

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2023年7月12日提出
【発行者名】	アセットマネジメントOne株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 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
【電話番号】	03-6774-5100
【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	たわらノーロード 最適化バランス(保守型) たわらノーロード 最適化バランス(安定型) たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) たわらノーロード 最適化バランス(成長型) たわらノーロード 最適化バランス(積極型)
【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券の金額】	たわらノーロード 最適化バランス(保守型) 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス(安定型) 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型) 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス(成長型) 1兆円を上限とします。 たわらノーロード 最適化バランス(積極型) 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

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

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき、1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

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

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

（７）【申込期間】

継続申込期間：2023年7月13日から2024年1月12日まで

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

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

（８）【申込取扱場所】

各ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

（９）【払込期日】

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

(10)【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

振替受益権について

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

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

(参考)

投資信託振替制度

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

各ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

各ファンドの信託金限度額は、各々1兆円とします。ただし、委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

<ファンドの特色>

1 ファンドごとに目標とするリスク水準(標準偏差)*1、*2を設定します。

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

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

●目標リスク水準に応じて、5つのファンドを用意しました。

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

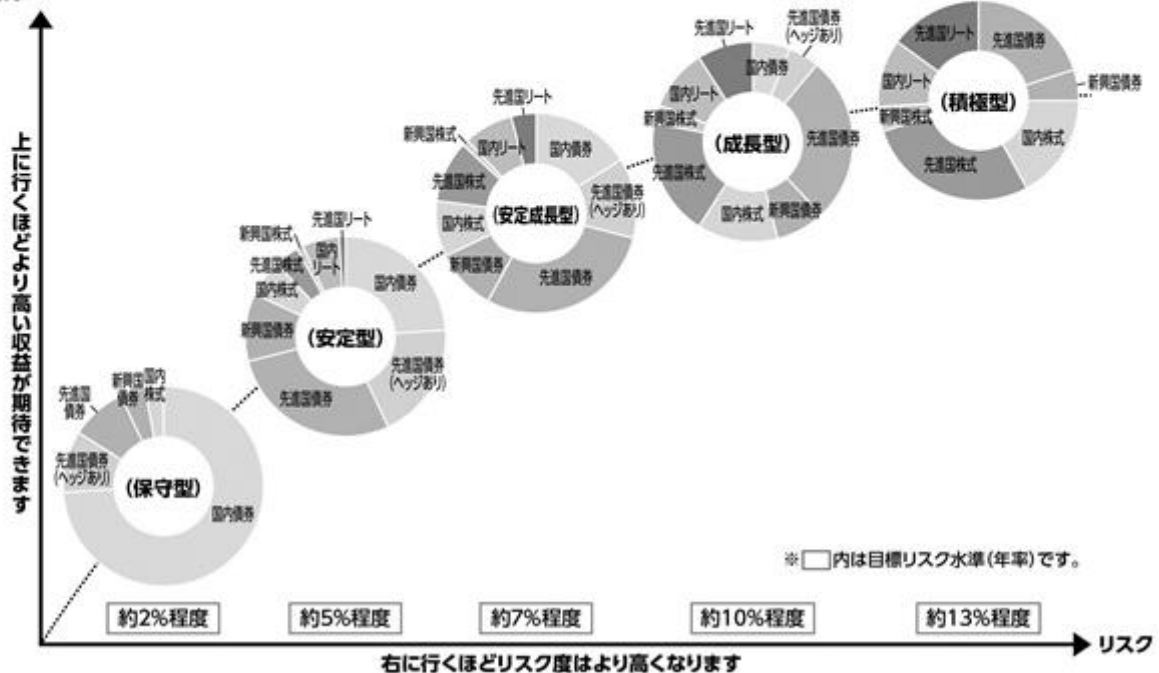
※目標リスク水準は今後変更される場合があります。

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

※各ファンドの資産別の投資配分のイメージは、2023年4月末現在のものです。

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

期待リターン



※上記はイメージ図であり、リスク水準とリターン特性を正確に表すものではなく、実際にはこれと異なる場合があります。また、将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

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

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

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

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

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

3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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

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

運用プロセス

投資資産配分案の助言

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

ポートフォリオの構築

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

みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社（FT社）について

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

■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

< 商品分類 >

- ・ 商品分類表
各ファンド

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

(注) 各ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

- ・ 商品分類定義

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

< 属性区分 >

・属性区分表

各ファンド

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

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

(注2) 各ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

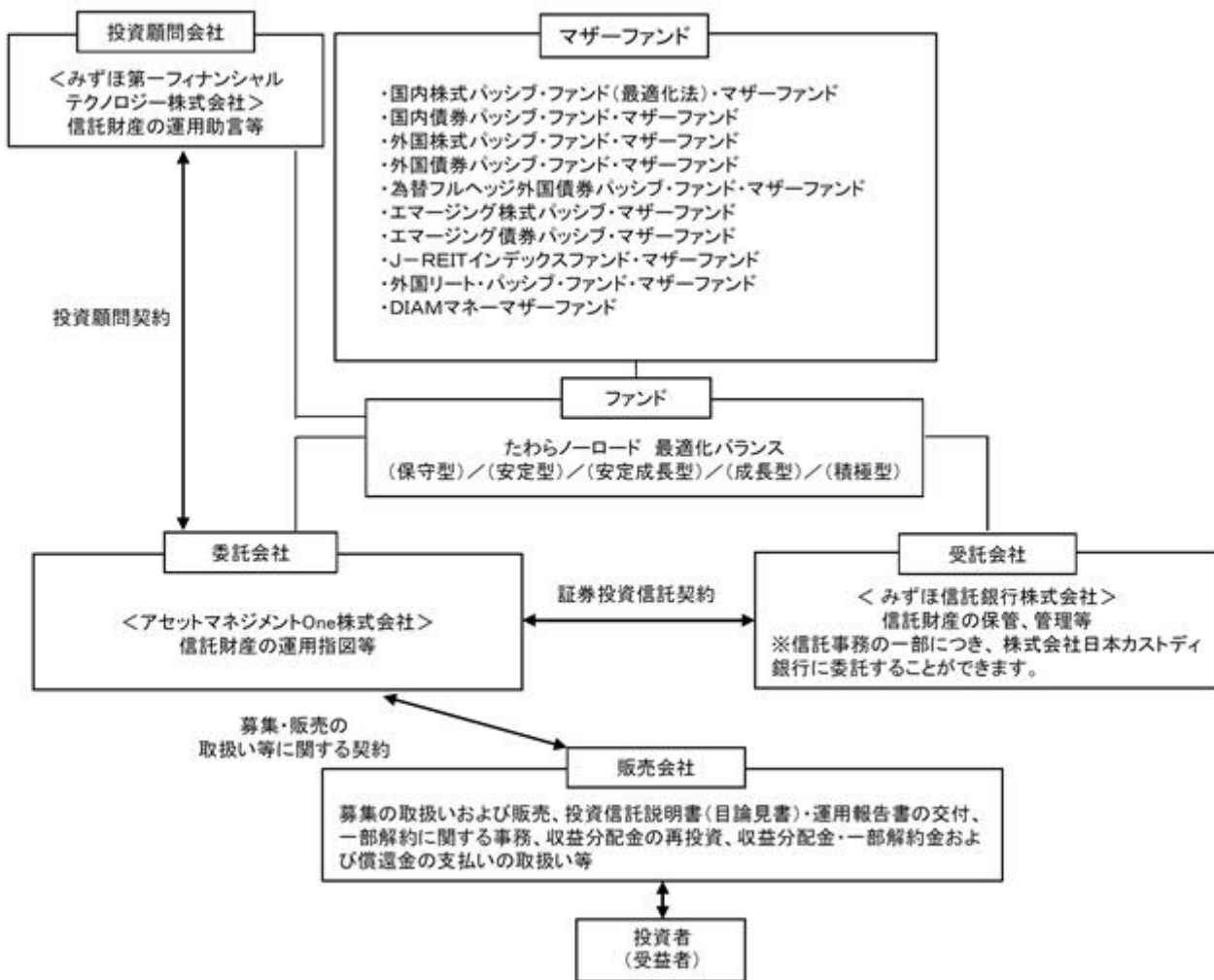
（注2）各ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

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

（2）【ファンドの沿革】

2018年1月24日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



・「証券投資信託契約」の概要

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

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

・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

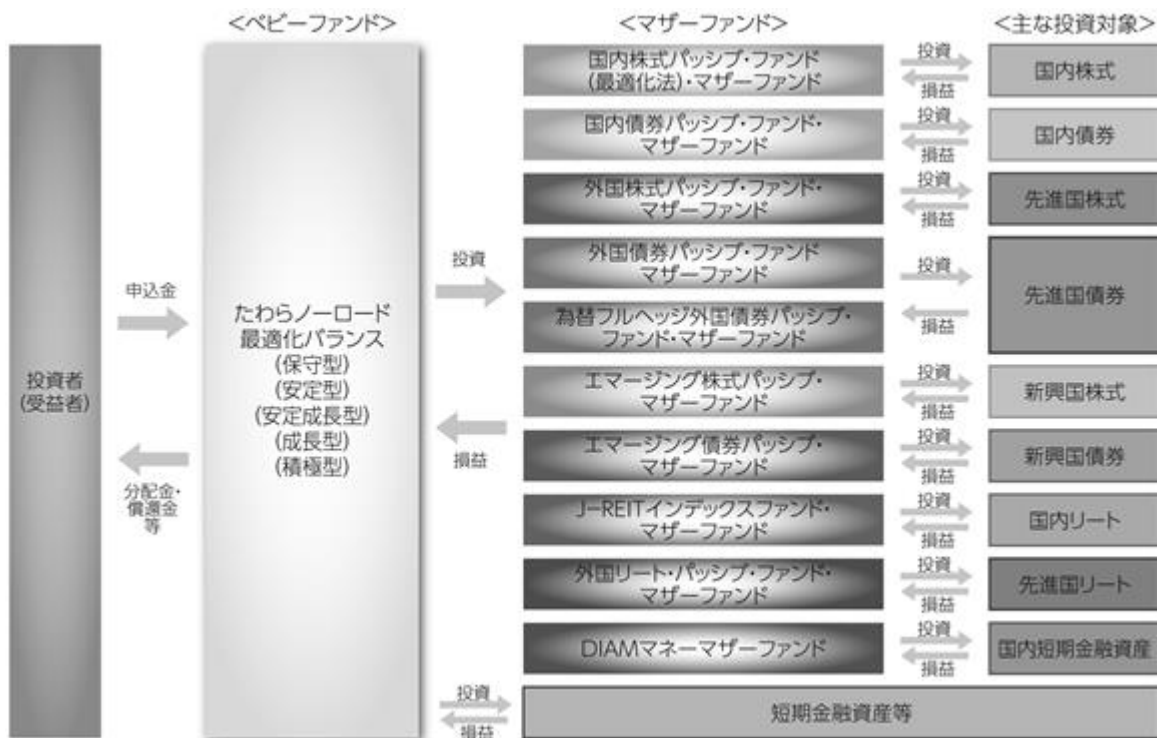
委託会社と投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）の間においては、運用にかかる助言契約が締結されております。

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

ファミリーファンド方式とは

各ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

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



委託会社の概況

名称：アセットマネジメントOne株式会社

本店の所在の場所：東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

資本金の額

20億円（2023年4月28日現在）

委託会社の沿革

- | | |
|------------|---|
| 1985年7月1日 | 会社設立 |
| 1998年3月31日 | 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得 |
| 1998年12月1日 | 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可 |
| 1999年10月1日 | 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。 |
| 2008年1月1日 | 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「DIAMアセットマネジメント株式会社」に商号変更 |
| 2016年10月1日 | DIAMアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社（資産運用部門）が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更 |

大株主の状況

(2023年4月28日現在)

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として、運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

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

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

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

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

ファンドごとに目標とするリスク水準(標準偏差)を設定します。

<各ファンドの目標リスク水準(注)>

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

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

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

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

なお、一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

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

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

(2) 【投資対象】

投資の対象とする資産の種類(約款第16条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

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

ハ. 金銭債権

ニ. 約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

運用の指図範囲等(約款第17条第1項)

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

1. 株券または新株引受権証券

2. 国債証券

3. 地方債証券

4. 特別の法律により法人の発行する債券

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

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

7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。)
 15. 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 16. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 17. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
 18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 20. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
 21. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、12.および18.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに15.の証券ならびに12.および18.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、13.の証券および14.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

運用の指図範囲等(約款第17条第2項)

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

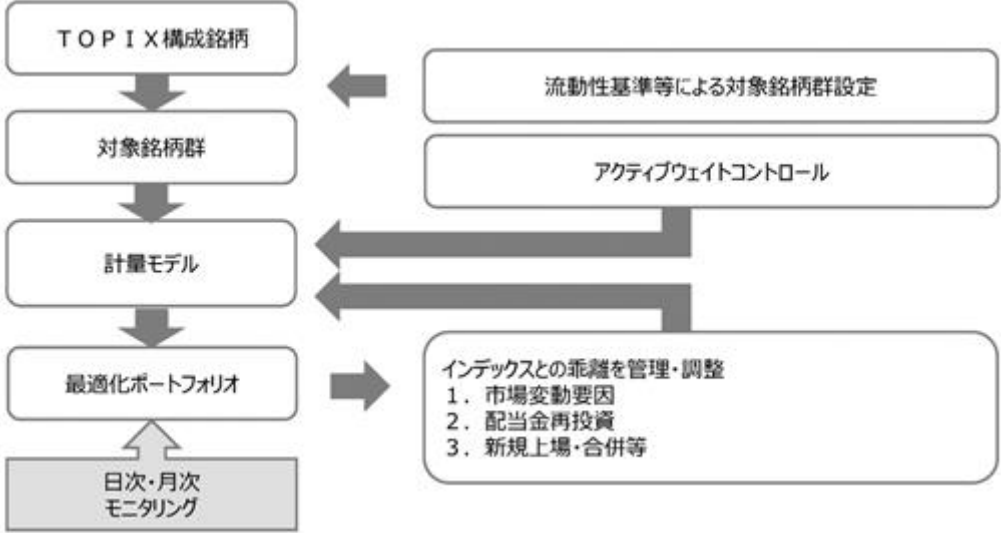
1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

(参考)各ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主としてわが国の金融商品取引所上場株式のうち、東証株価指数に採用されている(または採用予定の)銘柄に投資し、「東証株価指数(TOPIX)(配当込み)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.最適化法によるポートフォリオ構築を行い、運用コストの最小化と徹底したリスク管理を行います。3.株式(株価指数先物取引を含みます。)の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。4.株式の組入比率の調整には、株価指数先物取引等を活用します。5.非株式割合は原則として信託財産総額の50%以下とします。また、外貨建資産割合は原則として信託財産総額の10%以下とします。 <p>東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証株価指数(TOPIX)に関するすべての権利・ノウハウおよび東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有しています。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出もしくは公表の停止または東証株価指数(TOPIX)にかかる標章もしくは商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値および東証株価指数(TOPIX)にかかる標章または商標の使用に関して得られる結果ならびに特定日の東証株価指数(TOPIX)の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。</p> <p>JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証株価指数(TOPIX)の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。</p> <p>本件商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではありません。</p> <p>JPXは、本件商品の購入者または公衆に対し、本件商品の説明または投資のアドバイスをする義務を負いません。</p> <p>JPXは、当社または本件商品の購入者のニーズを東証株価指数(TOPIX)の指数値を算出する銘柄構成および計算に考慮するものではありません。</p> <p>以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。</p>
------	---

運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 マーケットインパクトの低減を図る為、TOPIX採用銘柄のうち、流動性が低い銘柄等を除外して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築 インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差（アクティブウェイト）を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理 日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。組入比率の調整には、先物等を利用することがあります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・市場変動に伴うもの：推定トラッキングエラーの増加に伴い実施 ・配当金再投資に伴うもの：キャッシュ比率の上昇に伴い実施 ・新規上場、合併等に伴うもの：指数に与える影響を勘案し、決定 
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>2.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>4.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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 - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>NOMURA - B P I 総合の知的財産権その他一切の権利は野村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。</p> </div>
運用プロセス	<p>1.流動性基準等による対象銘柄群設定 NOMURA - B P I 総合構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。</p> <p>2.最適化法によるポートフォリオの構築</p> <ol style="list-style-type: none"> 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 <p>1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</p> <p>3.インデックスとの乖離を管理</p> <p>日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <p>組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。</p> <p>インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資 <div style="margin-top: 20px;"> </div>

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

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

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

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

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

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

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

運用プロセス

1. 流動性基準による対象銘柄群設定

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

2. 最適化法によるポートフォリオの構築

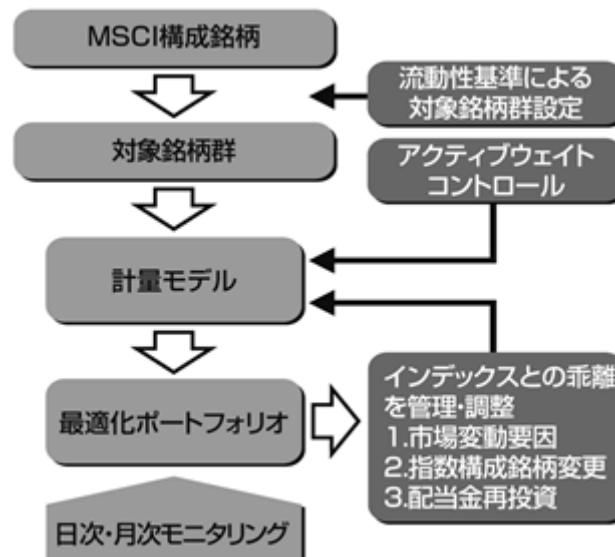
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

3. インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

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



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

ファンド名	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none"> 1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。 2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。 3. 外貨建資産については原則為替ヘッジは行いませんが、金利・為替状況によってはヘッジを実施する可能性があります。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

運用プロセス

1.流動性基準等による対象銘柄群設定

FTSE世界国債インデックス構成銘柄のうち、流動性基準等を勘案して投資対象銘柄群を設定します。

2.最適化法によるポートフォリオの構築

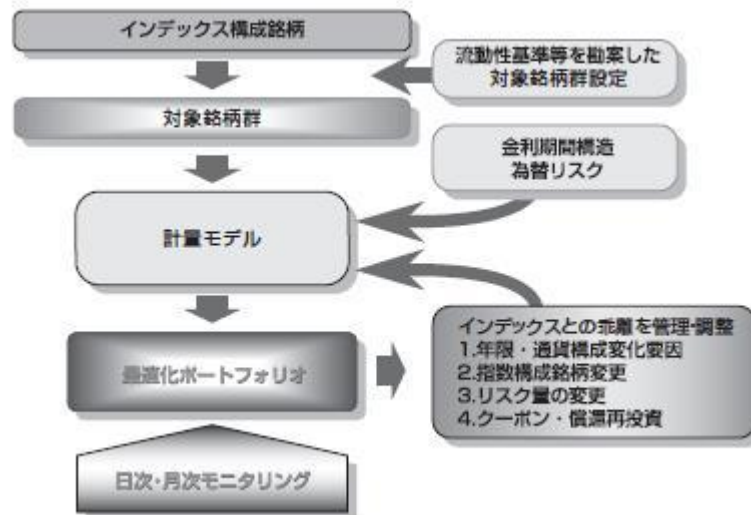
金利の期間構造、通貨エクスポージャーから発生するベンチマーク乖離要因が最小となるポートフォリオを構築します。

3.インデックスとの乖離を管理

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

インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。

- ・ 年限・通貨構成変化要因
- ・ 指数構成銘柄変更
- ・ リスク量の変更
- ・ クーポン・償還再投資



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

ファンド名	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1. 主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース、為替ヘッジあり)」に連動する投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2. 外国債券への投資は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等により弾力的に変更を行う場合があります。</p> <p>3. 外貨建資産の為替リスクは原則フルヘッジとします。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。</p> <p>このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。</p> </div>

<p>運用プロセス</p>	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p> <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B F --> C G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整] H --> C subgraph H_Box [インデックスとの乖離を管理・調整] H1[1. 年限・通貨構成変化要因] H2[2. インデックス構成銘柄変更] H3[3. リスク量の変更] H4[4. クーポン・償還再投資] end </pre>
<p>主な投資制限</p>	<ol style="list-style-type: none"> 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 同一銘柄の転換社債等への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
<p>ファンド名</p>	<p>エマージング株式パッシブ・マザーファンド</p>

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

投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主として海外の証券取引所に上場している株式に投資し、MSCIEマーキング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。2.原則として、株式の組入比率は高位を維持します。3.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。
------	---

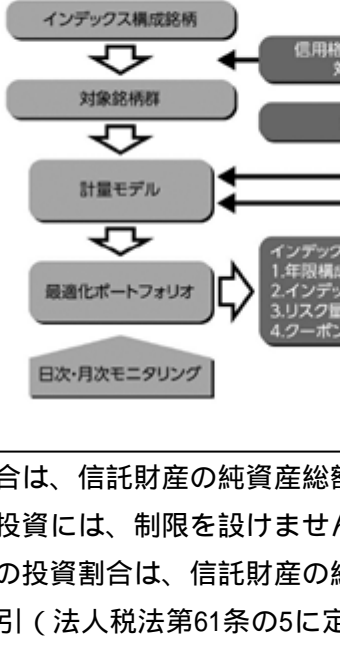
本ファンドは、MSCI Inc.（以下、「MSCI」といいます。）、MSCIの関連会社、情報提供者その他MSCI指数の編集、計算または作成に関与または関係した第三者（以下、総称して「MSCI関係者」といいます。）によって保証、推奨、販売、または宣伝されるものではありません。MSCI指数は、MSCIの独占的財産です。MSCIおよびMSCI指数の名称は、MSCIまたはその関連会社のサービスマークであり、委託会社による特定の目的のために使用が許諾されています。MSCI関係者は、本ファンドの発行者もしくは所有者、またはその他の者もしくは団体に対して、ファンド全般もしくは本ファンド自体への投資に関する適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

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

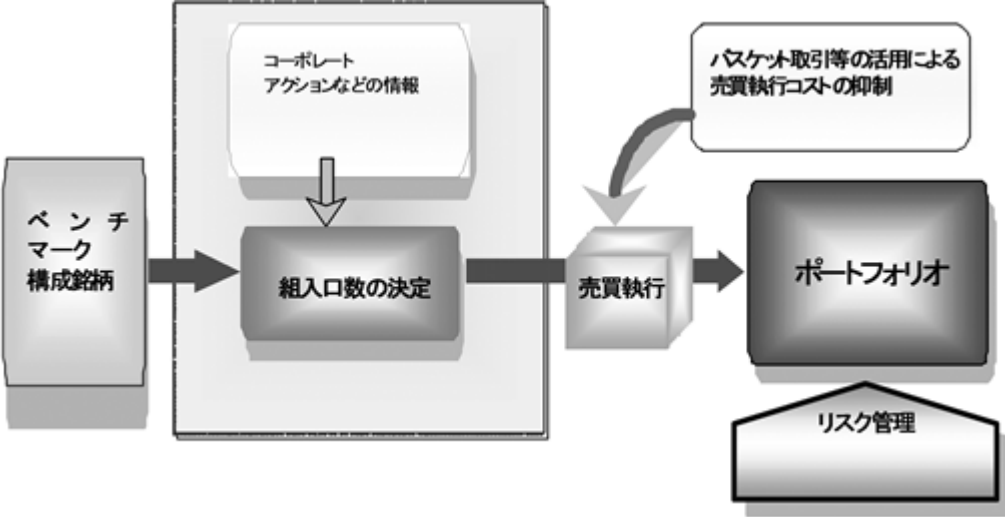
本証券、本商品もしくは本ファンドの購入者、販売者もしくは所有者、またはその他いかなる者もしくは団体も、MSCIの承認が必要か否かの確認を事前にMSCIに求めることなく、本証券を保証、推奨、販売、または宣伝するためにMSCIのトレードネーム、トレードマークまたはサービスマークを使用したり、それらに言及することはできません。いかなる状況においても、いかなる者ま

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

<p>ファンド名</p>	<p>エマージング債券パッシブ・マザーファンド</p>
<p>基本方針</p>	<p>この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p>

主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>2.原則として、新興国の債券の組入比率は高位を維持します。</p> <p>3.組入債券は、当初組入時において、S & PもしくはM o o d y ' s の外貨建て長期格付がB B - 格もしくはB a 3 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。</p> <p>4.外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin-top: 10px;"> <p>J Pモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ . P .モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日々・月次モニタリング] F[信用格付基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C D --> H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] H --> C </pre>
主な投資制限	<p>1.株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>2.外貨建資産への投資には、制限を設けません。</p> <p>3.投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>4.デリバティブ取引（法人税法第61条の5に定めるものをいいます。）は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>5.外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。</p> <p>6.一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>

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

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

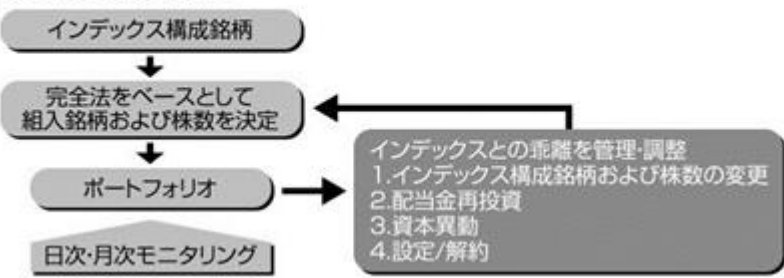
ファンド名	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
-------	-------------------------

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

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

S & P 先進国 R E I Tインデックスは、S&P Globalの一部門であるS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCまたはその関連会社(「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 R E I Tインデックスの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。指数の過去のパフォーマンスは、将来の成績を示唆または保証するものでもありません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに関して、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間にある唯一の関係は、当指数とS&P Dow Jones Indicesおよび/または特定の商標、サービスマーク、および/または商標名のライセンス供与です。S & P 先進国 R E I Tインデックスは委託会社または本商品に関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S & P 先進国 R E I Tインデックスの決定、構成または計算において委託会社または本商品の所有者のニーズを考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の価格および数量、または本商品の発行または販売のタイミングの決定、もしくは場合によっては本商品が将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して、責任を負わず、またこれに関与したこともありません。S&P Dow Jones Indicesは、本商品の管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S & P 先進国 R E I Tインデックスに基づく投資商品が、指数のパフォーマンスを正確に追跡する、またはプラスの投資収益率を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資または税務の顧問会社ではありません。免税証券のポートフォリオへの影響や特定の投資決断の税効果の評価は、税務顧問会社に相談してください。指数に証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホールドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

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

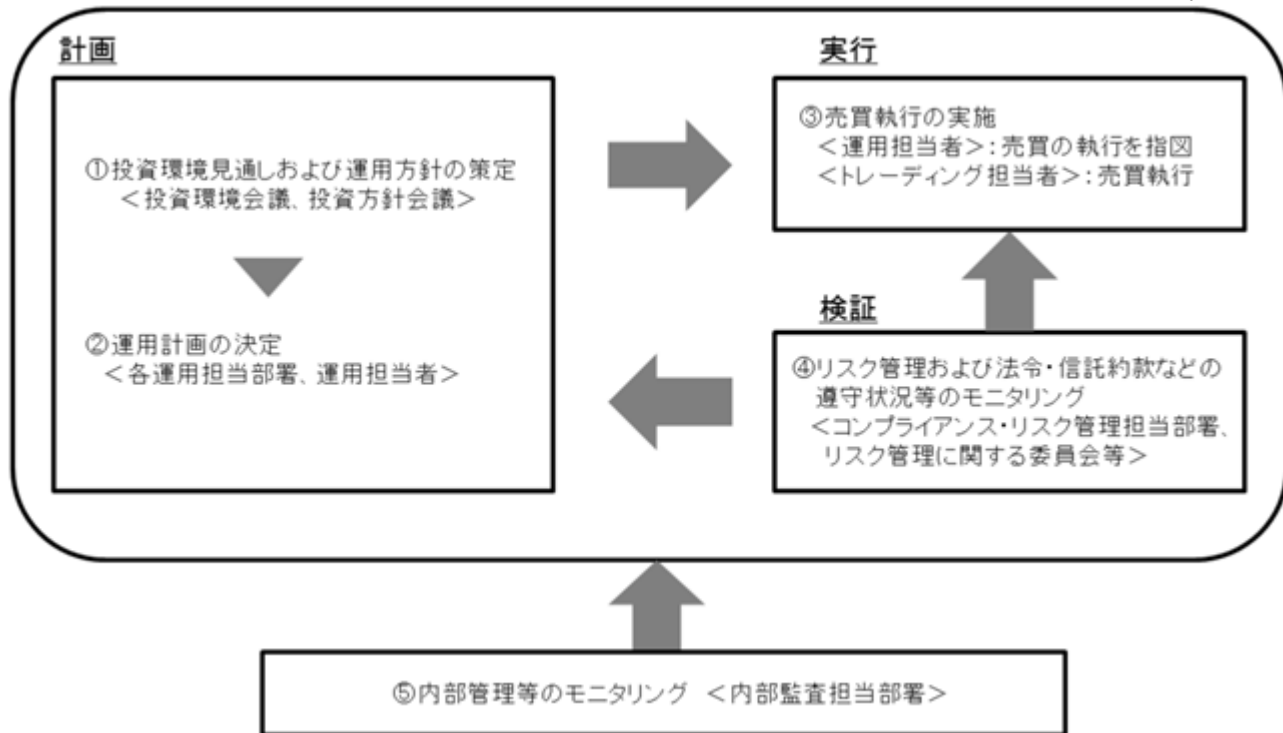
	<p>して、委託会社、本商品の所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P Dow Jones Indicesは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P Dow Jones Indicesのライセンサーを除き、S&P Dow Jones Indicesと委託会社との間の契約または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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。

