP	170,004	45.220	7,687,580.880	
	SAPUTO INC	26,668	35.160	937,646.880	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	9.700	895,416.700	
	DESCARTES SYSTEMS GRP (THE)	11,508	95.150	1,094,986.200	
	CGI INC	25,261	114.530	2,893,142.330	
	CCL INDUSTRIES INC	16,363	59.540	974,253.020	
	CAE INC	40,808	27.460	1,120,587.680	
	CAMECO CORP	54,264	33.990	1,844,433.360	

ROGERS COMM-CL B	45,607	63.390	2,891,027.730	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	109,348	56.930	6,225,181.640	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	136,276	74.370	10,134,846.120	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	152.000	930,848.000	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	36.920	602,903.600	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	70,975	163.140	11,578,861.500	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.140	849,846.820	
OPEN TEXT CORP	33,217	41.570	1,380,830.690	
EMPIRE CO LTD	29,433	36.060	1,061,353.980	
KINROSS GOLD CORP	219,914	6.200	1,363,466.800	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	79.520	1,056,502.720	
FORTIS INC	60,484	55.280	3,343,555.520	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	74,203	30.940	2,295,840.820	
TELUS CORP	31,890	26.990	860,711.100	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	33.400	1,142,547.200	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	64.180	1,748,648.280	
ENBRIDGE INC	244,225	55.040	13,442,144.000	
IGM FINANCIAL INC	12,478	40.080	500,118.240	
MANULIFE FINANCIAL CORP	233,861	24.770	5,792,736.970	
LOBLAW CO LTD	21,600	119.090	2,572,344.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	101,210	62.570	6,332,709.700	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	82.000	2,650,896.000	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,884	62.940	4,776,138.960	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	817.430	2,287,986.570	
METRO INC	28,629	74.180	2,123,699.220	
EMERA INC	30,947	52.000	1,609,244.000	
ONEX CORP	10,157	64.730	657,462.610	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	24.280	469,162.440	
POWER CORP OF CANADA	65,500	34.210	2,240,755.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	31.750	545,941.250	
ROYAL BANK OF CANADA	169,273	132.900	22,496,381.700	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	113,049	102.640	11,603,349.360	
SHAW COMM INC-B	59,877	38.650	2,314,246.050	
SUNCOR ENERGY INC	165,224	41.660	6,883,231.840	
LUNDIN MINING CORP	68,762	9.630	662,178.060	
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	53.090	3,043,437.340	
THOMSON REUTERS CORP	19,979	155.400	3,104,736.600	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	101.950	985,346.750	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C$	221,445	86.000	19,044,270.000	
TC ENERGY CORP	123,753	54.770	6,777,951.810	

	WEST FRASER TIMBER CO LTD	8,102	97.520	790,107.040	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,379	173.190	1,451,159.010	
	INTACT FINANCIAL CORP	21,566	199.190	4,295,731.540	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	58.360	3,117,241.040	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,530	2,242.560	5,673,676.800	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	23,163	193.340	4,478,334.420	
	TOURMALINE OIL CORP	39,298	63.190	2,483,240.620	
	KEYERA CORP	24,571	29.700	729,758.700	
	PARKLAND CORP	15,665	30.680	480,602.200	
	ALTAGAS LTD	33,833	23.470	794,060.510	
	PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	46.480	3,168,959.920	
	DOLLARAMA INC	32,535	81.370	2,647,372.950	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	167,715	25.160	4,219,709.400	
	ARC RESOURCES LTD	74,961	15.830	1,186,632.630	
	NORTHLAND POWER INC	34,152	37.830	1,291,970.160	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	51,243	18.700	958,244.100	
	TMX GROUP LTD	7,040	137.960	971,238.400	
	BRP INC	4,307	105.910	456,154.370	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	12.040	770,885.080	
	NUTRIEN LTD	66,177	99.800	6,604,464.600	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	141.600	1,330,898.400	
	WSP GLOBAL INC	15,681	166.900	2,617,158.900	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	80.190	963,162.090	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	40.990	1,130,381.230	
	NUVEI CORP	7,929	40.700	322,710.300	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	38.630	622,058.890	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT LTD	42,501	40.630	1,726,815.630	
	AIR CANADA	18,814	20.790	391,143.060	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	35,384	88.560	3,133,607.040	
	SHOPIFY INC	146,823	49.010	7,195,795.230	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	179.100	937,946.700	
	HYDRO ONE LTD	37,626	35.950	1,352,654.700	
カナダ・ドル　小計		4,990,683		290,284,170.920 (28,619,116,411)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.410	491,722.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	211,910	34.560	7,323,609.600	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.680	302,592.000	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	15,500	28.510	441,905.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	8.970	895,206.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.980	745,969.140	

	KEPPEL CORP LTD	184,900	7.270	1,344,223.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	398,198	12.540	4,993,402.920	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.470	2,330,025.100	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.580	907,866.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	139,966	30.100	4,212,976.600	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.650	289,940.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	17.580	770,004.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,500	4.130	1,067,605.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.730	1,143,580.700	
シンガポール・ドル　小計		3,753,587		27,260,627.060 (2,710,796,755)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	451,599	3.058	1,380,989.740	
	LOGITECH INTL-REG	23,734	61.360	1,456,318.240	
	NESTLE SA-REGISTERED	335,501	111.380	37,368,101.380	
	CIE FINANC RICHEMONT	64,458	134.950	8,698,607.100	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	85,335	292.550	24,964,754.250	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,236	186.800	978,084.800	
	SIKA INHABER	17,793	240.400	4,277,437.200	
	SGS SA-REG	748	2,264.000	1,693,472.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	263,600	83.520	22,015,872.000	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	149.000	845,575.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,828.000	840,880.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	15.290	322,190.880	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	528.400	1,812,940.400	
	ABB LTD	194,538	30.240	5,882,829.120	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	32.010	635,142.420	
	GEBERIT AG	4,377	495.800	2,170,116.600	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	470.500	4,247,203.500	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,500.000	1,111,500.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	95,800.000	1,245,400.000	
	GIVAUDAN-REG	1,105	3,008.000	3,323,840.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18,153	449.100	8,152,512.300	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	3,612	353.200	1,275,758.400	
	HOLCIM LTD	66,607	50.640	3,372,978.480	
	TEMENOS GROUP	7,082	55.980	396,450.360	
	BACHEM HOLDING AG	4,673	82.550	385,756.150	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	228.500	1,401,847.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	6,887	218.400	1,504,120.800	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	115.850	1,502,458.650	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	291.900	913,647.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	9,259	53.150	492,115.850	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	175.400	477,088.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	508.400	1,835,324.000	

	BANQUE CANTONALE VAUD	4,903	87.800	430,483.400	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	660.000	534,600.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	83.100	695,713.200	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,852	862.400	2,459,564.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	56.780	1,478,040.180	
	SWISS RE LTD	36,229	92.860	3,364,224.940	
	BKW AG	3,194	131.700	420,649.800	
	SIG GROUP AG	38,322	22.100	846,916.200	
	ALCON INC	61,285	66.720	4,088,935.200	
	UBS GROUP AG	403,341	18.545	7,479,958.840	
	VAT GROUP AG	3,325	279.000	927,675.000	
スイス・フラン　小計		2,241,162		169,708,073.680 (24,373,473,542)	
スウェーデン・クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	334,122	131.580	43,963,772.760	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	194,204	116.900	22,702,447.600	
	ERICSSON LM-B SHS	366,551	63.390	23,235,667.890	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	218.700	5,632,618.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	200.600	11,722,462.200	
	LUNDBERGS B	7,859	462.300	3,633,215.700	
	SKF AB-B SHS	46,594	179.650	8,370,612.100	
	SANDVIK AB	133,350	203.000	27,070,050.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	195,837	125.850	24,646,086.450	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	175.300	7,702,156.100	
	SWEDBANK AB	112,296	190.100	21,347,469.600	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	142.200	9,984,004.200	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	184,499	110.150	20,322,564.850	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	205.800	4,979,948.400	
	VOLVO AB-B SHS	179,832	195.080	35,081,626.560	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	429.400	4,354,974.800	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	90.960	5,859,279.360	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	266.700	4,078,376.400	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	266.000	5,672,450.000	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	159.380	4,288,437.660	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	92.680	7,051,557.800	
	INVESTOR AB-B SHS	226,392	197.420	44,694,308.640	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	127.640	10,503,112.680	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	236.400	29,458,276.800	
	TELIA CO AB	344,810	27.640	9,530,548.400	
	BOLIDEN AB	36,260	431.700	15,653,442.000	
	ALFA LAVAL AB	35,313	323.900	11,437,880.700	
	KINNEVIK AB-B	36,278	155.600	5,644,856.800	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	53.700	3,916,985.400	
	INDUTRADE AB	29,769	228.500	6,802,216.500	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	79.700	3,807,189.300	

	NIBE INDUSTRIER AB	185,845	104.150	19,355,756.750	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	223.500	4,107,930.000	
	HEXAGON AB-B SHS	248,163	116.200	28,836,540.600	
	SAGAX AB	19,038	262.300	4,993,667.400	
	EPIROC AB-A	84,563	207.200	17,521,453.600	
	EPIROC AB-B	41,205	177.800	7,326,249.000	
	ESSITY AB-B	75,180	288.800	21,711,984.000	
	EQT AB	31,718	245.400	7,783,597.200	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	47.890	3,821,190.990	
	VOLVO CAR AB	63,710	49.540	3,156,193.400	
	LIFCO AB	26,835	184.750	4,957,766.250	
	EVOLUTION AB	22,326	1,129.600	25,219,449.600	
	NORDEA BANK ABP	403,793	119.560	48,277,491.080	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	208.500	3,239,881.500	
スウェーデン・クローナ　小計		4,544,367		643,457,747.520 (8,184,782,548)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	12,549	927.600	11,640,452.400	
	A P MOLLER A/S	663	15,060.000	9,984,780.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	14,850.000	5,331,150.000	
	DANSKE BANK A/S	85,371	142.450	12,161,098.950	
	GENMAB A/S	7,926	2,999.000	23,770,074.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	354.200	8,450,857.800	
	ROCKWOOL AS	873	1,787.000	1,560,051.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	202,240	930.700	188,224,768.000	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	125,436	198.700	24,924,133.200	
	COLOPLAST-B	15,343	841.000	12,903,463.000	
	DSV A/S	22,074	1,087.000	23,994,438.000	
	DEMANT A/S	11,367	199.150	2,263,738.050	
	TRYG A/S	44,887	158.950	7,134,788.650	
	PANDORA A/S	9,912	539.000	5,342,568.000	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	503.600	6,314,136.800	
	ORSTED A/S	23,240	640.600	14,887,544.000	
デンマーク・クローネ　小計		598,637		358,888,041.850 (6,865,528,241)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	8.090	1,329,518.690	
	FISHER & PAYKEL	78,460	23.380	1,834,394.800	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.300	1,160,901.400	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.650	355,012.100	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	5.380	711,004.660	
ニュージーランド・ドル　小計		656,830		5,390,831.650 (454,824,466)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	173.750	7,906,320.000	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	75.060	12,232,603.260	
	TELENOR ASA	85,954	99.380	8,542,108.520	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	392.200	4,386,757.000	
	ORKLA ASA	116,068	72.880	8,459,035.840	
	EQUINOR ASA	115,617	309.100	35,737,214.700	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	455.600	9,036,370.400	
	AKER BP ASA	38,723	304.900	11,806,642.700	
	SALMAR ASA	7,248	398.000	2,884,704.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	186.700	4,802,110.700	
	ADEVINTA ASA	24,382	70.850	1,727,464.700	
	DNB BANK ASA	119,319	193.400	23,076,294.600	
ノルウェー・クローネ　小計		772,526		130,597,626.420 (1,734,336,479)	
ユーロ	CRH PLC	90,748	40.365	3,663,043.020	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	140.700	2,807,387.100	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	86.420	1,578,720.560	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	55.920	975,859.920	
	UMICORE	24,290	35.370	859,137.300	
	AIR LIQUIDE	63,347	141.700	8,976,269.900	
	AIRBUS SE	73,377	115.100	8,445,692.700	
	AXA SA	228,092	27.450	6,261,125.400	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	26.470	2,216,068.400	
	ADIDAS AG	20,476	140.100	2,868,687.600	
	ASSICURAZIONI GENERALI	133,912	17.330	2,320,694.960	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	151.300	472,056.000	
	DANONE	79,150	49.490	3,917,133.500	
	SAFRAN SA	40,925	121.840	4,986,302.000	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.250	4,614,689.250	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39,262	90.520	3,553,996.240	
	ACCOR SA	18,305	26.420	483,618.100	
	BOUYGUES	29,123	30.460	887,086.580	
	BNP PARIBAS	133,053	58.350	7,763,642.550	
	THALES SA	12,886	115.600	1,489,621.600	
	CAPGEMINI SA	19,839	163.600	3,245,660.400	
	UNICREDIT SPA	241,149	14.598	3,520,293.100	
	D'IETEREN TRDG	2,736	175.500	480,168.000	
	KONINKLIJKE DSM NV	20,425	119.950	2,449,978.750	
	COMMERZBANK AG	141,036	9.430	1,329,969.480	
	EIFFAGE	8,993	95.260	856,673.180	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	27.510	1,346,559.480	
	UNITED INTERNET	10,010	21.000	210,210.000	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	61.360	1,624,321.920	
	IBERDROLA SA	730,877	10.795	7,889,817.210	
	ENI SPA	296,020	13.974	4,136,583.480	
	JERONIMO MARTINS	34,644	21.360	739,995.840	
	KESKO OYJ-B	35,252	21.250	749,105.000	
	KBC GROUPE	32,213	63.920	2,059,054.960	
	HANNOVER RUECK SE	7,105	185.800	1,320,109.000	

WARTSILA OYJ	50,956	8.460	431,087.760	
L'OREAL	29,178	364.350	10,631,004.300	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33,871	756.300	25,616,637.300	
GEA GROUP AG	17,490	40.230	703,622.700	
BOLLORE	114,808	5.335	612,500.680	
MEDIOBANCA SPA	86,792	9.408	816,539.130	
MICHELIN(CGDE)-B	86,908	28.710	2,495,128.680	
CONTINENTAL AG	12,921	63.960	826,427.160	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,731	37.605	4,464,879.250	
OMV AG	17,258	47.330	816,821.140	
VERBUND AG	7,320	73.150	535,458.000	
PERNOD-RICARD	24,888	187.500	4,666,500.000	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	16,854	56.800	957,307.200	
RENAULT SA	27,902	36.365	1,014,656.230	
REPSOL SA	178,713	14.790	2,643,165.270	
REMY COINTREAU	2,866	163.900	469,737.400	
MERCK KGAA	15,234	192.500	2,932,545.000	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	61,460	51.720	3,178,711.200	
RWE AG	77,853	39.450	3,071,300.850	
SEB SA	2,596	90.200	234,159.200	
SOCIETE GENERALE-A	100,409	24.550	2,465,040.950	
VINCI S.A.	66,767	99.400	6,636,639.800	
SODEXO	9,822	88.100	865,318.200	
SOFINA	1,449	217.200	314,722.800	
SOLVAY SA	9,070	101.400	919,698.000	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	66,119	144.280	9,539,649.320	
VIVENDI SE	76,073	9.412	715,999.070	
SAP SE	126,307	104.680	13,221,816.760	
TELEFONICA S.A	614,947	3.568	2,194,130.890	
TOTALENERGIES SE	303,774	58.410	17,743,439.340	
VALEO	26,570	18.985	504,431.450	
E.ON SE	280,287	9.882	2,769,796.130	
VOEST-ALPINE AG	10,593	27.280	288,977.040	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	61.050	816,604.800	
SIEMENS AG-REG	92,954	138.140	12,840,665.560	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	34.790	2,165,086.070	
ING GROEP NV-CVA	454,638	12.188	5,541,127.940	
PUMA AG	16,210	62.000	1,005,020.000	
BAYER AG	121,329	53.960	6,546,912.840	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,960	13.990	1,048,690.400	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	64.860	1,274,109.840	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	99,529	67.750	6,743,089.750	
BASF SE	110,117	51.700	5,693,048.900	
BEIERSDORF AG	12,940	109.450	1,416,283.000	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	57.820	1,203,176.380	

FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	33.020	787,692.100	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	274.400	1,423,587.200	
ORANGE	255,481	9.892	2,527,218.050	
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	48.780	2,848,556.880	
RANDSTAD NV	15,584	56.300	877,379.200	
ALLIANZ SE	49,878	216.300	10,788,611.400	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.781	1,520,147.630	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	27.355	3,443,556.820	
HERMES INTL	3,916	1,606.500	6,291,054.000	
ENDESA S.A.	37,701	18.710	705,385.710	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	8.365	605,140.830	
ERSTE GROUP BANK AG	45,686	31.980	1,461,038.280	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	16,705	321.800	5,375,669.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	66,878	27.205	1,819,415.990	
DASSAULT SYSTEMES SA	81,900	34.390	2,816,541.000	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	28.220	665,173.620	
RHEINMETALL STAMM	4,693	211.600	993,038.800	
HEINEKEN NV	32,026	90.220	2,889,385.720	
AKZO NOBEL	22,627	66.260	1,499,265.020	
ASML HOLDING NV	49,677	582.700	28,946,787.900	
AEGON NV	196,332	4.944	970,665.400	
VOLKSWAGEN AG	3,315	159.250	527,913.750	
VOLKSWAGEN AG PFD	22,269	127.280	2,834,398.320	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	735,118	6.310	4,638,594.580	
KERING	8,881	524.300	4,656,308.300	
ACCIONA S.A.	2,642	180.300	476,352.600	
FORTUM OYJ	54,194	14.745	799,090.530	
AGEAS	18,136	44.190	801,429.840	
UCB SA	16,732	77.840	1,302,418.880	
NEMETSCHEK SE	9,878	50.900	502,790.200	
CARREFOUR SA	75,572	16.825	1,271,498.900	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	25.540	451,470.580	
NOKIA OYJ	637,662	4.557	2,905,825.730	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	115,512	15.372	1,775,650.460	
WOLTERS KLUWER-CVA	32,047	98.080	3,143,169.760	
SANOFI	137,939	90.070	12,424,165.730	
STMICROELECTRONICS NV	80,161	37.120	2,975,576.320	
ELISA OYJ	20,242	51.240	1,037,200.080	
BANCO SANTANDER SA	2,066,857	3.036	6,274,977.850	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	16.415	804,515.560	
QIAGEN N.V.	27,412	47.040	1,289,460.480	
DEUTSCHE BANK AG-REG	253,716	11.656	2,957,313.690	
BMW VORZUG	7,821	84.750	662,829.750	