(3) 【運用体制】

a. ファンドの運用体制



投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

運用計画の決定

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

売買執行の実施

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

モニタリング

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

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

内部管理等のモニタリング

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

b. ファンドの関係法人に関する管理

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

c. 運用体制に関する社内規則

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

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

運用体制は2023年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時（原則として毎年10月12日（休業日の場合は翌営業日））に、原則として以下の方針に基づき収益の分配を行います。

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

収益の分配方式

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

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

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

(3)毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

収益分配金の支払い

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

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

(5)【投資制限】

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

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

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

デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。(約款「運用の基本方針」2.運用方法(3)投資制限)

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

投資する株式等の範囲(約款第20条)

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

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

信用取引の指図範囲（約款第22条）

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

先物取引等の運用指図（約款第23条）

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

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

2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- 3) 委託会社は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに上記(2)投資対象 運用の指図範囲等1.~4.に掲げる金融商品で運用している額(以下2.において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額をいいます。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
 3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引の運用指図(約款第24条)

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

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

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

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第25条)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第26条)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(約款第27条)

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

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

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

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

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

公社債の空売りの指図および範囲(約款第28条)

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

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

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

公社債の借入れの指図および範囲(約款第29条)

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

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

特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第30条)

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

外国為替予約取引の指図(約款第31条)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

資金の借入れ(約款第37条)

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

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

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

3【投資リスク】

< 基準価額の主な変動要因 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、複数または全ての資産の価値が同時に下落した場合等は、基準価額の下落要因となります。

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

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

不動産投資信託証券(リート)の価格変動リスク

リーートの価格の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

為替変動リスク

為替相場の円高は、基準価額の下落要因となります。

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

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

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

信用リスク

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

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

流動性リスク

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

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

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

性、すでに受付けた換金のお申込みの受付が取り消しとなる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

- ・収益分配は、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。))を超えて行われる場合があります。したがって、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。
- ・受益者の個別元本の状況によっては、分配金の全額または一部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。個別元本とは、追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本のこと、受益者毎に異なります。
- ・分配金は純資産総額から支払われます。このため、分配金支払い後の純資産総額は減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中の運用収益以上に分配金の支払いを行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。

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

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

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

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

注意事項

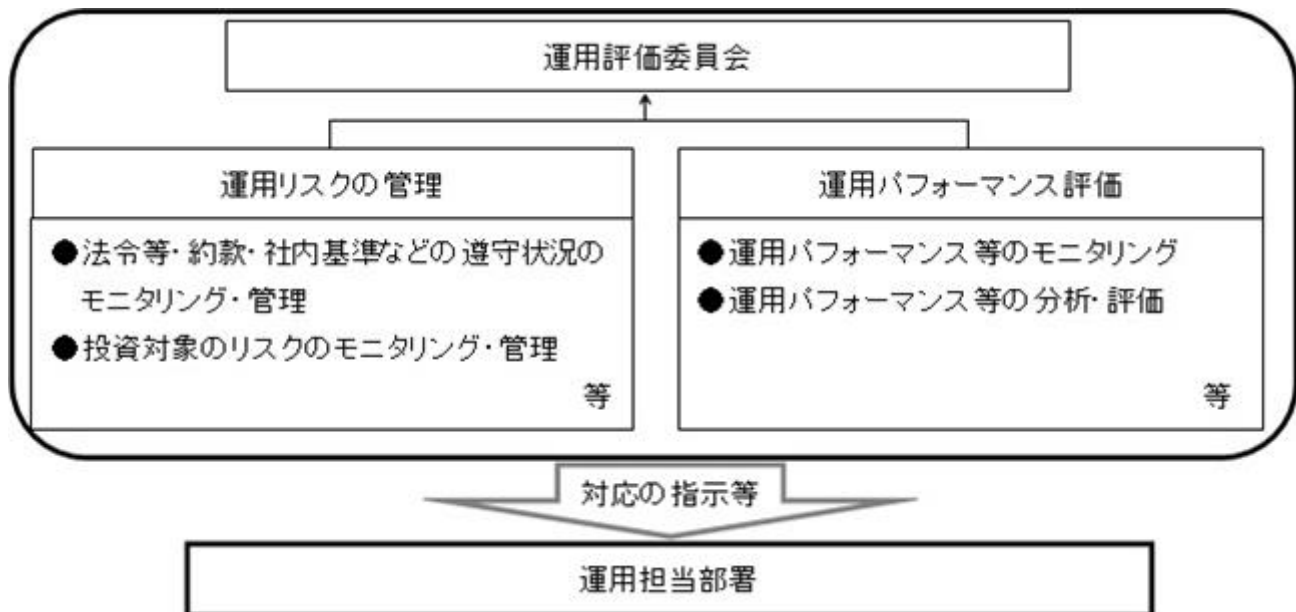
- ・各ファンドは、実質的に債券、株式、不動産投資信託証券(リート)などの値動きのある有価証券(外貨建資産には為替変動リスクもあります。)に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は、預金等や保険契約ではありません。また、預金保険機構および保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。加えて、証券会社を通して購入していない場合には投資者保護基金の対象にもなりません。
- ・投資信託は、購入金額について元本保証および利回り保証のいずれもありません。
- ・投資信託は、投資した資産の価値が減少して購入金額を下回る場合があります、これによる損失は購入者が負担することとなります。

<リスク管理体制>

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

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

- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。



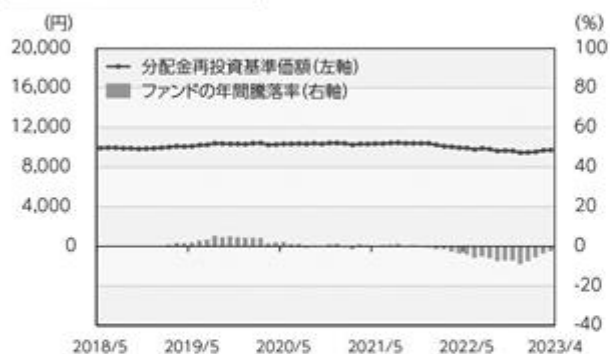
- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

リスク管理体制は2023年4月28日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

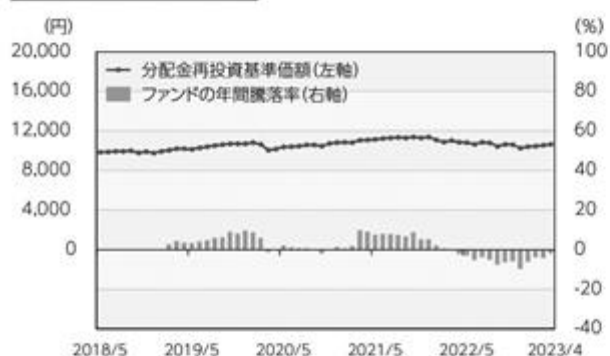
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

（保守型）



（安定型）



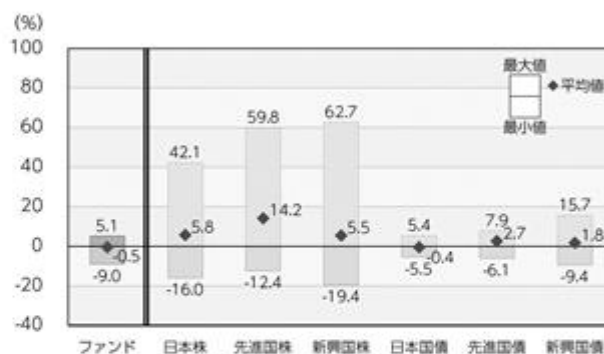
（安定成長型）



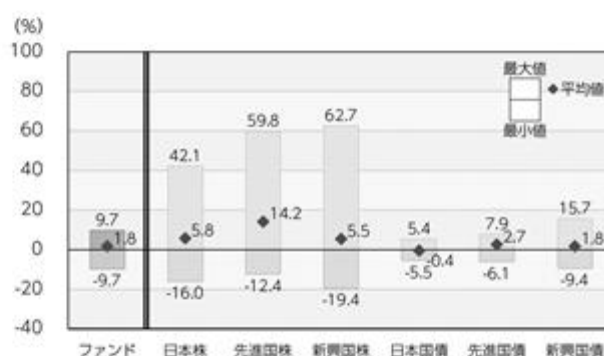
*ファンドの分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した基準価額が記載されていますので、実際の基準価額とは異なる場合があります。

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

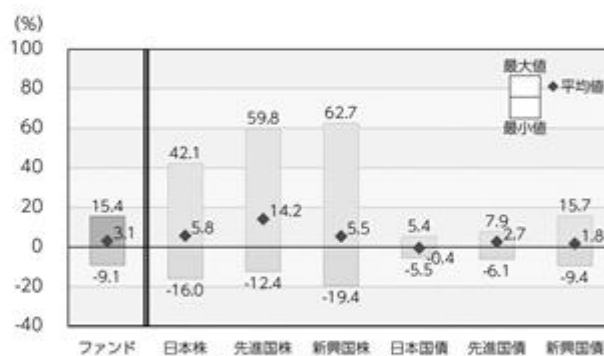
ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2019年1月～2023年4月
代表的な資産クラス:2018年5月～2023年4月



ファンド:2019年1月～2023年4月
代表的な資産クラス:2018年5月～2023年4月



ファンド:2019年1月～2023年4月
代表的な資産クラス:2018年5月～2023年4月

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

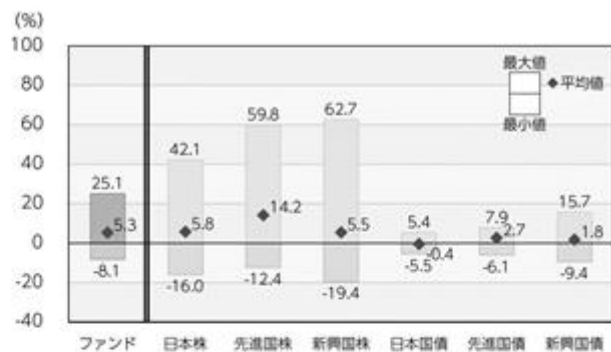
<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

(成長型)

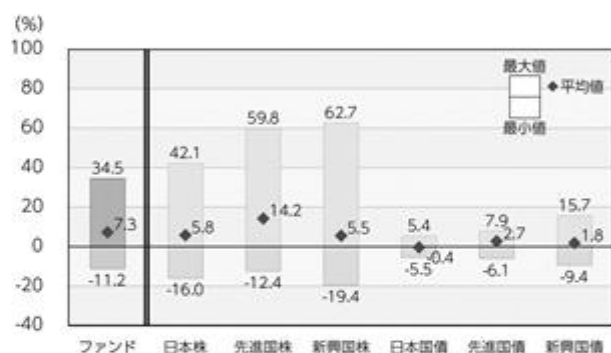


ファンドと他の代表的な資産クラスとの年間騰落率の比較



ファンド:2019年1月~2023年4月
代表的な資産クラス:2018年5月~2023年4月

(積極型)



ファンド:2019年1月~2023年4月
代表的な資産クラス:2018年5月~2023年4月

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

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

各資産クラスの指数

日本株	東証株価指数(TOPIX) (配当込み)	[東証株価指数(TOPIX)]は、日本の株式市場を広くに網羅し、投資対象としての機能性を有するマーケットベンチマークです。同指数の指数値および同指数にかかる標準または高標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標準または高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】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

各ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.55%（税抜0.50%）以内

2023年7月12日現在は、年率0.55%（税抜0.50%）になります。

配分は以下の通りです。

支払先	内訳（税抜）	主な役務
委託会社	年率0.23%	信託財産の運用、目論見書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
販売会社	年率0.23%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.04%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、各ファンドの投資顧問会社（みずほ第一フィナンシャルテクノロジー株式会社）に対する投資顧問報酬（各ファンドの純資産総額に対して年率0.03795%（税抜0.0345%））が含まれます。

税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

(4)【その他の手数料等】

- ・信託財産留保額

ありません。

- ・その他の費用

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

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

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

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

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5)【課税上の取扱い】

各ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

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

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA(ジュニアニーサ)」の適用対象です。また、販

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

NISAまたはつみたてNISA（いずれかの選択）、およびジュニアNISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

<2024年1月1日以降>

少額投資非課税制度（NISA）をご利用の場合、一定の額を上限として、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無期限で非課税となります。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。また、税法上の要件を満たした商品を購入した場合に限り、非課税の適用を受けることができます。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

各ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」および「つみたて投資枠（特定累積投資勘定）」の対象となる予定ですが、販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

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

個別元本方式について

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

<個別元本について>

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

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

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

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

<収益分配金の課税について>

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

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	46,452,801	99.45
内 日本	46,452,801	99.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	256,189	0.55
純資産総額	46,708,990	100.00

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

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

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	101,277,610	99.21
内 日本	101,277,610	99.21
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	807,538	0.79
純資産総額	102,085,148	100.00

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

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

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	1,319,018,676	99.48
内 日本	1,319,018,676	99.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,930,509	0.52
純資産総額	1,325,949,185	100.00

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

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

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	116,774,923	99.49
内 日本	116,774,923	99.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	603,699	0.51
純資産総額	117,378,622	100.00

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

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

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	266,914,485	99.48
内 日本	266,914,485	99.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,393,704	0.52
純資産総額	268,308,189	100.00

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

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

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	411,612,330,110	97.92
内 日本	411,612,330,110	97.92
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	8,755,724,993	2.08
純資産総額	420,368,055,103	100.00

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,145,940,000	2.41
内 日本	10,145,940,000	2.41

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	393,451,337,250	81.68
内 日本	393,451,337,250	81.68
地方債証券	32,789,067,847	6.81
内 日本	32,789,067,847	6.81
特殊債券	30,404,537,666	6.31
内 日本	30,404,537,666	6.31
社債券	25,664,599,640	5.33
内 日本	24,971,747,640	5.18
内 フランス	692,852,000	0.14
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	629,807,334	0.13
純資産総額	481,679,735,069	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4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	914,281,365,716	96.33
内 アメリカ	632,379,518,177	66.63
内 イギリス	41,390,595,839	4.36
内 フランス	34,020,217,716	3.58
内 カナダ	33,819,633,676	3.56
内 スイス	32,457,317,318	3.42
内 ドイツ	24,881,352,900	2.62
内 オーストラリア	19,723,052,732	2.08
内 オランダ	17,724,195,139	1.87
内 アイルランド	17,278,380,653	1.82
内 スウェーデン	9,105,441,234	0.96

内 デンマーク	8,950,953,834	0.94
内 スペイン	7,654,531,258	0.81
内 香港	5,863,511,996	0.62
内 イタリア	5,395,866,081	0.57
内 フィンランド	3,446,977,802	0.36
内 ジャージー	3,399,441,613	0.36
内 シンガポール	3,169,536,562	0.33
内 ベルギー	2,397,295,416	0.25
内 ノルウェー	1,865,720,724	0.20
内 イスラエル	1,820,263,215	0.19
内 ケイマン諸島	1,781,026,126	0.19
内 バミューダ	1,510,731,796	0.16
内 オランダ領キュラソー	1,241,840,748	0.13
内 ニュージーランド	774,483,443	0.08
内 ルクセンブルグ	585,046,548	0.06
内 オーストリア	544,133,765	0.06
内 ポルトガル	500,302,182	0.05
内 リベリア	263,273,419	0.03
内 マン島	178,800,497	0.02
内 パナマ	157,923,307	0.02
投資信託受益証券	1,601,156,959	0.17
内 オーストラリア	1,160,725,124	0.12
内 シンガポール	440,431,835	0.05
投資証券	18,528,441,957	1.95
内 アメリカ	17,236,091,477	1.82
内 イギリス	442,851,200	0.05
内 フランス	352,925,831	0.04
内 香港	304,456,397	0.03
内 ベルギー	120,100,079	0.01
内 カナダ	72,016,973	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	14,688,530,261	1.55
純資産総額	949,099,494,893	100.00

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	10,832,465,336	1.14
内 アメリカ	7,744,280,576	0.82
内 ドイツ	1,873,397,346	0.20
内 イギリス	498,730,249	0.05
内 カナダ	391,725,065	0.04
内 オーストラリア	324,332,100	0.03

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

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

国債証券		210,032,890,998	98.64
内 アメリカ		103,981,866,106	48.83
内 フランス		17,549,244,292	8.24
内 イタリア		16,031,800,428	7.53
内 ドイツ		13,873,168,950	6.52
内 スペイン		10,741,082,954	5.04
内 中国		10,418,301,056	4.89
内 イギリス		10,142,912,086	4.76
内 カナダ		4,289,543,364	2.01
内 ベルギー		3,934,837,560	1.85
内 オーストラリア		3,319,195,928	1.56
内 オランダ		3,244,072,936	1.52
内 オーストリア		2,543,745,012	1.19
内 メキシコ		1,869,382,246	0.88
内 アイルランド		1,300,174,406	0.61
内 マレーシア		1,145,895,731	0.54
内 フィンランド		1,121,480,640	0.53
内 ポーランド		1,023,463,328	0.48
内 シンガポール		926,434,522	0.44
内 デンマーク		680,135,103	0.32
内 イスラエル		665,990,950	0.31
内 ニュージーランド		476,136,203	0.22
内 スウェーデン		431,988,948	0.20
内 ノルウェー		322,038,249	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,897,331,028	1.36
純資産総額		212,930,222,026	100.00

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	309,176,135,376	100.44
内 アメリカ	153,112,429,384	49.74
内 フランス	25,871,426,428	8.40
内 イタリア	23,580,130,017	7.66
内 ドイツ	20,441,775,405	6.64
内 スペイン	15,797,878,295	5.13
内 中国	15,173,047,058	4.93
内 イギリス	14,972,569,505	4.86
内 カナダ	6,358,461,664	2.07
内 ベルギー	5,902,202,007	1.92
内 オーストラリア	4,828,200,655	1.57
内 オランダ	4,819,900,709	1.57
内 オーストリア	3,798,719,730	1.23
内 メキシコ	2,743,348,595	0.89
内 アイルランド	1,893,823,903	0.62
内 マレーシア	1,669,798,751	0.54
内 フィンランド	1,574,524,138	0.51
内 ポーランド	1,479,148,844	0.48

内 シンガポール	1,357,832,848	0.44
内 デンマーク	988,709,080	0.32
内 イスラエル	961,437,627	0.31
内 ニュージーランド	710,707,417	0.23
内 スウェーデン	639,872,897	0.21
内 ノルウェー	500,190,419	0.16
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,350,936,682	0.44
純資産総額	307,825,198,694	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4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	81,905,915,485	90.96
内 ケイマン諸島	14,176,133,090	15.74
内 台湾	11,798,005,877	13.10
内 インド	11,326,293,782	12.58
内 中国	10,432,141,271	11.59
内 韓国	9,885,455,266	10.98
内 ブラジル	4,023,255,916	4.47
内 サウジアラビア	3,495,978,592	3.88
内 南アフリカ	2,842,697,191	3.16
内 メキシコ	1,748,322,067	1.94
内 タイ	1,736,808,625	1.93
内 インドネシア	1,716,028,019	1.91
内 マレーシア	1,203,019,637	1.34
内 アラブ首長国連邦	1,114,907,134	1.24
内 香港	971,592,264	1.08
内 カタール	742,997,492	0.83
内 クエート	738,986,096	0.82
内 ポーランド	610,589,516	0.68
内 フィリピン	591,562,290	0.66
内 トルコ	503,127,456	0.56
内 チリ	457,753,232	0.51
内 アメリカ	406,311,552	0.45
内 バミューダ	403,368,609	0.45
内 ギリシャ	334,099,425	0.37
内 ハンガリー	179,310,401	0.20
内 チェコ	158,344,700	0.18
内 コロンビア	82,106,686	0.09
内 ルクセンブルグ	74,056,331	0.08
内 エジプト	55,471,966	0.06
内 オランダ	54,202,057	0.06
内 シンガポール	24,850,375	0.03
内 ベルー	18,138,570	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	593,002,276	0.66

	内 メキシコ	440,156,817	0.49
	内 ブラジル	152,845,459	0.17
投資証券		84,334,336	0.09
	内 メキシコ	54,183,736	0.06
	内 南アフリカ	30,150,600	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		7,462,220,188	8.29
純資産総額		90,045,472,285	100.00

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	7,440,416,438	8.26
内 アメリカ	7,440,416,438	8.26

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	129,790,294,106	98.58
内 サウジアラビア	14,362,299,250	10.91
内 メキシコ	12,546,923,313	9.53
内 カタール	12,337,035,965	9.37
内 アラブ首長国連邦	11,593,829,276	8.81
内 チリ	8,879,183,779	6.74
内 ドミニカ共和国	8,069,512,120	6.13
内 コロンビア	7,991,020,755	6.07
内 パナマ	7,524,652,825	5.72
内 ブラジル	6,997,640,658	5.32
内 ハンガリー	6,481,107,870	4.92
内 インドネシア	6,067,087,273	4.61
内 南アフリカ	5,313,535,268	4.04
内 ペルー	5,228,547,527	3.97
内 オマーン	4,640,932,069	3.53
内 ルーマニア	3,930,348,884	2.99
内 フィリピン	3,881,900,481	2.95
内 ウルグアイ	3,100,464,801	2.36
内 中国	844,271,992	0.64
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,864,090,970	1.42
純資産総額	131,654,385,076	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	202,264,387,168	97.81
内 日本	202,264,387,168	97.81
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,527,310,272	2.19

純資産総額	206,791,697,440	100.00
-------	-----------------	--------

その他資産の投資状況

2023年4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引（買建）	4,366,684,500	2.11
内 日本	4,366,684,500	2.11

（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4月28日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	8,325,252,500	10.60
内 オーストラリア	5,247,578,332	6.68
内 シンガポール	3,001,823,596	3.82
内 香港	75,850,572	0.10
投資証券	69,908,872,216	89.04
内 アメリカ	59,942,784,464	76.34
内 イギリス	3,815,458,907	4.86
内 フランス	1,421,596,764	1.81
内 カナダ	1,379,016,607	1.76
内 香港	1,148,224,051	1.46
内 ベルギー	902,022,043	1.15
内 スペイン	316,303,086	0.40
内 ニュージーランド	311,093,694	0.40
内 ガーンジー	173,199,903	0.22
内 韓国	173,157,738	0.22
内 オランダ	152,142,499	0.19
内 イスラエル	96,377,804	0.12
内 ドイツ	38,864,640	0.05
内 アイルランド	29,805,426	0.04
内 イタリア	8,824,590	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	281,699,588	0.36
純資産総額	78,515,824,304	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	27,137,488	1.2550 34,058,704	1.2680 34,410,334	- -	73.67

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	3,830,486	1.1944 4,575,335	1.2026 4,606,542	- -	9.86
3	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,013,158	2.0148 4,056,227	2.0668 4,160,794	- -	8.91
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	911,777	1.9942 1,818,268	2.0326 1,853,277	- -	3.97
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	398,634	3.1926 1,272,713	3.5438 1,412,679	- -	3.02
6	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	1,447	5.7650 8,342	6.3410 9,175	- -	0.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.45
合計	99.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	13,742,426	2.0179 27,731,572	2.0668 28,402,846	- -	27.82
2	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	18,998,749	1.2565 23,873,409	1.2680 24,090,413	- -	23.60
3	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	15,967,112	1.1942 19,069,306	1.2026 19,202,048	- -	18.81
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	5,506,848	1.9760 10,881,792	2.0326 11,193,219	- -	10.96
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,617,238	2.3638 6,186,635	2.3595 6,175,373	- -	6.05

6	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	1,733,482	3.1897	3.5438	-	6.02
				5,529,416	6,143,113	-	
7	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	638,855	5.8079	6.3410	-	3.97
				3,710,458	4,050,979	-	
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	630,267	1.5537	1.6096	-	0.99
				979,307	1,014,477	-	
9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	731,172	1.3318	1.3747	-	0.98
				973,814	1,005,142	-	

(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4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.21
合計	99.21

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	184,893,690	2.0167	2.0668	-	28.82
				372,888,848	382,138,278	-	
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	162,619,164	1.2563	1.2680	-	15.55
				204,309,370	206,201,099	-	
3	為替フルヘッジ外国債券 パッシブ・ファンド・マ ザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	141,568,607	1.1952	1.2026	-	12.84
				169,214,509	170,250,406	-	
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	21,061,667	5.8407	6.3410	-	10.07
				123,014,882	133,552,030	-	
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	65,083,747	1.9750	2.0326	-	9.98
				128,546,583	132,289,224	-	
6	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	34,027,017	3.1992	3.5438	-	9.09
				108,860,296	120,584,942	-	

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	45,630,651	2.3662 107,971,494	2.3595 107,665,521	- -	8.12
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	33,083,623	1.5690 51,910,573	1.6096 53,251,399	- -	4.02
9	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	9,519,006	1.3322 12,681,891	1.3747 13,085,777	- -	0.99

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.48
合計	99.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	外国債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	15,271,466	2.0134 30,747,602	2.0668 31,563,065	- -	26.89
2	外国株式パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	3,503,285	5.8132 20,365,609	6.3410 22,214,330	- -	18.93
3	国内株式パッシブ・ファン ド（最適化法）・マザー ファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,329,331	3.1880 13,802,301	3.5438 15,342,283	- -	13.07
4	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,054,735	2.3661 11,960,330	2.3595 11,926,647	- -	10.16
5	外国リート・パッシブ・ ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,517,944	1.5598 10,167,304	1.6096 10,491,282	- -	8.94
6	エマージング債券パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	4,624,137	1.9709 9,114,101	2.0326 9,399,020	- -	8.01
7	国内債券パッシブ・ファン ド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	5,123,599	1.2563 6,436,980	1.2680 6,496,723	- -	5.53
8	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	4,865,598	1.1947 5,813,278	1.2026 5,851,368	- -	4.99

9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,538,885	1.3312 3,379,948	1.3747 3,490,205	- -	2.97
---	----------------------------	-------------------	-----------	---------------------	---------------------	--------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.49
合計	99.49

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	11,780,001	5.8041 68,372,860	6.3410 74,696,986	- -	27.84
2	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	25,212,125	2.0196 50,918,804	2.0668 52,108,419	- -	19.42
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,944,424	3.1871 41,255,453	3.5438 45,872,449	- -	17.10
4	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	24,867,589	1.5605 38,806,079	1.6096 40,026,871	- -	14.92
5	J-REITインデックス ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	12,696,351	2.3654 30,033,010	2.3595 29,957,040	- -	11.17
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	6,602,567	1.9839 13,099,229	2.0326 13,420,377	- -	5.00
7	エマージング株式パッシブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	7,742,027	1.3286 10,286,701	1.3747 10,642,964	- -	3.97
8	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	91,804	1.1937 109,594	1.2026 110,403	- -	0.04
9	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	62,284	1.2581 78,363	1.2680 78,976	- -	0.03