ENEL SPA	1,019,343	5.536	5,643,082.840	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	393,301	19.970	7,854,220.970	
SARTORIUS AG	2,847	389.700	1,109,475.900	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	23.810	262,671.920	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159,023	30.820	4,901,088.860	
RATIONAL AG	516	606.000	312,696.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	128.000	622,848.000	
BECHTLE AG	8,139	35.100	285,678.900	
KONINKLIJKE KPN NV	475,739	3.004	1,429,119.950	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	66.620	984,576.980	
TELEPERFORMANCE	7,845	236.100	1,852,204.500	
DEUTSCHE BOERSE AG	22,570	162.800	3,674,396.000	
EURAZEO	5,673	61.450	348,605.850	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	76.700	868,090.600	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	72.600	787,927.800	
INDITEX	136,321	26.740	3,645,223.540	
ESSILORLUXOTTICA	35,682	172.650	6,160,497.300	
SNAM SPA	256,415	4.828	1,237,971.620	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	10.476	1,505,610.720	
ENAGAS	38,270	16.040	613,850.800	
WENDEL	5,449	93.100	507,301.900	
TENARIS SA	55,855	15.845	885,022.470	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.249	226,163.210	
TERNA SPA	166,064	7.254	1,204,628.250	
BIOMERIEUX	4,870	99.160	482,909.200	
GRIFOLS SA	31,982	11.675	373,389.850	
FERROVIAL SA	56,362	25.750	1,451,321.500	
NESTE OYJ	50,599	44.370	2,245,077.630	
RECORDATI SPA	10,908	39.040	425,848.320	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.862	569,777.050	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	7,294	216.800	1,581,339.200	
KONE OYJ	43,814	50.640	2,218,740.960	
ELIA GROUP	4,078	137.700	561,540.600	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	294.200	914,667.800	
ENGIE	221,751	13.156	2,917,356.150	
ALSTOM	37,007	24.750	915,923.250	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	12.000	780,144.000	
IPSEN SA	3,873	104.700	405,503.100	
ARKEMA SA	6,392	88.760	567,353.920	
LEGRAND SA	32,783	79.360	2,601,658.880	
AMPLIFON SPA	12,300	28.010	344,523.000	
ADP	3,975	132.350	526,091.250	
ORION OYJ	13,559	53.940	731,372.460	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	12.545	745,248.270	
SYMRISE AG	17,265	105.750	1,825,773.750	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	37.940	1,230,090.680	

PRYSMIAN SPA	30,728	34.570	1,062,266.960	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	126.200	306,539.800	
CAIXABANK	566,059	3.887	2,200,271.330	
BUREAU VERITAS SA	31,295	26.010	813,982.950	
GETLINK	63,509	14.950	949,459.550	
EDP RENOVAVEIS SA	39,688	20.770	824,319.760	
AMADEUS IT GROUP SA	54,712	54.560	2,985,086.720	
BRENNTAG SE	17,934	65.580	1,176,111.720	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	19.300	476,459.100	
EDENRED	31,091	48.310	1,502,006.210	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.561	270,118.910	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	68.540	562,644.860	
VONOVIA SE	85,937	25.210	2,166,471.770	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	134,537	9.554	1,285,366.490	
KNORR-BREMSE AG	10,342	58.700	607,075.400	
OCI NV	12,329	32.200	396,993.800	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34,318	47.500	1,630,105.000	
FERRARI NV	15,435	213.500	3,295,372.500	
CNH INDUSTRIAL NV	124,604	15.615	1,945,691.460	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.608	295,290.800	
AIB GROUP PLC	147,578	3.870	571,126.860	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	39.720	686,877.960	
MONCLER SPA	25,014	51.900	1,298,226.600	
NEXI SPA	58,847	7.836	461,125.090	
PROSUS NV	102,526	74.370	7,624,858.620	
DR ING HC F PORSCHE AG	15,174	101.100	1,534,091.400	
JDE PEET'S BV	14,385	27.440	394,724.400	
EXOR NV	14,142	72.300	1,022,466.600	
SIEMENS ENERGY AG	59,014	17.665	1,042,482.310	
EURONEXT NV	10,081	71.240	718,170.440	
IMCD NV	6,823	141.700	966,819.100	
WORLDLINE SA	29,916	40.120	1,200,229.920	
NN GROUP NV	31,214	39.210	1,223,900.940	
FINECOBANK SPA	75,180	16.830	1,265,279.400	
ARGENX SE	6,753	354.600	2,394,613.800	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	92,502	23.595	2,182,584.690	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	30.100	1,706,459.300	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVABLES SA	9,822	36.040	353,984.880	
IBERDROLA SA-RTS	730,877	0.178	130,096.100	
ZALANDO SE	31,321	38.990	1,221,205.790	
STELLANTIS NV	262,624	14.666	3,851,643.580	
AENA SME SA	8,494	127.700	1,084,683.800	
CELLNEX TELECOM SAU	64,293	32.600	2,095,951.800	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	22.990	521,183.300	
ABN AMRO BANK NV	52,835	14.605	771,655.170	

	SCOUT24 SE	10,048	49.770	500,088.960	
	COVESTRO AG	27,558	41.800	1,151,924.400	
	HELLOFRESH SE	17,856	24.940	445,328.640	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,327	56.340	5,934,123.180	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.700	571,223.300	
	AMUNDI SA	6,292	57.550	362,104.600	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.798	410,330.440	
	ADYEN NV	2,593	1,340.000	3,474,620.000	
	DELIVERY HERO SE	22,564	47.850	1,079,687.400	
ユーロ　小計		22,926,806		552,803,372.160 (78,636,279,690)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	15.060	3,870,420.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	57.600	11,364,249.600	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	93,314	42.250	3,942,516.500	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	145,391	373.800	54,347,155.800	
	MTR CORP	192,441	41.600	8,005,545.600	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	128.900	12,257,874.400	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	28.000	4,787,216.000	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	42.900	6,491,628.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,536,406	7.690	11,814,962.140	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	53.500	13,958,364.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	27.550	11,570,862.250	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	22.550	3,902,638.300	
	SINO LAND CO	411,200	10.100	4,153,120.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,565	108.600	19,609,359.000	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	67.250	3,565,595.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	180,156	94.550	17,033,749.800	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	16.580	2,951,240.000	
	AIA GROUP LTD	1,454,316	86.350	125,580,186.600	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	9.840	4,557,258.240	
	SANDS CHINA LTD	335,800	29.350	9,855,730.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	18.060	2,528,400.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	201,600	21.300	4,294,080.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	45.900	9,002,596.500	
	ESR GROUP LTD	216,400	16.000	3,462,400.000	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.090	1,254,685.000	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	26.350	6,982,750.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.880	4,545,720.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	48.800	15,149,716.000	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	49.650	13,216,581.750	
香港・ドル　小計		9,723,169		394,056,600.480 (6,679,259,378)	
合計		135,790,655		758,902,393,554 (758,902,393,554)	

（２）株式以外の有価証券

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,284,033.870	
		GOODMAN GROUP	214,602.000	3,828,499.680	
		GPT GROUP	219,223.000	940,466.670	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	939,180.340	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,863,927.360	
		STOCKLAND	259,328.000	949,140.480	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	765,396.720	
	オーストラリア・ドル　小計		2,323,705.000	10,570,645.120 (965,417,017)	
	シンガポール・ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	787,231.000	1,574,462.000	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,203,050.940	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	772,783.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	405,500.000	697,460.000	
	シンガポール・ドル　小計		2,107,509.000	4,247,755.940 (422,396,851)	
投資信託受益証券　合計			4,431,214	1,387,813,868 (1,387,813,868)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	2,781,176.100	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	42,177.000	1,304,956.380	
		AMERICAN TOWER CORP	56,451.000	12,529,299.450	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	58,993.000	1,311,414.390	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	2,759,746.680	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,248,804.090	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,271.000	1,504,798.690	
		CROWN CASTLE INC	52,742.000	7,758,348.200	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	34,187.000	3,498,013.840	
		EQUINIX INC	11,088.000	7,707,823.200	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,341,628.140	

	EQUITY RESIDENTIAL	46,054.000	2,705,672.500	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,345.000	1,786,330.700	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	16,256.000	2,381,178.880	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,539,058.300	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	869,029.210	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,636,100.900	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	91,777.000	1,509,731.650	
	INVITATION HOMES INC	76,646.000	2,284,817.260	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,731,222.240	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,457,516.460	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	903,364.230	
	MID AMERICA	13,578.000	2,100,788.160	
	PROLOGIS INC	111,846.000	12,979,728.300	
	PUBLIC STORAGE	19,317.000	5,431,554.060	
	REALTY INCOME CORP	76,685.000	4,918,575.900	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,197,861.330	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,918.000	3,795,695.940	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	39,034.000	4,561,122.900	
	SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,112,262.500	
	UDR INC	41,516.000	1,602,102.440	
	VENTAS INC	48,092.000	2,298,316.680	
	VICI PROPERTIES INC	114,690.000	3,713,662.200	
	WELLTOWER INC	58,944.000	4,066,546.560	
	WEYERHAEUSER CO	89,893.000	2,774,097.980	
	WP CAREY INC	23,664.000	1,901,639.040	
アメリカ・ドル　小計		1,580,343.000	116,003,985.480 (15,358,927,678)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	488,593.320	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	513,895.270	
	SEGRO PLC	139,569.000	1,103,990.790	
イギリス・ポンド　小計		335,772.000	2,106,479.380 (339,122,115)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	393,449.420	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	313,577.760	
カナダ・ドル　小計		23,146.000	707,027.180 (69,705,810)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	296,107.700	
	GECINA SA	5,045.000	507,527.000	
	KLEPIERRE	25,279.000	556,138.000	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	13,535.000	715,730.800	
	WAREHOUSES DE PAUW	27,206.000	762,312.120	
ユーロ　小計		76,131.000	2,837,815.620	

				(403,679,272)	
	香港・ドル	LINK REIT	262,516.000	15,737,834.200	
	香港・ドル　小計		262,516.000	15,737,834.200 (266,756,290)	
投資証券　合計			2,277,908	16,438,191,165 (16,438,191,165)	
合計				17,826,005,033 (17,826,005,033)	

（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	67.90	－	－	72.20
	投資証券	36銘柄	－	－	1.91	
イギリス・ポンド	株式	78銘柄	4.52	－	－	4.72
	投資証券	3銘柄	－	－	0.04	
イスラエル・シュケル	株式	10銘柄	0.14	－	－	0.14
オーストラリア・ドル	株式	52銘柄	2.21	－	－	2.41
	投資信託受益証券	7銘柄	－	0.12	－	
カナダ・ドル	株式	86銘柄	3.56	－	－	3.69
	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	3.03	－	－	3.14
スウェーデン・クローナ	株式	45銘柄	1.02	－	－	1.05
デンマーク・クローネ	株式	16銘柄	0.85	－	－	0.88
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	－	－	0.22
ユーロ	株式	223銘柄	9.79	－	－	10.18
	投資証券	5銘柄	－	－	0.05	
香港・ドル	株式	29銘柄	0.83	－	－	0.89
	投資証券	1銘柄	－	－	0.03	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,606,570,356
投資証券	192,505,859,750
未収配当金	1,446,669,125
前払金	172,213,530
差入委託証拠金	279,271,500
流動資産合計	198,010,584,261
資産合計	198,010,584,261
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	170,133,600
未払金	578,780,165
未払解約金	472,631,000
流動負債合計	1,221,544,765
負債合計	1,221,544,765
純資産の部	
元本等	
元本	85,187,544,308
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	111,601,495,188
元本等合計	196,789,039,496
純資産合計	196,789,039,496
負債純資産合計	198,010,584,261

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	83,254,722,505円
同期中追加設定元本額	82,347,723,741円
同期中一部解約元本額	80,414,901,938円
元本の内訳	
ファンド名	
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	185,528円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	1,165,609円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	3,727,398円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	2,340,411円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	1,613,877円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	2,377,391円
たわらノーロード　国内リート	5,451,203,249円
たわらノーロード　国内リート＜ラップ向け＞	1,144,350,754円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,005,553,931円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	36,480,623円
たわらノーロード　バランス（標準型）	689,991,569円
たわらノーロード　バランス（積極型）	756,356,526円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（保守型）	36,161円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定型）	148,068,532円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（安定成長型）	395,464,235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）	237,163,760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）	299,443,271円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	2,395,316円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	40,275,413円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,438,028円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	11,100,497円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	12,188,511円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	442,338,302円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	3,270,803円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	125,636,380円

ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	192,913,663円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	355,658,204円
投資のソムリエ	12,328,088,200円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	890,956,658円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	154,914,085円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	796,599,142円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	3,460,018,291円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	32,047,173円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	16,065,715円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	5,483,172円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	101,950,974円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	157,939,723円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	113,374,981円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	43,369,508円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	17,202,404円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	10,618,723円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	2,227,670円
Ｊリートインデックスファンド（ＤＣ）	63,535,821円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス私募ファンド２０１４０１（適格機関投資家限定）	704,411,388円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０１９－１２（適格機関投資家限定）	760,808円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型）２０－０４（適格機関投資家限定）	88,046,327円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０６（適格機関投資家限定）	708,067円
マルチアセット・インカム戦略ファンド２０－０８（適格機関投資家限定）	9,767,562円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	551,421円
固定比率マルチアセット戦略ファンド（米ドル建日本政府保証債活用型）（適格機関投資家限定）	181,945,946円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド（適格機関投資家限定）	65,457,891円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（株式先物活用型・シグナルヘッジ付き）２１－０３（適格機関投資家限定）	228,060,645円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンドⅡ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	2,869,206円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０５（適格機関投資家限定）	75,670,901円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０７（適格機関投資家限定）	124,733,821円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０８（適格機関投資家限定）	87,061,891円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	65,399,918円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	588,327円
マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－０９（適格機関投資家限定）	86,814,018円

マルチアセット・インカム戦略ファンド（シグナルヘッジ付き）２０２１－１２（適格機関投資家限定）	125,377,020円
ＤＩＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,536,664,731円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	329,779,722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）	51,846,803円
日米資産配分戦略ファンド（インカム重視型）（為替ヘッジあり）（適格機関投資家限定）	94,350,960円
インカム重視マルチアセット運用ファンド（適格機関投資家限定）	1,014,158円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	6,500,426円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	9,276,636円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,156,979,171円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド〈ＤＣ年金〉	7,807,907,095円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（毎月決算型）	37,034,342,906円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（年１回決算型）	2,659,539,140円
ＭＨＡＭ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（ファンドラップ）	90,460,138円
計	85,187,544,308円
２．　受益権の総数	85,187,544,308口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△13,232,326,470
合計	△13,232,326,470

（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7日から2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引 先物取引 買建	4,474,630,530	－	4,304,754,000	△169,876,530
合計	4,474,630,530	－	4,304,754,000	△169,876,530

（注）時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.3101円 (23,101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

2023年1月11日現在

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
投資証券	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	7,155	1,304,356,500	
	ＧＬＰ投資法人	59,625	8,597,925,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	17,758	2,400,881,600	
	Ｏｎｅリート投資法人	3,222	781,979,400	
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投資法人	9,189	1,232,244,900	
	いちごオフィスリート投資法人	15,137	1,288,158,700	
	いちごホテルリート投資法人	3,060	332,928,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	9,753	3,930,459,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,471	6,233,962,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	8,052	1,143,384,000	
	イオンリート投資法人	20,449	3,075,529,600	
	インヴィンシブル投資法人	81,310	4,211,858,000	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,755	447,596,000	
	オリックス不動産投資法人	36,808	6,621,759,200	
	グローバル・ワン不動産投資法人	13,594	1,455,917,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人	10,749	3,364,437,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,548	2,727,212,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	8,031	1,986,869,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,594	2,506,869,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,802	552,230,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,918	520,192,200	
	ザイマックス・リート投資法人	2,996	351,131,200	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	59,574	4,652,729,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	16,947	2,211,583,500	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	18,474	10,696,446,000	
	スターアジア不動産投資法人	23,066	1,245,564,000	
	スターツプロシード投資法人	3,202	743,184,200	

	タカラレーベン不動産投資法人	8,091	793,727,100	
	トーセイ・リート投資法人	4,098	542,575,200	
	ヒューリックリート投資法人	17,284	2,748,156,000	
	フロンティア不動産投資法人	6,854	3,447,562,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	4,555	814,434,000	
	マリモ地方創生リート投資法人	2,307	300,140,700	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	41,324	6,227,526,800	
	ラサールロジポート投資法人	22,615	3,523,417,000	
	阪急阪神リート投資法人	8,344	1,230,740,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,298	3,411,815,000	
	三菱地所物流リート投資法人	6,347	2,621,311,000	
	産業ファンド投資法人	27,607	4,074,793,200	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	4,334	568,187,400	
	森トラスト総合リート投資法人	13,203	1,889,349,300	
	森ヒルズリート投資法人	21,723	3,321,446,700	
	星野リゾート・リート投資法人	3,231	2,313,396,000	
	積水ハウス・リート投資法人	55,512	4,130,092,800	
	大江戸温泉リート投資法人	2,982	185,778,600	
	大和ハウスリート投資法人	27,846	7,969,525,200	
	大和証券オフィス投資法人	3,827	2,391,875,000	
	大和証券リビング投資法人	25,599	2,920,845,900	
	投資法人みらい	22,443	1,002,079,950	
	東海道リート投資法人	2,240	271,936,000	
	東急リアル・エステート投資法人	12,386	2,541,607,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	6,379	3,801,884,000	
	日本ビルファンド投資法人	21,551	12,478,029,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	12,634	4,567,191,000	
	日本プロロジスリート投資法人	31,139	9,279,422,000	
	日本リート投資法人	6,000	2,037,000,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	12,456	3,848,904,000	
	日本都市ファンド投資法人	93,209	9,628,489,700	
	福岡リート投資法人	9,554	1,594,562,600	
	平和不動産リート投資法人	12,625	1,900,062,500	
	野村不動産マスターファンド投資法人	59,740	9,510,608,000	
投資証券　合計		1,100,576	192,505,859,750	
合計			192,505,859,750	

（注）投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	337,210,094
コール・ローン	83,736,774
投資信託受益証券	6,836,619,284
投資証券	58,832,299,902
派生商品評価勘定	35,452
未収配当金	241,647,845
流動資産合計	66,331,549,351
資産合計	66,331,549,351
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,775
未払金	799,958,085
未払解約金	15,170,000
流動負債合計	815,129,860
負債合計	815,129,860
純資産の部	
元本等	
元本	41,342,647,392
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	24,173,772,099
元本等合計	65,516,419,491
純資産合計	65,516,419,491
負債純資産合計	66,331,549,351

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	46,542,419,917円
同期中追加設定元本額	82,189,071,015円
同期中一部解約元本額	87,388,843,540円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	74,856,900円
ＤＩＡＭ先進国ＲＥＩＴインデックスファンド＜為替ヘッジあり＞（ファンドラップ）	24,449,599円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	3,099,653円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	19,487,977円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	62,551,453円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	39,100,979円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	27,070,555円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	39,566,588円
たわらノーロード　先進国リート	14,763,810,090円
たわらノーロード　先進国リート＜ラップ向け＞	1,812,024,801円
たわらノーロード　先進国リート＜為替ヘッジあり＞	320,652,518円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,961,774,991円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	27,055,041円

たわらノーロード　バランス（標準型）	512,301,106円
たわらノーロード　バランス（積極型）	1,035,475,457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）	222,633,767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）	237,642,056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）	405,677,178円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	598,976円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	30,224,478円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	6,006,832円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	22,817,302円
Ｏｎｅ　ＤＣ　先進国リートインデックスファンド	1,558,733,524円
マネックス資産設計ファンド＜隔月分配型＞	14,049,798円
マネックス資産設計ファンド＜育成型＞	511,767,802円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	41,237,895円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	185,757,051円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	288,624,187円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	529,206,361円
投資のソムリエ	8,434,526,260円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	609,837,865円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	231,792,328円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	537,024,354円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	2,330,232,379円
ワールドアセットバランス（基本コース）	347,351,219円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	234,283,572円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	25,934,555円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	13,019,485円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	3,689,293円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	84,888,057円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	239,536,644円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	172,960,853円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	37,554,612円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	13,793,656円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	8,621,171円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	1,803,168円
ＤＩＡＭパッシブ資産分散ファンド	255,573,651円
ＤＩＡＭ外国リートインデックスファンド＜ＤＣ年金＞	293,784,187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Ⅱ　２０２１－０４（適格機関投資家限定）	826,526円
インカム重視マルチアセット運用ファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	692,408円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	223,271,265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）	3,615,759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）	4,443,460円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	6,255,668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）	77,198,966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）	193,831,515円
ＤＩＡＭグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド（適格機関投資家限定）	1,171,136,561円
計	41,342,647,392円
２．　受益権の総数	41,342,647,392口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在
	当期の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△101,876,032
投資証券	△1,964,153,262
合計	△2,066,029,294

（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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	668,474,342	－	668,508,019	33,677
アメリカ・ドル	503,033,360	－	503,053,120	19,760
イギリス・ポンド	35,409,990	－	35,413,928	3,938
オーストラリア・ドル	47,477,040	－	47,482,448	5,408
カナダ・ドル	13,800,640	－	13,800,864	224
シンガポール・ドル	25,844,000	－	25,848,108	4,108
ニュージーランド・ドル	4,217,700	－	4,217,530	△170
ユーロ	27,023,757	－	27,025,771	2,014
韓国・ウォン	3,193,200	－	3,192,000	△1,200
香港・ドル	8,474,655	－	8,474,250	△405
合計	668,474,342	－	668,508,019	33,677

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5847円 (15,847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

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	144,600.000	81,699.000	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000	
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	309,900.000	148,752.000	
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	645,800.000	177,595.000	
		PRIME US REIT	238,000.000	90,440.000	
	アメリカ・ドル　小計		1,411,000.000	498,486.000 (65,999,546)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	162,893.000	423,521.800	
		ARENA REIT	137,166.000	513,000.840	
		BWP TRUST	181,749.000	707,003.610	
		CENTURIA CAPITAL GROUP	277,234.000	487,931.840	
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	211,587.000	664,383.180	
		CENTURIA OFFICE REIT	170,806.000	259,625.120	
		CHARTER HALL GROUP	183,512.000	2,237,011.280	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	254,913.000	1,142,010.240	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	194,587.000	737,484.730	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	122,555.000	400,754.850	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	516,778.000	346,241.260	
		DEXUS	416,200.000	3,258,846.000	
		DEXUS INDUSTRIA REIT	78,918.000	227,283.840	
		GDI PROPERTY GROUP	210,436.000	157,827.000	
		GOODMAN GROUP	662,814.000	11,824,601.760	
		GPT GROUP	741,360.000	3,180,434.400	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	107,003.000	328,499.210	
		HEALTHCO REIT	92,113.000	162,579.440	
		HMC CAPITAL LTD	75,942.000	331,107.120	

		HOMECO DAILY NEEDS REIT	584,130.000	741,845.100	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,699.000	261,631.450	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	145,143.000	654,594.930	
		MIRVAC GROUP	1,526,781.000	3,313,114.770	
		NATIONAL STORAGE REIT	423,078.000	964,617.840	
		RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	105,257.250	
		REGION RE LTD	442,491.000	1,146,051.690	
		RURAL FUNDS GROUP	141,590.000	335,568.300	
		SCENTRE GROUP	2,003,467.000	5,769,984.960	
		STOCKLAND	923,539.000	3,380,152.740	
		VICINITY CENTRES	1,497,919.000	2,965,879.620	
		WAYPOINT REIT LTD	281,772.000	766,419.840	
オーストラリア・ドル　小計			12,982,518.000	47,795,266.010 (4,365,141,644)	
シンガポール・ドル		AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	201,395.000	249,729.800	
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	812,816.000	845,328.640	
		CAPITALAND CHINA TRUST	454,580.000	531,858.600	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,945,509.000	3,891,018.000	
		CAPLAND ASCENDAS REIT	1,299,160.000	3,546,706.800	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	307,200.000	384,000.000	
		DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	224,800.000	146,120.000	
		EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	50,018.000	
		ESR LOGOS REIT	2,103,640.000	788,865.000	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	393,900.000	248,157.000	
		FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	389,500.000	101,270.000	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	423,000.000	867,150.000	
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,127,964.000	1,297,158.600	
		KEPPEL DC REIT	511,500.000	941,160.000	
		KEPPEL REIT	780,800.000	698,816.000	
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	744,500.000	498,815.000	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	777,320.000	1,748,970.000	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,250,220.000	2,037,858.600	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	896,200.000	1,541,464.000	
		OUE COMMERCIAL REIT	910,555.000	314,141.470	
		PARAGON REIT	394,200.000	356,751.000	

		PARKWAY LIFE REIT	153,300.000	574,875.000	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	207,400.000	160,735.000	
		STARHILL GLOBAL REIT	553,000.000	301,385.000	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	874,890.000	1,172,352.600	
	シンガポール・ドル　小計		17,849,749.000	23,294,704.110 (2,316,425,377)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	133,740.000	197,935.200	
	ユーロ　小計		133,740.000	197,935.200 (28,156,282)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	573,000.000	3,592,710.000	
	香港・ドル　小計		573,000.000	3,592,710.000 (60,896,435)	
投資信託受益証券　合計			32,950,007	6,836,619,284 (6,836,619,284)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,926.000	502,245.480	
		AGREE REALTY CORP	34,792.000	2,482,757.120	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	28,607.000	540,958.370	
		ALEXANDER'S INC.	801.000	179,215.740	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	58,447.000	8,630,284.020	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,698.000	90,530.460	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	20,483.000	545,462.290	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	120,371.000	3,724,278.740	
		AMERICOLD REALTY TRUST	105,726.000	3,113,630.700	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	58,046.000	2,025,805.400	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	60,135.000	442,593.600	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	82,638.000	1,323,034.380	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,069.000	290,299.020	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	58,894.680	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	54,756.000	8,924,680.440	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	25,827.120	
		BOSTON PROPERTIES INC	55,944.000	3,770,066.160	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	91,383.690	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	65,995.000	403,889.400	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	117,776.000	2,549,850.400	
		BROADSTONE NET LEASE INC	67,356.000	1,167,953.040	
		BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	82,247.800	

		CAMDEN PROPERTY TRUST	41,747.000	4,733,692.330	
		CARETRUST REIT INC	38,168.000	717,176.720	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	9,033.000	209,475.270	
		CENTERSPACE	5,508.000	327,285.360	
		CHATHAM LODGING TRUST	19,111.000	232,580.870	
		CITY OFFICE REIT INC	15,657.000	128,230.830	
		CLIPPER REALTY INC	5,086.000	35,652.860	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,646.000	325,867.740	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	43,815.000	1,139,628.150	
		COUSINS PROPERTIES INC	58,757.000	1,430,732.950	
		CTO REALTY GROUTH INC	6,628.000	122,750.560	
		CUBESMART	88,085.000	3,529,565.950	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	82,077.000	666,465.240	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	112,502.000	11,511,204.640	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	67,632.400	
		DOUGLAS EMMETT INC	68,568.000	1,041,547.920	
		EAST GROUP	17,114.000	2,574,459.020	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,578.000	519,015.780	
		ELME COMMUNITIES	34,355.000	620,107.750	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	50,759.000	351,252.280	
		EPR PROPERTIES	29,194.000	1,092,731.420	
		EQUINIX INC	36,187.000	25,155,393.050	
		EQUITY COMMONWEALTH	42,581.000	1,076,873.490	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	68,568.000	4,490,518.320	
		EQUITY RESIDENTIAL	133,152.000	7,822,680.000	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	55,312.000	1,277,707.200	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	25,368.000	5,430,274.080	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	52,428.000	7,679,653.440	
		FARMLAND PARTNERS INC	17,744.000	222,864.640	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	28,688.000	2,921,299.040	
		FIRST INDUSTRIAL RT	51,900.000	2,525,454.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	32,805.000	895,904.550	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	92,892.800	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	100,896.000	5,159,821.440	
		GETTY REALTY CORP	16,720.000	575,836.800	

		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,534.000	282,540.960	
		GLADSTONE LAND CORP	11,727.000	221,640.300	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,924.000	222,821.280	
		GLOBAL NET LEASE INC	41,493.000	558,910.710	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	149,347.000	3,063,106.970	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	210,573.000	5,506,483.950	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	111,310.750	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	40,908.000	1,157,696.400	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	280,240.000	4,609,948.000	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	50,905.000	490,724.200	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	86,856.000	1,450,495.200	
		INDUS REALTY TRUST INC	2,126.000	134,341.940	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	107,255.190	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,909.000	1,120,136.120	
		INVENTRUST PROPERTIES CORP	26,466.000	618,510.420	
		INVITATION HOMES INC	227,441.000	6,780,016.210	
		IRON MOUNTAIN INC	113,873.000	5,711,869.680	
		ISTAR INC	31,134.000	252,185.400	
		JBG SMITH PROPERTIES	38,727.000	747,043.830	
		KILROY REALTY CORP	40,791.000	1,541,899.800	
		KIMCO REALTY	242,318.000	4,938,440.840	
		KITE REALTY GROUP TRUST	84,873.000	1,698,308.730	
		LIFE STORAGE INC	33,347.000	3,268,339.470	
		LTC PROPERTIES INC	15,922.000	569,370.720	
		LXP INDUSTRIAL TRUST	107,271.000	1,142,436.150	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST	234,736.000	2,931,852.640	
		MID AMERICA	45,215.000	6,995,664.800	
		NATIONAL HEALTH INVS INC	16,958.000	886,564.240	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	70,126.000	3,223,692.220	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	32,859.000	1,184,895.540	
		NETSTREIT CORP	20,589.000	383,778.960	
		NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE TRUST	11,872.000	132,610.240	
		NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,811.000	361,955.880	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,765.000	279,443.450	

		OMEGA HEALTHCARE INVS INC	91,971.000	2,478,618.450	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	129,231.360	
		ORION OFFICE REIT INC	21,073.000	178,277.580	
		PARAMOUNT GROUP INC	65,642.000	370,877.300	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	87,740.000	1,057,267.000	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	51,524.000	703,302.600	
		PHILLIPS EDISON & CO INC	45,439.000	1,441,779.470	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	88,668.000	1,330,906.680	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,250.000	438,007.500	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,621.000	306,796.440	
		POSTAL REALTY TRUST INC	7,309.000	107,661.570	
		PROLOGIS INC	360,896.000	41,881,980.800	
		PUBLIC STORAGE	61,828.000	17,384,797.040	
		REALTY INCOME CORP	245,318.000	15,734,696.520	
		REGENCY CENTERS CORP	60,395.000	3,746,301.850	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	48,965.000	716,357.950	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	71,941.000	4,019,343.670	
		RLJ LODGING TRUST	63,507.000	686,510.670	
		RPT REALTY	31,140.000	293,027.400	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	21,377.000	1,754,624.160	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	89,832.000	1,137,273.120	
		SAFEHOLD INC	8,894.000	270,021.840	
		SAUL CENTERS INC	4,804.000	189,854.080	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	62,996.000	489,478.920	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	127,893.000	14,944,297.050	
		SITE CENTERS CORP	72,024.000	908,942.880	
		SL GREEN	25,224.000	894,443.040	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	54,044.000	2,180,675.400	
		STAG INDUSTRIAL INC	69,838.000	2,316,526.460	
		STORE CAPITAL CORP	104,247.000	3,347,371.170	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,921.000	288,015.400	
		SUN COMMUNITIES INC	48,509.000	6,973,168.750	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	82,660.000	790,229.600	
		TANGER FACTORY OUTLET	41,032.000	726,676.720	
		TERRENO REALTY CORP	25,970.000	1,511,973.400	
		THE MACERICH COMPANY	83,863.000	959,392.720	

	THE NECESSITY RETAIL REIT INC	51,710.000	326,290.100	
	UDR INC	119,929.000	4,628,060.110	
	UMH PROPERTIES INC	20,807.000	340,610.590	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,699.000	231,660.700	
	URBAN EDGE PROPERTIES	46,764.000	662,645.880	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,191.000	199,199.800	
	VENTAS INC	156,492.000	7,478,752.680	
	VERIS RESIDENTIAL INC	31,286.000	515,906.140	
	VICI PROPERTIES INC	376,820.000	12,201,431.600	
	VORNADO REALTY TRUST	62,559.000	1,365,037.380	
	WELLTOWER INC	184,867.000	12,753,974.330	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	160,543.600	
	WP CAREY INC	81,464.000	6,546,447.040	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	44,849.000	574,067.200	
アメリカ・ドル　小計		8,608,707.000	381,029,741.840 (50,448,337,820)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	162,134.000	103,441.490	
	AEW UK REIT PLC	58,660.000	59,715.880	
	ASSURA PLC	1,162,717.000	644,145.210	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	307,797.000	265,628.810	
	BIG YELLOW GROUP PLC	68,187.000	780,741.150	
	BRITISH LAND CO PLC	369,097.000	1,514,035.890	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	336,778.000	355,974.340	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	232,446.000	141,559.610	
	CLS HOLDINGS PLC	66,862.000	100,560.440	
	CUSTODIAN REIT PLC	166,617.000	149,622.060	
	DERWENT LONDON PLC	43,623.000	1,053,931.680	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	74,836.000	46,997.000	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	221,510.000	195,371.820	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	99,629.000	523,052.250	
	HAMMERSON PLC	1,603,383.000	402,449.130	
	HOME REIT PLC	286,621.000	108,915.980	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	160,660.000	165,801.120	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	295,183.000	1,967,689.870	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	385,555.000	685,516.790	

		LXI REIT PLC	669,863.000	771,682.170	
		NEWRIVER REIT PLC	124,025.000	103,064.770	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	213,675.000	166,666.500	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	523,160.000	593,263.440	
		PRS REIT PLC/THE	206,206.000	171,769.590	
		REGIONAL REIT LTD	168,230.000	101,779.150	
		SAFESTORE HOLDINGS LTD	82,584.000	777,528.360	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	206,528.000	90,872.320	
		SEGRO PLC	473,952.000	3,748,960.320	
		SHAFTESBURY PLC	113,640.000	405,694.800	
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	487,963.000	484,059.290	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	91,834.260	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	726,105.000	1,042,686.780	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	316,742.000	178,325.740	
		UNITE GROUP PLC	157,519.000	1,459,413.530	
		URBAN LOGISTICS REIT PLC	191,976.000	253,408.320	
		WAREHOUSE REIT PLC	156,027.000	163,204.240	
		WORKSPACE GROUP PLC	56,124.000	261,537.840	
イギリス・ポンド　小計			11,361,223.000	20,130,901.940 (3,240,873,903)	
イスラエル・シュケル		MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,208.000	409,658.210	
		REIT 1 LTD	76,692.000	1,349,779.200	
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	84,874.000	713,281.090	
イスラエル・シュケル　小計			398,774.000	2,472,718.500 (94,500,625)	
カナダ・ドル		ALLIED PROPERTIES REIT	24,754.000	693,112.000	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,627.000	221,148.720	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	102,461.730	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,095.000	452,658.150	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,285.000	127,560.350	
		BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	58,607.400	
		CANADIAN APT PPTYS REIT	32,471.000	1,464,766.810	
		CHOICE PROPERTIES REIT	62,701.000	943,650.050	
		CROMBIE REAL ESTATE INV	18,845.000	303,592.950	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,186.000	307,359.720	

	DREAM INDUSTRIAL REIT	47,425.000	584,276.000	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,013.000	146,641.510	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	56,488.160	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	41,257.000	716,221.520	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,246.000	871,057.980	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	51,480.000	634,748.400	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	19,639.890	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	28,263.000	384,942.060	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	23,270.000	390,703.300	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,096.000	119,416.000	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	110,754.700	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,304.000	121,194.400	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	46,773.000	459,310.860	
	PRIMARIS REIT	18,329.000	272,552.230	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,243.000	63,404.170	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	57,982.000	1,260,528.680	
	SLATE GROCERY REIT	11,204.000	174,446.280	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	78,933.740	
	SMARTCENTRES REIT	27,873.000	764,835.120	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,650.000	809,255.000	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	14,758.000	88,990.740	
カナダ・ドル　小計		724,685.000	12,803,258.620 (1,262,273,267)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	329,282.000	386,906.350	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	400,978.000	822,004.900	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	625,672.000	581,874.960	
	PRECINCT PROPERTIES	504,991.000	641,338.570	
	STRIDE STAPLED GROUP	200,290.000	286,414.700	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	190,316.000	432,017.320	
ニュージーランド・ドル　小計		2,251,529.000	3,150,556.800 (265,812,477)	

ユーロ	AEDIFICA	15,481.000	1,219,902.800	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	31,315.050	
	ALTAREA	1,720.000	220,160.000	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,525.000	168,400.000	
	CARMILA SA	21,980.000	302,884.400	
	COFINIMMO SA	11,672.000	1,031,804.800	
	COVIVIO	18,058.000	1,055,490.100	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	16,907.000	397,990.780	
	GECINA SA	21,362.000	2,149,017.200	
	HAMBORNER REIT AG	25,669.000	178,142.860	
	ICADE	12,223.000	531,700.500	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	19,492.000	63,641.380	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	117,417.000	736,204.590	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	9,928.000	198,560.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	155,162.000	173,160.790	
	KLEPIERRE	76,589.000	1,684,958.000	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,349.000	95,877.210	
	MERCIALYS	30,882.000	312,525.840	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	129,615.000	1,157,461.950	
	MONTEA SCA	4,768.000	325,654.400	
	NSI NV	6,797.000	161,088.900	
	RETAIL ESTATES	4,371.000	271,876.200	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	41,974.000	2,219,585.120	
	VASTNED RETAIL	6,847.000	142,417.600	
	WAREHOUSES DE PAUW	61,002.000	1,709,276.040	
	WERELDHAVE NV	16,132.000	219,395.200	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,862.000	254,339.400	
ユーロ　小計		871,723.000	17,012,831.110 (2,420,075,225)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,294.000	58,902,810.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	58,904,150.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	60,102.000	242,812,080.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	54,718,720.000	
	JR REIT XXVII	55,330.000	243,175,350.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,110.000	76,194,000.000	
	LOTTE REIT CO LTD	46,445.000	187,405,575.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	39,605.000	161,984,450.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	20,887.000	74,671,025.000	