(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4月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.48
合計	99.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 （円）	評価単価 評価金額 （円）	利率 （％） 償還日	投資 比率 （％）
1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,679,900	1,894.35 14,548,443,941	1,857.00 14,261,574,300	- -	3.39
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	989,400	12,034.32 11,906,762,879	12,830.00 12,694,002,000	- -	3.02
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	139,900	61,137.19 8,553,093,168	61,100.00 8,547,890,000	- -	2.03
4	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,797,400	3,868.89 6,953,958,626	4,149.00 7,457,412,600	- -	1.77
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,626,900	932.20 8,042,080,707	852.90 7,357,883,010	- -	1.75
6	第一三共 日本	株式 医薬品	1,222,000	4,128.06 5,044,500,999	4,647.00 5,678,634,000	- -	1.35
7	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,241,400	4,197.10 5,210,287,907	4,512.00 5,601,196,800	- -	1.33
8	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,006,600	5,622.33 5,659,440,288	5,549.00 5,585,623,400	- -	1.33
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	686,900	7,049.43 4,842,256,270	7,485.00 5,141,446,500	- -	1.22
10	任天堂 日本	株式 その他製品	883,000	5,594.72 4,940,139,512	5,721.00 5,051,643,000	- -	1.20
11	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,084,000	3,977.72 4,311,854,724	4,248.00 4,604,832,000	- -	1.10
12	三菱商事 日本	株式 卸売業	915,300	4,614.21 4,223,390,148	5,018.00 4,592,975,400	- -	1.09
13	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	296,000	15,598.10 4,617,038,791	15,495.00 4,586,520,000	- -	1.09
14	信越化学工業 日本	株式 化学	1,164,500	3,871.11 4,507,912,282	3,863.00 4,498,463,500	- -	1.07
15	三井物産 日本	株式 卸売業	1,050,300	3,927.13 4,124,664,966	4,229.00 4,441,718,700	- -	1.06

16	HOYA 日本	株式 精密機器	298,700	14,240.05 4,253,503,207	14,210.00 4,244,527,000	- -	1.01
17	ダイキン工業 日本	株式 機械	168,600	22,984.52 3,875,191,078	24,620.00 4,150,932,000	- -	0.99
18	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	911,800	4,077.14 3,717,543,953	4,492.00 4,095,805,600	- -	0.97
19	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,136,900	3,293.88 3,744,818,297	3,588.00 4,079,197,200	- -	0.97
20	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,064,500	4,270.68 4,546,141,825	3,824.00 4,070,648,000	- -	0.97
21	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,992,200	2,066.62 4,117,128,920	1,965.00 3,914,673,000	- -	0.93
22	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,361,600	2,718.84 3,701,982,280	2,720.00 3,703,552,000	- -	0.88
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	760,900	4,341.62 3,303,541,186	4,799.00 3,651,559,100	- -	0.87
24	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	692,000	6,161.17 4,263,534,292	5,094.00 3,525,048,000	- -	0.84
25	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,253,500	1,529.28 3,446,236,026	1,531.50 3,451,235,250	- -	0.82
26	村田製作所 日本	株式 電気機器	424,200	7,720.02 3,274,833,232	7,880.00 3,342,696,000	- -	0.80
27	ファナック 日本	株式 電気機器	686,400	4,622.44 3,172,849,106	4,589.00 3,149,889,600	- -	0.75
28	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	510,000	5,948.64 3,033,806,641	6,145.00 3,133,950,000	- -	0.75
29	S M C 日本	株式 機械	45,800	67,968.26 3,112,946,492	67,750.00 3,102,950,000	- -	0.74
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,325,100	1,914.61 2,537,061,457	2,048.00 2,713,804,800	- -	0.65

(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4月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.92
合計	97.92

(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

2023年4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	17.35

情報・通信業	8.36
輸送用機器	7.17
卸売業	6.09
化学	6.06
銀行業	5.86
医薬品	5.48
機械	5.26
サービス業	5.01
小売業	4.52
食料品	3.58
陸運業	3.04
精密機器	2.50
その他製品	2.32
保険業	2.14
建設業	2.02
不動産業	1.87
電気・ガス業	1.24
その他金融業	1.10
鉄鋼	0.85
ゴム製品	0.76
非鉄金属	0.71
ガラス・土石製品	0.70
証券、商品先物取引業	0.69
海運業	0.59
金属製品	0.55
空運業	0.48
繊維製品	0.46
石油・石炭製品	0.45
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	97.92

（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。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	334回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	7,320,000,000	100.85 7,382,934,000	100.80 7,379,145,600	0.6 2024/6/20	1.53
2	137回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	4,680,000,000	111.20 5,204,412,000	112.20 5,251,006,800	1.7 2032/6/20	1.09
3	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,140,000,000	100.15 5,148,049,000	100.40 5,160,560,000	0.1 2026/12/20	1.07

4	144回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,530,000,000	100.32 4,544,681,000	100.33 4,544,994,300	0.1 2025/6/20	0.94
5	346回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,390,000,000	100.02 4,391,133,000	100.36 4,406,155,200	0.1 2027/3/20	0.91
6	145回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,250,000,000	100.36 4,265,455,000	100.35 4,265,215,000	0.1 2025/9/20	0.89
7	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,260,000,000	99.49 4,238,582,000	100.02 4,261,022,400	0.1 2028/3/20	0.88
8	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,330,000,000	96.93 4,197,182,000	98.23 4,253,488,900	0.1 2031/12/20	0.88
9	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,270,000,000	97.20 4,150,508,000	98.48 4,205,480,300	0.1 2031/6/20	0.87
10	343回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,090,000,000	100.32 4,103,120,000	100.40 4,106,687,200	0.1 2026/6/20	0.85
11	348回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,070,000,000	99.80 4,061,885,000	100.21 4,078,872,600	0.1 2027/9/20	0.85
12	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,030,000,000	99.94 4,027,751,000	100.30 4,042,452,700	0.1 2027/6/20	0.84
13	355回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,030,000,000	98.94 3,987,681,000	99.66 4,016,499,500	0.1 2029/6/20	0.83
14	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,910,000,000	99.54 3,892,178,000	99.91 3,906,754,700	0.005 2027/6/20	0.81
15	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,920,000,000	97.58 3,825,292,000	98.83 3,874,449,600	0.1 2030/12/20	0.80
16	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,880,000,000	97.96 3,800,998,000	98.96 3,839,764,400	0.2 2032/3/20	0.80
17	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,850,000,000	96.87 3,729,770,000	98.36 3,786,975,500	0.1 2031/9/20	0.79
18	143回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,700,000,000	100.32 3,711,860,000	100.30 3,711,137,000	0.1 2025/3/20	0.77
19	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,670,000,000	98.11 3,600,904,000	99.22 3,641,594,200	0.1 2030/6/20	0.76
20	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,570,000,000	100.25 3,579,171,000	100.40 3,584,494,200	0.1 2026/9/20	0.74

21	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,600,000,000	98.19 3,534,976,000	99.01 3,564,684,000	0.1 2030/9/20	0.74
22	362回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,610,000,000	97.22 3,509,685,000	98.64 3,561,228,900	0.1 2031/3/20	0.74
23	342回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,520,000,000	100.35 3,532,488,000	100.40 3,534,220,800	0.1 2026/3/20	0.73
24	148回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,510,000,000	100.01 3,510,624,000	100.10 3,513,825,900	0.005 2026/6/20	0.73
25	154回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,500,000,000	99.81 3,493,475,000	100.21 3,507,630,000	0.1 2027/9/20	0.73
26	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,460,000,000	99.24 3,433,872,000	99.91 3,457,197,400	0.1 2028/9/20	0.72
27	156回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	3,400,000,000	100.19 3,406,559,000	100.57 3,419,618,000	0.2 2027/12/20	0.71
28	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,380,000,000	99.36 3,358,704,000	99.97 3,379,121,200	0.1 2028/6/20	0.70
29	340回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,340,000,000	101.11 3,377,118,400	101.07 3,375,938,400	0.4 2025/9/20	0.70
30	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	3,350,000,000	99.67 3,339,060,000	100.13 3,354,623,000	0.1 2027/12/20	0.70

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	81.68
地方債証券	6.81
特殊債券	6.31
社債券	5.33
合計	100.13

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

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

1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,191,841	20,689.42 45,347,934,080	22,588.83 49,511,130,969	- -	5.22
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	975,662	36,578.17 35,687,938,196	40,886.84 39,891,743,795	- -	4.20
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,265,570	13,376.71 16,929,162,888	14,730.15 18,642,044,288	- -	1.96
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	339,294	31,460.50 10,674,360,872	36,518.23 12,390,417,618	- -	1.31
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	825,795	12,804.96 10,574,276,773	14,431.04 11,917,086,209	- -	1.26
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	752,213	12,839.56 9,658,087,016	14,535.66 10,933,918,508	- -	1.15
7	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	310,098	24,504.53 7,598,807,533	31,998.05 9,922,532,177	- -	1.05
8	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	567,903	15,587.76 8,852,340,197	15,670.40 8,899,271,657	- -	0.94
9	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	128,754	66,057.53 8,505,171,837	65,786.74 8,470,306,063	- -	0.89
10	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	370,393	27,831.91 10,308,748,074	21,486.28 7,958,369,448	- -	0.84
11	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	360,228	21,639.61 7,795,196,541	21,863.18 7,875,733,207	- -	0.83

12	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	179,381	41,688.75 7,478,171,117	43,757.22 7,849,215,656	- -	0.83
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	404,324	19,070.75 7,710,764,906	18,382.51 7,432,492,601	- -	0.78
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	224,220	30,728.54 6,889,954,484	30,717.11 6,887,390,695	- -	0.73
15	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	326,763	18,805.65 6,144,993,028	20,987.32 6,857,880,004	- -	0.72
16	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	379,210	16,689.16 6,328,696,730	17,064.09 6,470,875,844	- -	0.68
17	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	118,317	49,524.80 5,859,626,008	50,120.35 5,930,090,291	- -	0.62
18	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	111,559	46,509.93 5,188,601,866	52,357.64 5,840,966,574	- -	0.62
19	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	253,242	23,039.10 5,834,470,065	22,393.00 5,670,848,992	- -	0.60
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	140,856	42,340.59 5,963,926,780	39,424.83 5,553,223,981	- -	0.59
21	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	349,890	14,587.31 5,103,954,785	15,446.41 5,404,544,674	- -	0.57
22	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	228,400	19,946.01 4,555,670,898	22,179.64 5,065,831,603	- -	0.53
23	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	38,228	120,482.14 4,605,791,351	129,845.88 4,963,748,453	- -	0.52
24	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	243,795	20,572.41 5,015,452,816	19,967.93 4,868,082,250	- -	0.51
25	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	565,798	8,029.70 4,543,191,768	8,541.39 4,832,706,131	- -	0.51
26	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	189,912	23,654.51 4,492,276,618	25,443.11 4,831,953,748	- -	0.51
27	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	57,506	81,198.69 4,669,412,144	82,947.33 4,769,969,348	- -	0.50
28	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	55,678	91,637.77 5,102,207,846	83,524.16 4,650,458,625	- -	0.49

29	ASTRAZENECA PLC イギリス	株式 医薬品	213,840	19,262.15 4,119,018,512	19,775.99 4,228,898,556	- -	0.45
30	WALMART INC アメリカ	株式 生活必需品流通・ 小売り	205,924	19,544.39 4,024,660,506	20,304.59 4,181,204,326	- -	0.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率（％）
株式	96.33
投資信託受益証券	0.17
投資証券	1.95
合計	98.45

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年4月28日現在

業種	国内 / 外国	投資比率（％）
ソフトウェア	外国	7.51
医薬品		5.44
銀行		5.43
コンピュータ・周辺機器		5.41
石油・ガス・消耗燃料		4.98
半導体・半導体製造装置		4.82
インタラクティブ・メディアおよびサービス		3.58
保険		3.19
金融サービス		3.12
資本市場		3.01
ヘルスケア機器・用品		2.53
大規模小売り		2.41
ヘルスケア・プロバイダー / ヘルスケア・サービス		2.21
ホテル・レストラン・レジャー		2.12
バイオテクノロジー		2.03
化学		2.02
飲料		1.89
電力		1.88
生活必需品流通・小売り		1.83
機械		1.81
食品		1.77
航空宇宙・防衛		1.74
専門小売り		1.63
金属・鉱業		1.62
繊維・アパレル・贅沢品		1.51
自動車		1.49
ライフサイエンス・ツール / サービス		1.38
家庭用品		1.21
情報技術サービス		1.18
各種電気通信サービス		1.12

娯楽	1.11
専門サービス	1.00
陸上運輸	0.96
コングロマリット	0.94
電気設備	0.85
総合公益事業	0.84
メディア	0.74
パーソナルケア用品	0.68
タバコ	0.66
通信機器	0.65
航空貨物・物流サービス	0.58
建設関連製品	0.57
商業サービス・用品	0.53
電子装置・機器・部品	0.50
商社・流通業	0.38
消費者金融	0.36
不動産管理・開発	0.32
建設・土木	0.31
家庭用耐久財	0.30
無線通信サービス	0.30
建設資材	0.27
エネルギー設備・サービス	0.25
容器・包装	0.23
自動車用部品	0.19
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.15
ガス	0.13
運送インフラ	0.12
水道	0.11
販売	0.11
紙製品・林産品	0.09
海上運輸	0.06
旅客航空輸送	0.05
ヘルスケア・テクノロジー	0.05
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	96.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	US T N/B 1.5 11/30/24 アメリカ	国債証 券	1,207,170,000	94.46 1,140,316,925	95.67 1,154,992,901	1.5 2024/11/30	0.54
2	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証 券	1,200,463,500	92.14 1,106,196,344	94.98 1,140,299,640	2.875 2032/5/15	0.54
3	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証 券	1,192,415,700	81.59 972,920,203	84.30 1,005,308,909	1.125 2031/2/15	0.47

4	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,051,579,200	91.93 966,778,269	93.89 987,416,441	2.75 2032/8/15	0.46
5	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	1,161,565,800	81.24 943,766,176	83.94 975,034,662	1.25 2031/8/15	0.46
6	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,105,231,200	84.64 935,560,769	87.01 961,723,835	1.625 2031/5/15	0.45
7	US T N/B 0.25 05/15/24 アメリカ	国債証券	1,005,975,000	94.39 949,624,675	95.43 960,008,551	0.25 2024/5/15	0.45
8	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証券	957,379,500	99.64 953,989,313	99.75 955,058,342	2.26 2025/2/24	0.45
9	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,110,596,400	80.50 894,030,102	82.82 919,886,173	0.875 2030/11/15	0.43
10	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,071,698,700	81.96 878,458,027	84.37 904,245,778	1.375 2031/11/15	0.42
11	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	845,019,000	102.50 866,195,008	104.74 885,157,402	4.125 2032/11/15	0.42
12	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	976,466,400	85.28 832,780,891	87.69 856,315,255	1.875 2032/2/15	0.40
13	US T N/B 2.75 02/15/28 アメリカ	国債証券	850,384,200	93.75 797,284,842	96.13 817,498,244	2.75 2028/2/15	0.38
14	US T N/B 0.875 09/30/26 アメリカ	国債証券	886,599,300	88.64 785,882,562	90.83 805,385,419	0.875 2026/9/30	0.38
15	US T N/B 3.875 01/15/26 アメリカ	国債証券	777,954,000	98.44 765,872,374	99.97 777,726,082	3.875 2026/1/15	0.37
16	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証券	857,090,700	86.43 740,828,835	88.96 762,475,923	1.125 2028/2/29	0.36
17	US T N/B 0.625 08/15/30 アメリカ	国債証券	917,449,200	79.17 726,422,631	81.48 747,577,743	0.625 2030/8/15	0.35
18	US T N/B 4.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	737,715,000	99.03 730,618,181	99.87 736,764,041	4.25 2024/12/31	0.35
19	US T N/B 4.625 03/15/26 アメリカ	国債証券	714,912,900	101.92 728,696,420	102.18 730,551,619	4.625 2026/3/15	0.34
20	US T N/B 0.75 03/31/26 アメリカ	国債証券	767,223,600	90.88 697,255,522	91.69 703,478,104	0.75 2026/3/31	0.33
21	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	676,935,000	101.56 687,542,571	101.60 687,825,733	3.03 2026/3/11	0.32
22	FRANCE OAT 0.75 05/25/28 フランス	国債証券	756,484,400	90.07 681,394,245	90.51 684,768,543	0.75 2028/5/25	0.32
23	US T N/B 4.0 11/15/52 アメリカ	国債証券	651,871,800	101.44 661,301,908	104.68 682,428,290	4 2052/11/15	0.32
24	FRANCE OAT 0.0 05/25/32 フランス	国債証券	871,955,600	76.25 664,878,284	76.96 671,144,225	- 2032/5/25	0.32
25	US T N/B 2.5 05/15/24 アメリカ	国債証券	684,063,000	97.06 663,968,649	97.68 668,251,259	2.5 2024/5/15	0.31
26	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	577,356,000	114.91 663,461,233	114.59 661,625,727	5.5 2029/4/25	0.31
27	FRANCE OAT 2.5 05/25/30 フランス	国債証券	673,582,000	98.19 661,398,248	98.07 660,610,831	2.5 2030/5/25	0.31

28	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32 中国	国債証券	644,055,300	99.24 639,173,333	99.70 642,187,539	2.8 2032/11/15	0.30
29	US T N/B 0.375 11/30/25 アメリカ	国債証券	696,134,700	90.35 628,999,999	91.37 636,120,271	0.375 2025/11/30	0.30
30	DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31 ドイツ	国債証券	521,100,800	121.09 631,020,618	121.35 632,371,453	5.5 2031/1/4	0.30

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.64
合計	98.64

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

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4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (％) 償還日	投資 比率 (％)
1	US T N/B 2.875 08/15/28 アメリカ	国債証券	2,261,431,800	95.70 2,164,384,184	96.41 2,180,338,257	2.875 2028/8/15	0.71
2	US T N/B 1.25 08/15/31 アメリカ	国債証券	2,505,548,400	82.48 2,066,587,339	83.94 2,103,192,554	1.25 2031/8/15	0.68
3	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証券	1,814,185,800	99.65 1,807,998,293	99.75 1,809,787,324	2.26 2025/2/24	0.59
4	US T N/B 1.125 02/29/28 アメリカ	国債証券	1,944,885,000	87.89 1,709,398,324	88.96 1,730,187,939	1.125 2028/2/29	0.56
5	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	1,877,820,000	90.29 1,695,564,156	90.95 1,708,009,319	0.375 2026/1/31	0.55
6	CHINA GOVERNMENT BOND 2.64 01/15/28 中国	国債証券	1,702,008,000	99.77 1,698,190,415	99.93 1,700,944,261	2.64 2028/1/15	0.55
7	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 11/25/25 中国	国債証券	1,692,337,500	99.38 1,681,850,809	99.53 1,684,533,861	2.28 2025/11/25	0.55
8	US T N/B 1.25 04/30/28 アメリカ	国債証券	1,877,820,000	88.26 1,657,384,971	89.17 1,674,634,017	1.25 2028/4/30	0.54
9	US T N/B 1.25 05/31/28 アメリカ	国債証券	1,857,700,500	88.06 1,635,921,977	89.02 1,653,861,414	1.25 2028/5/31	0.54
10	US T N/B 0.375 12/31/25 アメリカ	国債証券	1,797,342,000	90.25 1,622,125,834	91.32 1,641,408,543	0.375 2025/12/31	0.53
11	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	1,730,277,000	93.42 1,616,489,424	94.13 1,628,825,997	1.625 2026/2/15	0.53
12	US T N/B 0.375 11/30/25 アメリカ	国債証券	1,746,372,600	90.40 1,578,785,776	91.37 1,595,816,176	0.375 2025/11/30	0.52

13	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,652,481,600	95.37 1,576,092,714	95.97 1,585,930,480	2.25 2025/11/15	0.52
14	US T N/B 1.375 11/15/31 アメリカ	国債証券	1,853,676,600	82.79 1,534,669,480	84.37 1,564,039,631	1.375 2031/11/15	0.51
15	US T N/B 2.0 08/15/25 アメリカ	国債証券	1,635,044,700	95.26 1,557,633,743	95.64 1,563,894,715	2 2025/8/15	0.51
16	US T N/B 2.25 08/15/27 アメリカ	国債証券	1,609,560,000	93.35 1,502,604,738	94.41 1,519,745,296	2.25 2027/8/15	0.49
17	US T N/B 4.125 09/30/27 アメリカ	国債証券	1,479,453,900	100.87 1,492,419,509	101.84 1,506,789,116	4.125 2027/9/30	0.49
18	US T N/B 0.5 03/31/25 アメリカ	国債証券	1,581,392,700	92.52 1,463,187,297	93.36 1,476,409,224	0.5 2025/3/31	0.48
19	US T N/B 0.25 09/30/25 アメリカ	国債証券	1,609,560,000	90.67 1,459,506,086	91.64 1,475,136,598	0.25 2025/9/30	0.48
20	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,182,839,600	124.25 1,469,692,251	122.88 1,453,543,088	5.75 2032/10/25	0.47
21	US T N/B 3.0 10/31/25 アメリカ	国債証券	1,480,795,200	97.17 1,438,899,438	97.76 1,447,708,682	3 2025/10/31	0.47
22	US T N/B 1.625 05/15/31 アメリカ	国債証券	1,651,140,300	85.35 1,409,347,618	87.01 1,436,750,050	1.625 2031/5/15	0.47
23	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証券	1,475,430,000	94.12 1,388,802,139	94.82 1,399,007,329	1.125 2025/1/15	0.45
24	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,609,560,000	83.34 1,341,483,758	84.30 1,356,997,405	1.125 2031/2/15	0.44
25	US T N/B 3.875 11/30/27 アメリカ	国債証券	1,341,300,000	100.07 1,342,305,975	101.01 1,354,922,578	3.875 2027/11/30	0.44
26	US T N/B 2.125 05/15/25 アメリカ	国債証券	1,408,365,000	95.71 1,347,981,685	96.12 1,353,735,845	2.125 2025/5/15	0.44
27	US T N/B 2.625 04/15/25 アメリカ	国債証券	1,378,856,400	97.09 1,338,866,837	97.13 1,339,402,795	2.625 2025/4/15	0.44
28	US T N/B 2.875 05/31/25 アメリカ	国債証券	1,348,006,500	97.25 1,310,950,673	97.59 1,315,570,092	2.875 2025/5/31	0.43
29	US T N/B 2.75 06/30/25 アメリカ	国債証券	1,350,689,100	96.89 1,308,795,445	97.30 1,314,336,571	2.75 2025/6/30	0.43
30	US T N/B 1.75 12/31/24 アメリカ	国債証券	1,341,300,000	95.63 1,282,712,016	95.91 1,286,547,718	1.75 2024/12/31	0.42

（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4月28日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	100.44
合計	100.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,354,879	2,268.70 5,342,532,826	2,153.09 5,070,269,134	- -	5.63
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	594,200	6,336.68 3,765,255,256	5,892.60 3,501,382,920	- -	3.89
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	457,121	6,549.58 2,993,955,130	6,479.37 2,961,860,664	- -	3.29
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,417,668	1,629.43 2,309,993,604	1,397.14 1,980,686,340	- -	2.20
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	291,511	3,906.29 1,138,727,232	3,922.13 1,143,344,767	- -	1.27
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	471,210	2,316.04 1,091,344,978	2,288.71 1,078,467,751	- -	1.20
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	9,133,530	91.89 839,283,725	89.66 819,003,635	- -	0.91
8	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 金融サー ビス	165,710	4,524.38 749,735,424	4,575.28 758,170,477	- -	0.84
9	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	495,554	1,487.14 736,960,653	1,515.27 750,901,826	- -	0.83
10	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	365,789	2,091.67 765,111,288	1,927.55 705,077,514	- -	0.78
11	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	321,610	2,076.19 667,725,073	2,056.31 661,330,663	- -	0.73
12	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	606,000	924.02 559,960,968	959.89 581,696,976	- -	0.65

13	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,201,773	453.74 545,294,403	451.56 542,672,796	- -	0.60
14	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	186,714	2,740.22 511,639,304	2,750.97 513,645,732	- -	0.57
15	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	20,843	24,630.55 513,374,745	23,703.02 494,042,066	- -	0.55
16	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	206,385	2,551.75 526,643,336	2,321.17 479,055,083	- -	0.53
17	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	52,044	8,876.54 461,971,168	8,906.63 463,537,172	- -	0.51
18	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	87,562	5,180.17 453,586,483	5,260.11 460,586,408	- -	0.51
19	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	5,248,300	83.03 435,766,349	84.18 441,801,894	- -	0.49
20	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	78,743	5,586.70 439,914,305	5,526.52 435,175,551	- -	0.48
21	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	187,600	2,509.05 470,698,155	2,319.46 435,131,446	- -	0.48
22	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	48,284	9,248.26 446,543,154	8,868.67 428,215,132	- -	0.48
23	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	144,975	3,093.29 448,450,602	2,888.23 418,722,565	- -	0.47
24	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	210,550	2,237.48 471,101,414	1,972.74 415,360,407	- -	0.46
25	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,526,200	53.80 404,924,612	53.63 403,639,137	- -	0.45
26	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,430,235	73.78 400,673,147	72.07 391,398,306	- -	0.43

27	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	2,640,678	146.11 385,844,535	142.39 376,021,609	- -	0.42
28	SAMSUNG SDI CO LTD 韓国	株式 電子装 置・機 器・部品	5,232	75,726.50 396,201,048	70,811.79 370,487,337	- -	0.41
29	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	208,506	1,805.32 376,421,719	1,751.59 365,218,692	- -	0.41
30	LG CHEM LTD 韓国	株式 化学	4,704	80,741.50 379,808,016	74,322.29 349,612,099	- -	0.39

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率(%)
株式	90.96
投資信託受益証券	0.66
投資証券	0.09
合計	91.71

(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4月28日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	14.57
半導体・半導体製造装置		8.21
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.12
コンピュータ・周辺機器		4.87
石油・ガス・消耗燃料		4.60
大規模小売り		4.10
金属・鉱業		3.92
化学		3.01
保険		2.65
自動車		2.58
電子装置・機器・部品		2.57
ホテル・レストラン・レジャー		2.42
情報技術サービス		1.88
食品		1.71
不動産管理・開発		1.67
無線通信サービス		1.59
金融サービス		1.59
生活必需品流通・小売り		1.47
各種電気通信サービス		1.36
飲料		1.34
医薬品		1.24
電気設備		1.14
コングロマリット		1.07
繊維・アパレル・贅沢品		1.01
娯楽		1.00
電力		1.00

独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.86
資本市場	0.85
建設資材	0.81
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.79
専門小売り	0.75
パーソナルケア用品	0.70
運送インフラ	0.70
バイオテクノロジー	0.70
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.67
建設・土木	0.63
消費者金融	0.57
自動車用部品	0.52
ガス	0.50
機械	0.49
海上運輸	0.38
タバコ	0.35
家庭用耐久財	0.34
航空貨物・物流サービス	0.29
旅客航空輸送	0.28
ソフトウェア	0.27
陸上運輸	0.26
ヘルスケア機器・用品	0.22
航空宇宙・防衛	0.18
通信機器	0.17
各種消費者サービス	0.16
紙製品・林産品	0.16
メディア	0.12
商社・流通業	0.10
家庭用品	0.10
水道	0.09
商業サービス・用品	0.07
エネルギー設備・サービス	0.07
容器・包装	0.03
建設関連製品	0.03
レジャー用品	0.03
総合公益事業	0.03
合計	90.96

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	2,843,556,000	92.54 2,631,467,811	93.30 2,653,184,759	6 2033/2/22	2.02
2	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,548,470,000	100.75 2,567,583,525	100.85 2,570,330,775	4.375 2029/4/16	1.95

3	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,548,470,000	95.29 2,428,551,718	95.29 2,428,622,642	5.5 2029/2/22	1.84
4	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	2,146,080,000	101.87 2,186,389,820	102.00 2,189,001,600	6 2029/8/1	1.66
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,146,080,000	98.62 2,116,672,265	99.04 2,125,599,958	4.817 2049/3/14	1.61
6	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,548,470,000	76.77 1,956,669,240	76.23 1,942,824,065	5.875 2060/1/30	1.48
7	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,743,690,000	106.72 1,861,022,900	107.03 1,866,337,667	7.125 2033/1/17	1.42
8	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,146,080,000	85.72 1,839,749,506	86.38 1,853,911,552	2.783 2031/1/23	1.41
9	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	1,877,820,000	98.00 1,840,263,600	97.97 1,839,700,254	3.4 2025/4/16	1.40
10	PANAMA 6.4 02/14/35 パナマ	国債証券	1,743,690,000	104.14 1,815,901,120	105.39 1,837,747,184	6.4 2035/2/14	1.40
11	STATE OF QATAR 5.103 04/23/48 カタール	国債証券	1,743,690,000	102.15 1,781,179,335	102.25 1,782,923,025	5.103 2048/4/23	1.35
12	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,743,690,000	100.01 1,743,936,313	100.83 1,758,208,991	4.375 2031/1/23	1.34
13	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,877,820,000	93.74 1,760,268,468	93.58 1,757,263,956	4.4 2050/4/16	1.33
14	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,743,690,000	100.19 1,747,159,943	100.23 1,747,850,444	4 2029/3/14	1.33
15	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,877,820,000	89.38 1,678,410,069	89.23 1,675,756,747	3.875 2030/6/12	1.27
16	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証券	1,743,690,000	95.89 1,672,180,446	95.76 1,669,804,745	2.875 2025/6/6	1.27
17	OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 オマーン	国債証券	1,609,560,000	100.64 1,619,901,423	100.59 1,619,056,404	5.625 2028/1/17	1.23
18	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	2,146,080,000	73.29 1,573,016,142	73.18 1,570,521,538	4.75 2050/1/14	1.19
19	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,609,560,000	96.56 1,554,191,136	96.42 1,551,937,752	2.5 2025/4/16	1.18
20	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,146,080,000	72.08 1,547,001,768	71.68 1,538,310,144	5.75 2049/9/30	1.17
21	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,743,690,000	81.93 1,428,663,979	83.22 1,451,176,412	3 2034/1/15	1.10