		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,249.000	161,580,550.000	
		SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	39,009,960.000	
		SK REITS CO LTD	29,445.000	162,536,400.000	
	韓国・ウォン　小計		337,485.000	1,521,895,070.000 (161,929,635)	
	香港・ドル	CHAMPION REIT	696,070.000	2,213,502.600	
		LINK REIT	815,620.000	48,896,419.000	
		PROSPERITY REIT	475,000.000	978,500.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	385,000.000	1,282,050.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	892,000.000	1,998,080.000	
	香港・ドル　小計		3,263,690.000	55,368,551.600 (938,496,950)	
投資証券　合計			27,817,816	58,832,299,902 (58,832,299,902)	
合計				65,668,919,186 (65,668,919,186)	

（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　141銘柄	0.10 －	－ 77.00	76.92
イギリス・ポンド	投資証券　38銘柄	－	4.95	4.94
イスラエル・シュケル	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	6.66	－	6.65
カナダ・ドル	投資証券　31銘柄	－	1.93	1.92
シンガポール・ドル	投資信託受益証券　25銘柄	3.54	－	3.53
ニュージーランド・ドル	投資証券　6銘柄	－	0.41	0.40
ユーロ	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　27銘柄	0.04 －	－ 3.69	3.73
韓国・ウォン	投資証券　12銘柄	－	0.25	0.25
香港・ドル	投資信託受益証券　1銘柄 投資証券　5銘柄	0.09 －	－ 1.43	1.52

（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）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,127,451,838
コール・ローン	810,654,563
国債証券	122,130,500,602
派生商品評価勘定	39,891
未収利息	1,343,309,463
前払費用	425,433,351
流動資産合計	126,837,389,708
資産合計	126,837,389,708
負債の部	
流動負債	
未払金	1,640,780,240
未払解約金	250,000
流動負債合計	1,641,030,240
負債合計	1,641,030,240
純資産の部	
元本等	
元本	64,251,853,316
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	60,944,506,152
元本等合計	125,196,359,468
純資産合計	125,196,359,468
負債純資産合計	126,837,389,708

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	67,295,763,529円
同期中追加設定元本額	153,491,081,451円
同期中一部解約元本額	156,534,991,664円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国債券インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	107,018,143円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	2,373,212,341円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	173,454,767円
たわらノーロード　バランス（標準型）	492,673,649円
たわらノーロード　バランス（積極型）	207,461,235円
たわらノーロード　最適化バランス（保守型）	911,954円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	5,330,034円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	61,222,562円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	4,316,537円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	6,078,135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
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	250,043,672円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	387,327,305円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	706,275,379円
投資のソムリエ	20,358,266,706円
クルーズコントロール	53,995,128円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,471,362,128円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	305,966,961円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,609,338,476円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	6,987,721,193円
ワールドアセットバランス（基本コース）	441,610,114円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	288,731,174円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	61,411,967円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	30,826,286円

リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	11,066,622円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	236,029,689円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	787,878,174円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	231,359,150円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	79,069,288円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	32,668,247円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	20,411,537円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	4,283,630円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	20,904,918,138円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	538,630,768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）	1,097,273,451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）	381,680,377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）	10,734,230円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	18,762,551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）	7,546,061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）	156,503,579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）	70,307,786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）	3,220,575,518円
計	64,251,853,316円
２．　受益権の総数	64,251,853,316口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在

１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在 当期の損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	56,433,719
合計	56,433,719

（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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち１年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,100,000,000	－	1,100,039,891	39,891
アメリカ・ドル	1,100,000,000	－	1,100,039,891	39,891
合計	1,100,000,000	－	1,100,039,891	39,891

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

２．　計算日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客電信売買相場の仲

値で評価しております。

３． 換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9485円 (19,485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

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	3,000,000.000	2,916,390.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	7,000,000.000	6,146,700.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	6,000,000.000	4,954,056.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	7,000,000.000	5,796,301.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	9,000,000.000	8,624,340.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	12,000,000.000	11,491,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	10,000,000.000	8,995,200.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	3,000,000.000	1,869,936.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	10,000,000.000	9,265,980.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	10,000,000.000	7,400,580.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	9,000,000.000	7,595,730.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,566,945.290	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	7,000,000.000	5,982,250.820	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,490,150.490	
		BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	7,536,800.000	
		BRAZIL 4.75 01/14/50	15,000,000.000	10,773,561.750	
		BRAZIL 5.625 01/07/41	2,100,000.000	1,801,606.210	
		BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	5,001,800.060	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,663,435.500	

		CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,629,179.440	
		CHINA GOVT INTL BOND 1.95 12/03/24	1,000,000.000	956,860.000	
		COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	5,395,316.430	
		COLOMBIA 3.125 04/15/31	11,000,000.000	8,233,436.750	
		COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	6,563,286.180	
		COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	3,024,657.550	
		COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	4,729,851.750	
		COLOMBIA 4.5 03/15/29	9,000,000.000	7,820,819.730	
		COLOMBIA 5.2 05/15/49	11,000,000.000	7,715,400.000	
		COLOMBIA 5.625 02/26/44	2,000,000.000	1,484,544.060	
		COLOMBIA 8.0 04/20/33	6,000,000.000	6,046,597.020	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	18,000,000.000	16,676,022.060	
		DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	19,000,000.000	14,148,725.250	
		DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	26,200,000.000	23,871,941.090	
		HUNGARY 2.125 09/22/31	13,000,000.000	9,621,066.000	
		HUNGARY 3.125 09/21/51	12,000,000.000	7,193,160.000	
		HUNGARY 5.25 06/16/29	8,000,000.000	7,618,982.320	
		HUNGARY 5.375 03/25/24	4,380,000.000	4,396,092.120	
		HUNGARY 7.625 03/29/41	2,400,000.000	2,628,496.800	
		INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,585,762.910	
		INDONESIA 2.85 02/14/30	2,000,000.000	1,796,899.260	
		INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,681,732.000	
		INDONESIA 3.4 09/18/29	2,200,000.000	2,014,779.640	
		INDONESIA 3.5 01/11/28	4,200,000.000	3,994,476.400	
		INDONESIA 3.85 10/15/30	6,400,000.000	6,016,023.160	
		INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	2,946,153.240	
		INDONESIA 4.125 01/15/25	3,200,000.000	3,180,924.700	
		INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	5,813,599.750	
		INDONESIA 4.35 01/08/27	4,600,000.000	4,558,879.260	
		INDONESIA 4.35 01/11/48	6,600,000.000	5,716,448.490	
		INDONESIA 4.75 01/08/26	2,000,000.000	2,013,189.080	
		INDONESIA 5.25 01/17/42	1,500,000.000	1,457,589.090	
		INDONESIA 7.75 01/17/38	2,500,000.000	3,031,311.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	12,000,000.000	11,863,200.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	11,000,000.000	11,083,600.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	11,000,000.000	11,120,120.000	
		OMAN GOV INTERNTL BOND 6.75 01/17/48	8,000,000.000	7,587,200.000	
		PANAMA 2.252 09/29/32	14,000,000.000	10,491,286.540	
		PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	6,932,800.000	
		PANAMA 3.87 07/23/60	13,000,000.000	8,444,301.320	

		PANAMA 4.5 01/19/63	5,000,000.000	3,566,668.550	
		PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	8,135,324.010	
		PANAMA 4.5 04/16/50	9,300,000.000	7,072,456.000	
		PANAMA 6.4 02/14/35	7,000,000.000	7,165,248.440	
		PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,056,661.490	
		PERU 2.392 01/23/26	2,000,000.000	1,845,498.760	
		PERU 2.78 12/01/60	8,000,000.000	4,689,542.320	
		PERU 2.783 01/23/31	16,000,000.000	13,321,492.640	
		PERU 3.0 01/15/34	13,000,000.000	10,350,870.530	
		PERU 3.55 03/10/51	9,000,000.000	6,459,016.140	
		PHILIPPINES 1.648 06/10/31	3,600,000.000	2,865,780.030	
		PHILIPPINES 2.457 05/05/30	3,800,000.000	3,292,696.420	
		PHILIPPINES 2.65 12/10/45	7,000,000.000	4,699,038.330	
		PHILIPPINES 3.0 02/01/28	9,000,000.000	8,365,749.660	
		PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	5,090,678.110	
		PHILIPPINES 3.7 02/02/42	2,000,000.000	1,625,621.200	
		PHILIPPINES 3.75 01/14/29	7,200,000.000	6,876,268.700	
		REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	6,200,000.000	5,192,803.110	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	5,952,947.540	
		REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	8,000,000.000	6,326,433.360	
		REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	8,200,000.000	7,595,029.740	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	5,000,000.000	3,170,366.650	
		REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	11,000,000.000	8,024,023.590	
		REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	7,600,000.000	7,129,560.000	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	6,000,000.000	4,350,880.440	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	6,200,000.000	5,338,316.680	
		REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	2,876,576.280	
		REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	9,000,000.000	7,727,598.540	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	13,000,000.000	12,975,151.930	
		REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	13,000,000.000	12,577,200.480	
		ROMANIA 3.0 02/14/31	4,000,000.000	3,210,252.000	
		ROMANIA 4.0 02/14/51	10,000,000.000	6,706,780.000	
		ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	3,709,440.000	

		ROMANIA 6.125 01/22/44	6,600,000.000	6,081,867.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	8,000,000.000	6,453,344.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	9,000,000.000	8,613,900.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	10,200,000.000	9,303,664.800	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	2,846,920.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	6,400,000.000	5,010,400.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	13,000,000.000	12,857,000.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	18,000,000.000	17,790,390.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	12,000,000.000	11,870,616.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	6,000,000.000	5,308,590.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	9,000,000.000	8,449,290.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	7,000,000.000	6,834,079.000	
		SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	8,000,000.000	8,424,800.000	
		SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	10,982,928.000	
		SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	2,400,000.000	2,349,000.000	
		SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	17,000,000.000	13,048,146.000	
		SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	4,000,000.000	3,821,760.000	
		SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	12,000,000.000	10,833,600.000	
		STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	7,000,000.000	6,872,600.000	
		STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,801,900.000	
		STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	12,000,000.000	11,604,000.000	
		STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	12,000,000.000	11,817,216.000	
		STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	13,000,000.000	11,950,900.000	
		STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	10,000,000.000	10,103,000.000	
		STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	16,000,000.000	15,588,800.000	

		STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	16,000,000.000	16,116,800.000	
		UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	6,000,000.000	4,441,200.000	
		UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,941,960.000	
		UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	9,000,000.000	7,387,073.910	
		UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,320,646.220	
		UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	9,000,000.000	7,382,757.330	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	5,200,000.000	4,955,288.670	
		UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,574,317.930	
		UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	7,000,000.000	4,650,620.030	
		UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,578,979.540	
		UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	2,400,000.000	2,360,848.200	
		UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	10,000,000.000	7,955,011.200	
		UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	7,000,000.000	5,363,981.840	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	5,000,000.000	3,943,115.400	
		UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	9,000,000.000	8,704,971.270	
		UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	2,000,000.000	1,614,414.320	
		UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	8,000,000.000	7,611,330.240	
		UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	7,000,000.000	6,561,707.250	
		UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	5,052,425.820	
	アメリカ・ドル　小計		1,064,980,000.000 (141,003,352,000)	922,435,805.150 (122,130,500,602)	
国債証券　合計			141,003,352,000 (141,003,352,000)	122,130,500,602 (122,130,500,602)	
合計				122,130,500,602 (122,130,500,602)	

（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 136銘柄	97.55	100.00

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年1月11日現在
資産の部	
流動資産	
預金	4,273,619,660
コール・ローン	4,554,635,942
株式	91,379,149,211
投資信託受益証券	565,157,044
投資証券	93,850,461
派生商品評価勘定	310,762,171
未収入金	128,634,877
未収配当金	102,800,396
差入委託証拠金	1,428,304,744
流動資産合計	102,836,914,506
資産合計	102,836,914,506
負債の部	
流動負債	
未払金	26,995
未払解約金	4,147,285,000
流動負債合計	4,147,311,995
負債合計	4,147,311,995
純資産の部	
元本等	
元本	70,027,488,260
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	28,662,114,251
元本等合計	98,689,602,511
純資産合計	98,689,602,511
負債純資産合計	102,836,914,506

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
２．　デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。 為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
３．　収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。
４．　その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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	2023年1月11日現在
１．　本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,702,663,813円
同期中追加設定元本額	61,570,649,032円
同期中一部解約元本額	45,245,824,585円
元本の内訳	
ファンド名	
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜ＤＣ年金＞	8,939,235,619円
ＤＩＡＭ新興国株式インデックスファンド＜為替ヘッジなし＞（ファンドラップ）	221,373,908円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（安定型）	2,360,482円

ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（中立型）	14,873,547円
ＭＩＴＯ　ラップ型ファンド（積極型）	47,963,706円
グローバル８資産ラップファンド（安定型）	29,778,979円
グローバル８資産ラップファンド（中立型）	20,650,978円
グローバル８資産ラップファンド（積極型）	30,267,775円
たわらノーロード　新興国株式	10,823,532,925円
たわらノーロード　新興国株式＜ラップ向け＞	2,807,493,692円
たわらノーロード　バランス（８資産均等型）	3,448,525,572円
たわらノーロード　バランス（堅実型）	31,496,219円
たわらノーロード　バランス（標準型）	119,283,395円
たわらノーロード　バランス（積極型）	200,926,526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）	104,324,038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）	261,874,040円
たわらノーロード　スマートグローバルバランス（成長型）	186,387,988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）	318,174,216円
たわらノーロード　最適化バランス（安定型）	704,729円
たわらノーロード　最適化バランス（安定成長型）	8,890,183円
たわらノーロード　最適化バランス（成長型）	2,353,416円
たわらノーロード　最適化バランス（積極型）	7,068,234円
たわらノーロード　全世界株式	332,047,143円
Ｏｎｅ　ＤＣ　新興国株式インデックスファンド	723,807,245円
マネックス資産設計ファンド　エボリューション	393,257,262円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国１０）	366,379,426円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国２０）	568,786,720円
ＤＩＡＭ　ＤＣ　８資産バランスファンド（新興国３０）	1,041,246,012円
投資のソムリエ	23,273,396,479円
クルーズコントロール	81,614,813円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞	1,681,147,034円
ＤＩＡＭ　８資産バランスファンドＮ＜ＤＣ年金＞	446,925,491円
投資のソムリエ＜ＤＣ年金＞リスク抑制型	1,872,449,573円
リスク抑制世界８資産バランスファンド	8,129,863,305円
ワールドアセットバランス（基本コース）	622,686,789円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	381,005,501円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４５）	71,800,890円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５５）	36,039,126円
リスク抑制世界８資産バランスファンド（ＤＣ）	12,882,758円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０３５）	265,998,584円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	598,155,802円
９資産分散投資・スタンダード＜ＤＣ年金＞	335,406,294円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）	90,344,235円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）	38,192,588円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）	23,864,626円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６５）	5,012,772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）	11,093,992円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	631,642,248円
リスクコントロール世界８資産バランスファンド（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家専用）	12,405,252円
しあわせの一歩・私募（適格機関投資家限定）	21,852,530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）	228,075,182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）	102,475,330円
計	70,027,488,260円

２．　受益権の総数	70,027,488,260口

（金融商品に関する注記）

１．金融商品の状況に関する事項

項目	自　2022年1月12日 至　2023年1月11日
１．　金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
２．　金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
３．　金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

２．金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年1月11日現在
１．　貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２．　時価の算定方法	(１)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (２)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (３)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
３．　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価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	2023年1月11日現在 当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
株式	△1,983,383,286
投資信託受益証券	△29,037,184
投資証券	6,947,528
合計	△2,005,472,942

（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2023年1月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	716,848,140	－	717,980,995	1,132,855
アメリカ・ドル	716,848,140	－	717,980,995	1,132,855
合計	716,848,140	－	717,980,995	1,132,855

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．　換算において円未満の端数は切捨てております。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年1月11日現在			
	契約額等（円）	うち １年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				
先物取引				
買建	6,768,705,722	－	7,078,335,038	309,629,316
合計	6,768,705,722	－	7,078,335,038	309,629,316

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．　先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年1月11日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.4093円 (14,093円)

附属明細表

第１　有価証券明細表

（１）株式

2023年1月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	55,584	37.650	2,092,737.600	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	17,959	8.140	146,186.260	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,612	148.000	1,126,576.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,272	71.820	594,095.040	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	306,034	1.248	381,930.430	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	131,500	1.380	181,470.000	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.833	72,044.500	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	57,440	3.100	178,064.000	
	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	15.150	658,615.950	

	TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	9.500	438,852.500	
	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	44.190	905,143.770	
	JOYY INC-ADR	4,368	36.890	161,135.520	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	44.530	267,001.880	
	ZAI LAB LTD ADR	8,902	42.260	376,198.520	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	360 DIGITECH INC ADR	12,687	22.980	291,547.260	
	NIO INC ADR	142,587	11.240	1,602,677.880	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	70,412	8.740	615,400.880	
	AUTOHOME INC ADR	7,801	35.730	278,729.730	
	WEIBO CORP ADR	8,996	20.800	187,116.800	
	KANZHUN LTD ADR	19,079	24.050	458,849.950	
	KE HOLDINGS INC ADR	69,275	18.170	1,258,726.750	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,058	49.810	251,938.980	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	2.470	149,281.860	
	PINDUODUO INC ADR	52,294	94.090	4,920,342.460	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	42,886	59.170	2,537,564.620	
	IQIYI INC ADR	40,457	6.030	243,955.710	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	42,575	28.200	1,200,615.000	
アメリカ・ドル　小計		307,779,792		21,634,597.700 (2,864,420,735)	
アラブ首長国連邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	149,810	9.140	1,369,263.400	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	279,091	5.640	1,574,073.240	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	363,295	24.300	8,828,068.500	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	291,901	8.990	2,624,189.990	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	459,487	16.200	7,443,689.400	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	395,030	5.790	2,287,223.700	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	413,204	4.390	1,813,965.560	
	EMIRATES NBD BANK PJSC	190,646	12.950	2,468,865.700	
	Q HOLDING PJSC	222,915	3.900	869,368.500	
	MULTIPLY GROUP	357,097	4.750	1,696,210.750	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	311,988	4.640	1,447,624.320	
アラブ首長国連邦・ディルハム　小計		3,434,464		32,422,543.060 (1,170,778,030)	

インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	316,568	2,558.400	809,907,571.200	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	88,686	347.350	30,805,082.100	
	ASIAN PAINTS LTD	39,680	2,960.350	117,466,688.000	
	EICHER MOTORS LTD	13,332	3,167.550	42,229,776.600	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	27,870	1,651.000	46,013,370.000	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	88,048	1,314.900	115,774,315.200	
	SHREE CEMENT LTD	1,110	23,559.500	26,151,045.000	
	ICICI BANK LTD	536,948	861.350	462,500,159.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	68,931	249.200	17,177,605.200	
	STATE BANK OF INDIA LTD	187,727	595.150	111,725,724.050	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	722.100	20,430,375.300	
	TATA STEEL LTD	758,027	118.850	90,091,508.950	
	TATA MOTORS LTD	170,813	412.900	70,528,687.700	
	JSW STEEL LTD	71,665	745.200	53,404,758.000	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	60,239	769.250	46,338,850.750	
	BAJAJ HOLDINGS & INVESTMENT LTD	2,895	5,859.500	16,963,252.500	
	TATA POWER CO LTD	149,677	206.050	30,840,945.850	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,684	4,326.850	46,228,065.400	
	NESTLE INDIA LTD	3,501	20,023.950	70,103,848.950	
	GAIL INDIA LTD	257,886	98.100	25,298,616.600	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	57,534	1,795.550	103,305,173.700	
	VEDANTA LTD	74,877	316.050	23,664,875.850	
	AXIS BANK LTD	232,796	952.150	221,656,711.400	
	TITAN COMPANY LTD	37,021	2,468.200	91,375,232.200	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	263,145	149.350	39,300,705.750	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	14,144	1,499.850	21,213,878.400	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	351,792	99.150	34,880,176.800	
	LUPIN LTD	17,511	758.850	13,288,222.350	
	MPHASIS LTD	8,886	1,988.750	17,672,032.500	
	ACC LTD	8,629	2,418.950	20,873,119.550	
	BAJAJ FINANCE LTD	28,559	5,904.150	168,616,619.850	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	179,804	2,575.350	463,058,231.400	
	INFOSYS LTD	350,646	1,469.750	515,361,958.500	
	WIPRO LTD	145,337	393.050	57,124,707.850	
	TATA ELXSI LTD	3,406	6,199.800	21,116,518.800	
	MRF LTD	215	94,163.950	20,245,249.250	
	INDIAN OIL CORP LTD	326,644	80.600	26,327,506.400	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	85,753	2,643.850	226,718,069.050	
	TRENT LTD	18,269	1,223.650	22,354,861.850	
	APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,275	4,466.650	45,894,828.750	

HCL TECHNOLOGIES LTD	112,189	1,063.850	119,352,267.650	
DABUR INDIA LTD	63,591	554.600	35,267,568.600	
HERO MOTOCORP LTD	10,549	2,712.050	28,609,415.450	
SRF LTD	15,454	2,270.100	35,082,125.400	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	8,829	2,189.550	19,331,536.950	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	12,180	4,288.700	52,236,366.000	
BHARTI AIRTEL LTD	227,302	792.850	180,216,390.700	
UNITED SPIRITS LTD	31,760	864.100	27,443,816.000	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	100,124	1,011.850	101,310,469.400	
DIVI'S LABORATORIES LTD	14,384	3,501.850	50,370,610.400	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	12,201	8,293.150	101,184,723.150	
AUROBINDO PHARMA LTD	21,102	450.000	9,495,900.000	
HAVELLS INDIA LTD	26,114	1,181.600	30,856,302.400	
TVS MOTOR COMPANY LTD	23,063	1,016.300	23,438,926.900	
INDRAPRASTHA GAS LTD	30,576	426.450	13,039,135.200	
JINDAL STEEL & POWER LTD	44,243	599.000	26,501,557.000	
BIOCON LTD	33,274	257.900	8,581,364.600	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	210,454	78.750	16,573,252.500	
SHRIRAM FINANCE LTD	26,086	1,333.900	34,796,115.400	
PETRONET LNG LTD	65,233	219.850	14,341,475.050	
CIPLA LTD/INDIA	51,586	1,078.700	55,645,818.200	
LARSEN & TOUBRO LTD	70,065	2,106.650	147,602,432.250	
ULTRATECH CEMENT LTD	10,332	6,920.300	71,500,539.600	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	95,636	3,286.400	314,298,150.400	
ADANI ENTERPRISES LTD	28,833	3,646.900	105,151,067.700	
NTPC LTD	385,873	167.950	64,807,370.350	
YES BANK LTD	1,230,792	20.650	25,415,854.800	
AMBUJA CEMENTS LTD	66,469	514.450	34,194,977.050	
BHARAT FORGE LTD	26,609	883.250	23,502,399.250	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	143,357	477.550	68,460,135.350	
ITC LTD	306,365	333.400	102,142,091.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,113	2,529.200	38,223,799.600	
UNITED PHOSPHORUS LTD	49,294	724.650	35,720,897.100	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,851	1,565.350	15,420,262.850	
SIEMENS INDIA LTD	7,173	2,870.150	20,587,585.950	
INFO EDGE INDIA LTD	7,579	3,687.150	27,944,909.850	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,211	911.650	37,570,008.150	
TECH MAHINDRA LTD	62,485	1,002.650	62,650,585.250	
INDIAN HOTELS CO LTD	92,561	310.350	28,726,306.350	
MARICO LTD	53,087	510.050	27,077,024.350	
PAGE INDUSTRIES LTD	589	41,038.400	24,171,617.600	
ABB LTD/INDIA	5,891	2,841.650	16,740,160.150	

	DLF LTD	70,028	373.050	26,123,945.400	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	320,491	211.800	67,879,993.800	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	55,624	796.400	44,298,953.600	
	BAJAJ FINSERV LTD	39,194	1,413.300	55,392,880.200	
	BAJAJ AUTO LTD	6,864	3,574.200	24,533,308.800	
	JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	492.100	19,953,670.800	
	ADANI POWER LTD	77,437	279.200	21,620,410.400	
	MUTHOOT FINANCE LTD	11,565	1,074.350	12,424,857.750	
	COAL INDIA LTD	156,007	216.750	33,814,517.250	
	INDUS TOWERS LTD	64,346	183.200	11,788,187.200	
	PI INDUSTRIES LTD	7,418	3,289.750	24,403,365.500	
	VARUN BEVERAGES LTD	24,592	1,287.300	31,657,281.600	
	TUBE INVESTMENTS OF INDIA LTD	11,416	2,674.600	30,533,233.600	
	LTIMINDTREE LTD	9,300	4,231.600	39,353,880.000	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	33,531	1,895.200	63,547,951.200	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	102,431	600.200	61,479,086.200	
	AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	625.200	9,877,534.800	
	BANDHAN BANK LTD	73,413	246.050	18,063,268.650	
	ADANI TOTAL GAS LTD	27,988	3,656.400	102,335,323.200	
	GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,212.250	15,381,028.000	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	39,547	669.000	26,456,943.000	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	23,890	782.000	18,681,980.000	
	INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	26,775	636.950	17,054,336.250	
	ZOMATO LTD	332,258	54.700	18,174,512.600	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	28,692	566.850	16,264,060.200	
	ADANI TRANSMISSIONS LTD	28,180	2,652.000	74,733,360.000	
	AVENUE SUPERMARTS LTD	16,878	3,877.400	65,442,757.200	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	23,926	1,241.700	29,708,914.200	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	465.650	17,073,988.550	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	9,662	2,044.150	19,750,577.300	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	45,847	1,302.600	59,720,302.200	
インド・ルピー　小計		10,720,284		7,757,136,648.700 (12,644,132,737)	
インドネシア・ルピア	ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	2,040.000	1,840,488,000.000	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,887,506	820.000	2,367,754,920.000	
	UNITED TRACTORS TBK PT	169,701	24,950.000	4,234,039,950.000	

	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	509,800	6,675.000	3,402,915,000.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	822,500	4,690.000	3,857,525,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	2,066,300	5,325.000	11,003,047,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,035,700	3,830.000	19,286,731,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	752,600	6,250.000	4,703,750,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	8,550.000	2,500,020,000.000	
	BANK MANDIRI	1,883,100	9,275.000	17,465,752,500.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	7,173,000	4,430.000	31,776,390,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	717,900	8,725.000	6,263,677,500.000	
	KALBE FARMA TBK PT	2,330,100	2,050.000	4,776,705,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	274,432	7,050.000	1,934,745,600.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,808,900	8,175.000	47,487,757,500.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	287,700	7,250.000	2,085,825,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,380,900	3,140.000	4,336,026,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	10,200.000	2,644,860,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,720.000	4,618,288,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,155.000	2,562,483,000.000	
	BANK JAGO TBK PT	428,300	2,970.000	1,272,051,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	4,400.000	5,422,920,800.000	
インドネシア・ルピア　小計		39,131,321		185,843,753,270.000 (1,579,671,903)	
オフショア・人民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	88.010	1,146,946.320	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	41.180	238,844.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	12.280	278,756.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	12.530	74,428.200	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	113.230	339,690.000	
	HENGDIAN GROUP DMEGC MAGNETICS CO LTD	20,800	22.080	459,264.000	
	DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	5,100	35.100	179,010.000	

GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	48,300	6.180	298,494.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.660	103,920.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	73.380	886,430.400	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	36,800	12.040	443,072.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	17.300	302,750.000	
UNISPLENDOUR CORP LTD	21,240	22.870	485,758.800	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	18.290	192,045.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.610	221,751.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	108.270	129,924.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	22.690	367,578.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	17.110	128,325.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	201.040	422,184.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	19.590	174,351.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	18,300	32.470	594,201.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	24.520	340,828.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	11.830	282,737.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	8.210	258,615.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	4.040	249,672.000	
GEM CO LTD	29,100	7.510	218,541.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	107.690	279,994.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	39.880	275,172.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	3.940	73,284.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	12.670	214,123.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	121.920	1,194,816.000	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	11.150	133,744.250	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	30.990	182,964.960	

ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	18.880	515,650.560	
HANGZHOU BINJIANG REAL ESTATE GROUP CO LTD	29,600	10.540	311,984.000	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	13,360	29.340	391,982.400	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	23.880	157,608.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	19,300	27.210	525,153.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	62.970	585,621.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	31.040	322,816.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	41,400	10.270	425,178.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	31.520	362,480.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	48.290	1,608,057.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	11,300	102.860	1,162,318.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	5,700	30.300	172,710.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	11.030	198,540.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	12.130	218,340.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	85.930	867,893.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	10.610	118,832.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	8.950	90,395.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.760	65,856.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	24.420	344,322.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	15.670	217,813.000	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	300	28.330	8,499.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	23.200	180,960.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	11.880	852,390.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	47.650	285,900.000	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	124.050	761,542.950	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	22.810	81,431.700	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	10.040	127,508.000	

O-FILM TECH CO LTD	8,600	4.880	41,968.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	4.320	158,544.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	7.990	255,680.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	50,467	31.930	1,611,411.310	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	31.820	343,656.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	11,184	38.590	431,590.560	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	11,100	35.150	390,165.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	23.340	161,046.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	28,700	5.510	158,137.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	40.830	200,067.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	8.420	128,826.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	49.400	370,500.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	28.330	141,650.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	3.190	316,129.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	20.460	135,036.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	25.580	250,684.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	10,000	239.000	2,390,000.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	67.900	1,208,620.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	9.110	136,194.500	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	22,300	40.840	910,732.000	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	31,240	14.770	461,414.800	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	15.360	114,401.280	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	108.000	226,800.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	6.020	219,609.600	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	9.160	130,988.000	

LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	29.650	1,335,851.100	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	23.090	690,391.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.400	148,500.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	7.030	501,239.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	12.690	252,531.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	11.620	221,942.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	34.120	402,616.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.260	211,084.000	
GOERTEK INC	25,100	18.280	458,828.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.530	139,089.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	45,200	32.510	1,469,452.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	10.640	421,344.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	135,200	3.870	523,224.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.420	153,386.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	5.370	201,912.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	68,188	13.360	910,991.680	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.170	140,059.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	25.630	702,262.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	55.020	578,810.400	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	84,349	21.000	1,771,329.000	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	10,300	176.800	1,821,040.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	22,900	195.240	4,470,996.000	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	76,600	6.460	494,836.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.670	800,427.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	13.880	637,092.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	34.120	638,044.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	9.030	381,969.000	
PING AN BANK CO LTD	128,100	14.440	1,849,764.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	29,180	19.180	559,672.400	

SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	4.020	588,126.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	18.800	1,035,880.000	
ZTE CORP	19,700	25.490	502,153.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	5.580	159,030.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,100	10.730	516,113.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	33.450	140,490.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	16.250	628,875.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.210	236,531.000	
BYD CO LTD	10,400	266.590	2,772,536.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	105.410	221,361.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	7.690	232,238.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.740	161,634.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	47.150	455,469.000	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	50.240	262,252.800	
LB GROUP CO LTD	11,000	19.790	217,690.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	14.460	258,834.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	24.460	205,464.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	57.100	119,910.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	26.900	258,240.000	
SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	23.560	275,652.000	
SHENZHEN KSTAR SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	6,400	61.100	391,040.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	24.500	196,000.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	23.280	295,656.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	230.500	806,750.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	8.560	257,656.000	

NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	17.710	226,688.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	7.310	250,002.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.690	268,737.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	13.790	76,534.500	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	3,300	295.760	976,008.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.200	112,320.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	65.510	432,366.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	52.200	31,320.000	
NINESTAR CORP	4,500	53.500	240,750.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	13.300	338,086.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.040	102,752.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	57.950	92,720.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	15.310	258,739.000	
SHENZHEN YUTO PACKAGING TECHNOLOGY CO LTD	10,700	33.590	359,413.000	
ASYMCHEM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	149.890	272,799.800	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	149.560	269,208.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	6.490	97,999.000	
SF HOLDING CO LTD	32,000	59.100	1,891,200.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	107.330	193,194.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.750	135,700.000	
BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	59.690	238,760.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	71.810	179,525.000	
GUANGZHOU GREAT POWER ENERGY & TECHNOLOGY CO LTD	4,700	83.340	391,698.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	119,490	5.930	708,575.700	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	6.800	264,520.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	5.220	381,060.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	76.250	175,375.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	24.710	644,931.000	

SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	12,180	53.700	654,066.000	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	19.140	174,174.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,200	15.960	529,872.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	85.790	265,949.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.160	228,600.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	10,372	43.950	455,849.400	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	9.180	356,184.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	39.750	147,075.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	26.330	136,916.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	16.090	245,823.020	
SHENZHEN KEDALI INDUSTRY CO LTD	3,000	134.210	402,630.000	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	60.000	189,000.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	3,900	149.000	581,100.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	60.490	163,323.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	57.020	176,762.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	123.560	259,476.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	61.140	557,352.240	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.850	131,575.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	28.250	84,750.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	18.760	193,228.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	51.800	243,460.000	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	40.340	278,346.000	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD	4,540	74.520	338,320.800	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	121.900	365,700.000	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	55.300	149,310.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	33.420	268,362.600	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	52.990	68,887.000	

WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	66.000	198,000.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	11,600	34.520	400,432.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	34.390	110,048.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.460	94,742.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	87.530	210,072.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	14.770	314,601.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	15.000	198,000.000	
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY SYSTEMS CO LTD	4,200	83.730	351,666.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	81.250	154,375.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	9.400	527,340.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	328.090	2,427,866.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.810	121,055.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	4,400	136.200	599,280.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	23.780	202,130.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	36.560	148,433.600	
SG MICRO CORP	3,150	166.000	522,900.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	15,700	432.000	6,782,400.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	106.380	320,842.080	
WUXI APPTEC CO LTD	17,572	89.530	1,573,221.160	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	36.430	375,229.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	3.520	324,192.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	55.780	407,194.000	
MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	126.500	323,840.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	12.700	377,190.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	73.140	362,043.000	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	251.100	150,660.000	

BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,900	97.990	284,171.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	208.010	228,811.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	69.780	76,758.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	96.780	377,442.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	95.460	171,828.000	
ADVANCED MICRO-FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	100.140	300,420.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	63.460	342,684.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	4.690	351,750.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	71.510	193,077.000	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO	3,500	46.680	163,380.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	33.730	276,586.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	11.940	314,022.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	9,130	85.490	780,523.700	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	111.160	264,560.800	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	63.500	204,470.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	26.440	338,432.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	6.820	298,034.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.920	333,756.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	4.950	349,965.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	27.660	295,962.000	
CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.550	212,040.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	121.440	267,168.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	171.230	215,749.800	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	69.450	201,405.000	

STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	351.000	280,800.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	439.940	422,342.400	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	4.750	878,750.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.730	225,330.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	64.900	149,270.000	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD	32,900	11.720	385,588.000	
TIANSHAN ALUMINUM GROUP CO LTD	43,500	8.280	360,180.000	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	3,900	60.370	235,443.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	178.700	250,180.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	44.890	273,829.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	43.210	69,136.000	
HUBEI FEILIHUA QUARTZ GLASS CO LTD	6,300	51.680	325,584.000	
HANGZHOU CHANG CHUAN TECHNOLOGY CO LTD	6,000	41.250	247,500.000	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	107.300	236,060.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	17,380	64.830	1,126,745.400	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.490	231,044.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	5,055	136.320	689,097.600	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	9,100	58.390	531,349.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	160.700	417,820.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	38.520	288,900.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	54.500	250,700.000	
SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	2,900	79.980	231,942.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	1,600	600.240	960,384.000	

SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	2,200	77.620	170,764.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	3,247	272.370	884,385.390	
SHANGHAI MEDICILON INC	800	223.400	178,720.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.300	426,880.000	
PETROCHINA CO LTD	164,900	4.960	817,904.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	373,700	4.300	1,606,910.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	511,200	2.910	1,487,592.000	
BANK OF CHINA LTD	196,000	3.180	623,280.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	227,300	4.370	993,301.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,700	36.400	826,280.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	46,200	27.440	1,267,728.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	125,100	38.250	4,785,075.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	62,600	49.210	3,080,546.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	17.780	2,309,622.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	151,300	7.280	1,101,464.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	3.430	746,711.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.490	615,825.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,900	1,854.450	14,650,155.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	4.790	1,081,103.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	83,100	20.440	1,698,564.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	24.160	983,312.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.240	200,692.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	144,800	20.630	2,987,224.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.530	539,378.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	3.050	656,055.000	
CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	271,500	5.430	1,474,245.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.800	488,400.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.210	368,347.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	32,500	32.510	1,056,575.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	166,400	4.230	703,872.000	

CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	4.980	952,176.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	169,900	5.830	990,517.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	28.350	657,720.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	59,800	13.610	813,878.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.380	435,420.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	30.240	353,808.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	88,000	15.900	1,399,200.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.130	726,921.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	43,252	39.380	1,703,263.760	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	30,400	26.510	805,904.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	12.110	599,445.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	157,500	5.540	872,550.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	16,300	31.710	516,873.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	45,500	25.750	1,171,625.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	16.880	813,616.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.190	424,447.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	5.600	314,720.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	35.770	622,398.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	9.540	251,856.000	
GEMDALE CORP	39,700	10.160	403,352.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	90.900	1,818,000.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	3.990	314,013.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	140,200	11.410	1,599,682.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	32,344	26.200	847,412.800	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	6.050	180,290.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	11,100	231.980	2,574,978.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	11.460	354,114.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.910	424,975.000	

TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	106.890	470,316.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.270	81,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	4.770	486,540.000	
AIR CHINA LTD	60,700	10.630	645,241.000	
TBEA CO LTD	18,600	20.080	373,488.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	8.390	364,965.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	164,900	3.190	526,031.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	117,300	7.030	824,619.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	33,700	22.000	741,400.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	10,400	58.000	603,200.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.830	205,827.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	18.350	273,415.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.800	130,340.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	17.480	498,180.000	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO LTD	23,700	12.190	288,903.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.400	209,760.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	11,200	41.810	468,272.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.570	605,661.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	13.450	102,220.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	10.190	913,737.300	
CMOC GROUP LIMITED	119,700	4.830	578,151.000	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL CO LTD	115,800	3.100	358,980.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	84,800	6.230	528,304.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	44.320	398,880.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	19.900	400,388.000	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	5,200	31.320	162,864.000	
BBMG CORP	54,200	2.430	131,706.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	33.020	462,280.000	

CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	111,500	5.400	602,100.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	21.880	328,615.720	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.920	343,360.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	26,400	16.820	444,048.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	42.980	441,146.720	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	24.120	391,950.000	
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO LTD	127,500	2.430	309,825.000	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	20.850	68,805.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	96,500	7.840	756,560.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.570	151,630.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	36.320	370,464.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	13.250	250,425.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.370	163,072.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	45.900	211,140.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.690	112,392.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	25.450	384,295.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	49,500	5.040	249,480.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	14,900	14.520	216,348.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.380	172,572.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.210	121,716.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	10.860	253,038.000	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	291.640	1,137,396.000	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	34,100	8.810	300,421.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	294.000	2,199,120.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	14.900	187,740.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	5.750	326,600.000	

SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	7.580	189,500.000	
CHINA NATIONAL SOFTWARE & SERVICE CO LTD	6,500	61.350	398,775.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	16.430	333,529.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	10.580	205,252.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	135,800	3.390	460,362.000	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO LTD	31,900	10.160	324,104.000	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	16.820	211,932.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	11.780	307,458.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	37.540	157,668.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.600	277,120.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	33,900	10.710	363,069.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	21.210	269,367.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	23.960	139,686.800	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.600	136,880.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	26,800	15.010	402,268.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	39.980	1,159,420.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	8,879	45.290	402,129.910	
JCET GROUP CO LTD	10,900	25.100	273,590.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	33.600	228,480.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	127.550	318,875.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	56.930	301,729.000	
HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	15.280	85,568.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	32.810	344,176.900	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	170.620	290,054.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	14.270	288,910.420	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	3.050	190,320.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	18.610	245,652.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	4,524	66.200	299,488.800	

ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	12.170	238,532.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	16.230	318,108.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	9.960	196,212.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	14.550	228,435.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	106.400	180,880.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	43.570	213,493.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	29.580	165,648.000	
BTG HOTELS GROUP CO LTD	14,800	24.400	361,120.000	
SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONICS GROUP CO LTD	4,200	72.830	305,886.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	6,500	70.450	457,925.000	
YUNNAN BOTANEE BIO-TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	146.300	131,670.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	344.000	275,200.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	44.060	114,556.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	134.200	134,200.000	
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	365.000	365,000.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	53.780	381,838.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	71.410	792,651.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.870	1,066,579.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	26.770	310,532.000	
SHANGHAI RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	97,900	5.910	578,589.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	325.200	325,200.000	
IRAY TECHNOLOGY CO LTD	600	472.600	283,560.000	
WUXI AUTOWELL TECHNOLOGY CO LTD	1,600	224.040	358,464.000	
3PEAK INC	1,200	262.010	314,412.000	
ZHEJIANG SUPCON TECHNOLOGY CO LTD	4,800	89.450	429,360.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	42.570	1,999,427.760	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	12.950	164,465.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	135.840	244,512.000	

HUBEI JUMPCAN PHARMACEUTICAL CO LTD	10,200	27.780	283,356.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	19.000	1,201,769.000	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	24,016	80.150	1,924,882.400	
JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	58.350	291,750.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	35.000	245,000.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.960	105,072.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	67.900	475,300.000	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD	22,300	16.460	367,058.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	13.720	558,404.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	5.980	627,900.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	61.680	209,712.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	74.070	392,571.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	124.940	249,880.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.420	617,344.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	13.380	607,452.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	21.550	245,670.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	21.300	42,600.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	19.890	562,887.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	43.830	387,895.500	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	9.400	285,760.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	3,200	155.000	496,000.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	17.050	363,165.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	10,580	74.500	788,210.000	
TOLY BREAD CO LTD	7,056	15.640	110,355.840	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	63.390	181,295.400	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XIAMEN CO LTD	1,000	364.580	364,580.000	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	48.300	142,002.000	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	19.250	217,717.500	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	10.200	502,860.000	

	EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	15.260	244,160.000	
	SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	54.860	246,870.000	
	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	22.280	238,396.000	
オフショア・人民元　小計		15,390,647		245,061,336.490 (4,781,342,724)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	482,352	19.400	9,357,628.800	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	312,267	5.605	1,750,256.530	
	OOREDOO QSC	86,085	9.218	793,531.530	
	QATAR FUEL QSC	67,101	18.690	1,254,117.690	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	49,676	17.800	884,232.800	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	109,350	10.630	1,162,390.500	
	INDUSTRIES QATAR QSC	159,428	14.000	2,231,992.000	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	165,252	20.850	3,445,504.200	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	3.780	943,064.640	
	MASRAF AL RAYAN	554,259	3.420	1,895,565.780	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	3.068	625,298.280	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	2.272	1,026,176.060	
カタール・リアル　小計		2,890,733		25,369,758.810 (918,892,664)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	766,665	0.820	628,665.300	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	242,238	0.559	135,411.040	
	GULF BANK KSCP	185,675	0.305	56,630.870	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	734,176	1.090	800,251.840	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	137,927	0.652	89,928.400	
	MABANEE CO KPSC	68,589	0.837	57,408.990	
	BOUBYAN BANK KSCP	136,266	0.787	107,241.340	
クウェート・ディナール　小計		2,271,536		1,875,537.780 (813,364,469)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	48,542	22,000.000	1,067,924,000.000	
	BANCOLOMBIA SA	29,016	43,050.000	1,249,138,800.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	45,692	34,500.000	1,576,374,000.000	
コロンビア・ペソ　小計		123,250		3,893,436,800.000 (107,610,700)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,055	41.500	1,081,282.500	

JARIR MARKETING CO	6,127	151.600	928,853.200	
ETIHAD ETISALAT CO	38,569	36.200	1,396,197.800	
SAUDI BRITISH BANK	92,679	37.500	3,475,462.500	
AL RAJHI BANK	204,748	75.900	15,540,373.200	
ARAB NATIONAL BANK	58,412	30.500	1,781,566.000	
BANK ALBILAD	47,980	45.050	2,161,499.000	
BANK AL-JAZIRA	41,743	19.180	800,630.740	
BANQUE SAUDI FRANSI	62,154	39.650	2,464,406.100	
RIYAD BANK	136,011	30.750	4,182,338.250	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	18.000	945,972.000	
SAUDI TELECOM CO	157,136	37.900	5,955,454.400	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	21,953	144.800	3,178,794.400	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	94,642	93.500	8,849,027.000	
SAUDI ELECTRICITY CO	87,342	23.600	2,061,271.200	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	23.380	908,453.280	
SAVOLA GROUP	30,777	28.300	870,989.100	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	24,022	12.660	304,118.520	
ALMARAI CO JSC	23,932	53.900	1,289,934.800	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,987	186.000	741,582.000	
EMAAR ECONOMIC CITY	53,833	8.420	453,273.860	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	33,939	34.500	1,170,895.500	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	44.000	633,468.000	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	13.700	1,039,994.400	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	59,592	12.040	717,487.680	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	52,677	11.040	581,554.080	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	53,271	10.700	569,999.700	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	8,157	144.600	1,179,502.200	
ALINMA BANK	98,225	32.300	3,172,667.500	
SAUDI ARABIAN MINING CO	87,447	73.300	6,409,865.100	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	211.800	1,066,624.800	
DALLAH HEALTHCARE CO	4,127	144.000	594,288.000	
SAUDI ARABIAN OIL CO	254,633	31.850	8,110,061.050	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,510	223.800	1,904,538.000	

	ACWA POWER CO	7,940	161.000	1,278,340.000	
	ARABIAN INTERNET & COMMUNICATIONS SERVICES CO	2,627	242.600	637,310.200	
	NAHDI MEDICAL CO	4,279	170.600	729,997.400	
	SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	5,202	185.000	962,370.000	
	ELM CO	2,420	331.600	802,472.000	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	229,007	49.100	11,244,243.700	
サウジアラビア・リアル　小計		2,310,910		102,177,159.160 (3,610,940,805)	
タイ・バーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	148,800	36.500	5,431,200.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	419,600	18.100	7,594,760.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	44.500	5,531,350.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,414,455	4.880	6,902,540.400	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	66,300	155.500	10,309,650.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	177.000	5,203,800.000	
	SHIN CORP PCL	127,600	76.000	9,697,600.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	24.000	9,412,800.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	118,700	203.000	24,096,100.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	666,020	15.800	10,523,116.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	31,700	832.000	26,374,400.000	
	PTT PCL	1,061,900	33.250	35,308,175.000	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	265,000	16.400	4,346,000.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	83,100	58.750	4,882,125.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	9.850	8,137,085.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	82,050	358.000	29,373,900.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	429,100	75.250	32,289,775.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	193,400	70.000	13,538,000.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,097,500	30.750	33,748,125.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	62,700	225.000	14,107,500.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	328,110	33.750	11,073,712.500	
	THAI OIL PCL NVDR	124,700	55.500	6,920,850.000	
	CP ALL PCL NVDR	588,600	71.000	41,790,600.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	8.600	7,455,340.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	138,845	169.000	23,464,805.000	

	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	189,722	41.250	7,826,032.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	234,908	50.250	11,804,127.000	
	JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	54,300	68.750	3,733,125.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	167,600	91.000	15,251,600.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	860,800	9.600	8,263,680.000	
	B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	41.500	4,075,300.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	291,000	55.000	16,005,000.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	142,800	30.000	4,284,000.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	6.150	5,025,780.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	203,033	44.750	9,085,726.750	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	143,300	58.000	8,311,400.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	53.000	3,657,000.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	24.000	7,087,200.000	
	SCB X PCL NVDR	90,300	113.500	10,249,050.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	32,500	102.500	3,331,250.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	55,400	41.250	2,285,250.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	74.750	5,561,400.000	
タイ・バーツ　小計		13,506,843		513,350,230.150 (2,022,599,907)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	8,062	725.000	5,844,950.000	
	CEZ	17,008	802.000	13,640,416.000	
	MONETA MONEY BANK AS	40,915	80.700	3,301,840.500	
チェコ・コルナ　小計		65,985		22,787,206.500 (135,153,200)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,868,510	33.450	229,751,659.500	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,709	24,300.000	138,728,700.000	
	BANCO DE CHILE	4,614,110	83.490	385,232,043.900	
	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,469.000	175,190,002.000	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	6,150.000	248,601,450.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	5,615.000	59,047,340.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,882,457	67.360	126,802,303.520	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	110.000	234,646,720.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	14,822	67,000.000	993,074,000.000	
	FALABELLA SA	80,736	1,799.000	145,244,064.000	
	CENCOSUD SA	152,261	1,300.000	197,939,300.000	

	ENEL CHILE SA	2,415,702	36.900	89,139,403.800	
チリ・ペソ　小計		18,337,656		3,023,396,986.720 (483,029,996)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	335,192	17.030	5,708,319.760	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	73,827	58.150	4,293,040.050	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	147,123	37.860	5,570,076.780	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	479.000	3,549,390.000	
	HEKTAS TICARET TAS	121,118	34.000	4,118,012.000	
	KOC HOLDING AS	71,598	72.250	5,172,955.500	
	SASA POLYESTER SANAYI	46,986	101.000	4,745,586.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	144,586	40.840	5,904,892.240	
	TURK HAVA YOLLARI	57,648	131.200	7,563,417.600	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	137,757	35.840	4,937,210.880	
	TURKIYE IS BANKASI	315,842	11.180	3,531,113.560	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	13,554	475.300	6,442,216.200	
	YAPI VE KREDI BANKASI AS	313,727	9.530	2,989,818.310	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	92,361	40.180	3,711,064.980	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,467	130.000	6,300,710.000	
トルコ・リラ　小計		1,927,196		74,537,823.860 (525,417,120)	
ハンガリー・フォリント	RICHTER GEDEON NYRT	13,796	8,550.000	117,955,800.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,781	2,680.000	109,293,080.000	
	OTP BANK NYRT	22,296	10,920.000	243,472,320.000	
ハンガリー・フォリント　小計		76,873		470,721,200.000 (168,103,014)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	755,500	30.000	22,665,000.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158,120	59.000	9,329,080.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	188,130	104.500	19,659,585.000	
	AYALA CORP	27,283	703.000	19,179,949.000	
	GLOBE TELECOM INC	3,335	2,114.000	7,050,190.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	96,370	203.000	19,563,110.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	318,290	56.200	17,887,898.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46,960	241.000	11,317,360.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	205,155	57.200	11,734,866.000	
	BDO UNIBANK INC	230,062	110.900	25,513,875.800	
	PLDT INC	8,985	1,433.000	12,875,505.000	

	SM PRIME HOLDINGS INC	1,194,575	37.250	44,497,918.750	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	96,820	138.000	13,361,160.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,133	903.500	21,804,165.500	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,720	306.000	7,564,320.000	
	ACEN CORP	763,119	7.300	5,570,768.700	
	MONDE NISSIN CORP	649,200	12.300	7,985,160.000	
フィリピン・ペソ　小計		4,790,757		277,559,911.750 (669,446,751)	
ブラジル・レアル	BRF SA	54,692	9.060	495,509.520	
	VALE SA	396,789	93.580	37,131,514.620	
	RAIA DROGASIL SA	106,600	24.010	2,559,466.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,950	42.190	1,010,450.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	124,000	40.900	5,071,600.000	
	BANCO DO BRASIL SA	87,800	35.300	3,099,340.000	
	ITAUSA SA	544,626	8.720	4,749,138.720	
	GERDAU SA	114,630	31.810	3,646,380.300	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	388,910	27.250	10,597,797.500	
	VIBRA ENERGIA SA	116,600	14.890	1,736,174.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	490,912	24.090	11,826,070.080	
	CCR SA	121,020	10.870	1,315,487.400	
	WEG SA	171,244	37.550	6,430,212.200	
	BANCO BRADESCO SA PREF	545,102	15.100	8,231,040.200	
	BANCO BRADESCO SA	176,892	13.190	2,333,205.480	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64,606	17.120	1,106,054.720	
	SUZANO SA	74,375	49.980	3,717,262.500	
	CPFL ENERGIA SA	23,600	31.740	749,064.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	504,947	25.900	13,078,127.300	
	AMERICANAS SA	69,171	11.910	823,826.610	
	BRASKEM SA	19,900	23.050	458,695.000	
	ENGIE BRASIL SA	25,587	37.850	968,467.950	
	LOCALIZA RENT A CAR	79,789	53.580	4,275,094.620	
	LOJAS RENNER SA	93,720	20.020	1,876,274.400	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	66,304	12.720	843,386.880	
	COSAN SA	127,900	17.050	2,180,695.000	
	TOTVS SA	53,400	28.830	1,539,522.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	110,600	26.180	2,895,508.000	
	JBS SA	83,500	22.650	1,891,275.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	137,962	11.220	1,547,933.640	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	38,498	55.190	2,124,704.620	
	HYPERA SA	41,200	43.250	1,781,900.000	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	626,548	12.860	8,057,407.280	

	MAGAZINE LUIZA SA	271,500	3.050	828,075.000	
	HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	70,900	36.210	2,567,289.000	
	TELEFONICA BRASIL SA	50,528	38.500	1,945,328.000	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	77,500	34.200	2,650,500.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	468,661	4.310	2,019,928.910	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	73,400	14.700	1,078,980.000	
	AMBEV SA	501,895	14.540	7,297,553.300	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	12.590	1,167,093.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	348	11.980	4,169.040	
	SENDAS DISTRIBUIDORA SA	88,800	19.240	1,708,512.000	
	TIM SA	97,900	11.870	1,162,073.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	60,700	27.100	1,644,970.000	
	RUMO SA	144,300	18.130	2,616,159.000	
ブラジル・レアル　小計		7,704,506		176,839,216.290 (4,496,667,592)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	356.000	478,464.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,187	150.850	2,290,958.950	
	BANK PEKAO SA	20,059	99.800	2,001,888.200	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	67,889	62.000	4,209,118.000	
	LPP SA	112	12,530.000	1,403,360.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	3,927	298.800	1,173,387.600	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	138.160	967,258.160	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	85,944	35.000	3,008,040.000	
	CYFROWY POLSAT SA	33,104	19.070	631,293.280	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	113,003	6.668	753,504.000	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	58,500	36.920	2,159,820.000	
	DINO POLSKA SA	4,692	365.000	1,712,580.000	
	ALLEGRO.EU SA	40,496	28.910	1,170,739.360	
	PEPCO GROUP NV	16,587	41.560	689,355.720	
ポーランド・ズロチ　小計		467,845		22,649,767.270 (686,573,335)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	210,200	4.160	874,432.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	680,800	5.720	3,894,176.000	
	DIGI.COM BHD	338,100	3.980	1,345,638.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	88,020	7.000	616,140.000	
	RHB BANK BHD	169,380	5.720	968,853.600	

	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	60,000	6.710	402,600.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	0.850	425,595.000	
	GENTING BHD	250,100	4.800	1,200,480.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	18.580	335,480.480	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	20.600	1,349,464.800	
	IOI CORP BHD	276,613	3.960	1,095,387.480	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	48,500	21.960	1,065,060.000	
	MALAYAN BANKING BHD	507,475	8.790	4,460,705.250	
	MISC BHD	147,380	7.300	1,075,874.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,300	137.500	866,250.000	
	PPB GROUP BHD	70,260	17.520	1,230,955.200	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	22.740	782,256.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	17.160	1,364,220.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	254,200	2.800	711,760.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	142,900	5.200	743,080.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	270,750	9.530	2,580,247.500	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.800	669,610.000	
	DIALOG GROUP BHD	418,344	2.550	1,066,777.200	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,475,450	4.300	6,344,435.000	
	SIME DARBY BERHAD	320,700	2.290	734,403.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	249,800	1.570	392,186.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	317,100	2.900	919,590.000	
	MAXIS BHD	206,000	3.740	770,440.000	
	INARI AMERTRON BHD	330,600	2.640	872,784.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	232,000	8.300	1,925,600.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	177,700	6.030	1,071,531.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.920	1,850,412.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.370	964,896.000	
	MR DIY GROUP M BHD	259,200	2.040	528,768.000	
マレーシア・リンギット　小計		8,918,386		45,500,087.510 (1,377,019,198)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	338,400	13.600	4,602,240.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	130,400	90.380	11,785,552.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,700	270.430	5,868,331.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,660	176.490	3,999,263.400	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	48,500	87.520	4,244,720.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	268,700	153.420	41,223,954.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	121,125	38.430	4,654,833.750	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	15,975	292.750	4,676,681.250	

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	170,000	34.910	5,934,700.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	18,755	497.440	9,329,487.200	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	313,552	82.870	25,984,054.240	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,871,978	18.820	54,050,625.960	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	219,900	35.400	7,784,460.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,700	161.530	7,220,391.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	546,700	72.170	39,455,339.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	34,865	320.090	11,159,937.850	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	101,400	22.650	2,296,710.000	
	BANCO DEL BAJIO SA	85,300	65.970	5,627,241.000	
メキシコ・ペソ　小計		5,374,610		249,898,521.650 (1,736,469,857)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	235,597	1.140	268,580.580	
	NATIONAL BANK OF GREECE	62,656	3.948	247,365.880	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,850	14.600	304,410.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	240,441	1.142	274,583.620	
	MYTILINEOS HOLDINGS	10,944	20.060	219,536.640	
	OPAP SA	21,952	13.260	291,083.520	
	JUMBO SA	12,011	15.840	190,254.240	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	7.140	153,088.740	
	TERNA ENERGY SA	6,102	20.420	124,602.840	
ユーロ　小計		635,124		2,073,506.060 (294,956,237)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	2,357	92,700.000	218,493,900.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	8,603	22,600.000	194,427,800.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,498	79,900.000	279,490,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	2,979	201,000.000	598,779,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	5,051	65,400.000	330,335,400.000	
	COWAY CO LTD	5,833	55,100.000	321,398,300.000	
	KT&G CORP	11,192	91,700.000	1,026,306,400.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	59,500.000	92,641,500.000	
	CJ CORP	1,958	82,800.000	162,122,400.000	
	KAKAO CORP	32,040	60,700.000	1,944,828,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	6,650.000	207,666,200.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,670	454,000.000	758,180,000.000	
	LG UPLUS CORP	25,277	10,850.000	274,255,450.000	

DOOSAN ENERBILITY	44,086	16,400.000	723,010,400.000	
LG H&H CO LTD	981	743,000.000	728,883,000.000	
LG CHEM LTD	5,096	629,000.000	3,205,384,000.000	
LG CHEM LTD	733	287,000.000	210,371,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	46,638	40,900.000	1,907,494,200.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	25,738	20,050.000	516,046,900.000	
S-OIL CORP	4,649	81,600.000	379,358,400.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	12,729	43,750.000	556,893,750.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	30,993	6,100.000	189,057,300.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	34,200.000	214,639,200.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	3,016	188,500.000	568,516,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,896	185,500.000	351,708,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,641	83,600.000	304,387,600.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	74,900.000	328,286,700.000	
HYUNDAI MOBIS	6,285	217,500.000	1,366,987,500.000	
SK HYNIX INC	56,210	86,500.000	4,862,165,000.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	8,580	38,350.000	329,043,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,064	77,800.000	160,579,200.000	
HYUNDAI MOTOR CO	14,554	163,000.000	2,372,302,000.000	
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	2,694	75,300.000	202,858,200.000	
HYUNDAI STEEL CO	9,701	33,350.000	323,528,350.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	28,033	10,150.000	284,534,950.000	
KIA CORPORATION	27,279	63,900.000	1,743,128,100.000	
KOREA ZINC CO LTD	943	547,000.000	515,821,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	24,475	19,700.000	482,157,500.000	
KOREAN AIR CO LTD	19,941	23,700.000	472,601,700.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	2,003	140,500.000	281,421,500.000	
HLB INC	12,499	30,750.000	384,344,250.000	
LG ELECTRONICS INC	10,636	95,100.000	1,011,483,600.000	
LG CORP	9,486	78,800.000	747,496,800.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	9,190.000	140,515,100.000	
NAVER CORP	13,545	193,000.000	2,614,185,000.000	
L&F CO LTD	2,630	181,700.000	477,871,000.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	4,934	59,200.000	292,092,800.000	
KANGWON LAND INC	9,245	23,800.000	220,031,000.000	
POSCO HOLDINGS INC	7,980	291,000.000	2,322,180,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16,885	24,350.000	411,149,750.000	

SAMSUNG SDI CO LTD	5,633	612,000.000	3,447,396,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,494	146,500.000	804,871,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	495,712	60,400.000	29,941,004,800.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	68,830	5,060.000	348,279,800.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	86,098	55,000.000	4,735,390,000.000	
YUHAN CORP	6,167	55,200.000	340,418,400.000	
HANON SYSTEMS	19,141	8,680.000	166,143,880.000	
GS HOLDINGS CORP	4,259	43,250.000	184,201,750.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	13,450.000	319,329,900.000	
CELLTRION INC	10,474	165,000.000	1,728,210,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	29,840	49,400.000	1,474,096,000.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	167,500.000	322,940,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,764	64,500.000	113,778,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	97,300.000	99,732,500.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	3,912	47,450.000	185,624,400.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	7,704	71,100.000	547,754,400.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	140,000.000	424,480,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,862	148,500.000	870,507,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	890	341,500.000	303,935,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	5,540.000	173,363,220.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	275,500.000	395,618,000.000	
SK INC	3,619	189,500.000	685,800,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	39,949	57,800.000	2,309,052,200.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	44,400.000	329,714,400.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,508	56,200.000	140,949,600.000	
HANMI PHARM CO LTD	810	265,000.000	214,650,000.000	
E-MART CO LTD	1,730	100,500.000	173,865,000.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	32,150.000	247,458,550.000	
HD HYUNDAI CO LTD	5,382	56,500.000	304,083,000.000	
BGF RETAIL CO LTD	715	189,500.000	135,492,500.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,129	122,000.000	259,738,000.000	
NETMARBLE CORP	2,597	54,000.000	140,238,000.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	55,475	12,700.000	704,532,500.000	
ECOPRO BM CO LTD	5,510	96,500.000	531,715,000.000	
SD BIOSENSOR INC	4,288	30,300.000	129,926,400.000	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,949	73,800.000	217,636,200.000	
KRAFTON INC	3,153	171,500.000	540,739,500.000	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	2,064	106,500.000	219,816,000.000	

	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	58,500.000	159,120,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	10,144	35,150.000	356,561,600.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	2,779	77,200.000	214,538,800.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	43,550.000	142,147,200.000	
	HYBE CO LTD	1,920	170,500.000	327,360,000.000	
	LOTTE CHEMICAL CORP-RTS	366	45,550.000	16,671,300.000	
	LG ENERGY SOLUTION	3,656	473,500.000	1,731,116,000.000	
	KAKAOBANK CORP	15,775	28,350.000	447,221,250.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,875	134,000.000	251,250,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,640	124,500.000	453,180,000.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,441	117,500.000	991,817,500.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,858	799,000.000	1,484,542,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	3,427	41,800.000	143,248,600.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	34,200.000	157,320,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	9,033	57,100.000	515,784,300.000	
韓国・ウォン　小計		1,665,725		100,215,798,250.000 (10,662,960,934)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	131,000	12.640	1,655,840.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	7.210	1,038,240.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	206,000	5.490	1,130,940.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12,000	135.590	1,627,080.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,000	29.250	3,597,750.000	
	BEIJING ENTERPRISES	58,000	26.600	1,542,800.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	390,000	4.150	1,618,500.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	496,000	7.670	3,804,320.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	154,000	23.950	3,688,300.000	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	67,500	40.950	2,764,125.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	897,600	8.650	7,764,240.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	384,620	22.000	8,461,640.000	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	326,888	37.850	12,372,710.800	
	CITIC LTD	572,000	8.380	4,793,360.000	
	BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	234,000	6.350	1,485,900.000	
	LENOVO GROUP LTD	772,000	6.440	4,971,680.000	
	PETRO CHINA CO LTD	2,136,000	3.580	7,646,880.000	
	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	170,790	10.360	1,769,384.400	
	SHANGHAI FUDAN MICROELECTRONIC	29,000	33.900	983,100.000	

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,577,200	3.840	9,896,448.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	106,000	17.800	1,886,800.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	257,000	16.940	4,353,580.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	80,400	119.700	9,623,880.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	358,000	6.090	2,180,220.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	216,000	6.420	1,386,720.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	152,200	10.960	1,668,112.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	162,000	11.600	1,879,200.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	3.760	1,428,800.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	130,500	7.810	1,019,205.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	287,800	11.940	3,436,332.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	73,500	27.500	2,021,250.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	627,000	12.360	7,749,720.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	88,200	34.200	3,016,440.000	
BYD CO LTD	87,000	207.200	18,026,400.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	200,000	9.700	1,940,000.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	3.530	1,452,919.760	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	300,000	7.270	2,181,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	138.800	1,804,400.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	723,788	7.350	5,319,841.800	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.690	808,110.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	193,200	17.100	3,303,720.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	314,000	10.680	3,353,520.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	753,000	14.240	10,722,720.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	571,000	12.420	7,091,820.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	256,000	13.020	3,333,120.000	
WEICHAI POWER CO LTD	189,440	11.280	2,136,883.200	
TINGYI HOLDING CORP	202,000	13.380	2,702,760.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	66,000	80.200	5,293,200.000	

GUANGDONG INVESTMENTS LTD	332,000	8.730	2,898,360.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	3.930	1,241,880.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	167,333	60.000	10,039,980.000	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	100,000	6.450	645,000.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,022,250	4.770	4,876,132.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	323,000	37.400	12,080,200.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	648,100	362.400	234,871,440.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	659,000	56.750	37,398,250.000	
LI NING CO LTD	244,000	74.150	18,092,600.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	522,000	2.070	1,080,540.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	3.670	1,992,810.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	7.280	1,426,880.000	
ZTE CORP	91,288	18.000	1,643,184.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	339,000	23.250	7,881,750.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	354,250	7.980	2,826,915.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	906,205	4.720	4,277,287.600	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	216,250	8.480	1,833,800.000	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	85,000	17.300	1,470,500.000	
BAIDU INC	229,350	130.600	29,953,110.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,981,530	4.990	49,807,834.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	85,600	97.200	8,320,320.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	334,000	4.600	1,536,400.000	
MINTH GROUP LTD	82,000	22.000	1,804,000.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	7.740	1,253,880.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	370,000	7.010	2,593,700.000	
BANK OF CHINA LTD	8,265,200	2.900	23,969,080.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	84,000	12.320	1,034,880.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	410,470	46.250	18,984,237.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,857,235	4.140	24,248,952.900	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	137,000	9.420	1,290,540.000	

KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	8.730	982,125.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	3.060	873,936.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	6.260	1,308,340.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	74,000	22.000	1,628,000.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	40.250	2,153,375.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	1,280,142	2.900	3,712,411.800	
CMOC GROUP LIMITED	393,000	3.890	1,528,770.000	
CHINA CITIC BANK-H	987,800	3.610	3,565,958.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	72,700	95.650	6,953,755.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	125,000	108.000	13,500,000.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	24.700	864,500.000	
FOSUN INTERNATIONAL	288,028	6.810	1,961,470.680	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.830	1,021,140.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	392,000	4.300	1,685,600.000	
KINGSOFT CORP LTD	98,800	29.550	2,919,540.000	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,145,000	2.110	4,525,950.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	469,000	4.180	1,960,420.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	7.830	1,190,160.000	
DONGYUE GROUP	159,000	9.330	1,483,470.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	71,000	25.300	1,796,300.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	492,000	5.380	2,646,960.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	282,200	18.640	5,260,208.000	
CRRC CORP LTD - H	487,000	3.350	1,631,450.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	154,500	9.390	1,450,755.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	13.220	1,890,460.000	
SINOPHARM GROUP CO	140,400	19.840	2,785,536.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	192,000	4.490	862,080.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	5.640	1,638,572.280	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	257,500	8.160	2,101,200.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	344,000	11.300	3,887,200.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	61,300	13.840	848,392.000	

CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	210,600	16.940	3,567,564.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	99,000	8.250	816,750.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	196,000	26.050	5,105,800.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	21.600	1,907,280.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	2.820	1,771,399.920	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	62,200	7.820	486,404.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	9.100	964,600.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	227,000	2.450	556,150.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	3,054,000	2.750	8,398,500.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	61,500	47.650	2,930,475.000	
FAR EAST HORIZON LTD	188,000	6.570	1,235,160.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	61,200	22.050	1,349,460.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	219,500	17.060	3,744,670.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	343,200	5.150	1,767,480.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	836,000	2.650	2,215,400.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	26.300	1,209,800.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	4.050	1,409,400.000	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	176,000	5.720	1,006,720.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	834,000	5.330	4,445,220.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	57,000	31.950	1,821,150.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	114,000	25.700	2,929,800.000	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING LTD	42,500	62.350	2,649,875.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	228,000	20.750	4,731,000.000	

PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	23.350	1,309,935.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	88,000	15.460	1,360,480.000	
CHINA TOWER CORP LTD	4,292,000	0.890	3,819,880.000	
XIAOMI CORP	1,560,400	11.980	18,693,592.000	
BEIGENE LTD	63,000	150.100	9,456,300.000	
WUXI APPTEC CO LTD	36,912	93.200	3,440,198.400	
MEITUAN	526,110	178.500	93,910,635.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	18.820	2,408,960.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	124,000	24.050	2,982,200.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	490,000	9.800	4,802,000.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	103,000	37.600	3,872,800.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	1.160	1,156,520.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	44,000	18.160	799,040.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	176,500	16.440	2,901,660.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	152,000	7.470	1,135,440.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	128,000	17.700	2,265,600.000	
CHINA FEIHE LTD	374,000	8.250	3,085,500.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,538,668	109.500	168,484,146.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	58.500	1,129,050.000	
HAICHANG OCEAN PARK HOLDINGS LTD	351,000	1.780	624,780.000	
JD.COM INC	223,735	250.000	55,933,750.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	14.000	2,576,000.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	7,600	251.400	1,910,640.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	22.900	1,580,100.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	182,100	77.750	14,158,275.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	228,400	28.900	6,600,760.000	
BILIBILI INC	19,420	214.400	4,163,648.000	
NETEASE INC	202,700	127.100	25,763,170.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	23.400	2,117,700.000	
NONGFU SPRING CO LTD	177,000	44.250	7,832,250.000	
LI AUTO INC	116,000	88.550	10,271,800.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	112,850	73.300	8,271,905.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	38,400	59.250	2,275,200.000	

	CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	69,200	44.200	3,058,640.000	
	HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	94.900	1,195,740.000	
	CHINA VANKE CO LTD-H	174,661	17.000	2,969,237.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	150,400	31.400	4,722,560.000	
	POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	25.300	1,254,880.000	
	XPENG INC	93,600	40.650	3,804,840.000	
	SUPER HI INTERNATIONAL HOLDING LTD	12,400	13.920	172,608.000	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	65,000	30.200	1,963,000.000	
	CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.890	1,971,270.000	
	GF SECURITIES CO LTD	106,000	11.940	1,265,640.000	
	FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	35.250	2,171,400.000	
	HUATAI SECURITIES CO LTD	149,400	9.470	1,414,818.000	
	3SBIO INC	146,500	8.590	1,258,435.000	
	CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	182,500	5.850	1,067,625.000	
	CHINA LITERATURE LTD	38,600	39.350	1,518,910.000	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	23.050	991,150.000	
	DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	3.640	951,860.000	
	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	145,000	10.460	1,516,700.000	
	BOC AVIATION LTD	23,600	65.400	1,543,440.000	
	ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	61,700	26.100	1,610,370.000	
	YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	15.620	1,936,880.000	
	CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	144,000	16.340	2,352,960.000	
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	376,500	67.400	25,376,100.000	
	HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	436,000	2.030	885,080.000	
	GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	37,240	61.650	2,295,846.000	
	C&D INTERNATIONAL INVESTMENT GROUP LTD	70,000	23.750	1,662,500.000	
香港・ドル　小計		87,680,228		1,384,772,852.240 (23,471,899,847)	
台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	48,906	253.000	12,373,218.000	
	ACER INC	257,385	24.000	6,177,240.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	76,387	269.500	20,586,296.500	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,734	323.500	15,118,449.000	
	ASIA CEMENT CORP	236,105	41.800	9,869,189.000	
	TAIWAN BUSINESS BANK	665,088	13.350	8,878,924.800	

VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	96,000	91.700	8,803,200.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	70,000	126.500	8,855,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	133,577	126.500	16,897,490.500	
QUANTA COMPUTER INC	288,704	74.000	21,364,096.000	
EVA AIRWAYS CORP	255,000	28.300	7,216,500.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	65,760	177.500	11,672,400.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	435,421	17.550	7,641,638.550	
CHINA AIRLINES	290,000	19.100	5,539,000.000	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	178,169	34.850	6,209,189.650	
CHINA STEEL CORP	1,208,550	30.850	37,283,767.500	
ADVANTECH CO LTD	46,107	346.000	15,953,022.000	
COMPAL ELECTRONICS INC	390,291	23.250	9,074,265.750	
DELTA ELECTRONICS INC	198,397	283.500	56,245,549.500	
NANYA TECHNOLOGY CORP	134,000	56.500	7,571,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	396,170	115.000	45,559,550.000	
AUO CORP	618,649	16.000	9,898,384.000	
TAIWAN MOBILE CO LTD	168,100	98.300	16,524,230.000	
EVERGREEN MARINE CORP	108,427	155.500	16,860,398.500	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	301,339	32.300	9,733,249.700	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	210.000	9,401,280.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	487.000	9,409,814.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,144	347.000	20,175,968.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	428,320	88.900	38,077,648.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	357,733	72.500	25,935,642.500	
GIANT MANUFACTURING	31,244	201.000	6,280,044.000	
MEDIATEK INC	158,073	694.000	109,702,662.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	769,272	59.200	45,540,902.400	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	926,468	23.500	21,771,998.000	
HOTAI MOTOR CO LTD	31,875	637.000	20,304,375.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	165,000	68.000	11,220,000.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,054,424	22.600	23,829,982.400	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	895,649	41.700	37,348,563.300	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,644,723	13.000	21,381,399.000	