22	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,609,560,000	89.63 1,442,790,269	89.76 1,444,821,534	4.85 2029/9/30	1.10
23	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,341,300,000	105.75 1,418,470,743	106.27 1,425,532,177	6.35 2035/2/9	1.08
24	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	1,341,300,000	102.07 1,369,098,442	101.93 1,367,287,687	4.75 2028/1/18	1.04
25	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29 アラブ首長国連邦	国債証券	1,475,430,000	91.97 1,356,983,955	92.24 1,360,973,517	2.5 2029/9/30	1.03
26	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55 ウルグアイ	国債証券	1,341,300,000	98.76 1,324,717,885	100.07 1,342,255,810	4.975 2055/4/20	1.02
27	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,341,300,000	98.68 1,323,702,144	98.99 1,327,775,672	3.75 2030/4/16	1.01
28	REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32 チリ	国債証券	1,502,256,000	85.94 1,291,047,083	86.55 1,300,335,261	2.55 2032/1/27	0.99
29	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,341,300,000	96.35 1,292,421,686	96.35 1,292,400,225	2.125 2024/9/30	0.98
30	ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30 アラブ首長国連邦	国債証券	1,341,300,000	95.15 1,276,374,373	95.33 1,278,714,942	3.125 2030/4/16	0.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.58
合計	98.58

(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。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	22,391	669,053.03 14,980,766,466	570,000.00 12,762,870,000	- -	6.17
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	19,681	614,913.10 12,102,104,771	539,000.00 10,608,059,000	- -	5.13

3	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証 券	32,352	330,075.50 10,678,602,695	309,500.00 10,012,944,000	- -	4.84
4	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証 券	62,067	165,066.68 10,245,194,187	159,100.00 9,874,859,700	- -	4.78
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証 券	96,841	105,128.25 10,180,725,373	99,500.00 9,635,679,500	- -	4.66
6	G L P 投資法人 日本	投資証 券	61,949	161,228.14 9,987,922,222	155,500.00 9,633,069,500	- -	4.66
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証 券	28,931	305,897.80 8,849,929,357	289,500.00 8,375,524,500	- -	4.05
8	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証 券	19,191	349,850.65 6,713,983,996	353,000.00 6,774,423,000	- -	3.28
9	オリックス不動産投資法人 日本	投資証 券	38,243	183,966.85 7,035,444,515	175,800.00 6,723,119,400	- -	3.25
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証 券	42,934	147,466.89 6,331,343,585	151,000.00 6,483,034,000	- -	3.14
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証 券	84,478	45,246.81 3,822,360,741	58,700.00 4,958,858,600	- -	2.40
12	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証 券	61,895	70,658.57 4,373,412,522	76,800.00 4,753,536,000	- -	2.30
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証 券	13,126	396,721.02 5,207,360,173	353,500.00 4,640,041,000	- -	2.24
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証 券	29,285	173,275.73 5,074,379,847	155,800.00 4,562,603,000	- -	2.21
15	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証 券	57,675	78,665.06 4,537,007,417	77,100.00 4,446,742,500	- -	2.15
16	日本アコモデーションファ ンド投資法人 日本	投資証 券	6,627	650,987.38 4,314,093,430	661,000.00 4,380,447,000	- -	2.12
17	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証 券	12,942	319,575.70 4,135,948,823	323,000.00 4,180,266,000	- -	2.02
18	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証 券	10,133	412,206.82 4,176,891,760	396,000.00 4,012,668,000	- -	1.94
19	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	7,582	521,735.99 3,955,802,323	511,000.00 3,874,402,000	- -	1.87
20	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証 券	23,496	169,994.08 3,994,181,078	161,600.00 3,796,953,600	- -	1.84
21	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	7,121	519,527.68 3,699,556,648	491,500.00 3,499,971,500	- -	1.69

22	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証券	22,570	153,389.84 3,462,008,816	153,700.00 3,469,009,000	- -	1.68
23	イオンリート投資法人 日本	投資証券	22,034	153,191.13 3,375,413,517	155,900.00 3,435,100,600	- -	1.66
24	ケネディクス・オフィス投資法人 日本	投資証券	11,168	328,875.19 3,672,878,184	300,500.00 3,355,984,000	- -	1.62
25	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 日本	投資証券	9,178	326,911.74 3,000,395,970	340,500.00 3,125,109,000	- -	1.51
26	大和証券リビング投資法人 日本	投資証券	26,597	115,457.47 3,070,822,533	115,700.00 3,077,272,900	- -	1.49
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	14,076	212,690.49 2,993,831,396	213,400.00 3,003,818,400	- -	1.45
28	ヒューリックリート投資法人 日本	投資証券	17,957	161,717.38 2,903,959,002	156,700.00 2,813,861,900	- -	1.36
29	三菱地所物流リート投資法人 日本	投資証券	6,594	445,184.79 2,935,548,523	417,500.00 2,752,995,000	- -	1.33
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証券	35,723.48	71,580.71 2,557,112,151	71,600.00 2,557,801,168	- -	1.24

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年4月28日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.81
合計	97.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資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4月28日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	PROLOGIS INC アメリカ	投資証券	428,024	15,721.04 6,728,982,842	16,388.00 7,014,458,767	- -	8.93
2	EQUINIX INC アメリカ	投資証券	42,918	88,515.98 3,798,929,034	96,552.13 4,143,824,710	- -	5.28
3	PUBLIC STORAGE アメリカ	投資証券	73,328	40,524.81 2,971,603,928	39,223.63 2,876,190,773	- -	3.66
4	REALTY INCOME CORP アメリカ	投資証券	290,807	8,648.88 2,515,155,378	8,354.95 2,429,680,183	- -	3.09
5	WELLTOWER INC アメリカ	投資証券	219,237	9,880.35 2,166,140,382	10,460.79 2,293,394,124	- -	2.92

6	SIMON PROPERTY GROUP INC アメリカ	投資証券	151,362	14,399.20 2,179,491,911	14,834.77 2,245,421,667	- -	2.86
7	VICI PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	465,713	4,230.21 1,970,067,132	4,465.18 2,079,495,959	- -	2.65
8	DIGITAL REALTY TRUST INC アメリカ	投資証券	133,436	15,033.16 2,005,965,532	13,647.72 1,821,098,166	- -	2.32
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	64,712	24,150.66 1,562,837,968	23,828.19 1,541,970,122	- -	1.96
10	GOODMAN GROUP オーストラリア	投資信託受益証券	792,693	1,637.01 1,297,648,353	1,714.64 1,359,186,771	- -	1.73
11	EQUITY RESIDENTIAL アメリカ	投資証券	157,777	8,840.56 1,394,838,017	8,290.57 1,308,062,099	- -	1.67
12	EXTRA SPACE STORAGE INC アメリカ	投資証券	62,042	21,830.40 1,354,401,700	20,269.72 1,257,574,315	- -	1.60
13	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT アメリカ	投資証券	72,974	18,372.74 1,340,732,745	16,460.43 1,201,183,681	- -	1.53
14	INVITATION HOMES INC アメリカ	投資証券	269,111	4,404.91 1,185,412,421	4,408.85 1,186,470,866	- -	1.51
15	VENTAS INC アメリカ	投資証券	185,347	6,223.10 1,153,432,938	6,322.88 1,171,928,359	- -	1.49
16	MID AMERICA アメリカ	投資証券	53,630	21,418.95 1,148,698,305	20,296.55 1,088,504,062	- -	1.39
17	SUN COMMUNITIES INC アメリカ	投資証券	57,535	19,706.10 1,133,790,827	18,174.61 1,045,676,474	- -	1.33
18	LINK REIT 香港	投資証券	1,172,120	955.36 1,119,804,910	871.07 1,021,010,289	- -	1.30
19	IRON MOUNTAIN INC アメリカ	投資証券	135,035	6,739.75 910,103,001	7,374.46 995,811,205	- -	1.27
20	WP CAREY INC アメリカ	投資証券	97,836	10,789.52 1,055,604,386	9,854.53 964,127,904	- -	1.23
21	ESSEX PROPERTY TRUST INC アメリカ	投資証券	30,017	31,580.70 947,958,103	28,363.12 851,376,067	- -	1.08
22	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	119,657	6,580.31 787,380,299	6,902.32 825,912,076	- -	1.05
23	UDR INC アメリカ	投資証券	143,710	5,707.00 820,153,656	5,511.40 792,043,538	- -	1.01
24	SEGRO PLC イギリス	投資証券	562,081	1,471.47 827,086,647	1,358.97 763,851,721	- -	0.97
25	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES アメリカ	投資証券	80,792	9,095.23 734,822,336	9,116.81 736,565,806	- -	0.94
26	CAMDEN PROPERTY TRUST アメリカ	投資証券	51,080	16,029.94 818,809,834	14,288.86 729,875,423	- -	0.93
27	KIMCO REALTY アメリカ	投資証券	285,608	2,667.86 761,963,598	2,547.12 727,480,333	- -	0.93
28	HEALTHPEAK PROPERTIES INC アメリカ	投資証券	252,501	3,237.78 817,545,075	2,844.89 718,339,413	- -	0.91

29	HOST HOTELS & RESORTS INC アメリカ	投資証 券	330,213	2,243.54 740,846,130	2,134.00 704,677,282	- -	0.90
30	LIFE STORAGE INC アメリカ	投資証 券	39,247	15,482.14 607,627,796	17,856.72 700,822,960	- -	0.89

(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4月28日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	10.60
投資証券	89.04
合計	99.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

該当事項はありません。

(参考)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

該当事項はありません。

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

該当事項はありません。

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0506月	買建	493	9,883,972,690	10,145,940,000	2.41

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 （円）	評価金額 （円）	投資比率 （％）
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun23	買建	278	7,720,164,002	7,744,280,576	0.82
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun23	買建	293	1,866,862,861	1,873,397,346	0.20
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun23	買建	38	499,508,983	498,730,249	0.05
	モン トリ オール取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun23	買建	16	391,039,018	391,725,065	0.04

シドニー先物取引所	SPI 200 FUTURES Jun23	買建	20	326,047,189	324,332,100	0.03
-----------	--------------------------	----	----	-------------	-------------	------

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

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

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
 該当事項はありません。

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

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun23	買建	1,133	7,611,306,106	7,440,416,438	8.26

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
 該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0506月	買建	2,337	4,213,377,300	4,366,684,500	2.11

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

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

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
 該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

直近日(2023年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年10月12日)	2	2	0.9833	0.9833
第2計算期間末 (2019年10月15日)	15	15	1.0351	1.0351
第3計算期間末 (2020年10月12日)	21	21	1.0398	1.0398

第4計算期間末 (2021年10月12日)	33	33	1.0379	1.0379
第5計算期間末 (2022年10月12日)	41	41	0.9606	0.9606
2022年4月末日	38	-	0.9966	-
5月末日	39	-	0.9928	-
6月末日	40	-	0.9787	-
7月末日	42	-	0.9907	-
8月末日	42	-	0.9832	-
9月末日	41	-	0.9636	-
10月末日	42	-	0.9669	-
11月末日	43	-	0.9658	-
12月末日	43	-	0.9469	-
2023年1月末日	44	-	0.9494	-
2月末日	45	-	0.9564	-
3月末日	46	-	0.9690	-
4月末日	46	-	0.9720	-

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

直近日(2023年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年10月12日)	3	3	0.9790	0.9790
第2計算期間末 (2019年10月15日)	33	33	1.0636	1.0636
第3計算期間末 (2020年10月12日)	37	37	1.0639	1.0639
第4計算期間末 (2021年10月12日)	59	59	1.1257	1.1257
第5計算期間末 (2022年10月12日)	89	89	1.0408	1.0408
2022年4月末日	79	-	1.0843	-
5月末日	85	-	1.0813	-
6月末日	86	-	1.0651	-
7月末日	89	-	1.0868	-
8月末日	88	-	1.0782	-
9月末日	88	-	1.0444	-
10月末日	92	-	1.0643	-
11月末日	94	-	1.0624	-
12月末日	92	-	1.0279	-
2023年1月末日	95	-	1.0403	-
2月末日	99	-	1.0465	-
3月末日	102	-	1.0550	-
4月末日	102	-	1.0644	-

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

直近日(2023年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年10月12日)	21	21	0.9769	0.9769
第2計算期間末 (2019年10月15日)	50	50	1.0707	1.0707
第3計算期間末 (2020年10月12日)	92	92	1.0644	1.0644
第4計算期間末 (2021年10月12日)	546	546	1.1651	1.1651
第5計算期間末 (2022年10月12日)	1,079	1,079	1.0905	1.0905
2022年4月末日	854	-	1.1341	-
5月末日	900	-	1.1320	-
6月末日	939	-	1.1149	-
7月末日	1,006	-	1.1411	-
8月末日	1,043	-	1.1352	-
9月末日	1,046	-	1.0933	-
10月末日	1,125	-	1.1248	-
11月末日	1,159	-	1.1212	-
12月末日	1,156	-	1.0789	-
2023年1月末日	1,209	-	1.0968	-
2月末日	1,248	-	1.1071	-
3月末日	1,283	-	1.1112	-
4月末日	1,325	-	1.1257	-

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

直近日(2023年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年10月12日)	11	11	0.9720	0.9720
第2計算期間末 (2019年10月15日)	20	20	1.0764	1.0764
第3計算期間末 (2020年10月12日)	40	40	1.0631	1.0631
第4計算期間末 (2021年10月12日)	82	82	1.2298	1.2298
第5計算期間末 (2022年10月12日)	96	96	1.1726	1.1726
2022年4月末日	91	-	1.2200	-
5月末日	92	-	1.2174	-
6月末日	92	-	1.1967	-
7月末日	98	-	1.2299	-
8月末日	98	-	1.2281	-
9月末日	96	-	1.1739	-
10月末日	102	-	1.2237	-

11月末日	104	-	1.2178	-
12月末日	103	-	1.1641	-
2023年1月末日	107	-	1.1930	-
2月末日	112	-	1.2090	-
3月末日	114	-	1.2053	-
4月末日	117	-	1.2272	-

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

直近日(2023年4月末)、同日前1年以内における各月末及び下記計算期間末における純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額 (分配落) (百万円)	純資産総額 (分配付) (百万円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2018年10月12日)	25	25	0.9689	0.9689
第2計算期間末 (2019年10月15日)	41	41	1.0762	1.0762
第3計算期間末 (2020年10月12日)	71	71	1.0582	1.0582
第4計算期間末 (2021年10月12日)	177	177	1.2864	1.2864
第5計算期間末 (2022年10月12日)	230	230	1.2449	1.2449
2022年4月末日	224	-	1.2995	-
5月末日	229	-	1.2942	-
6月末日	231	-	1.2697	-
7月末日	242	-	1.3099	-
8月末日	248	-	1.3122	-
9月末日	222	-	1.2447	-
10月末日	245	-	1.3125	-
11月末日	243	-	1.3049	-
12月末日	236	-	1.2399	-
2023年1月末日	250	-	1.2796	-
2月末日	257	-	1.3009	-
3月末日	260	-	1.2881	-
4月末日	268	-	1.3172	-

【分配の推移】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2022年10月13日～2023年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

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

第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2022年10月13日～2023年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2022年10月13日～2023年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2022年10月13日～2023年4月12日	-

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

	1口当たりの分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
2022年10月13日～2023年4月12日	-

【収益率の推移】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.3
第3計算期間	0.5
第4計算期間	0.2
第5計算期間	7.4
2022年10月13日～2023年4月12日	0.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

	収益率(%)
第1計算期間	2.1
第2計算期間	8.6
第3計算期間	0.0
第4計算期間	5.8
第5計算期間	7.5

2022年10月13日～2023年4月12日	1.8
------------------------	-----

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

	収益率(%)
第1計算期間	2.3
第2計算期間	9.6
第3計算期間	0.6
第4計算期間	9.5
第5計算期間	6.4
2022年10月13日～2023年4月12日	2.6

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	10.7
第3計算期間	1.2
第4計算期間	15.7
第5計算期間	4.7
2022年10月13日～2023年4月12日	3.8

(注) 収益率は期間騰落率です。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

	収益率(%)
第1計算期間	3.1
第2計算期間	11.1
第3計算期間	1.7
第4計算期間	21.6
第5計算期間	3.2
2022年10月13日～2023年4月12日	4.7

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

たわらノーロード 最適化バランス(保守型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	2,977,556	174,550
第2計算期間	22,730,963	10,540,865
第3計算期間	17,938,395	12,483,397
第4計算期間	24,844,256	13,204,883
第5計算期間	18,138,145	6,528,366
2022年10月13日～ 2023年4月12日	8,860,967	4,350,044

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

たわらノーロード 最適化バランス(安定型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	3,904,625	582,727
第2計算期間	36,969,409	8,563,355
第3計算期間	42,156,996	38,919,319

第4計算期間	33,732,331	15,446,236
第5計算期間	57,763,582	25,452,275
2022年10月13日～ 2023年4月12日	15,074,186	3,542,027

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	25,984,069	4,188,524
第2計算期間	41,599,021	16,390,022
第3計算期間	82,404,947	42,671,397
第4計算期間	444,800,840	62,559,806
第5計算期間	676,989,235	156,154,740
2022年10月13日～ 2023年4月12日	253,658,793	70,669,753

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

たわらノーロード 最適化バランス(成長型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	13,018,896	1,605,269
第2計算期間	14,012,274	6,756,536
第3計算期間	36,439,613	16,975,790
第4計算期間	51,733,528	22,607,245
第5計算期間	39,935,902	24,513,436
2022年10月13日～ 2023年4月12日	16,023,463	3,051,493

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)

	設定口数	解約口数
第1計算期間	31,119,190	5,281,700
第2計算期間	28,388,516	15,995,569
第3計算期間	62,838,030	33,055,430
第4計算期間	99,789,186	30,094,855
第5計算期間	116,848,868	69,648,260
2022年10月13日～ 2023年4月12日	32,272,722	13,880,051

(注1) 本邦外における設定及び解約はありません。

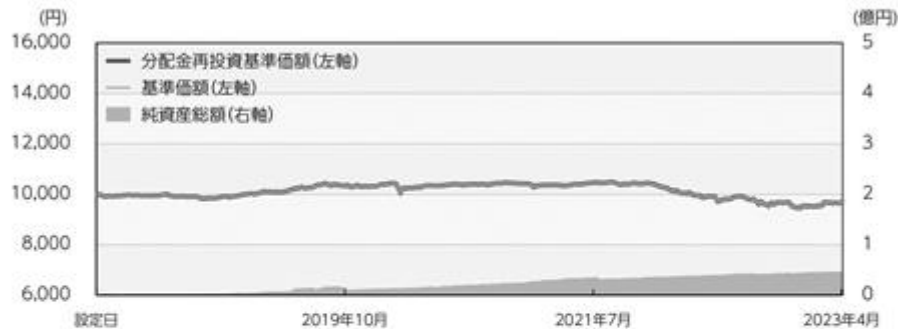
(注2) 第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

<< 参考情報 >>

データの基準日:2023年4月28日

(保守型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2023年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	73.67
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	9.86
3	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.91
4	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	3.97
5	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	3.02
6	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.02

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。

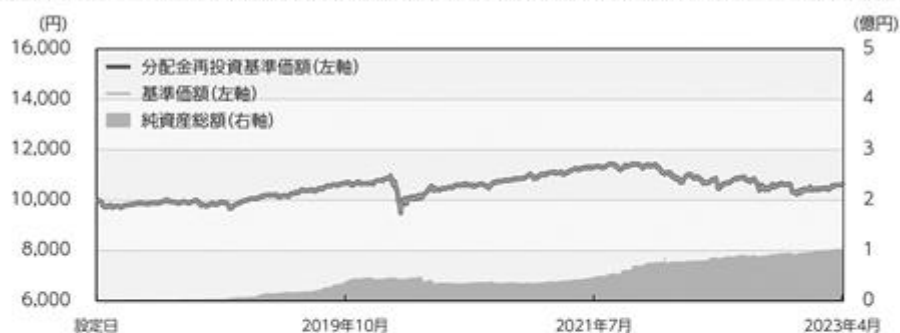
○掲載データ等はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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4月28日

(安定型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2023年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
設定来累計	0円

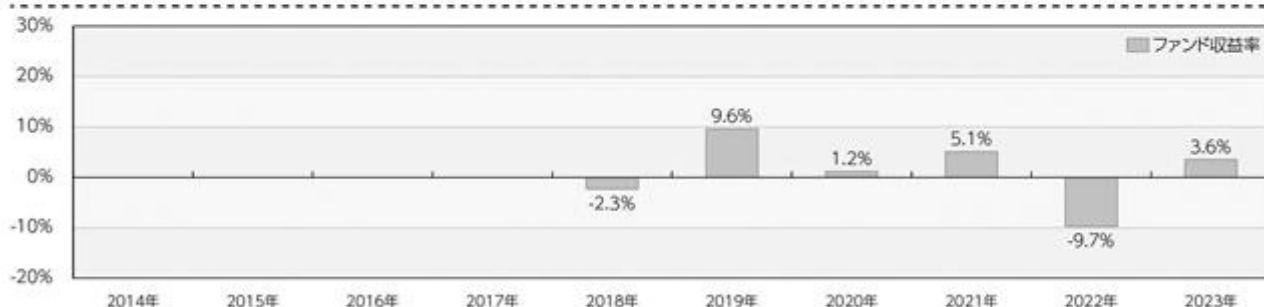
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	27.82
2	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	23.60
3	為替フルヘッジ外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	18.81
4	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	10.96
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	6.05
6	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	6.02
7	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	3.97
8	外国リート/パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.99
9	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	0.98

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。

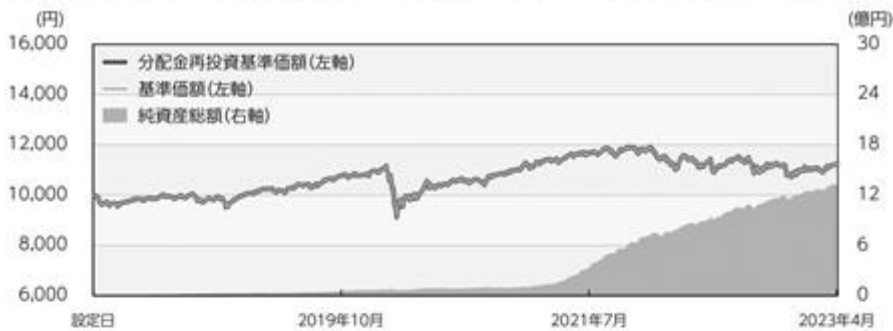
※当ファンドにはベンチマークはありません。

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

(安定成長型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2023年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	28.82
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	15.55
3	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	12.84
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	10.07
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	9.98
6	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	9.09
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	8.12
8	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	4.02
9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	0.99

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。

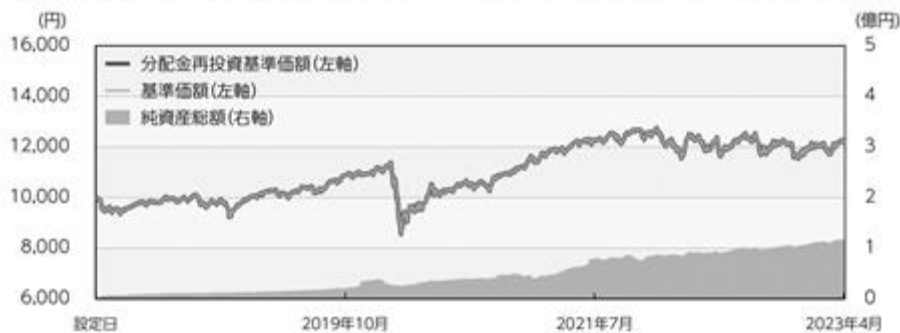
※当ファンドにはベンチマークはありません。

○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。

(成長型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2023年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	26.89
2	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	18.93
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	13.07
4	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	10.16
5	外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド	8.94
6	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	8.01
7	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	5.53
8	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	4.99
9	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	2.97

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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。

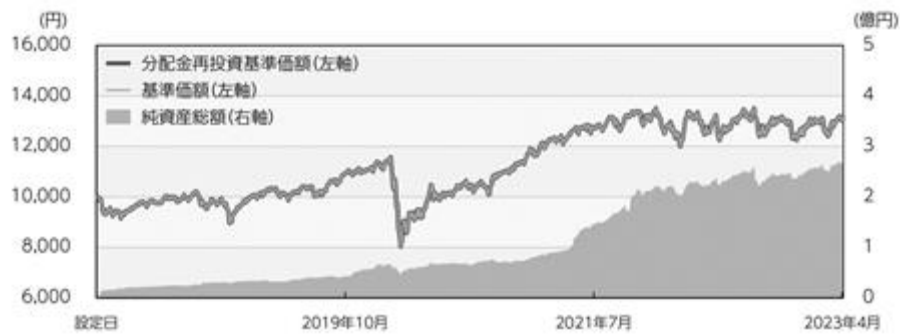
○掲載データ等はいくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を示唆、保証するものではありません。

○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4月28日

(積極型)

基準価額・純資産の推移 (2018年1月24日～2023年4月28日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

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

分配の推移(税引前)

2018年10月	0円
2019年10月	0円
2020年10月	0円
2021年10月	0円
2022年10月	0円
設定来累計	0円

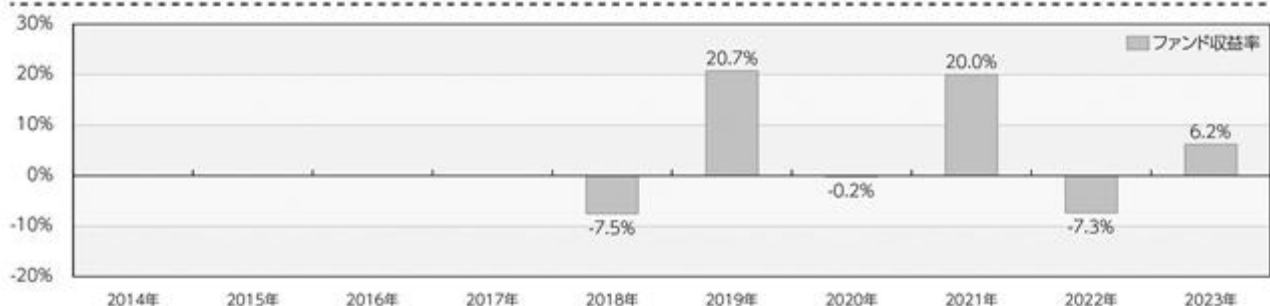
※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄 ※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	比率(%)
1	外国株式/パッシブ・ファンド・マザーファンド	27.84
2	外国債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	19.42
3	国内株式/パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	17.10
4	外国リート/パッシブ・ファンド・マザーファンド	14.92
5	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	11.17
6	エマージング債券/パッシブ・マザーファンド	5.00
7	エマージング株式/パッシブ・マザーファンド	3.97
8	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	0.04
9	国内債券/パッシブ・ファンド・マザーファンド	0.03

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※2018年は設定日から年末までの収益率、および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4月28日

主要な資産の状況

■国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	トヨタ自動車	株式	日本	輸送用機器	3.39
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	3.02
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.03
4	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.77
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.75

■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	334回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.6	2024/6/20	1.53
2	137回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.7	2032/6/20	1.09
3	345回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2026/12/20	1.07
4	144回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.1	2025/6/20	0.94
5	346回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.1	2027/3/20	0.91

■外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	業種	比率(%)
1	APPLE INC	株式	アメリカ	コンピュータ・周辺機器	5.22
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.20
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	1.96
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.31
5	ALPHABET INC-CL A	株式	アメリカ	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.26

■外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	アメリカ	1.5	2024/11/30	0.54
2	US T N/B 2.875 05/15/32	国債証券	アメリカ	2.875	2032/5/15	0.54
3	US T N/B 1.125 02/15/31	国債証券	アメリカ	1.125	2031/2/15	0.47
4	US T N/B 2.75 08/15/32	国債証券	アメリカ	2.75	2032/8/15	0.46
5	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.46

■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 2.875 08/15/28	国債証券	アメリカ	2.875	2028/8/15	0.71
2	US T N/B 1.25 08/15/31	国債証券	アメリカ	1.25	2031/8/15	0.68
3	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	中国	2.26	2025/2/24	0.59
4	US T N/B 1.125 02/29/28	国債証券	アメリカ	1.125	2028/2/29	0.56
5	US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	アメリカ	0.375	2026/1/31	0.55

○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。

■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	5.63
2	TENCENT HOLDINGS LTD	株式	ケイマン諸島	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.89
3	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.29
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.20
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.27

■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	2.02
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	1.95
3	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.84
4	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	オマーン	6	2029/8/1	1.66
5	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.61

■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	6.17
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.13
3	日本プロロジスリート投資法人	投資証券	日本	4.84
4	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.78
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.66

■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	8.93
2	EQUINIX INC	投資証券	アメリカ	5.28
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	アメリカ	3.66
4	REALTY INCOME CORP	投資証券	アメリカ	3.09
5	WELLTOWER INC	投資証券	アメリカ	2.92

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

○委託会社のホームページ等で運用状況が開示されている場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、取扱いが一部異なる場合があります。

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

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

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

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

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

なお、委託会社または販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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1万口あたりに換算した基準価額で表示することがあります。）

< 基準価額の照会方法等 >

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

・お申込手数料

ありません。

・お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

確定拠出年金制度によるお申込みの場合は、1円以上1円単位となります。

当初元本は1口当たり1円です。

・払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

各ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して6営業日目から販売会社の営業所等において支払います。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

各ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2018年1月24日から原則として無期限です。

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

(4)【計算期間】

a. 計算期間は、原則として毎年10月13日から翌年10月12日までとします。

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

(5)【その他】

イ.償還規定

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

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

c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下イ.償還規定c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、

知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

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

ロ. 信託約款の変更等

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたはこの信託と他の投資信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款はa.からg.に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

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

八. 関係法人との契約の更改

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

投資顧問契約について、委託会社と投資顧問会社との間の当該契約は、原則として期間満了の1ヵ月前までに、当事者間の別段の意思表示がない限り、半年毎に自動的に更新されます。当該契約は、当事者間の合意により変更することができます。

二. 公告

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

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

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

ホ. 運用報告書

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

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

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

4【受益者の権利等】

(1)収益分配金請求権

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

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

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

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

(2)償還金請求権

受益者は、持ち分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

1【財務諸表】

【たわらノーロード 最適化バランス（保守型）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	268,921	472,985
親投資信託受益証券	33,126,904	41,721,399
未収入金	-	37,000
流動資産合計	33,395,825	42,231,384
資産合計	33,395,825	42,231,384
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	142,333
未払受託者報酬	7,188	8,968
未払委託者報酬	83,332	103,662
その他未払費用	549	732
流動負債合計	91,069	255,695
負債合計	91,069	255,695
純資産の部		
元本等		
元本	32,087,475	43,697,254
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,217,281	1,721,565
（分配準備積立金）	336,175	565,017
元本等合計	33,304,756	41,975,689
純資産合計	33,304,756	41,975,689
負債純資産合計	33,395,825	42,231,384

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期 自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	第5期 自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	121,472	2,824,505
営業収益合計	121,472	2,824,505
営業費用		
支払利息	6	6
受託者報酬	12,581	16,820
委託者報酬	146,131	194,429
その他費用	939	1,317
営業費用合計	159,657	212,572
営業利益又は営業損失()	38,185	3,037,077
経常利益又は経常損失()	38,185	3,037,077
当期純利益又は当期純損失()	38,185	3,037,077
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()	32,750	189,297
期首剰余金又は期首欠損金()	814,496	1,217,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,000,587	125,758
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	1,000,587	125,758
剰余金減少額又は欠損金増加額	526,867	216,824
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	526,867	216,824
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()	1,217,281	1,721,565

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	2021年10月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	20,448,102円	32,087,475円
期中追加設定元本額	24,844,256円	18,138,145円
期中一部解約元本額	13,204,883円	6,528,366円
2. 受益権の総数	32,087,475口	43,697,254口
3. 元本の欠損	-	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,721,565円でありませ

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(207,381円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(881,106円)及び分配準備積立金(128,794円)より分配対象収益は1,217,281円(1万口当たり379.36円)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(281,513円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(0円)、信託約款に規定される収益調整金(1,224,597円)及び分配準備積立金(283,504円)より分配対象収益は1,789,614円(1万口当たり409.54円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	27,052	2,289,776
合計	27,052	2,289,776

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0379円 (10,379円)	0.9606円 (9,606円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	673,741	2,138,184	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	845,206	1,689,228	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	22,510,601	28,320,587	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,447	8,342	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,008,194	2,085,247	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	6,270,275	7,479,811	
親投資信託受益証券 合計		31,309,464	41,721,399	
合計			41,721,399	

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

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【たわらノーロード 最適化バランス(安定型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	461,672	754,249
親投資信託受益証券	59,621,736	88,552,307
流動資産合計	60,083,408	89,306,556
資産合計	60,083,408	89,306,556
負債の部		
流動負債		
未払解約金	11,519	9,313
未払受託者報酬	10,041	18,997
未払委託者報酬	116,036	218,996
その他未払費用	813	1,604
流動負債合計	138,409	248,910
負債合計	138,409	248,910
純資産の部		
元本等		
元本	53,251,724	85,563,031
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	6,693,275	3,494,615
(分配準備積立金)	2,159,651	2,687,237
元本等合計	59,944,999	89,057,646
純資産合計	59,944,999	89,057,646
負債純資産合計	60,083,408	89,306,556

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2020年10月13日 至 2021年10月12日	自	2021年10月13日 至 2022年10月12日
営業収益				
受取利息		-		2
有価証券売買等損益		2,337,060		6,240,429
営業収益合計		2,337,060		6,240,427
営業費用				
支払利息		6		51
受託者報酬		17,980		35,181
委託者報酬		207,790		405,700
その他費用		1,390		2,981
営業費用合計		227,166		443,913
営業利益又は営業損失()		2,109,894		6,684,340
経常利益又は経常損失()		2,109,894		6,684,340
当期純利益又は当期純損失()		2,109,894		6,684,340
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()		377,184		660,858
期首剰余金又は期首欠損金()		2,233,502		6,693,275
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,790,295		5,940,246
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		3,790,295		5,940,246
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,063,232		3,115,424
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,063,232		3,115,424
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()		6,693,275		3,494,615

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	2021年10月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	34,965,629円	53,251,724円
期中追加設定元本額	33,732,331円	57,763,582円
期中一部解約元本額	15,446,236円	25,452,275円
2. 受益権の総数	53,251,724口	85,563,031口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(686,595円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(857,843円)、信託約款に規定される収益調整金(4,533,624円)及び分配準備積立金(615,213円)より分配対象収益は6,693,275円(1万口当たり1,256.91円)ですが、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(1,158,671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(6,413,604円)及び分配準備積立金(1,528,566円)より分配対象収益は9,100,841円(1万口当たり1,063.64円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,690,988	5,279,713
合計	1,690,988	5,279,713

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1257円 (11,257円)	1.0408円 (10,408円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	2,853,044	9,054,420	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	3,586,649	7,168,276	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	17,319,805	21,790,046	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	2,221,820	5,284,821	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	1,231,109	7,098,205	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	6,858,333	14,185,090	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	126,975	198,576	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	19,205,766	22,910,558	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	653,715	862,315	
親投資信託受益証券 合計		54,057,216	88,552,307	
合計			88,552,307	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,482,757	10,435,603
親投資信託受益証券	543,352,929	1,072,637,359
未収入金	-	211,000
流動資産合計	547,835,686	1,083,283,962
資産合計	547,835,686	1,083,283,962
負債の部		
流動負債		
未払解約金	550,951	1,174,574
未払受託者報酬	67,873	213,875
未払委託者報酬	781,080	2,460,114
その他未払費用	5,948	18,950
流動負債合計	1,405,852	3,867,513
負債合計	1,405,852	3,867,513
純資産の部		
元本等		
元本	468,979,128	989,813,623
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	77,450,706	89,602,826
(分配準備積立金)	10,155,195	21,873,873
元本等合計	546,429,834	1,079,416,449
純資産合計	546,429,834	1,079,416,449
負債純資産合計	547,835,686	1,083,283,962

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2020年10月13日	自	2021年10月13日
	至	2021年10月12日	至	2022年10月12日
営業収益				
受取利息		5		55
有価証券売買等損益		11,874,013		59,174,570
営業収益合計		11,874,018		59,174,515
営業費用				
支払利息		333		1,795
受託者報酬		89,949		369,459
委託者報酬		1,035,631		4,249,883
その他費用		7,819		32,715
営業費用合計		1,133,732		4,653,852
営業利益又は営業損失()		10,740,286		63,828,367
経常利益又は経常損失()		10,740,286		63,828,367
当期純利益又は当期純損失()		10,740,286		63,828,367
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()		1,996,852		2,386,115
期首剰余金又は期首欠損金()		5,585,406		77,450,706
剰余金増加額又は欠損金減少額		69,541,934		99,277,528
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		69,541,934		99,277,528
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,420,068		25,683,156
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,420,068		25,683,156
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()		77,450,706		89,602,826

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	2021年10月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	86,738,094円	468,979,128円
期中追加設定元本額	444,800,840円	676,989,235円
期中一部解約元本額	62,559,806円	156,154,740円
2. 受益権の総数	468,979,128口	989,813,623口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(3,897,058円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(4,525,949円)、信託約款に規定される収益調整金(67,295,511円)及び分配準備積立金(1,732,188円)より分配対象収益は77,450,706円(1万口当たり1,651.47円)ですが、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(13,818,401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(89,675,340円)及び分配準備積立金(8,055,472円)より分配対象収益は111,549,213円(1万口当たり1,126.97円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	10,153,470	52,907,570
合計	10,153,470	52,907,570

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1651円 (11,651円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	45,049,814	142,970,089	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	38,081,399	76,109,484	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	141,363,742	177,849,723	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	36,060,306	85,773,043	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	26,153,378	150,792,531	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	83,053,072	171,778,668	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	20,641,354	32,281,013	
	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	179,030,528	213,565,516	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	16,312,101	21,517,292	
親投資信託受益証券 合計		585,745,694	1,072,637,359	
合計			1,072,637,359	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【たわらノーロード 最適化バランス(成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	859,698	738,211
親投資信託受益証券	82,197,914	96,406,278
未収入金	100,000	581,000
流動資産合計	83,157,612	97,725,489
資産合計	83,157,612	97,725,489
負債の部		
流動負債		
未払解約金	250,384	508,002
未払受託者報酬	15,145	20,986
未払委託者報酬	174,559	241,916
その他未払費用	1,254	1,751
流動負債合計	441,342	772,655
負債合計	441,342	772,655
純資産の部		
元本等		
元本	67,259,471	82,681,937
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	15,456,799	14,270,897
(分配準備積立金)	6,338,724	6,053,907
元本等合計	82,716,270	96,952,834
純資産合計	82,716,270	96,952,834
負債純資産合計	83,157,612	97,725,489

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2020年10月13日	自	2021年10月13日
	至	2021年10月12日	至	2022年10月12日
営業収益				
受取利息		-		1
有価証券売買等損益		7,637,064		3,839,636
営業収益合計		7,637,064		3,839,635
営業費用				
支払利息		15		85
受託者報酬		24,933		39,639
委託者報酬		287,616		456,881
その他費用		2,058		3,347
営業費用合計		314,622		499,952
営業利益又は営業損失()		7,322,442		4,339,587
経常利益又は経常損失()		7,322,442		4,339,587
当期純利益又は当期純損失()		7,322,442		4,339,587
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()		1,632,290		305,451
期首剰余金又は期首欠損金()		2,404,406		15,456,799
剰余金増加額又は欠損金減少額		9,373,515		9,117,861
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		9,373,515		9,117,861
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,011,274		5,658,725
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,011,274		5,658,725
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()		15,456,799		14,270,897

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	2021年10月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	38,133,188円	67,259,471円
期中追加設定元本額	51,733,528円	39,935,902円
期中一部解約元本額	22,607,245円	24,513,436円
2. 受益権の総数	67,259,471口	82,681,937口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(1,165,968円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(4,348,441円)、信託約款に規定される収益調整金(9,118,075円)及び分配準備積立金(824,315円)より分配対象収益は15,456,799円(1万口当たり2,298.08円)ですが、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(1,600,954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(10,489,922円)及び分配準備積立金(4,452,953円)より分配対象収益は16,543,829円(1万口当たり2,000.90円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,734,678	3,943,386
合計	5,734,678	3,943,386

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2298円 (12,298円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	5,599,124	17,769,379	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	2,443,343	4,883,265	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,764,943	7,252,874	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	4,045,790	9,623,316	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	3,856,832	22,237,336	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	6,521,779	13,488,995	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	3,704,473	5,793,425	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	10,443,176	12,457,664	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	2,198,487	2,900,024	
親投資信託受益証券 合計		44,577,947	96,406,278	
合計			96,406,278	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【たわらノーロード 最適化バランス(積極型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,277,770	1,999,706
親投資信託受益証券	176,238,141	228,926,338
流動資産合計	177,515,911	230,926,044
資産合計	177,515,911	230,926,044
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,596	90,270
未払受託者報酬	28,844	51,594
未払委託者報酬	332,135	593,917
その他未払費用	2,463	4,500
流動負債合計	371,038	740,281
負債合計	371,038	740,281
純資産の部		
元本等		
元本	137,707,368	184,907,976
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	39,437,505	45,277,787
(分配準備積立金)	15,899,987	14,643,383
元本等合計	177,144,873	230,185,763
純資産合計	177,144,873	230,185,763
負債純資産合計	177,515,911	230,926,044

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2020年10月13日	自	2021年10月13日
	至	2021年10月12日	至	2022年10月12日
営業収益				
受取利息		1		8
有価証券売買等損益		17,132,568		7,247,803
営業収益合計		17,132,569		7,247,795
営業費用				
支払利息		79		349
受託者報酬		45,432		97,549
委託者報酬		523,442		1,122,797
その他費用		3,840		8,496
営業費用合計		572,793		1,229,191
営業利益又は営業損失()		16,559,776		8,476,986
経常利益又は経常損失()		16,559,776		8,476,986
当期純利益又は当期純損失()		16,559,776		8,476,986
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()		2,302,579		808,434
期首剰余金又は期首欠損金()		3,955,570		39,437,505
剰余金増加額又は欠損金減少額		23,927,705		35,620,146
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		23,927,705		35,620,146
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,702,967		20,494,444
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,702,967		20,494,444
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()		39,437,505		45,277,787

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	2021年10月12日現在	2022年10月12日現在
1. 期首元本額	68,013,037円	137,707,368円
期中追加設定元本額	99,789,186円	116,848,868円
期中一部解約元本額	30,094,855円	69,648,260円
2. 受益権の総数	137,707,368口	184,907,976口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(2,355,397円)、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益(11,438,466円)、信託約款に規定される収益調整金(23,537,518円)及び分配準備積立金(2,106,124円)より分配対象収益は39,437,505円(1万口当たり2,863.86円)ですが、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(4,254,299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(30,634,404円)及び分配準備積立金(10,389,084円)より分配対象収益は45,277,787円(1万口当たり2,448.66円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	第4期	第5期
	自 2020年10月13日 至 2021年10月12日	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
親投資信託受益証券	15,350,292	6,823,473
合計	15,350,292	6,823,473

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	第4期 2021年10月12日現在	第5期 2022年10月12日現在
	1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2864円 (12,864円)

（４）【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

（１）株式

該当事項はありません。

（２）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	16,220,309	51,476,772	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	4,627,319	9,248,159	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	912,120	1,147,538	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	10,544,437	25,080,997	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	12,326,774	71,072,480	
	外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	12,205,953	25,245,572	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	14,643,299	22,900,655	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	11,408,159	13,608,792	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	6,933,040	9,145,373	
親投資信託受益証券 合計		89,821,410	228,926,338	
合計			228,926,338	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,455,590,539
株式	332,133,809,651
派生商品評価勘定	81,846,710
未収配当金	3,709,054,139
差入委託証拠金	457,875,000
流動資産合計	343,838,176,039
資産合計	343,838,176,039
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	84,379,860
前受金	28,175,000
未払解約金	1,210,162,000
流動負債合計	1,322,716,860
負債合計	1,322,716,860
純資産の部	
元本等	
元本	107,927,334,401
剰余金	
剰余金又は欠損金()	234,588,124,778
元本等合計	342,515,459,179
純資産合計	342,515,459,179
負債純資産合計	343,838,176,039

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	123,946,519,436円
同期中追加設定元本額	178,208,465,092円
同期中一部解約元本額	194,227,650,127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	2,652,863,013円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	4,862,785,423円
One DC 国内株式インデックスファンド	22,823,186,152円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,864,559,160円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,427,469円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	20,700,650円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	58,857,219円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,901,736円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,853,212円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,955,349円
たわらノーロード TOPIX	1,584,822,292円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,361,394,173円
たわらノーロード バランス(堅実型)	49,273,303円
たわらノーロード バランス(標準型)	314,229,083円
たわらノーロード バランス(積極型)	495,191,897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)	4,141,598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)	190,496,006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)	451,725,528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)	310,805,608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)	440,247,544円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	673,741円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,853,044円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	45,049,814円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,599,124円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,220,309円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,899,673,784円
Oneグローバルバランス	3,268,042円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,090,813,179円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,635,167,367円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,981,624,804円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	346,576,137円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,098,209,057円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,142,524,221円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	32,407,197円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,136,763,668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)	313,462,182円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	358,888,702円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	579,588,419円
投資のソムリエ	4,326,897,212円
クルーズコントロール	322,795,205円
投資のソムリエ<DC年金>	292,930,749円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	363,997,958円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	803,909,055円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	252,134,902円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,181,486,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	43,216,942円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	21,384,832円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,707,882円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	87,958,180円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	473,793,246円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	98,741,289円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	272,612,912円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	53,132,842円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	22,436,935円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	14,443,413円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	301,057,886円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,725,119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)	16,978,083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)	17,392,044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)	17,077,139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)	10,630,000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)	16,792,980円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	30,061,045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)	124,512,299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)	15,147,529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)	102,643,636円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	110,126,855円

AM O n e 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)	4,453,434円
D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	32,034,453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)	141,911,709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)	28,796,594円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,677,080円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	3,050,039円
D I A Mグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	51,278,501円
D I A Mグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	98,362,176円
D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,879,036円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,917,858円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	5,115,786円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	664,374円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	7,016,195円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	28,389,293円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	484,595,230円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	575,422,445円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,667,066,350円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	16,554,618円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	24,559,230円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	252,165,936円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	63,332,259円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	68,610円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	301,092,674円
D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	17,501,207円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	59,345,367円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	135,585,623円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	211,790,782円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	34,026,704円
D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	16,556,735円
D I A M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)	229,207,055円
D I A M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
D I A M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
D I A M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>	5,993,725円
コア資産形成ファンド	4,080,157円
MHAMトピックスファンド	766,918,834円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	59,754,049円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	794,092,672円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,690,846,521円
計	107,927,334,401円

2. 受益権の総数	107,927,334,401口
-----------	------------------

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	8,724,834,086	
合計	8,724,834,086	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月8日から2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年10月12日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	10,355,875,000	-	10,353,525,000	2,350,000
合計	10,355,875,000	-	10,353,525,000	2,350,000

(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ではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年10月12日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.1736円 (31,736円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年10月12日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,100	3,630.00	22,143,000	
日本水産	175,300	540.00	94,662,000	
マルハニチロ	24,900	2,397.00	59,685,300	
雪国まいたけ	13,800	1,007.00	13,896,600	
カネコ種苗	5,200	1,437.00	7,472,400	
サカタのタネ	20,500	4,305.00	88,252,500	
ホクト	14,400	1,893.00	27,259,200	
ホクリヨウ	2,600	605.00	1,573,000	
ショーボンドホールディングス	22,000	6,400.00	140,800,000	
ミライト・ワン	60,800	1,448.00	88,038,400	

タマホーム	11,500	2,249.00	25,863,500
サンヨーホームズ	2,200	696.00	1,531,200
日本アクア	7,500	691.00	5,182,500
ファーストコーポレーション	4,600	702.00	3,229,200
ベステラ	3,900	859.00	3,350,100
Robot Home	27,700	173.00	4,792,100
キャンディル	2,800	497.00	1,391,600
住石ホールディングス	33,100	207.00	6,851,700
日鉄鉱業	7,400	2,861.00	21,171,400
三井松島ホールディングス	8,000	3,000.00	24,000,000
I N P E X	598,800	1,470.00	880,236,000
石油資源開発	22,200	3,690.00	81,918,000
K & O エナジーグループ	7,300	1,777.00	12,972,100
ダイセキ環境ソリューション	3,700	809.00	2,993,300
第一カッター興業	4,100	1,239.00	5,079,900
明豊ファシリティワークス	6,000	665.00	3,990,000
安藤・間	86,000	830.00	71,380,000
東急建設	50,700	634.00	32,143,800
コムシスホールディングス	60,800	2,452.00	149,081,600
ピーアールホールディングス	23,800	341.00	8,115,800
高松コンストラクショングループ	12,100	1,886.00	22,820,600
東建コーポレーション	5,100	8,000.00	40,800,000
ソネック	1,900	947.00	1,799,300
ヤマウラ	8,200	970.00	7,954,000
オリエンタル白石	63,500	252.00	16,002,000
大成建設	121,400	4,045.00	491,063,000
大林組	405,000	950.00	384,750,000
清水建設	374,500	727.00	272,261,500
飛島建設	11,600	1,038.00	12,040,800
長谷工コーポレーション	116,900	1,563.00	182,714,700
松井建設	14,500	560.00	8,120,000
銭高組	1,500	2,881.00	4,321,500
鹿島建設	296,700	1,387.00	411,522,900
不動テトラ	9,300	1,477.00	13,736,100
大末建設	4,600	1,457.00	6,702,200
鉄建建設	8,700	1,762.00	15,329,400
西松建設	26,400	3,800.00	100,320,000
三井住友建設	98,300	435.00	42,760,500
大豊建設	6,300	3,940.00	24,822,000
佐田建設	9,400	405.00	3,807,000
ナカノフドー建設	10,500	303.00	3,181,500
奥村組	21,600	2,803.00	60,544,800
東鉄工業	17,200	2,394.00	41,176,800
イチケン	3,200	1,801.00	5,763,200
富士ピー・エス	5,600	448.00	2,508,800
浅沼組	9,800	2,777.00	27,214,600
戸田建設	167,200	738.00	123,393,600
熊谷組	21,500	2,529.00	54,373,500
北野建設	2,700	2,375.00	6,412,500
植木組	3,600	1,280.00	4,608,000

矢作建設工業	17,300	727.00	12,577,100
ピーエス三菱	14,300	608.00	8,694,400
日本ハウスホールディングス	22,500	454.00	10,215,000
大東建託	44,600	14,350.00	640,010,000
新日本建設	18,500	706.00	13,061,000
東亜道路工業	2,300	5,890.00	13,547,000
日本道路	3,900	5,550.00	21,645,000
東亜建設工業	9,700	2,439.00	23,658,300
日本国土開発	33,900	632.00	21,424,800
若築建設	6,700	2,238.00	14,994,600
東洋建設	48,900	895.00	43,765,500
五洋建設	160,600	724.00	116,274,400
世紀東急工業	20,000	778.00	15,560,000
福田組	4,200	4,870.00	20,454,000
日本ドライケミカル	3,200	1,453.00	4,649,600
住友林業	86,800	2,284.00	198,251,200
日本基礎技術	10,700	443.00	4,740,100
巴コーポレーション	15,800	380.00	6,004,000
大和ハウス工業	345,200	2,990.00	1,032,148,000
ライト工業	24,000	1,968.00	47,232,000
積水ハウス	413,900	2,480.00	1,026,472,000
日特建設	9,000	924.00	8,316,000
北陸電気工事	7,800	686.00	5,350,800
ユアテック	24,800	705.00	17,484,000
日本リーテック	8,200	769.00	6,305,800
四電工	4,200	1,790.00	7,518,000
中電工	17,600	2,085.00	36,696,000
関電工	70,800	823.00	58,268,400
きんでん	88,600	1,514.00	134,140,400
東京エネシス	12,800	930.00	11,904,000
トーエネック	4,400	3,465.00	15,246,000
住友電設	10,900	2,616.00	28,514,400
日本電設工業	18,500	1,733.00	32,060,500
エクシオグループ	60,500	2,147.00	129,893,500
新日本空調	9,400	1,831.00	17,211,400
日本工営	8,400	3,365.00	28,266,000
九電工	27,700	2,819.00	78,086,300
三機工業	27,700	1,604.00	44,430,800
日揮ホールディングス	123,200	1,725.00	212,520,000
中外炉工業	4,000	1,548.00	6,192,000
ヤマト	10,500	731.00	7,675,500
太平電業	8,000	3,270.00	26,160,000
高砂熱学工業	33,400	1,708.00	57,047,200
三晃金属工業	1,600	2,650.00	4,240,000
NEC ネットズエスアイ	45,000	1,617.00	72,765,000
朝日工業社	5,100	1,902.00	9,700,200
明星工業	21,900	683.00	14,957,700
大気社	18,200	3,330.00	60,606,000
ダイダン	8,200	2,117.00	17,359,400
日比谷総合設備	11,900	1,893.00	22,526,700

ニッポン	34,100	1,557.00	53,093,700
日清製粉グループ本社	131,500	1,509.00	198,433,500
日東富士製粉	1,500	4,545.00	6,817,500
昭和産業	11,100	2,481.00	27,539,100
鳥越製粉	10,200	636.00	6,487,200
中部飼料	14,400	1,024.00	14,745,600
フィード・ワン	16,600	666.00	11,055,600
東洋精糖	1,600	849.00	1,358,400
日本甜菜製糖	7,300	1,634.00	11,928,200
D M三井製糖ホールディングス	11,400	1,903.00	21,694,200
塩水港精糖	16,600	197.00	3,270,200
日新製糖	6,600	1,707.00	11,266,200
L I F U L L	40,600	161.00	6,536,600
M I X I	30,400	2,287.00	69,524,800
ジェイエイシーリクルートメント	10,800	2,384.00	25,747,200
日本M&Aセンターホールディングス	218,000	1,685.00	367,330,000
メンバーズ	3,500	2,608.00	9,128,000
中広	1,000	394.00	394,000
U Tグループ	19,300	2,212.00	42,691,600
アイティメディア	6,200	1,707.00	10,583,400
E・Jホールディングス	7,600	1,290.00	9,804,000
夢真ビーネックスグループ	43,400	1,716.00	74,474,400
コシダカホールディングス	35,600	958.00	34,104,800
アルトナー	3,200	945.00	3,024,000
パソナグループ	14,400	2,148.00	30,931,200
C D S	3,300	1,761.00	5,811,300
リンクアンドモチベーション	34,200	841.00	28,762,200
エス・エム・エス	45,000	3,145.00	141,525,000
サニーサイドアップグループ	4,600	568.00	2,612,800
パーソルホールディングス	132,900	2,892.00	384,346,800
リニカル	7,400	743.00	5,498,200
クックパッド	32,500	204.00	6,630,000
エスクリ	5,900	362.00	2,135,800
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,500	616.00	4,004,000
森永製菓	28,100	3,905.00	109,730,500
中村屋	2,800	3,110.00	8,708,000
江崎グリコ	32,500	3,480.00	113,100,000
名糖産業	4,900	1,617.00	7,923,300
井村屋グループ	6,800	2,220.00	15,096,000
不二家	7,800	2,422.00	18,891,600
山崎製パン	76,100	1,644.00	125,108,400
第一屋製パン	2,500	400.00	1,000,000
モロゾフ	4,100	3,650.00	14,965,000
亀田製菓	7,200	4,515.00	32,508,000
寿スピリッツ	12,100	8,520.00	103,092,000
カルビー	63,600	3,030.00	192,708,000
森永乳業	22,700	4,160.00	94,432,000
六甲バター	8,200	1,371.00	11,242,200
ヤクルト本社	88,600	8,600.00	761,960,000
明治ホールディングス	76,900	6,360.00	489,084,000

雪印メグミルク	30,500	1,657.00	50,538,500
プリマハム	17,500	2,028.00	35,490,000
日本ハム	48,900	3,690.00	180,441,000
林兼産業	3,600	438.00	1,576,800
丸大食品	12,600	1,409.00	17,753,400
S Foods	12,500	3,010.00	37,625,000
柿安本店	4,900	2,221.00	10,882,900
伊藤ハム米久ホールディングス	88,300	669.00	59,072,700
学情	5,300	1,426.00	7,557,800
スタジオアリス	5,900	2,087.00	12,313,300
クロスキャット	7,300	1,420.00	10,366,000
シミックホールディングス	6,500	1,625.00	10,562,500
エブコ	2,800	644.00	1,803,200
システナ	194,600	423.00	82,315,800
N J S	2,600	1,986.00	5,163,600
デジタルアーツ	7,300	6,690.00	48,837,000
日鉄ソリューションズ	23,800	3,505.00	83,419,000
総合警備保障	48,500	3,730.00	180,905,000
キューブシステム	6,900	958.00	6,610,200
いちご	152,700	311.00	47,489,700
日本駐車場開発	135,400	229.00	31,006,600
コア	5,800	1,403.00	8,137,400
カカクコム	97,500	2,546.00	248,235,000
アイロムグループ	4,800	2,601.00	12,484,800
セントケア・ホールディング	8,600	805.00	6,923,000
サイネックス	2,200	580.00	1,276,000
ルネサンス	9,300	950.00	8,835,000
ディップ	23,400	3,920.00	91,728,000
S B Sホールディングス	10,300	2,830.00	29,149,000
デジタルホールディングス	9,300	1,138.00	10,583,400
新日本科学	16,200	2,729.00	44,209,800
キャリアデザインセンター	2,700	1,544.00	4,168,800
ベネフィット・ワン	48,000	2,179.00	104,592,000
エムスリー	234,500	4,117.00	965,436,500
ツカダ・グローバルホールディング	8,400	372.00	3,124,800
プラス	1,700	929.00	1,579,300
アウトソーシング	70,700	1,075.00	76,002,500
ウェルネット	11,700	612.00	7,160,400
ワールドホールディングス	5,200	2,670.00	13,884,000
ディー・エヌ・エー	50,700	1,871.00	94,859,700
博報堂D Yホールディングス	168,200	1,083.00	182,160,600
ぐるなび	19,400	454.00	8,807,600
タカミヤ	16,000	399.00	6,384,000
ジャパンベストレスキューシステム	7,500	752.00	5,640,000
ファンコミュニケーションズ	23,300	422.00	9,832,600
ライク	4,400	1,949.00	8,575,600
ビジネス・ブレークスルー	4,900	405.00	1,984,500
エスプール	34,200	884.00	30,232,800
W D Bホールディングス	6,000	2,465.00	14,790,000
手間いらず	1,800	5,630.00	10,134,000

ティア	7,800	427.00	3,330,600
C D G	1,500	1,215.00	1,822,500
アドウェイズ	16,300	726.00	11,833,800
バリューコマース	8,900	2,271.00	20,211,900
インフォマート	123,200	471.00	58,027,200
サッポロホールディングス	37,400	3,330.00	124,542,000
アサヒグループホールディングス	262,800	4,335.00	1,139,238,000
麒麟ホールディングス	513,100	2,262.00	1,160,632,200
宝ホールディングス	77,600	1,060.00	82,256,000
オエノンホールディングス	34,000	275.00	9,350,000
養命酒製造	3,900	1,808.00	7,051,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	89,000	1,384.00	123,176,000
サントリー食品インターナショナル	80,100	5,060.00	405,306,000
ダイドーグループホールディングス	7,200	4,730.00	34,056,000
伊藤園	42,400	5,680.00	240,832,000
キーコーヒー	12,700	2,127.00	27,012,900
ユニカフェ	4,200	936.00	3,931,200
ジャパンフーズ	1,500	1,054.00	1,581,000
日清オイリオグループ	16,000	3,200.00	51,200,000
不二製油グループ本社	30,300	2,320.00	70,296,000
かどや製油	1,200	3,540.00	4,248,000
J - オイルミルズ	12,900	1,548.00	19,969,200
ローソン	30,400	4,640.00	141,056,000
サンエー	9,400	4,495.00	42,253,000
カワチ薬品	10,700	2,127.00	22,758,900
エービーシー・マート	21,300	6,630.00	141,219,000
ハードオフコーポレーション	6,000	1,184.00	7,104,000
高千穂交易	4,900	1,976.00	9,682,400
アスクル	29,400	1,463.00	43,012,200
ゲオホールディングス	16,400	1,825.00	29,930,000
アダストリア	14,700	2,138.00	31,428,600
ジーフット	8,200	304.00	2,492,800
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,900	395.00	750,500
オルパヘルスケアホールディングス	2,200	1,468.00	3,229,600
伊藤忠食品	2,700	4,855.00	13,108,500
くら寿司	14,300	3,125.00	44,687,500
キャンドゥ	4,300	2,172.00	9,339,600
エレマテック	11,000	1,288.00	14,168,000
アイケイ	4,300	410.00	1,763,000
パルグループホールディングス	12,000	2,289.00	27,468,000
エディオン	62,900	1,186.00	74,599,400
あらた	10,200	4,060.00	41,412,000
サーラコーポレーション	25,700	764.00	19,634,800
ワッツ	6,600	636.00	4,197,600
トーマンデバイス	1,900	5,250.00	9,975,000
ハローズ	6,200	3,080.00	19,096,000
J Pホールディングス	34,200	304.00	10,396,800
フジオフードグループ本社	10,200	1,356.00	13,831,200
あみやき亭	3,300	2,913.00	9,612,900

東京エレクトロン デバイス	4,000	5,550.00	22,200,000	
ひらまつ	29,000	189.00	5,481,000	
円谷フィールドホールディングス	12,000	1,766.00	21,192,000	
双日	140,600	2,188.00	307,632,800	
アルフレッサ ホールディングス	142,100	1,694.00	240,717,400	
大黒天物産	4,400	5,600.00	24,640,000	
ハニーズホールディングス	10,900	1,208.00	13,167,200	
ファーマライズホールディングス	2,900	638.00	1,850,200	
キッコーマン	83,700	8,150.00	682,155,000	
味の素	278,300	4,007.00	1,115,148,100	
ブルドックソース	4,900	1,828.00	8,957,200	
キューピー	61,100	2,435.00	148,778,500	
ハウス食品グループ本社	43,600	2,848.00	124,172,800	
カゴメ	52,900	3,020.00	159,758,000	
焼津水産化学工業	5,600	856.00	4,793,600	
アリアケジャパン	12,700	4,940.00	62,738,000	
ピエトロ	1,700	1,784.00	3,032,800	
エバラ食品工業	3,100	3,055.00	9,470,500	
やまみ	1,100	1,337.00	1,470,700	
ニチレイ	52,100	2,338.00	121,809,800	
横浜冷凍	33,300	897.00	29,870,100	
東洋水産	62,300	5,960.00	371,308,000	
イートアンドホールディングス	5,100	2,117.00	10,796,700	
大冷	1,600	1,867.00	2,987,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7,200	506.00	3,643,200	
日清食品ホールディングス	44,900	9,870.00	443,163,000	
永谷園ホールディングス	6,100	1,975.00	12,047,500	
一正蒲鉾	5,300	766.00	4,059,800	
フジッコ	12,900	1,912.00	24,664,800	
ロック・フィールド	13,800	1,447.00	19,968,600	
日本たばこ産業	748,500	2,406.50	1,801,265,250	
ケンコーマヨネーズ	7,200	1,635.00	11,772,000	
わらべや日洋ホールディングス	8,300	1,884.00	15,637,200	
なとり	7,800	2,046.00	15,958,800	
イフジ産業	2,500	885.00	2,212,500	
ファーマフーズ	17,600	1,233.00	21,700,800	
北の達人コーポレーション	48,700	256.00	12,467,200	
ユーグレナ	73,000	854.00	62,342,000	
紀文食品	10,900	884.00	9,635,600	
ピクルスホールディングス	7,500	984.00	7,380,000	
スター・マイカ・ホールディングス	5,800	1,434.00	8,317,200	
SREホールディングス	3,500	3,250.00	11,375,000	
ADワークスグループ	24,500	157.00	3,846,500	
片倉工業	10,700	2,050.00	21,935,000	
ゲンゼ	8,000	3,825.00	30,600,000	
ヒューリック	265,200	1,082.00	286,946,400	
神栄	1,800	813.00	1,463,400	
ラサ商事	6,100	995.00	6,069,500	
アルペン	10,200	2,013.00	20,532,600	
ハブ	4,500	655.00	2,947,500	

ラクーンホールディングス	11,600	1,099.00	12,748,400
クオールホールディングス	16,800	1,220.00	20,496,000
アルコニックス	17,400	1,326.00	23,072,400
神戸物産	94,500	3,420.00	323,190,000
ソリトンシステムズ	5,900	996.00	5,876,400
ジーンズホールディングス	7,300	4,810.00	35,113,000
ピックカメラ	81,200	1,239.00	100,606,800
DCMホールディングス	81,300	1,161.00	94,389,300
ペッパーフードサービス	25,500	209.00	5,329,500
ハイパー	2,200	452.00	994,400
MonotaRO	173,200	2,260.00	391,432,000
東京一番フーズ	3,100	582.00	1,804,200
DDホールディングス	7,200	603.00	4,341,600
あいホールディングス	19,600	2,114.00	41,434,400
ディーブイエックス	4,500	859.00	3,865,500
きちりホールディングス	3,800	326.00	1,238,800
アークランドサービスホールディングス	10,100	2,205.00	22,270,500
J.フロントリテイリング	151,900	1,182.00	179,545,800
ドトール・日レスホールディングス	21,600	1,809.00	39,074,400
マツキヨココカラ&カンパニー	80,200	6,300.00	505,260,000
ブロンコビリー	6,500	2,463.00	16,009,500
ZOZO	94,200	3,030.00	285,426,000
トレジャー・ファクトリー	4,000	1,665.00	6,660,000
物語コーポレーション	6,800	7,010.00	47,668,000
三越伊勢丹ホールディングス	205,600	1,300.00	267,280,000
東洋紡	53,800	1,052.00	56,597,600
ユニチカ	37,400	274.00	10,247,600
富士紡ホールディングス	5,500	3,380.00	18,590,000
日清紡ホールディングス	94,900	1,048.00	99,455,200
倉敷紡績	9,400	2,018.00	18,969,200
ダイワボウホールディングス	58,300	1,893.00	110,361,900
シキボウ	7,200	855.00	6,156,000
日東紡績	17,200	2,210.00	38,012,000
トヨタ紡織	48,600	1,841.00	89,472,600
マクニカホールディングス	32,600	2,756.00	89,845,600
Hamee	4,900	902.00	4,419,800
マーケットエンタープライズ	1,500	1,060.00	1,590,000
ラクト・ジャパン	4,700	2,205.00	10,363,500
ウエルシアホールディングス	72,400	3,225.00	233,490,000
クリエイトSDホールディングス	20,300	3,195.00	64,858,500
グリムス	6,100	1,549.00	9,448,900
バイタルケーエスケー・ホールディングス	21,700	645.00	13,996,500
八洲電機	9,900	981.00	9,711,900
メディアスホールディングス	7,900	716.00	5,656,400
レスターホールディングス	12,900	1,902.00	24,535,800
ジューテックホールディングス	2,700	1,018.00	2,748,600
丸善CHIホールディングス	16,000	323.00	5,168,000
大光	5,800	684.00	3,967,200

OCHIホールディングス	3,100	1,211.00	3,754,100
TOKAIホールディングス	66,400	875.00	58,100,000
黒谷	3,800	546.00	2,074,800
ミサワ	2,700	572.00	1,544,400
ティーライフ	1,700	1,219.00	2,072,300
Cominix	2,400	716.00	1,718,400
エー・ピーホールディングス	1,900	443.00	841,700
三洋貿易	12,500	1,051.00	13,137,500
チムニー	4,100	1,146.00	4,698,600
シュッピン	11,400	1,300.00	14,820,000
ビューティガレージ	2,200	2,602.00	5,724,400
オイシックス・ラ・大地	19,800	1,753.00	34,709,400
ウイン・パートナーズ	9,900	976.00	9,662,400
ネクステージ	27,800	2,785.00	77,423,000
ジョイフル本田	39,300	1,797.00	70,622,100
鳥貴族ホールディングス	4,500	2,188.00	9,846,000
ホットランド	9,400	1,357.00	12,755,800
すかいらーくホールディングス	167,000	1,565.00	261,355,000
SFPホールディングス	6,600	1,679.00	11,081,400
綿半ホールディングス	9,400	1,391.00	13,075,400
日本毛織	33,700	1,045.00	35,216,500
ダイトウボウ	22,100	85.00	1,878,500
トーア紡コーポレーション	3,900	333.00	1,298,700
ダイドーリミテッド	18,600	148.00	2,752,800
ヨシックスホールディングス	2,700	2,109.00	5,694,300
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39,800	1,060.00	42,188,000
三栄建築設計	5,400	1,632.00	8,812,800
野村不動産ホールディングス	70,900	3,405.00	241,414,500
三重交通グループホールディングス	27,800	491.00	13,649,800
サムティ	18,100	2,252.00	40,761,200
ディア・ライフ	17,000	610.00	10,370,000
コーセーアールイー	4,000	650.00	2,600,000
地主	8,700	1,991.00	17,321,700
プレサンスコーポレーション	14,900	1,526.00	22,737,400
フィル・カンパニー	1,900	1,115.00	2,118,500
THEグローバル社	7,300	204.00	1,489,200
ハウスコム	2,400	926.00	2,222,400
JPMC	5,700	1,014.00	5,779,800
サンセイランディック	3,800	833.00	3,165,400
エストラスト	1,500	551.00	826,500
フージャースホールディングス	17,600	775.00	13,640,000
オープンハウスグループ	41,600	5,060.00	210,496,000
東急不動産ホールディングス	373,000	786.00	293,178,000
飯田グループホールディングス	112,100	2,031.00	227,675,100
イーランド	1,800	1,555.00	2,799,000
ムゲンエステート	8,300	468.00	3,884,400
帝国繊維	12,900	1,571.00	20,265,900
日本コークス工業	117,600	91.00	10,701,600
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,500	1,327.00	7,298,500

ミタチ産業	3,500	892.00	3,122,000
B E E N O S	6,900	2,448.00	16,891,200
あさひ	11,400	1,303.00	14,854,200
日本調剤	8,200	1,334.00	10,938,800
コスモス薬品	13,800	15,200.00	209,760,000
シップヘルスケアホールディングス	39,400	2,842.00	111,974,800
トーエル	5,900	781.00	4,607,900
ソフトクリエイイトホールディングス	5,900	3,135.00	18,496,500
セブン&アイ・ホールディングス	459,300	5,443.00	2,499,969,900
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	91,900	985.00	90,521,500
明治電機工業	4,100	1,044.00	4,280,400
ツルハホールディングス	29,900	9,000.00	269,100,000
デリカフーズホールディングス	5,200	512.00	2,662,400
スターティアホールディングス	3,200	1,189.00	3,804,800
サンマルクホールディングス	10,900	1,622.00	17,679,800
フェリシモ	3,100	981.00	3,041,100
トリドールホールディングス	34,100	3,015.00	102,811,500
帝人	119,700	1,371.00	164,108,700
東レ	845,400	722.80	611,055,120
クラレ	183,900	1,009.00	185,555,100
旭化成	842,600	950.80	801,144,080
T O K Y O B A S E	12,500	311.00	3,887,500
稲葉製作所	7,000	1,343.00	9,401,000
宮地エンジニアリンググループ	3,900	3,275.00	12,772,500
トーカロ	35,500	1,158.00	41,109,000
アルファ	4,900	911.00	4,463,900
S U M C O	226,800	1,742.00	395,085,600
川田テクノロジーズ	2,600	3,725.00	9,685,000
R S T e c h n o l o g i e s	3,900	6,230.00	24,297,000
ジェイテックコーポレーション	1,700	1,391.00	2,364,700
信和	8,500	792.00	6,732,000
ビーロット	8,600	536.00	4,609,600
ファーストブラザーズ	2,500	854.00	2,135,000
A n d D o ホールディングス	6,700	855.00	5,728,500
シーアールイー	5,100	1,306.00	6,660,600
プロパティエージェント	1,600	1,282.00	2,051,200
ケイアイスター不動産	6,100	4,315.00	26,321,500
アグレ都市デザイン	2,200	1,447.00	3,183,400
グッドコムアセット	5,100	1,553.00	7,920,300
ジェイ・エス・ビー	2,800	3,745.00	10,486,000
ロードスターキャピタル	4,900	1,650.00	8,085,000
テンポイノベーション	3,900	911.00	3,552,900
グローバル・リンク・マネジメント	2,500	961.00	2,402,500
フェイスネットワーク	1,700	1,340.00	2,278,000
住江織物	2,400	1,745.00	4,188,000
日本フェルト	7,700	400.00	3,080,000
イチカワ	1,500	1,320.00	1,980,000
エコナックホールディングス	22,800	89.00	2,029,200
日東製網	1,600	1,325.00	2,120,000

芦森工業	2,600	1,032.00	2,683,200
アツギ	9,700	383.00	3,715,100
ウイルプラスホールディングス	2,600	1,152.00	2,995,200
J Mホールディングス	10,400	1,708.00	17,763,200
コメダホールディングス	29,900	2,326.00	69,547,400
サツドラホールディングス	6,100	670.00	4,087,000
アレンザホールディングス	9,200	983.00	9,043,600
串カツ田中ホールディングス	3,200	1,693.00	5,417,600
パロックジャパンリミテッド	9,400	788.00	7,407,200
クスリのアオキホールディングス	12,200	7,510.00	91,622,000
ダイニック	4,400	579.00	2,547,600
共和レザー	7,400	521.00	3,855,400
ピーバンドットコム	1,700	505.00	858,500
力の源ホールディングス	7,100	855.00	6,070,500
FOOD & LIFE COMPANIES	70,200	2,352.00	165,110,400
アセンテック	4,700	504.00	2,368,800
セーレン	25,100	2,230.00	55,973,000
ソトー	4,900	796.00	3,900,400
東海染工	1,500	1,136.00	1,704,000
小松マテーレ	20,500	763.00	15,641,500
ワコールホールディングス	27,900	2,334.00	65,118,600
ホギメディカル	17,000	3,615.00	61,455,000
クラウドシアホールディングス	2,200	289.00	635,800
T S Iホールディングス	41,400	416.00	17,222,400
マツオカコーポレーション	3,900	925.00	3,607,500
ワールド	17,900	1,418.00	25,382,200
T I S	119,300	3,925.00	468,252,500
J N Sホールディングス	6,200	377.00	2,337,400
グリー	62,100	844.00	52,412,400
G M Oペパボ	1,600	1,833.00	2,932,800
コーエーテクモホールディングス	87,300	2,182.00	190,488,600
三菱総合研究所	5,600	4,605.00	25,788,000
ボルテージ	3,800	328.00	1,246,400
電算	800	1,676.00	1,340,800
A G S	5,300	625.00	3,312,500
ファインデックス	9,200	558.00	5,133,600
ブレインパッド	11,600	891.00	10,335,600
K L a b	21,600	474.00	10,238,400
ポールトゥウィンホールディングス	19,800	938.00	18,572,400
ネクソン	299,100	2,572.00	769,285,200
アイスタイル	35,300	484.00	17,085,200
エムアップホールディングス	15,700	1,692.00	26,564,400
エイチーム	8,500	753.00	6,400,500
エニグモ	14,700	525.00	7,717,500
テクノスジャパン	10,600	455.00	4,823,000
e n i s h	9,700	468.00	4,539,600
コロプラ	44,800	691.00	30,956,800
オルトプラス	9,800	283.00	2,773,400
ブロードリーフ	67,600	525.00	35,490,000

クロス・マーケティンググループ	5,100	844.00	4,304,400
デジタルハーツホールディングス	6,100	1,897.00	11,571,700
システム情報	10,200	958.00	9,771,600
メディアドゥ	4,600	1,689.00	7,769,400
じげん	38,600	372.00	14,359,200
ブイキューブ	13,800	946.00	13,054,800
エンカレッジ・テクノロジー	3,000	514.00	1,542,000
サイバーリンクス	4,000	1,140.00	4,560,000
ディー・エル・イー	9,200	305.00	2,806,000
フィックスターズ	13,000	1,046.00	13,598,000
CARTA HOLDINGS	5,500	1,682.00	9,251,000
オブティム	9,500	812.00	7,714,000
セレス	4,600	881.00	4,052,600
SHIFT	8,400	20,340.00	170,856,000
特種東海製紙	7,100	2,895.00	20,554,500
ティーガイア	12,100	1,652.00	19,989,200
セック	1,900	2,190.00	4,161,000
テクマトリックス	23,000	1,712.00	39,376,000
プロシップ	4,500	1,558.00	7,011,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	35,400	2,175.00	76,995,000
GMOペイメントゲートウェイ	26,500	10,890.00	288,585,000
ザッパラス	4,700	341.00	1,602,700
システムリサーチ	4,000	1,892.00	7,568,000
インターネットイニシアティブ	72,800	2,204.00	160,451,200
さくらインターネット	14,700	546.00	8,026,200
ヴィンクス	3,900	1,504.00	5,865,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3,600	4,455.00	16,038,000
SRAホールディングス	6,600	3,095.00	20,427,000
システムインテグレータ	4,300	453.00	1,947,900
朝日ネット	12,400	597.00	7,402,800
eBASE	16,300	533.00	8,687,900
アバントグループ	14,700	1,488.00	21,873,600
アドソル日進	4,900	1,493.00	7,315,700
ODKソリューションズ	2,800	598.00	1,674,400
フリービット	7,100	963.00	6,837,300
コムチュア	15,200	2,340.00	35,568,000
サイバーコム	2,000	1,368.00	2,736,000
アステリア	9,800	840.00	8,232,000
アイル	6,500	1,803.00	11,719,500
王子ホールディングス	525,500	528.00	277,464,000
日本製紙	55,200	898.00	49,569,600
三菱製紙	17,400	282.00	4,906,800
北越コーポレーション	81,200	753.00	61,143,600
中越パルプ工業	5,100	916.00	4,671,600
巴川製紙所	4,000	735.00	2,940,000
大王製紙	58,300	1,149.00	66,986,700
阿波製紙	3,100	301.00	933,100
マークライnz	6,200	2,444.00	15,152,800

メディカル・データ・ビジョン	17,300	1,086.00	18,787,800
gumi	18,900	1,006.00	19,013,400
ショーケース	3,000	381.00	1,143,000
モバイルファクトリー	2,700	932.00	2,516,400
テラスカイ	4,900	1,904.00	9,329,600
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,000	1,582.00	9,492,000
PCIホールディングス	5,200	944.00	4,908,800
アイピーシー	1,900	449.00	853,100
ネオジャパン	3,900	978.00	3,814,200
PR TIMES	2,900	2,091.00	6,063,900
ラクス	62,500	1,421.00	88,812,500
ランドコンピュータ	3,200	831.00	2,659,200
ダブルスタンダード	4,000	2,504.00	10,016,000
オーブンドア	8,100	2,115.00	17,131,500
マイネット	4,100	468.00	1,918,800
アカツキ	6,100	2,055.00	12,535,500
ベネフィットジャパン	800	1,523.00	1,218,400
Ubicomホールディングス	3,700	2,097.00	7,758,900
カナミックネットワーク	16,600	591.00	9,810,600
ノムラシステムコーポレーション	12,000	122.00	1,464,000
レンゴー	105,400	848.00	89,379,200
トーモク	6,600	1,434.00	9,464,400
ザ・パック	8,600	2,275.00	19,565,000
チェンジ	28,300	1,895.00	53,628,500
シンクロ・フード	7,000	491.00	3,437,000
オークネット	6,000	2,254.00	13,524,000
キャピタル・アセット・プランニング	2,500	564.00	1,410,000
セグエグループ	3,600	645.00	2,322,000
エイトレッド	1,800	1,655.00	2,979,000
マクロミル	26,200	1,117.00	29,265,400
ビーグリー	2,100	1,306.00	2,742,600
オロ	3,600	1,456.00	5,241,600
ユーザーローカル	4,100	1,590.00	6,519,000
テモナ	2,500	277.00	692,500
ニーズウェル	3,900	617.00	2,406,300
マネーフォワード	27,800	3,275.00	91,045,000
サインポスト	4,400	782.00	3,440,800
昭和電工	111,800	2,107.00	235,562,600
住友化学	929,100	493.00	458,046,300
住友精化	5,300	3,015.00	15,979,500
日産化学	61,000	6,790.00	414,190,000
ラサ工業	4,800	2,133.00	10,238,400
クレハ	9,900	9,360.00	92,664,000
多木化学	4,500	5,020.00	22,590,000
テイカ	7,800	1,248.00	9,734,400
石原産業	24,500	1,002.00	24,549,000
片倉コープアグリ	3,100	1,144.00	3,546,400
日本曹達	14,900	4,445.00	66,230,500
東ソー	168,500	1,607.00	270,779,500

トクヤマ	40,500	1,749.00	70,834,500
セントラル硝子	20,500	3,355.00	68,777,500
東亜合成	59,500	1,122.00	66,759,000
大阪ソーダ	10,500	3,515.00	36,907,500
関東電化工業	24,800	918.00	22,766,400
デンカ	45,900	3,145.00	144,355,500
イビデン	66,900	4,000.00	267,600,000
信越化学工業	215,900	14,800.00	3,195,320,000
日本カーバイド工業	4,900	1,237.00	6,061,300
電算システムホールディングス	5,500	2,246.00	12,353,000
堺化学工業	8,700	1,909.00	16,608,300
第一稀元素化学工業	11,600	1,229.00	14,256,400
エア・ウォーター	109,200	1,696.00	185,203,200
日本酸素ホールディングス	112,200	2,330.00	261,426,000
日本化学工業	3,900	1,845.00	7,195,500
東邦アセチレン	2,700	1,080.00	2,916,000
日本パーカライジング	57,200	948.00	54,225,600
高圧ガス工業	19,300	625.00	12,062,500
チタン工業	1,600	1,545.00	2,472,000
四国化成工業	15,700	1,203.00	18,887,100
戸田工業	2,900	2,777.00	8,053,300
ステラ ケミファ	6,800	2,643.00	17,972,400
保土谷化学工業	3,700	2,849.00	10,541,300
日本触媒	19,300	5,300.00	102,290,000
大日精化工業	9,600	1,711.00	16,425,600
カネカ	29,300	3,620.00	106,066,000
協和キリン	139,900	3,335.00	466,566,500
三菱瓦斯化学	105,600	1,895.00	200,112,000
三井化学	106,100	2,748.00	291,562,800
J S R	116,900	2,711.00	316,915,900
東京応化工業	20,300	6,130.00	124,439,000
大阪有機化学工業	8,700	1,912.00	16,634,400
三菱ケミカルグループ	845,600	656.20	554,882,720
K Hネオケム	19,300	2,794.00	53,924,200
ダイセル	183,100	838.00	153,437,800
住友ベークライト	19,300	4,000.00	77,200,000
積水化学工業	260,100	1,820.00	473,382,000
日本ゼオン	99,100	1,306.00	129,424,600
アイカ工業	32,100	3,160.00	101,436,000
U B E	64,200	1,906.00	122,365,200
積水樹脂	18,700	1,677.00	31,359,900
タキロンシーアイ	29,400	515.00	15,141,000
旭有機材	7,700	2,249.00	17,317,300
ニチバン	7,200	1,633.00	11,757,600
リケンテクノス	27,700	504.00	13,960,800
大倉工業	5,200	1,820.00	9,464,000
積水化成成品工業	16,200	391.00	6,334,200
群栄化学工業	2,700	2,401.00	6,482,700
タイガースポリマー	6,500	403.00	2,619,500
ミライアル	4,400	1,522.00	6,696,800

ダイキアクシス	4,700	648.00	3,045,600
ダイキョーニシカワ	28,700	547.00	15,698,900
竹本容器	4,300	747.00	3,212,100
森六ホールディングス	6,600	1,674.00	11,048,400
恵和	3,900	3,385.00	13,201,500
日本化薬	95,700	1,154.00	110,437,800
カーリットホールディングス	11,500	670.00	7,705,000
ソルクシーズ	10,500	357.00	3,748,500
CLホールディングス	2,800	846.00	2,368,800
プレステージ・インターナショナル	49,900	646.00	32,235,400
フェイス	3,700	531.00	1,964,700
プロトコーポレーション	14,500	1,106.00	16,037,000
ハイマックス	3,700	1,455.00	5,383,500
アミューズ	7,200	1,760.00	12,672,000
野村総合研究所	237,300	3,350.00	794,955,000
ドリームインキュベータ	4,000	1,924.00	7,696,000
サイバネットシステム	9,700	984.00	9,544,800
クイック	8,200	1,886.00	15,465,200
TAC	7,200	203.00	1,461,600
CEホールディングス	6,600	451.00	2,976,600
日本システム技術	5,000	1,215.00	6,075,000
電通グループ	124,600	4,290.00	534,534,000
インテージホールディングス	15,700	1,688.00	26,501,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	1,708.00	10,418,800
東邦システムサイエンス	3,700	971.00	3,592,700
ぴあ	4,000	3,335.00	13,340,000
イオンファンタジー	5,000	3,115.00	15,575,000
ソースネクスト	58,900	294.00	17,316,600
シーティーエス	14,900	775.00	11,547,500
ネクシィーズグループ	4,000	667.00	2,668,000
インフォコム	14,900	1,976.00	29,442,400
メディカルシステムネットワーク	11,900	406.00	4,831,400
日本精化	8,700	1,903.00	16,556,100
扶桑化学工業	10,800	3,110.00	33,588,000
トリケミカル研究所	14,000	1,937.00	27,118,000
シンプレクス・ホールディングス	21,500	1,917.00	41,215,500
HEROZ	3,900	1,039.00	4,052,100
ラクスル	16,300	2,841.00	46,308,300
メルカリ	52,100	2,179.00	113,525,900
IPS	3,900	3,075.00	11,992,500
FIG	14,900	384.00	5,721,600
システムサポート	4,900	1,358.00	6,654,200
ADEKA	53,700	2,143.00	115,079,100
日油	39,300	5,160.00	202,788,000
ミヨシ油脂	4,500	992.00	4,464,000
新日本理化	19,300	263.00	5,075,900
ハリマ化成グループ	9,000	864.00	7,776,000
イーソル	7,400	555.00	4,107,000
アルテリア・ネットワークス	12,800	1,191.00	15,244,800
東海ソフト	2,000	917.00	1,834,000

ウイングアーク1st	10,500	1,795.00	18,847,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,100	1,650.00	5,115,000	
サーバーワークス	2,400	2,199.00	5,277,600	
東名	1,000	1,240.00	1,240,000	
ヴィッツ	1,200	983.00	1,179,600	
トピラシステムズ	2,700	878.00	2,370,600	
Sansan	43,200	1,267.00	54,734,400	
Link-U	2,500	687.00	1,717,500	
ギフトイ	11,400	2,137.00	24,361,800	
花王	287,200	5,703.00	1,637,901,600	
第一工業製薬	4,600	1,925.00	8,855,000	
石原ケミカル	6,300	1,248.00	7,862,400	
日華化学	4,600	838.00	3,854,800	
ニイタカ	2,600	2,140.00	5,564,000	
三洋化成工業	8,200	4,165.00	34,153,000	
ベース	3,900	3,595.00	14,020,500	
JMDC	18,400	4,990.00	91,816,000	
武田薬品工業	1,093,200	3,779.00	4,131,202,800	
アステラス製薬	1,189,000	1,924.50	2,288,230,500	
住友ファーマ	85,900	1,013.00	87,016,700	
塩野義製薬	161,500	6,936.00	1,120,164,000	
わかもと製薬	13,600	238.00	3,236,800	
日本新薬	30,400	7,670.00	233,168,000	
中外製薬	362,500	3,730.00	1,352,125,000	
科研製薬	19,900	3,780.00	75,222,000	
エーザイ	153,700	7,842.00	1,205,315,400	
理研ビタミン	9,800	1,807.00	17,708,600	
ロート製薬	66,300	4,645.00	307,963,500	
小野薬品工業	268,100	3,401.00	911,808,100	
久光製薬	29,400	3,345.00	98,343,000	
有機合成薬品工業	9,400	296.00	2,782,400	
持田製薬	15,600	3,410.00	53,196,000	
参天製薬	242,200	983.00	238,082,600	
扶桑薬品工業	4,500	1,994.00	8,973,000	
日本ケミファ	1,600	1,747.00	2,795,200	
ツムラ	39,800	3,115.00	123,977,000	
日医工	40,200	468.00	18,813,600	
テルモ	393,500	4,209.00	1,656,241,500	
H.U.グループホールディングス	34,700	2,652.00	92,024,400	
キッセイ薬品工業	20,200	2,605.00	52,621,000	
生化学工業	24,500	874.00	21,413,000	
栄研化学	20,600	1,802.00	37,121,200	
鳥居薬品	6,100	2,950.00	17,995,000	
JCRファーマ	39,200	2,124.00	83,260,800	
東和薬品	20,100	2,146.00	43,134,600	
富士製薬工業	7,500	1,024.00	7,680,000	
ゼリア新薬工業	20,600	2,114.00	43,548,400	
第一三共	1,008,900	4,231.00	4,268,655,900	
キョーリン製薬ホールディングス	25,100	1,810.00	45,431,000	

大幸薬品	21,000	547.00	11,487,000
ダイト	8,700	2,497.00	21,723,900
大塚ホールディングス	264,900	4,596.00	1,217,480,400
大正製薬ホールディングス	25,800	5,340.00	137,772,000
ペプチドリーム	56,200	1,686.00	94,753,200
大日本塗料	15,400	713.00	10,980,200
日本ペイントホールディングス	511,900	934.00	478,114,600
関西ペイント	117,700	2,065.00	243,050,500
神東塗料	9,300	131.00	1,218,300
中国塗料	29,400	898.00	26,401,200
日本特殊塗料	8,200	871.00	7,142,200
藤倉化成	17,000	407.00	6,919,000
太陽ホールディングス	20,100	2,427.00	48,782,700
D I C	45,100	2,407.00	108,555,700
サカタインクス	25,700	1,000.00	25,700,000
東洋インキS Cホールディングス	22,700	1,888.00	42,857,600
T & K T O K A	11,000	900.00	9,900,000
アルプス技研	10,400	1,910.00	19,864,000
サニックス	23,300	238.00	5,545,400
ダイオーズ	2,600	1,498.00	3,894,800
日本空調サービス	13,900	735.00	10,216,500
オリエンタルランド	141,400	20,010.00	2,829,414,000
フォーカスシステムズ	8,400	992.00	8,332,800
ダスキン	28,500	2,865.00	81,652,500
パーク24	88,600	2,017.00	178,706,200
明光ネットワークジャパン	15,600	591.00	9,219,600
ファルコホールディングス	5,900	1,738.00	10,254,200
クレスコ	10,000	1,665.00	16,650,000
フジ・メディア・ホールディングス	121,300	1,061.00	128,699,300
秀英予備校	2,900	436.00	1,264,400
田谷	1,600	529.00	846,400
ラウンドワン	111,200	670.00	74,504,000
リゾートトラスト	56,200	2,386.00	134,093,200
オービック	43,000	20,920.00	899,560,000
ジャストシステム	19,400	3,100.00	60,140,000
T D C ソフト	10,900	1,300.00	14,170,000
Zホールディングス	1,967,900	384.50	756,657,550
ビー・エム・エル	17,000	3,255.00	55,335,000
トレンドマイクロ	66,900	7,560.00	505,764,000
りらいあコミュニケーションズ	19,600	972.00	19,051,200
I Dホールディングス	8,600	876.00	7,533,600
リソー教育	60,700	302.00	18,331,400
日本オラクル	22,100	8,080.00	178,568,000
早稲田アカデミー	7,300	1,066.00	7,781,800
アルファシステムズ	3,700	4,125.00	15,262,500
フューチャー	28,800	1,593.00	45,878,400
C A C H o l d i n g s	7,200	1,467.00	10,562,400
S B テクノロジー	5,900	2,182.00	12,873,800
トーセ	3,400	783.00	2,662,200
ユー・エス・エス	148,800	2,227.00	331,377,600

オービックビジネスコンサルタント	12,900	4,530.00	58,437,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	62,200	3,490.00	217,078,000	
アイティフォー	16,500	761.00	12,556,500	
東京個別指導学院	11,700	511.00	5,978,700	
東計電算	1,600	5,850.00	9,360,000	
サイバーエージェント	283,800	1,247.00	353,898,600	
楽天グループ	548,400	640.00	350,976,000	
エクスネット	2,100	983.00	2,064,300	
クリーク・アンド・リバー社	7,000	2,140.00	14,980,000	
モーニングスター	23,300	444.00	10,345,200	
テー・オー・ダブリュー	25,400	309.00	7,848,600	
大塚商会	65,700	4,555.00	299,263,500	
サイボウズ	16,000	1,575.00	25,200,000	
山田コンサルティンググループ	6,900	1,186.00	8,183,400	
セントラルスポーツ	4,900	2,424.00	11,877,600	
パラカ	4,000	1,810.00	7,240,000	
電通国際情報サービス	14,100	4,455.00	62,815,500	
A C C E S S	15,400	799.00	12,304,600	
デジタルガレージ	22,700	3,500.00	79,450,000	
イーエムシステムズ	19,300	825.00	15,922,500	
ウェザーニューズ	4,000	7,160.00	28,640,000	
C I J	10,600	794.00	8,416,400	
ビジネスエンジニアリング	3,200	2,080.00	6,656,000	
日本エンタープライズ	13,300	143.00	1,901,900	
WOWOW	5,600	1,276.00	7,145,600	
スカラ	11,500	707.00	8,130,500	
インテリジェント ウェイブ	6,800	722.00	4,909,600	
フルキャストホールディングス	11,400	2,776.00	31,646,400	
エン・ジャパン	23,600	2,397.00	56,569,200	
あすか製薬ホールディングス	13,100	1,145.00	14,999,500	
サワイグループホールディングス	26,800	4,215.00	112,962,000	
富士フイルムホールディングス	244,400	6,691.00	1,635,280,400	
コニカミノルタ	282,200	441.00	124,450,200	
資生堂	241,800	5,150.00	1,245,270,000	
ライオン	139,000	1,578.00	219,342,000	
高砂香料工業	7,900	2,694.00	21,282,600	
マンダム	27,100	1,520.00	41,192,000	
ミルボン	17,200	6,270.00	107,844,000	
ファンケル	56,300	2,873.00	161,749,900	
コーセー	23,600	15,370.00	362,732,000	
コタ	9,700	1,555.00	15,083,500	
シーボン	1,500	1,622.00	2,433,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	59,400	1,665.00	98,901,000	
ノエビアホールディングス	10,400	5,590.00	58,136,000	
アジュバンホールディングス	3,200	942.00	3,014,400	
新日本製薬	6,600	1,493.00	9,853,800	
エステー	8,900	1,520.00	13,528,000	
アグロ カネショウ	4,600	1,320.00	6,072,000	
コニシ	21,100	1,642.00	34,646,200	
長谷川香料	24,000	3,105.00	74,520,000	

星光PMC	6,600	521.00	3,438,600
小林製薬	35,400	8,330.00	294,882,000
荒川化学工業	9,800	981.00	9,613,800
メック	9,500	2,307.00	21,916,500
日本高純度化学	3,300	2,434.00	8,032,200
タカラバイオ	36,500	1,687.00	61,575,500
JCU	14,300	2,870.00	41,041,000
新田ゼラチン	8,000	978.00	7,824,000
OATアグリオ	5,100	1,749.00	8,919,900
デクセリアルズ	36,200	3,210.00	116,202,000
アース製薬	10,500	5,200.00	54,600,000
北興化学工業	11,600	898.00	10,416,800
大成ラミック	3,800	2,884.00	10,959,200
クミアイ化学工業	45,900	967.00	44,385,300
日本農薬	24,800	840.00	20,832,000
富士興産	3,400	1,173.00	3,988,200
ニチレキ	14,900	1,326.00	19,757,400
ユシロ化学工業	6,600	846.00	5,583,600
ビーピー・カストロール	4,900	1,049.00	5,140,100
富士石油	30,400	316.00	9,606,400
MORESCO	4,600	1,082.00	4,977,200
出光興産	141,500	3,280.00	464,120,000
ENEOSホールディングス	2,092,300	484.50	1,013,719,350
コスモエネルギーホールディングス	54,800	3,860.00	211,528,000
テスホールディングス	12,100	916.00	11,083,600
インフロニア・ホールディングス	151,900	1,004.00	152,507,600
横浜ゴム	65,900	2,251.00	148,340,900
TOYO TIRE	66,700	1,631.00	108,787,700
ブリヂストン	369,700	4,860.00	1,796,742,000
住友ゴム工業	113,500	1,205.00	136,767,500
藤倉コンポジット	11,200	842.00	9,430,400
オカモト	6,400	3,545.00	22,688,000
WOW WORLD GROUP	1,800	907.00	1,632,600
アキレス	8,900	1,371.00	12,201,900
フコク	6,100	988.00	6,026,800
ニッタ	13,000	2,850.00	37,050,000
クリエートメディック	4,100	891.00	3,653,100
住友理工	27,000	564.00	15,228,000
三ツ星ベルト	17,000	3,060.00	52,020,000
バンドー化学	22,400	1,038.00	23,251,200
AGC	117,700	4,535.00	533,769,500
日本板硝子	62,900	547.00	34,406,300
石塚硝子	2,200	1,498.00	3,295,600
有沢製作所	18,900	1,255.00	23,719,500
日本山村硝子	4,800	572.00	2,745,600
日本電気硝子	47,200	2,501.00	118,047,200
オハラ	5,400	1,187.00	6,409,800
住友大阪セメント	20,700	3,130.00	64,791,000
太平洋セメント	79,000	2,018.00	159,422,000
リソルホールディングス	1,500	4,805.00	7,207,500

日本ヒューム	11,500	628.00	7,222,000
日本コンクリート工業	24,800	245.00	6,076,000
三谷セキサン	5,600	3,395.00	19,012,000
アジアパイルホールディングス	19,800	493.00	9,761,400
東海カーボン	97,100	953.00	92,536,300
日本カーボン	6,600	4,065.00	26,829,000
東洋炭素	7,300	3,510.00	25,623,000
ノリタケカンパニーリミテド	7,100	3,990.00	28,329,000
TOTO	84,100	4,835.00	406,623,500
日本碍子	137,000	1,824.00	249,888,000
日本特殊陶業	96,900	2,665.00	258,238,500
ダントーホールディングス	9,100	257.00	2,338,700
MARUWA	4,800	15,690.00	75,312,000
品川リフラクトリーズ	3,300	3,825.00	12,622,500
黒崎播磨	2,400	4,620.00	11,088,000
ヨータイ	8,800	1,386.00	12,196,800
東京窯業	13,700	258.00	3,534,600
ニッカトー	5,800	416.00	2,412,800
フジインコーポレーテッド	10,400	6,020.00	62,608,000
クニミネ工業	4,400	776.00	3,414,400
エーアンドエーマテリアル	2,400	847.00	2,032,800
ニチアス	29,300	2,282.00	66,862,600
日本製鉄	574,400	2,105.50	1,209,399,200
神戸製鋼所	239,600	604.00	144,718,400
中山製鋼所	19,100	609.00	11,631,900
合同製鉄	6,600	1,693.00	11,173,800
JFEホールディングス	318,400	1,410.00	448,944,000
東京製鉄	40,200	1,322.00	53,144,400
共英製鋼	13,600	1,408.00	19,148,800
大和工業	22,500	4,505.00	101,362,500
東京鐵鋼	5,600	1,336.00	7,481,600
大阪製鉄	7,300	1,093.00	7,978,900
淀川製鋼所	14,900	2,414.00	35,968,600
丸一鋼管	39,900	2,968.00	118,423,200
モリ工業	3,400	2,513.00	8,544,200
大同特殊鋼	18,800	3,595.00	67,586,000
日本高周波鋼業	3,900	309.00	1,205,100
日本冶金工業	9,400	2,838.00	26,677,200
山陽特殊製鋼	11,700	1,920.00	22,464,000
愛知製鋼	7,800	2,062.00	16,083,600
日立金属	148,200	2,178.00	322,779,600
日本金属	3,500	982.00	3,437,000
大平洋金属	8,400	2,082.00	17,488,800
新日本電工	76,200	338.00	25,755,600
栗本鐵工所	5,600	1,601.00	8,965,600
虹 技	1,700	876.00	1,489,200
日本鑄鉄管	1,500	960.00	1,440,000
日本製鋼所	35,300	2,971.00	104,876,300
三菱製鋼	8,800	920.00	8,096,000
日亜鋼業	15,700	231.00	3,626,700

日本精線	2,200	4,425.00	9,735,000
エンビプロ・ホールディングス	9,100	749.00	6,815,900
大紀アルミニウム工業所	17,000	1,232.00	20,944,000
日本軽金属ホールディングス	34,800	1,464.00	50,947,200
三井金属鉱業	37,100	2,996.00	111,151,600
東邦亜鉛	7,100	2,170.00	15,407,000
三菱マテリアル	79,500	1,986.00	157,887,000
住友金属鉱山	150,700	4,126.00	621,788,200
DOWAホールディングス	32,100	5,080.00	163,068,000
古河機械金属	21,000	1,240.00	26,040,000
エス・サイエンス	61,100	23.00	1,405,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,900	2,922.00	46,459,800
東邦チタニウム	24,600	2,211.00	54,390,600
UACJ	18,800	2,012.00	37,825,600
CKサンエツ	2,600	4,150.00	10,790,000
古河電気工業	39,600	2,277.00	90,169,200
住友電気工業	480,000	1,505.00	722,400,000
フジクラ	153,200	876.00	134,203,200
昭和電線ホールディングス	12,000	1,813.00	21,756,000
東京特殊電線	1,700	2,201.00	3,741,700
タツタ電線	24,200	446.00	10,793,200
カナレ電気	2,000	1,398.00	2,796,000
平河ヒューテック	7,600	1,041.00	7,911,600
いよぎんホールディングス	153,800	687.00	105,660,600
しずおかフィナンシャルグループ	282,700	895.00	253,016,500
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	96,500	890.00	85,885,000
リョービ	12,700	1,263.00	16,040,100
アーレスティ	14,700	358.00	5,262,600
アサヒホールディングス	55,000	1,950.00	107,250,000
東洋製罐グループホールディングス	70,200	1,778.00	124,815,600
ホッカンホールディングス	6,400	1,279.00	8,185,600
コロナ	6,600	831.00	5,484,600
横河ブリッジホールディングス	19,700	1,930.00	38,021,000
駒井ハルテック	2,100	1,574.00	3,305,400
高田機工	600	2,391.00	1,434,600
三和ホールディングス	129,600	1,254.00	162,518,400
文化シャッター	40,500	1,059.00	42,889,500
三協立山	16,400	551.00	9,036,400
アルインコ	9,100	940.00	8,554,000
東洋シャッター	2,200	516.00	1,135,200
LIXIL	198,300	2,197.00	435,665,100
日本フィルコン	8,600	450.00	3,870,000
ノーリツ	17,600	1,512.00	26,611,200
長府製作所	12,400	2,029.00	25,159,600
リンナイ	23,800	10,400.00	247,520,000
ユニプレス	22,700	879.00	19,953,300
ダイニチ工業	6,600	627.00	4,138,200
日東精工	15,600	517.00	8,065,200
三洋工業	1,500	1,677.00	2,515,500
岡部	19,300	641.00	12,371,300

ジーテクト	15,100	1,269.00	19,161,900
東ブレ	21,000	1,141.00	23,961,000
高周波熱錬	21,300	659.00	14,036,700
東京製綱	8,400	895.00	7,518,000
サンコール	11,700	672.00	7,862,400
モリテックスチール	10,800	355.00	3,834,000
パイオラックス	18,100	1,815.00	32,851,500
エイチワン	12,200	583.00	7,112,600
日本発条	116,000	874.00	101,384,000
中央発條	6,600	673.00	4,441,800
アドバネクス	1,700	1,176.00	1,999,200
三浦工業	54,000	3,055.00	164,970,000
タクマ	39,400	1,224.00	48,225,600
テクノプロ・ホールディングス	79,600	3,265.00	259,894,000
アトラグループ	3,000	186.00	558,000
インターワークス	3,900	367.00	1,431,300
アイ・アールジャパンホールディングス	6,100	2,020.00	12,322,000
Keeper 技研	8,500	3,945.00	33,532,500
ファーストロジック	2,000	784.00	1,568,000
三機サービス	2,300	880.00	2,024,000
Gunosy	7,300	744.00	5,431,200
デザインワン・ジャパン	3,500	173.00	605,500
イー・ガーディアン	4,500	2,926.00	13,167,000
リブセンス	6,100	257.00	1,567,700
ジャパンマテリアル	40,900	1,830.00	74,847,000
ベクトル	18,600	1,141.00	21,222,600
ウチヤマホールディングス	6,500	289.00	1,878,500
チャーム・ケア・コーポレーション	9,900	1,047.00	10,365,300
キャリアリンク	4,900	2,363.00	11,578,700
IBJ	7,300	975.00	7,117,500
アサンテ	5,900	1,603.00	9,457,700
バリューHR	10,400	1,459.00	15,173,600
M&Aキャピタルパートナーズ	11,000	3,530.00	38,830,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,100	1,018.00	5,191,800
ERIホールディングス	3,800	1,016.00	3,860,800
アピスト	1,900	2,827.00	5,371,300
シグマクシス・ホールディングス	16,000	1,186.00	18,976,000
ウィルグループ	9,900	1,411.00	13,968,900
エスクロー・エージェント・ジャパン	13,800	151.00	2,083,800
メドピア	9,400	1,347.00	12,661,800
レアジョブ	2,500	778.00	1,945,000
リクルートホールディングス	952,100	4,315.00	4,108,311,500
エラン	15,700	1,063.00	16,689,100
ツガミ	28,100	1,137.00	31,949,700
オークマ	13,000	5,070.00	65,910,000
芝浦機械	15,500	2,896.00	44,888,000
アマダ	217,100	1,019.00	221,224,900
アイダエンジニアリング	30,000	847.00	25,410,000

TAKISAWA	4,000	1,017.00	4,068,000
FUJI	54,800	1,911.00	104,722,800
牧野フライス製作所	13,900	4,490.00	62,411,000
オーエスジー	55,700	1,814.00	101,039,800
ダイジェット工業	1,500	841.00	1,261,500
旭ダイヤモンド工業	33,700	713.00	24,028,100
DMG森精機	70,700	1,651.00	116,725,700
ソディック	32,500	749.00	24,342,500
ディスコ	20,300	30,600.00	621,180,000
日東工器	6,600	1,573.00	10,381,800
日進工具	10,900	1,123.00	12,240,700
パンチ工業	11,600	416.00	4,825,600
富士ダイス	6,900	570.00	3,933,000
土木管理総合試験所	5,500	307.00	1,688,500
日本郵政	1,452,000	970.00	1,408,440,000
ベルシステム24ホールディングス	19,200	1,385.00	26,592,000
鎌倉新書	15,000	841.00	12,615,000
SMN	3,000	500.00	1,500,000
一蔵	1,600	464.00	742,400
グローバルキッズCOMPANY	1,900	589.00	1,119,100
エアトリ	7,700	2,845.00	21,906,500
アトラエ	9,400	1,665.00	15,651,000
ストライク	5,900	3,815.00	22,508,500
ソラスト	32,600	916.00	29,861,600
セラク	4,200	1,049.00	4,405,800
インソース	14,700	3,010.00	44,247,000
豊田自動織機	98,500	7,280.00	717,080,000
豊和工業	7,100	850.00	6,035,000
ニデックオーケーケー	5,100	1,102.00	5,620,200
石川製作所	3,700	1,449.00	5,361,300
東洋機械金属	8,900	548.00	4,877,200
津田駒工業	2,400	519.00	1,245,600
エンシュウ	3,100	758.00	2,349,800
島精機製作所	20,200	2,036.00	41,127,200
オプトラン	17,200	2,045.00	35,174,000
NCホールディングス	3,900	1,824.00	7,113,600
イワキ	8,700	1,331.00	11,579,700
フリー	12,200	1,111.00	13,554,200
ヤマシンフィルタ	21,500	407.00	8,750,500
日阪製作所	14,100	826.00	11,646,600
やまびこ	19,100	1,098.00	20,971,800
野村マイクロ・サイエンス	4,400	3,160.00	13,904,000
平田機工	6,000	4,010.00	24,060,000
ペガサスミシン製造	13,900	890.00	12,371,000
マルマエ	5,600	1,555.00	8,708,000
タツモ	6,400	1,300.00	8,320,000
ナプテスコ	73,200	3,045.00	222,894,000
三井海洋開発	14,700	1,478.00	21,726,600
レオン自動機	14,700	1,134.00	16,669,800
S M C	40,800	59,500.00	2,427,600,000

ホソカワミクロン	8,900	2,540.00	22,606,000	
ユニオンツール	5,000	3,425.00	17,125,000	
オイレス工業	17,900	1,485.00	26,581,500	
日精エー・エス・ビー機械	5,200	3,615.00	18,798,000	
サトーホールディングス	18,100	1,836.00	33,231,600	
技研製作所	12,100	3,165.00	38,296,500	
日本エアテック	5,900	1,074.00	6,336,600	
カワタ	4,000	836.00	3,344,000	
日精樹脂工業	8,600	921.00	7,920,600	
オカダアイオン	4,300	1,427.00	6,136,100	
ワイエイシーホールディングス	5,400	1,267.00	6,841,800	
小松製作所	630,200	2,644.50	1,666,563,900	
住友重機械工業	74,300	2,695.00	200,238,500	
日立建機	55,700	2,634.00	146,713,800	
日工	17,200	613.00	10,543,600	
巴工業	4,900	2,461.00	12,058,900	
井関農機	10,900	1,172.00	12,774,800	
TOWA	11,900	1,630.00	19,397,000	
丸山製作所	2,200	1,464.00	3,220,800	
北川鉄工所	5,300	1,258.00	6,667,400	
シンニッタン	16,600	214.00	3,552,400	
ローツェ	6,900	7,220.00	49,818,000	
タカキタ	4,200	473.00	1,986,600	
クボタ	621,800	1,985.00	1,234,273,000	
荏原実業	5,800	2,141.00	12,417,800	
東洋エンジニアリング	18,300	561.00	10,266,300	
三菱化工機	4,000	2,053.00	8,212,000	
月島機械	21,600	898.00	19,396,800	
帝国電機製作所	8,800	1,892.00	16,649,600	
東京機械製作所	5,600	542.00	3,035,200	
新東工業	26,000	685.00	17,810,000	
澁谷工業	11,000	2,487.00	27,357,000	
アイチコーポレーション	19,900	780.00	15,522,000	
小森コーポレーション	31,900	701.00	22,361,900	
鶴見製作所	9,800	2,348.00	23,010,400	
住友精密工業	2,000	2,407.00	4,814,000	
日本ギア工業	4,900	345.00	1,690,500	
酒井重工業	2,300	2,934.00	6,748,200	
荏原製作所	47,700	4,715.00	224,905,500	
石井鐵工所	1,000	2,789.00	2,789,000	
西島製作所	11,400	1,310.00	14,934,000	
北越工業	11,700	1,010.00	11,817,000	
ダイキン工業	151,900	22,535.00	3,423,066,500	
オルガノ	15,900	2,040.00	32,436,000	
トーヨーカネツ	4,900	2,476.00	12,132,400	
栗田工業	70,200	4,935.00	346,437,000	
椿本チエイン	18,200	3,005.00	54,691,000	
大同工業	5,600	733.00	4,104,800	
日機装	28,900	938.00	27,108,200	
木村化工機	10,700	674.00	7,211,800	

レイズネクスト	18,700	1,218.00	22,776,600
アネスト岩田	21,500	898.00	19,307,000
ダイフク	65,600	6,890.00	451,984,000
サムコ	3,900	2,937.00	11,454,300
加藤製作所	6,600	741.00	4,890,600
油研工業	1,600	1,773.00	2,836,800
タダノ	67,100	864.00	57,974,400
フジテック	42,700	3,040.00	129,808,000
C K D	35,200	1,729.00	60,860,800
キトー	10,900	2,719.00	29,637,100
平和	38,700	2,312.00	89,474,400
理想科学工業	11,600	2,240.00	25,984,000
SANKYO	28,600	4,515.00	129,129,000
日本金銭機械	14,100	681.00	9,602,100
マースグループホールディングス	8,800	1,649.00	14,511,200
フクシマガリレイ	8,500	3,825.00	32,512,500
オーイズミ	4,900	410.00	2,009,000
ダイコク電機	6,300	1,302.00	8,202,600
竹内製作所	21,200	2,611.00	55,353,200
アマノ	36,500	2,527.00	92,235,500
JUKI	18,100	714.00	12,923,400
サンデン	19,300	199.00	3,840,700
ジャノメ	11,800	613.00	7,233,400
ブラザー工業	158,600	2,523.00	400,147,800
マックス	16,400	1,998.00	32,767,200
モリタホールディングス	22,200	1,270.00	28,194,000
グローリー	33,000	2,237.00	73,821,000
新晃工業	12,800	1,525.00	19,520,000
大和冷機工業	17,900	1,193.00	21,354,700
セガサミーホールディングス	125,100	1,875.00	234,562,500
日本ピストンリング	5,000	1,191.00	5,955,000
リケン	5,000	2,284.00	11,420,000
T P R	15,000	1,223.00	18,345,000
ツバキ・ナカシマ	28,700	1,160.00	33,292,000
ホシザキ	75,100	4,205.00	315,795,500
大豊工業	11,400	691.00	7,877,400
日本精工	238,100	725.00	172,622,500
NTN	253,000	252.00	63,756,000
ジェイテクト	118,600	940.00	111,484,000
不二越	8,600	3,670.00	31,562,000
ミネベアミツミ	221,300	2,106.00	466,057,800
日本トムソン	31,700	501.00	15,881,700
THK	67,300	2,461.00	165,625,300
ユーシン精機	10,900	686.00	7,477,400
前澤給装工業	8,900	898.00	7,992,200
イーグル工業	14,900	1,060.00	15,794,000
前澤工業	8,200	627.00	5,141,400
日本ピラー工業	11,900	2,327.00	27,691,300
キッツ	43,000	835.00	35,905,000
日立製作所	668,900	6,324.00	4,230,123,600

東芝	243,200	5,133.00	1,248,345,600
三菱電機	1,298,000	1,325.50	1,720,499,000
富士電機	77,300	5,270.00	407,371,000
東洋電機製造	4,600	872.00	4,011,200
安川電機	138,200	4,160.00	574,912,000
シンフォニアテクノロジー	14,200	1,336.00	18,971,200
明電舎	19,700	1,896.00	37,351,200
オリジン	3,200	1,236.00	3,955,200
山洋電気	4,900	4,785.00	23,446,500
デンヨー	9,900	1,410.00	13,959,000
PHCホールディングス	21,400	1,375.00	29,425,000
バイカレント・コンサルティング	9,400	38,300.00	360,020,000
Orchestra Holdings	2,500	2,272.00	5,680,000
アイモバイル	6,600	1,159.00	7,649,400
キャリアインデックス	4,500	408.00	1,836,000
MS-Japan	5,300	806.00	4,271,800
船場	1,500	733.00	1,099,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	42,200	1,922.00	81,108,400
フルテック	1,700	1,046.00	1,778,200
グリーンズ	4,900	982.00	4,811,800
ツナググループ・ホールディングス	3,800	382.00	1,451,600
GAMEWITH	3,900	352.00	1,372,800
MS&Consulting	1,800	615.00	1,107,000
ウェルビー	8,700	909.00	7,908,300
エル・ティー・エス	1,600	3,080.00	4,928,000
ミダックホールディングス	6,000	3,630.00	21,780,000
日総工産	10,300	565.00	5,819,500
キュービーネットホールディングス	6,100	1,301.00	7,936,100
RPAホールディングス	18,700	292.00	5,460,400
三櫻工業	19,300	688.00	13,278,400
マキタ	157,300	2,711.00	426,440,300
東芝テック	14,900	4,040.00	60,196,000
芝浦メカトロニクス	2,500	8,900.00	22,250,000
マブチモーター	28,900	3,930.00	113,577,000
日本電産	309,000	7,715.00	2,383,935,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,900	481.00	2,356,900
トレックス・セミコンダクター	5,900	2,539.00	14,980,100
東光高岳	7,800	1,787.00	13,938,600
ダブル・スコープ	38,000	1,507.00	57,266,000
宮越ホールディングス	5,100	880.00	4,488,000
ダイヘン	12,800	3,620.00	46,336,000
ヤーマン	22,700	1,117.00	25,355,900
JVCケンウッド	113,300	201.00	22,773,300
ミマキエンジニアリング	12,400	660.00	8,184,000
I-PEX	6,500	1,253.00	8,144,500
日新電機	32,600	1,299.00	42,347,400
大崎電気工業	23,400	511.00	11,957,400
オムロン	115,800	6,861.00	794,503,800

日東工業	17,500	2,443.00	42,752,500
I D E C	17,200	3,005.00	51,686,000
正興電機製作所	3,900	993.00	3,872,700
不二電機工業	2,600	1,080.00	2,808,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	41,700	2,206.00	91,990,200
サクサホールディングス	2,700	1,214.00	3,277,800
メルコホールディングス	3,900	3,025.00	11,797,500
テクノメディカ	3,200	1,676.00	5,363,200
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	3,900	1,138.00	4,438,200
日本電気	165,100	4,660.00	769,366,000
富士通	125,200	15,940.00	1,995,688,000
沖電気工業	52,700	713.00	37,575,100
岩崎通信機	5,600	737.00	4,127,200
電気興業	6,600	2,198.00	14,506,800
サンケン電気	11,900	4,525.00	53,847,500
ナカヨ	1,900	1,070.00	2,033,000
アイホン	6,200	1,964.00	12,176,800
ルネサスエレクトロニクス	758,900	1,204.00	913,715,600
セイコーエプソン	155,400	2,019.00	313,752,600
ワコム	106,600	689.00	73,447,400
アルバック	27,800	5,270.00	146,506,000
アクセル	5,200	1,035.00	5,382,000
E I Z O	9,400	3,695.00	34,733,000
ジャパンディスプレイ	474,900	48.00	22,795,200
日本信号	29,500	950.00	28,025,000
京三製作所	27,100	415.00	11,246,500
能美防災	15,700	1,623.00	25,481,100
ホーチキ	8,700	1,417.00	12,327,900
星和電機	5,100	430.00	2,193,000
エレコム	31,800	1,395.00	44,361,000
パナソニック ホールディングス	1,483,400	1,024.50	1,519,743,300
シャープ	132,100	800.00	105,680,000
アンリツ	87,900	1,620.00	142,398,000
富士通ゼネラル	37,700	3,080.00	116,116,000
ソニーグループ	871,300	9,348.00	8,144,912,400
T D K	201,400	4,505.00	907,307,000
帝国通信工業	6,100	1,448.00	8,832,800
タムラ製作所	50,100	689.00	34,518,900
アルプスアルパイン	113,500	1,065.00	120,877,500
池上通信機	4,000	553.00	2,212,000
日本電波工業	13,900	1,494.00	20,766,600
鈴木	6,800	845.00	5,746,000
メイコー	14,900	2,452.00	36,534,800
日本トリム	2,600	2,326.00	6,047,600
ローランド ディー・ジー・	6,600	2,984.00	19,694,400
フォスター電機	12,800	759.00	9,715,200
S M K	3,200	2,406.00	7,699,200
ヨコオ	9,300	1,944.00	18,079,200
ティアック	21,300	114.00	2,428,200

ホシデン	30,700	1,468.00	45,067,600
ヒロセ電機	19,300	19,620.00	378,666,000
日本航空電子工業	27,900	2,093.00	58,394,700
TOA	14,900	771.00	11,487,900
マクセル	25,300	1,369.00	34,635,700
古野電気	16,500	1,046.00	17,259,000
スミダコーポレーション	10,700	940.00	10,058,000
アイコム	4,500	2,571.00	11,569,500
リオン	4,800	1,990.00	9,552,000
横河電機	127,600	2,296.00	292,969,600
新電元工業	4,900	3,490.00	17,101,000
アズビル	80,600	3,960.00	319,176,000
東亜ディーケーケー	6,900	834.00	5,754,600
日本光電工業	53,400	3,160.00	168,744,000
チノー	4,400	1,638.00	7,207,200
共和電業	12,100	332.00	4,017,200
日本電子材料	6,500	1,315.00	8,547,500
堀場製作所	25,700	5,670.00	145,719,000
アドバンテスト	103,300	6,780.00	700,374,000
小野測器	4,800	387.00	1,857,600
エスベック	10,300	1,703.00	17,540,900
キーエンス	126,000	49,160.00	6,194,160,000
日置電機	6,000	6,380.00	38,280,000
シスメックス	99,600	7,589.00	755,864,400
日本マイクロニクス	19,100	1,218.00	23,263,800
メガチップス	12,200	2,397.00	29,243,400
OBARA GROUP	5,300	3,235.00	17,145,500
IMAGICA GROUP	9,600	944.00	9,062,400
澤藤電機	1,600	1,139.00	1,822,400
デンソー	272,200	7,000.00	1,905,400,000
原田工業	6,600	781.00	5,154,600
コーセル	15,400	806.00	12,412,400
イリソ電子工業	11,600	3,850.00	44,660,000
オブテックスグループ	21,200	1,996.00	42,315,200
千代田インテグレ	4,700	2,248.00	10,565,600
レーザーテック	57,000	16,420.00	935,940,000
スタンレー電気	89,700	2,373.00	212,858,100
岩崎電気	4,400	2,528.00	11,123,200
ウシオ電機	65,800	1,486.00	97,778,800
岡谷電機産業	9,900	245.00	2,425,500
ヘリオス テクノ ホールディング	11,800	455.00	5,369,000
エノモト	3,900	1,544.00	6,021,600
日本セラミック	11,700	2,534.00	29,647,800
遠藤照明	6,300	716.00	4,510,800
古河電池	10,000	1,099.00	10,990,000
双信電機	6,600	407.00	2,686,200
山一電機	9,100	1,879.00	17,098,900
図研	9,000	3,360.00	30,240,000
日本電子	26,800	4,945.00	132,526,000
カシオ計算機	86,000	1,308.00	112,488,000

ファナック	122,100	20,220.00	2,468,862,000	
日本シイエムケイ	24,500	454.00	11,123,000	
エンプラス	3,500	4,090.00	14,315,000	
大真空	17,200	873.00	15,015,600	
ローム	57,800	9,850.00	569,330,000	
浜松ホトニクス	92,700	6,310.00	584,937,000	
三井ハイテック	11,900	7,100.00	84,490,000	
新光電気工業	40,900	3,130.00	128,017,000	
京セラ	195,700	7,268.00	1,422,347,600	
協栄産業	1,500	1,429.00	2,143,500	
太陽誘電	61,800	3,675.00	227,115,000	
村田製作所	379,400	6,826.00	2,589,784,400	
双葉電子工業	23,800	602.00	14,327,600	
日東電工	84,100	7,780.00	654,298,000	
北陸電気工業	5,100	1,021.00	5,207,100	
東海理化電機製作所	36,700	1,408.00	51,673,600	
ニチコン	37,100	1,331.00	49,380,100	
日本ケミコン	13,100	1,797.00	23,540,700	
K O A	19,300	2,200.00	42,460,000	
三井E & Sホールディングス	51,600	405.00	20,898,000	
日立造船	110,100	809.00	89,070,900	
三菱重工業	204,000	4,772.00	973,488,000	
川崎重工業	94,200	2,300.00	216,660,000	
I H I	86,700	3,100.00	268,770,000	
名村造船所	35,900	546.00	19,601,400	
サノヤスホールディングス	15,700	121.00	1,899,700	
スプリックス	4,500	972.00	4,374,000	
マネジメントソリューションズ	6,500	2,752.00	17,888,000	
プロレド・パートナーズ	2,800	478.00	1,338,400	
and factory	3,900	354.00	1,380,600	
テノ・ホールディングス	1,600	560.00	896,000	
フロンティア・マネジメント	3,600	1,190.00	4,284,000	
ピアラ	2,000	634.00	1,268,000	
コプロ・ホールディングス	2,600	854.00	2,220,400	
ギークス	2,300	787.00	1,810,100	
カーブスホールディングス	36,500	871.00	31,791,500	
フォーラムエンジニアリング	8,100	912.00	7,387,200	
FAST FITNESS JAPAN	2,500	1,462.00	3,655,000	
日本車輛製造	4,500	2,037.00	9,166,500	
三菱ロジスネクスト	18,400	715.00	13,156,000	
近畿車輛	1,500	950.00	1,425,000	
一家ホールディングス	2,500	662.00	1,655,000	
フルサト・マルカホールディングス	12,100	3,380.00	40,898,000	
ヤマエグループホールディングス	7,700	1,517.00	11,680,900	
ジャパングラフトホールディングス	4,200	654.00	2,746,800	
F P G	46,100	1,151.00	53,061,100	
島根銀行	4,100	406.00	1,664,600	
じもとホールディングス	9,100	451.00	4,104,100	
全国保証	32,700	4,830.00	157,941,000	

めぶきフィナンシャルグループ	564,300	288.00	162,518,400	
ジャパンインベストメントアドバイザー	9,400	1,313.00	12,342,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	15,900	2,105.00	33,469,500	
九州フィナンシャルグループ	240,100	379.00	90,997,900	
かんぼ生命保険	138,100	2,130.00	294,153,000	
ゆうちょ銀行	323,800	968.00	313,438,400	
あんしん保証	5,300	247.00	1,309,100	
富山第一銀行	30,500	410.00	12,505,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	679,000	452.00	306,908,000	
ジェイリース	4,600	2,347.00	10,796,200	
西日本フィナンシャルホールディングス	72,000	751.00	54,072,000	
イントラスト	5,800	592.00	3,433,600	
日本モーゲージサービス	7,600	862.00	6,551,200	
CASA	4,900	803.00	3,934,700	
アルヒ	20,300	1,383.00	28,074,900	
プレミアグループ	20,900	1,576.00	32,938,400	
日産自動車	1,640,300	450.00	738,135,000	
いすゞ自動車	402,900	1,645.00	662,770,500	
トヨタ自動車	6,340,500	1,990.00	12,617,595,000	
日野自動車	173,700	591.00	102,656,700	
三菱自動車工業	514,900	467.00	240,458,300	
エフテック	8,800	505.00	4,444,000	
レシップホールディングス	5,000	460.00	2,300,000	
GMB	2,500	707.00	1,767,500	
ファルテック	2,500	611.00	1,527,500	
武蔵精密工業	31,100	1,603.00	49,853,300	
日産車体	20,400	825.00	16,830,000	
新明和工業	36,300	1,004.00	36,445,200	
極東開発工業	22,100	1,353.00	29,901,300	
トピー工業	10,500	1,568.00	16,464,000	
ティラド	3,900	2,535.00	9,886,500	
曙ブレーキ工業	76,500	171.00	13,081,500	
タチエス	22,700	1,099.00	24,947,300	
NOK	52,400	1,104.00	57,849,600	
フタバ産業	31,000	321.00	9,951,000	
KYB	12,200	3,150.00	38,430,000	
市光工業	16,600	398.00	6,606,800	
大同メタル工業	26,800	488.00	13,078,400	
プレス工業	62,400	393.00	24,523,200	
ミクニ	16,100	301.00	4,846,100	
太平洋工業	26,500	1,034.00	27,401,000	
河西工業	17,200	194.00	3,336,800	
アイシン	101,700	3,825.00	389,002,500	
マツダ	409,300	925.00	378,602,500	
今仙電機製作所	9,100	555.00	5,050,500	
本田技研工業	1,016,900	3,195.00	3,248,995,500	
スズキ	275,800	4,555.00	1,256,269,000	

S U B A R U	365,300	2,218.50	810,418,050	
安永	5,500	631.00	3,470,500	
ヤマハ発動機	181,500	2,841.00	515,641,500	
小糸製作所	138,800	2,060.00	285,928,000	
T B K	13,900	285.00	3,961,500	
エクセディ	21,000	1,690.00	35,490,000	
ミツバ	21,500	382.00	8,213,000	
豊田合成	39,300	2,257.00	88,700,100	
愛三工業	21,700	682.00	14,799,400	
盟和産業	1,500	1,000.00	1,500,000	
日本プラスト	10,100	431.00	4,353,100	
ヨロズ	10,900	838.00	9,134,200	
エフ・シー・シー	22,700	1,386.00	31,462,200	
新家工業	2,900	1,787.00	5,182,300	
シマノ	47,200	22,955.00	1,083,476,000	
テイ・エス テック	58,800	1,511.00	88,846,800	
三十三フィナンシャルグループ	11,100	1,426.00	15,828,600	
第四北越フィナンシャルグループ	19,300	2,643.00	51,009,900	
ひろぎんホールディングス	175,200	613.00	107,397,600	
マーキュリアホールディングス	7,400	619.00	4,580,600	
おきなわフィナンシャルグループ	11,600	2,050.00	23,780,000	
ダイレクトマーケティングミックス	13,500	1,585.00	21,397,500	
ポピンズ	1,700	1,597.00	2,714,900	
L I T A L I C O	10,800	2,893.00	31,244,400	
十六フィナンシャルグループ	16,000	2,402.00	38,432,000	
北國フィナンシャルホールディングス	11,400	4,665.00	53,181,000	
ネットプロテクションズホールディングス	41,600	380.00	15,808,000	
プロクレアホールディングス	13,900	2,188.00	30,413,200	
あいちフィナンシャルグループ	18,119	1,759.00	31,871,321	
ジャムコ	8,200	1,398.00	11,463,600	
小野建	12,200	1,443.00	17,604,600	
はるやまホールディングス	6,400	426.00	2,726,400	
南陽	2,600	1,818.00	4,726,800	
ノジマ	44,200	1,239.00	54,763,800	
佐鳥電機	8,500	1,221.00	10,378,500	
カッパ・クリエイト	19,300	1,383.00	26,691,900	
エコートレーディング	2,700	541.00	1,460,700	
伯東	8,100	3,305.00	26,770,500	
コンドーテック	10,300	989.00	10,186,700	
中山福	7,200	307.00	2,210,400	
ライトオン	10,300	645.00	6,643,500	
ナガイレーベン	15,400	1,970.00	30,338,000	
三菱食品	13,100	3,110.00	40,741,000	
良品計画	157,600	1,178.00	185,652,800	
パリミキホールディングス	17,000	252.00	4,284,000	
松田産業	9,300	2,231.00	20,748,300	
第一興商	26,000	4,120.00	107,120,000	
メディバルホールディングス	126,600	1,859.00	235,349,400	
アドヴァングループ	11,600	838.00	9,720,800	

S P K	5,300	1,408.00	7,462,400
萩原電気ホールディングス	4,700	2,123.00	9,978,100
アルビス	4,000	2,325.00	9,300,000
アズワン	19,700	6,060.00	119,382,000
スズデン	4,300	2,191.00	9,421,300
尾家産業	2,800	842.00	2,357,600
シモジマ	8,300	1,000.00	8,300,000
ドウシシャ	12,800	1,470.00	18,816,000
小津産業	3,000	1,574.00	4,722,000
コナカ	14,800	338.00	5,002,400
高速	7,200	1,554.00	11,188,800
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,609.00	2,574,400
G - 7ホールディングス	15,100	1,556.00	23,495,600
たけびし	4,600	1,464.00	6,734,400
イオン北海道	18,100	1,210.00	21,901,000
コジマ	23,600	645.00	15,222,000
ヒマラヤ	4,200	905.00	3,801,000
コーナン商事	19,500	3,075.00	59,962,500
ネットワンシステムズ	50,400	2,860.00	144,144,000
エコス	4,500	1,772.00	7,974,000
ワタミ	16,600	898.00	14,906,800
マルシェ	4,500	409.00	1,840,500
リックス	2,800	2,094.00	5,863,200
システムソフト	40,300	102.00	4,110,600
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	273,900	2,636.00	722,000,400
丸文	10,900	789.00	8,600,100
西松屋チェーン	27,100	1,308.00	35,446,800
ゼンショーホールディングス	66,900	3,725.00	249,202,500
ハビネット	10,500	1,966.00	20,643,000
幸楽苑ホールディングス	8,100	1,068.00	8,650,800
ハークスレイ	5,700	477.00	2,718,900
橋本総業ホールディングス	5,000	981.00	4,905,000
日本ライフライン	40,600	974.00	39,544,400
サイゼリヤ	20,300	2,744.00	55,703,200
タカショー	10,700	662.00	7,083,400
V Tホールディングス	51,500	480.00	24,720,000
アルゴグラフィックス	10,700	3,685.00	39,429,500
魚力	3,900	2,031.00	7,920,900
I D O M	41,500	797.00	33,075,500
日本エム・ディ・エム	8,100	1,250.00	10,125,000
ポブラ	3,100	149.00	461,900
フジ・コーポレーション	7,200	1,253.00	9,021,600
ユナイテッドアローズ	14,300	2,020.00	28,886,000
進和	8,100	1,963.00	15,900,300
エスケイジャパン	3,300	631.00	2,082,300
ダイトロン	4,800	2,000.00	9,600,000
ハイデイ日高	19,800	1,925.00	38,115,000
シークス	17,400	1,097.00	19,087,800

YU-WA CREATION HOLDINGS	8,100	209.00	1,692,900	
コロワイド	56,300	1,826.00	102,803,800	
ピーシーデポコーポレーション	15,900	270.00	4,293,000	
田中商事	3,300	551.00	1,818,300	
オーハシテクニカ	6,700	1,399.00	9,373,300	
壱番屋	9,600	4,380.00	42,048,000	
白銅	4,400	2,346.00	10,322,400	
トップカルチャー	4,400	204.00	897,600	
PLANT	3,200	630.00	2,016,000	
スギホールディングス	27,400	6,140.00	168,236,000	
ダイコー通産	1,500	1,103.00	1,654,500	
薬王堂ホールディングス	6,800	2,650.00	18,020,000	
島津製作所	166,300	3,805.00	632,771,500	
JMS	10,700	537.00	5,745,900	
クボテック	3,000	225.00	675,000	
長野計器	9,300	1,039.00	9,662,700	
ブイ・テクノロジー	6,100	2,687.00	16,390,700	
スター精密	22,600	1,622.00	36,657,200	
東京計器	8,800	1,248.00	10,982,400	
愛知時計電機	4,900	1,319.00	6,463,100	
インターアクション	7,000	1,480.00	10,360,000	
オーバル	12,400	453.00	5,617,200	
東京精密	21,600	4,155.00	89,748,000	
マニー	50,700	2,085.00	105,709,500	
ニコン	196,100	1,305.00	255,910,500	
トプコン	65,400	1,547.00	101,173,800	
オリンパス	666,300	2,890.50	1,925,940,150	
理研計器	9,200	3,605.00	33,166,000	
SCREENホールディングス	21,900	7,600.00	166,440,000	
キヤノン電子	12,700	1,613.00	20,485,100	
タムロン	8,600	3,070.00	26,402,000	
HOYA	265,000	14,100.00	3,736,500,000	
シード	6,500	503.00	3,269,500	
ノーリツ鋼機	11,000	2,506.00	27,566,000	
A&Dホロンホールディングス	15,700	890.00	13,973,000	
朝日インテック	152,500	2,492.00	380,030,000	
キヤノン	633,500	3,217.00	2,037,969,500	
リコー	330,900	1,054.00	348,768,600	
シチズン時計	126,800	610.00	77,348,000	
リズム	4,300	1,561.00	6,712,300	
大研医器	11,000	463.00	5,093,000	
メニコン	43,000	2,968.00	127,624,000	
シンシア	1,200	454.00	544,800	
KYORITSU	19,100	126.00	2,406,600	
中本パックス	3,900	1,475.00	5,752,500	
スノーピーク	19,800	2,183.00	43,223,400	
パラマウントベッドホールディングス	26,700	2,661.00	71,048,700	
トランザクション	8,800	1,044.00	9,187,200	
粧美堂	3,500	392.00	1,372,000	

ニホンフラッシュ	10,900	964.00	10,507,600
前田工織	12,500	3,185.00	39,812,500
永大産業	15,000	226.00	3,390,000
アートネイチャー	11,900	753.00	8,960,700
バンダイナムコホールディングス	115,000	9,674.00	1,112,510,000
アイフィスジャパン	3,600	592.00	2,131,200
SHOEI	12,100	5,430.00	65,703,000
フランスベッドホールディングス	17,900	913.00	16,342,700
マーベラス	21,400	652.00	13,952,800
パイロットコーポレーション	18,000	5,900.00	106,200,000
萩原工業	7,800	1,045.00	8,151,000
エイベックス	23,600	1,581.00	37,311,600
フジシールインターナショナル	28,500	1,598.00	45,543,000
タカラトミー	57,400	1,211.00	69,511,400
広済堂ホールディングス	8,600	1,480.00	12,728,000
エステールホールディングス	3,000	618.00	1,854,000
レック	16,400	845.00	13,858,000
タカノ	4,800	660.00	3,168,000
三光合成	15,900	488.00	7,759,200
プロネクサス	10,900	955.00	10,409,500
ホクシン	9,600	146.00	1,401,600
ウッドワン	4,200	987.00	4,145,400
大建工業	7,100	1,877.00	13,326,700
きもと	21,300	235.00	5,005,500
凸版印刷	181,300	2,168.00	393,058,400
大日本印刷	150,700	2,914.00	439,139,800
共同印刷	3,700	2,515.00	9,305,500
NISSHA	21,900	1,689.00	36,989,100
光村印刷	600	1,196.00	717,600
藤森工業	10,900	3,150.00	34,335,000
ヴィア・ホールディングス	17,900	138.00	2,470,200
TAKARA & COMPANY	8,100	2,090.00	16,929,000
前澤化成工業	8,200	1,311.00	10,750,200
未来工業	4,900	1,489.00	7,296,100
アシックス	106,600	2,363.00	251,895,800
ツツミ	3,500	2,020.00	7,070,000
ウェーブロックホールディングス	5,100	585.00	2,983,500
JSP	8,200	1,438.00	11,791,600
ニチハ	17,800	2,752.00	48,985,600
ローランド	8,400	4,255.00	35,742,000
エフピコ	25,500	3,625.00	92,437,500
小松ウオール工業	4,200	1,881.00	7,900,200
ヤマハ	80,800	5,190.00	419,352,000
河合楽器製作所	3,600	2,525.00	9,090,000
クリナップ	12,800	591.00	7,564,800
ピジョン	73,600	2,026.00	149,113,600
天馬	11,000	1,973.00	21,703,000
兼松サステック	600	1,604.00	962,400
キングジム	10,200	914.00	9,322,800
象印マホービン	34,500	1,518.00	52,371,000

リンテック	26,500	2,216.00	58,724,000
信越ポリマー	24,900	1,241.00	30,900,900
東リ	31,700	193.00	6,118,100
イトーキ	23,700	412.00	9,764,400
任天堂	785,000	6,025.00	4,729,625,000
三菱鉛筆	16,700	1,408.00	23,513,600
松風	4,600	2,470.00	11,362,000
タカラスタANDARD	22,300	1,307.00	29,146,100
コクヨ	55,600	1,846.00	102,637,600
ナカバヤシ	11,300	515.00	5,819,500
ニフコ	46,400	3,045.00	141,288,000
立川ブラインド工業	5,300	1,033.00	5,474,900
グローブライト	10,400	2,219.00	23,077,600
オカムラ	39,100	1,378.00	53,879,800
バルカー	11,400	2,546.00	29,024,400
MUTOHホールディングス	1,000	1,910.00	1,910,000
伊藤忠商事	821,300	3,781.00	3,105,335,300
丸紅	1,186,600	1,316.00	1,561,565,600
スクロール	21,100	699.00	14,748,900
高島	1,800	2,509.00	4,516,200
ヨンドシーホールディングス	11,600	1,757.00	20,381,200
三陽商会	6,000	1,068.00	6,408,000
長瀬産業	62,600	2,013.00	126,013,800
ナイガイ	3,900	262.00	1,021,800
蝶理	7,700	1,905.00	14,668,500
豊田通商	122,300	4,615.00	564,414,500
オンワードホールディングス	75,100	308.00	23,130,800
三共生興	17,600	452.00	7,955,200
兼松	47,400	1,464.00	69,393,600
美津濃	11,600	2,613.00	30,310,800
ツカモトコーポレーション	1,600	1,079.00	1,726,400
ルックホールディングス	3,800	2,176.00	8,268,800
三井物産	962,600	3,246.00	3,124,599,600
日本紙パルプ商事	6,500	4,415.00	28,697,500
東京エレクトロン	88,300	35,090.00	3,098,447,000
カメイ	14,600	1,103.00	16,103,800
東都水産	600	4,560.00	2,736,000
OUGホールディングス	1,800	2,406.00	4,330,800
スターゼン	9,300	2,025.00	18,832,500
セイコーグループ	19,700	3,030.00	59,691,000
山善	49,300	902.00	44,468,600
椿本興業	2,300	3,655.00	8,406,500
住友商事	810,500	1,887.00	1,529,413,500
BIPROGY	42,600	3,145.00	133,977,000
内田洋行	5,300	4,320.00	22,896,000
三菱商事	898,100	4,090.00	3,673,229,000
第一実業	5,100	3,875.00