E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,305,380	24.500	31,981,810.000	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,303,150	99.400	129,533,110.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,163,734	31.750	36,948,554.500	
LARGAN PRECISION CO LTD	10,527	2,180.000	22,948,860.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,169,529	15.700	18,361,605.300	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,245,381	8.970	11,171,067.570	
INVENTEC CO LTD	270,005	26.550	7,168,632.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	191,335	66.100	12,647,243.500	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,095,163	17.400	19,055,836.200	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,823,942	23.150	42,224,257.300	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,068,224	27.100	28,948,870.400	
NAN YA PLASTICS CORP	494,529	74.500	36,842,410.500	
POU CHEN CORP	233,990	34.250	8,014,157.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	497,113	67.100	33,356,282.300	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	60,771	276.000	16,772,796.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	112,706	82.600	9,309,515.600	
E INK HOLDINGS INC	83,920	173.500	14,560,120.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	174,336	43.300	7,548,748.800	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	151,509	60.100	9,105,690.900	
TAIWAN CEMENT CORP	656,781	34.600	22,724,622.600	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,555,294	486.000	1,241,872,884.000	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,230,318	45.000	55,364,310.000	
WAN HAI LINES LTD	78,747	76.500	6,024,145.500	
WALSIN LIHWA CORP	246,163	47.200	11,618,893.600	
WINBOND ELECTRONICS CORP	258,059	20.900	5,393,433.100	
YAGEO CORP	37,651	535.000	20,143,285.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	165,608	62.900	10,416,743.200	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	29.300	5,654,900.000	
INNOLUX CORPORATION	910,742	11.750	10,701,218.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	48.000	7,929,744.000	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	26,098	236.500	6,172,177.000	
EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,995	1,505.000	10,527,475.000	
PEGATRON CORP	191,880	64.500	12,376,260.000	

	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	14,928	982.000	14,659,296.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	39,402	176.000	6,934,752.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	145,886	233.000	33,991,438.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	957.000	7,656,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	72,362	108.000	7,815,096.000	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	1,002,944	27.000	27,079,488.000	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	383,437	46.150	17,695,617.550	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	7,029	1,650.000	11,597,850.000	
	WIWYNN CORP	10,133	776.000	7,863,208.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	332,527	101.500	33,751,490.500	
	SILERGY CORP	33,108	519.000	17,183,052.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	326,209	34.000	11,091,106.000	
	PHARMAESSENTIA CORP	20,576	457.500	9,413,520.000	
	MOMO.COM INC	6,600	737.000	4,864,200.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	23,884	470.000	11,225,480.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	20,508	308.000	6,316,464.000	
台湾・ドル　小計		34,923,597		2,944,843,246.220 (12,792,104,577)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,000	311.800	3,118,000.000	
	BIDVEST GROUP LTD	27,847	220.590	6,142,769.730	
	CLICKS GROUP LTD	24,286	282.780	6,867,595.080	
	DISCOVERY LTD	49,120	131.940	6,480,892.800	
	GOLD FIELDS LTD	89,222	205.500	18,335,121.000	
	REMGRO LTD	54,645	135.650	7,412,594.250	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	108.000	3,563,028.000	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	60,894	67.730	4,124,350.620	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,734	221.590	5,480,807.060	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,969	1,895.930	17,004,596.170	
	MTN GROUP LTD	174,803	128.900	22,532,106.700	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	44,096	371.780	16,394,010.880	
	FIRSTRAND LTD	529,869	63.020	33,392,344.380	
	NASPERS LTD	22,668	3,236.010	73,353,874.680	
	NEDBANK GROUP LTD	48,729	213.650	10,410,950.850	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,841	1,473.750	8,608,173.750	
	SASOL LTD	58,516	280.030	16,386,235.480	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	52,979	238.800	12,651,385.200	
	MR PRICE GROUP LTD	26,025	168.410	4,382,870.250	

	STANDARD BANK GROUP LTD	142,458	169.780	24,186,519.240	
	SPAR GROUP LTD/THE	21,004	128.510	2,699,224.040	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	99,816	69.250	6,912,258.000	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	139.860	5,393,421.180	
	ABSA GROUP LTD	86,956	198.470	17,258,157.320	
	SANLAM LTD	189,923	52.340	9,940,569.820	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	88,373	232.430	20,540,536.390	
	KUMBA IRON ORE LTD	7,079	539.000	3,815,581.000	
	VODACOM GROUP PTY LTD	69,076	123.520	8,532,267.520	
	NEPI ROCKCASTLE NV	51,129	105.450	5,391,553.050	
	OLD MUTUAL LTD	479,238	11.280	5,405,804.640	
	REINET INVESTMENTS SCA	12,515	332.970	4,167,119.550	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	166,142	20.530	3,410,895.260	
	MULTICHOICE GROUP LTD	34,585	120.860	4,179,943.100	
	SIBANYE STILLWATER LTD	280,877	51.420	14,442,695.340	
	NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	32,404	204.430	6,624,349.720	
	BID CORP LTD	35,633	350.730	12,497,562.090	
南アフリカ・ランド　小計		3,182,005		432,040,164.140 (3,365,592,879)	
合計		573,310,273		91,379,149,211 (91,379,149,211)	

（２）株式以外の有価証券

2023年1月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・レアル	BANCO BTG PACTUAL SA	126,200.000	2,983,368.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,162,800.000	
		ENERGISA SA	24,300.000	1,008,207.000	
		KLABIN SA	78,200.000	1,584,332.000	
	ブラジル・レアル　小計		266,700.000	6,738,707.000 (171,351,842)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,625,775.000	13,997,922.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	54,600.000	7,147,686.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	199,700.000	30,685,902.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	246,900.000	4,841,709.000	
	メキシコ・ペソ　小計		2,126,975.000	56,673,219.750 (393,805,202)	
投資信託受益証券　合計			2,393,675	565,157,044 (565,157,044)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	296,300.000	7,229,720.000	
	メキシコ・ペソ　小計		296,300.000	7,229,720.000 (50,237,154)	

	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	380,859.000	5,598,627.300	
	南アフリカ・ランド　小計		380,859.000	5,598,627.300 (43,613,307)	
投資証券　合計			677,159	93,850,461 (93,850,461)	
合計				659,007,505 (659,007,505)	

（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	2.90	－	－	3.11
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式　11銘柄	1.19	－	－	1.27
インド・ルピー	株式　113銘柄	12.81	－	－	13.74
インドネシア・ルピア	株式　22銘柄	1.60	－	－	1.72
オフショア・人民元	株式　467銘柄	4.84	－	－	5.19
カタール・リアル	株式　12銘柄	0.93	－	－	1.00
クウェート・ディナール	株式　7銘柄	0.82	－	－	0.88
コロンビア・ペソ	株式　3銘柄	0.11	－	－	0.12
サウジアラビア・リアル	株式　40銘柄	3.66	－	－	3.92
タイ・バーツ	株式　42銘柄	2.05	－	－	2.20
チェコ・コルナ	株式　3銘柄	0.14	－	－	0.15
チリ・ペソ	株式　12銘柄	0.49	－	－	0.52
トルコ・リラ	株式　15銘柄	0.53	－	－	0.57
ハンガリー・フォリント	株式　3銘柄	0.17	－	－	0.18
フィリピン・ペソ	株式　17銘柄	0.68	－	－	0.73
ブラジル・レアル	株式　46銘柄	4.56	－	－	5.07
	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	0.70	－	－	0.75
マレーシア・リンギット	株式　34銘柄	1.40	－	－	1.50
メキシコ・ペソ	株式　18銘柄	1.76	－	－	2.37
	投資信託受益証券　4銘柄	－	0.40	－	
	投資証券　1銘柄	－	－	0.05	
ユーロ	株式　10銘柄	0.30	－	－	0.32
韓国・ウォン	株式　103銘柄	10.80	－	－	11.59
香港・ドル	株式　193銘柄	23.78	－	－	25.50

台湾・ドル	株式	88銘柄	12.96	－	－	13.90
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.41	－	－	3.70
	投資証券	1銘柄	－	－	0.04	

（注）「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	2,047,949,498円
Ⅱ　負債総額	2,411,028円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	2,045,538,470円
Ⅳ　発行済数量	2,012,005,635口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0167円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	906,007,917円
Ⅱ　負債総額	1,301,806円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	904,706,111円
Ⅳ　発行済数量	889,702,821口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0169円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	557,832,494円
Ⅱ　負債総額	2,414,836円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	555,417,658円
Ⅳ　発行済数量	547,637,526口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0142円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	403,120,588,516円
Ⅱ　負債総額	895,818,000円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	402,224,770,516円
Ⅳ　発行済数量	325,931,703,612口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2341円

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	393,671,022,265円
Ⅱ　負債総額	9,089,626,373円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	384,581,395,892円
Ⅳ　発行済数量	114,413,471,080口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3613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

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	255,072,395,131円
Ⅱ　負債総額	1,306,761,995円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	253,765,633,136円
Ⅳ　発行済数量	208,778,770,853口
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2155円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**822,406,574,455円**
Ⅱ　負債総額	**82,299,750円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**822,324,274,705円**
Ⅳ　発行済数量	**137,257,450,597口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**5.9911円**

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**197,552,982,976円**
Ⅱ　負債総額	**1,769,159,390円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**195,783,823,586円**
Ⅳ　発行済数量	**86,012,553,753口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**2.2762円**

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**72,913,793,053円**
Ⅱ　負債総額	**1,313,319,447円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**71,600,473,606円**
Ⅳ　発行済数量	**42,834,243,528口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.6716円**

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**140,703,948,426円**
Ⅱ　負債総額	**7,152,170,914円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**133,551,777,512円**
Ⅳ　発行済数量	**68,033,401,700口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.9630円**

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年1月31日現在

Ⅰ　資産総額	**101,634,115,011円**
Ⅱ　負債総額	**15,360,587円**
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	**101,618,754,424円**
Ⅳ　発行済数量	**71,134,790,439口**
Ⅴ　１口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	**1.4285円**

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額（2023年1月31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（2023年1月31日現在）

① 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

② 投資運用の意思決定機構

1.投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2.運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年1月31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	1,454,101,154,791
追加型株式投資信託	799	14,530,011,226,224
単位型公社債投資信託	24	46,366,500,374
単位型株式投資信託	215	1,136,549,215,059
合計	1,064	17,167,028,096,448

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
ソフトウエア		2,878		3,107
ソフトウエア仮勘定		1,109		1,449
電話加入権		3		3
投資その他の資産		11,153		10,153
投資有価証券		261		241
関係会社株式		5,299		5,349
長期差入保証金		1,324		1,102
繰延税金資産		3,676		3,092
その他		591		367
固定資産計		16,264		15,983
資産合計		104,757		103,810

（単位：百万円）

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

（２）【損益計算書】

（単位：百万円）

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

（単位：百万円）

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

（３）【株主資本等変動計算書】

第36期（自　2020年4月1日　至　2021年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

第37期（自　2021年4月1日　至　2022年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

重要な会計方針

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

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

（会計上の見積りの変更）

第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
当社は、当事業年度において、新しい働き方を踏まえたオフィスレイアウトの見直しを決定しました。これに伴い、当事業年度において、本社オフィスに係る内部造作物等の有形固定資産の見積耐用年数の見直しを行い、将来にわたり変更しております。また、本社オフィスの不動産賃借契約に伴う原状回復義務として認識していた資産除去債務について、退去時に必要とされる原状回復費用及び使用見込期間の見積の変更を行っております。これにより、従来の方法と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ334百万円減少しております。

（会計方針の変更）

1．収益認識に関する会計基準等の適用

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

2．時価の算定に関する会計基準等の適用

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

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

（未適用の会計基準等）

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

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

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

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当該会計基準等の適用による影響は、評価中であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

※1. 有形固定資産の減価償却累計額

（百万円）

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

（損益計算書関係）

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

（百万円）

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

※2. オフィス再編費用

オフィス再編費用は、主に本社オフィスレイアウトの見直しによるものです。

（株主資本等変動計算書関係）

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

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

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

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

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

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

営業債務である未払手数料は、１年以内の支払期日であります。

（3）金融商品に係るリスク管理体制

①信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

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

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

②市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

③資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第36期（2021年3月31日現在）

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

第37期（2022年3月31日現在）

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

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

（注2）金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第36期（2021年3月31日現在）

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

第37期（2022年3月31日現在）

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

3. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

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

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

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

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

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

時価で貸借対照表に計上している金融商品

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

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

（注1）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

金銭の信託

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

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

（注2）市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次の通りであります。

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

（百万円）

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

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

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

2．その他有価証券

第36期（2021年3月31日現在）

（百万円）

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

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

第37期（2022年3月31日現在）

（百万円）

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

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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

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

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

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

（退職給付関係）

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

（1）退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（百万円）

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

（2）退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（百万円）

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

（3）退職給付費用及びその内訳項目の金額

（百万円）

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

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

（4）数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主要な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。

（企業結合等関係）

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

（1）被取得企業の取得原価及びその内訳

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

（2）発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

（3）企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

（1）貸借対照表項目

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

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

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

（2）損益計算書項目

	第36期 （自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）
営業収益	－百万円	－百万円
営業利益	△8,823百万円	△8,429百万円
経常利益	△8,823百万円	△8,429百万円
税引前当期純利益	△8,823百万円	△8,429百万円
当期純利益	△7,288百万円	△7,015百万円
1株当たり当期純利益	△182,220円85銭	△175,380円68銭

（注）営業利益には、のれん及び顧客関連資産の償却額が含まれております。

のれんの償却額	3,811百万円	3,811百万円
顧客関連資産の償却額	5,016百万円	4,618百万円

（資産除去債務関係）

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

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

（収益認識関係）

1．収益の分解情報

当事業年度の収益の構成は次の通りです。

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

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

2．収益を理解するための基礎となる情報

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

（セグメント情報等）

1．セグメント情報

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

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

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（関連当事者情報）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び法人主要株主等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（2）子会社及び関連会社等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当はありません。

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

該当はありません。

（3）兄弟会社等

第36期（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	6,435	未払手数料	1,457
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	12,767	未払手数料	2,524

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

属性	会社等の名称	住所	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関係内容		取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
						役員の兼任等	事業上の関係				
親会社の子会社	株式会社みずほ銀行	東京都千代田区	14,040億円	銀行業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	7,789	未払手数料	1,592
	みずほ証券株式会社	東京都千代田区	1,251億円	証券業	―	―	当社設定投資信託の販売	投資信託の販売代行手数料	16,373	未払手数料	2,651

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

株式会社みずほフィナンシャルグループ

（東京証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

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

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

(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		1,202
建物	※1	1,055
器具備品	※1	138
リース資産	※1	8
無形固定資産		4,948
ソフトウエア		3,151
ソフトウエア仮勘定		1,794
電話加入権		2
投資その他の資産		10,147
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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 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
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産(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 (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エアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。 (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。
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	(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。 (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。 (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。 ①退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当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。 ②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年）による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数（5年または10年）による定額法により按分した額を、それぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。 (4) 時効後支払損引当金は、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。
6. 重要な収益及び費用の計上基準	当社は、資産運用サービスから委託者報酬、運用受託報酬及び投資助言報酬を稼得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。 (1) 委託者報酬 委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産総額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を投資信託によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。 (2) 運用受託報酬 運用受託報酬は、投資顧問契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年1回又は2回受取ります。当該報酬は顧問口座の運用期間にわたり収益として認識しております。 (3) 投資助言報酬 投資助言報酬は、投資助言契約で定められた報酬に基づき、確定した報酬を顧問口座によって主に年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。 (4) 成功報酬 成功報酬は、対象となる投資信託または顧問口座の特定のベンチマークまたはその他のパフォーマンス目標を上回る超過運用益に対する一定割合として認識されます。当該報酬は成功報酬を受領する権利が確定した時点で収益として認識しております。
7. 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。

（会計方針の変更）

「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 A種種類株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日

（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			
その他有価証券	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	－	－	－	－
その他有価証券	－	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

①MHAMを吸収合併存続会社、新光投信を吸収合併消滅会社とする吸収合併、②TBを吸収分割会社、吸収合併後のMHAMを吸収分割承継会社とし、同社がTB資産運用部門に係る権利義務を承継する吸収分割、③DIAMを吸収合併存続会社、MHAMを吸収合併消滅会社とする吸収合併の順に実施しております。

4.結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5.企業結合の主な目的

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

6.合併比率

「3. 企業結合の方法」③の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

（*）普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7.交付した株式数

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

8.経済的持分比率（議決権比率）

MHFGが企業結合直前に所有していた当社に対する経済的持分比率　50.00%
MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率　20.00%
MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率　70.00%
なお、MHFGが所有する議決権比率については50.00%から51.00%に異動しております。

9.取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10.会計処理

「企業結合に関する会計基準」（企業結合会計基準第21号　平成25年9月13日公表分）及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第10号　平成25年9月13日公表分）に基づき、「3. 企業結合の方法」①の吸収合併及び②の吸収分割については共通支配下の取引として処理し、③の吸収合併については逆取得として処理しております。

11.被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

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

(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

①営業収益

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

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

（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) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

(4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

(5) 上記（3）（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社（以下「PPAM」といいます。）の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2)販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「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。
株式会社横浜銀行	215,628	日本において銀行業務を営んでおります。
第一生命保険株式会社	60,000	日本において保険業務を営んでおります。
損保ジャパンＤＣ証券株式会社	3,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

（注）資本金の額は2022年3月末日現在

（注）確定拠出年金向けの取扱販売会社を含みます。

(3) 投資顧問会社

名称	Asset Management One USA Inc.
資本金の額	400万米ドル（2022年12月末日現在)
事業の内容	米国において投資顧問業務を営んでいます。

２【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

(1)委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分

(2)信託財産の計算

(3)信託財産に関する報告書の作成

(4)その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

(1)募集の取扱い

(2)追加設定の申込事務

(3)信託契約の一部解約事務

(4)受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い

(5)受益者に対する収益分配金の再投資

(6)受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付

(7)その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

３【資本関係】

委託会社は、Asset Management One USA Inc.の株式を、100%保有しています。

※持株比率5%以上を記載します。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類を提出いたしました。

提出年月日	提出書類
2022年4月11日	有価証券報告書
2022年4月11日	有価証券届出書
2022年10月11日	半期報告書
2022年10月11日	有価証券届出書

独立監査人の監査報告書

２０２２年5月２６日

アセットマネジメントOne株式会社
取　締　役　会　　御　中

EY新日本有限責任監査法人
東　　京　　事　　務　　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　丘本　正彦

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　　長谷川　敬

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているアセットマネジメントOne株式会社の２０２１年４月１日から２０２２年３月３１日までの第３７期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、アセットマネジメントOne株式会社の２０２２年３月３１日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

その他の記載内容
その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。
当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任
経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。
財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。
監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２３年3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
業 務 執 行 社 員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）の２０２２年1月１２日から２０２３年1月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０４０）の２０２３年1月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２３年3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
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）の２０２２年1月１２日から２０２３年1月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０５０）の２０２３年1月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

２０２３年3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
業務執行社員　公認会計士　　稲　葉　　宏　和

監査意見
当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）の２０２２年1月１２日から２０２３年1月１１日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、投資のソムリエ（ターゲット・イヤー２０６０）の２０２３年1月１１日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

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

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注１）上記の監査報告書の原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
（注２）ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

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）ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれておりません。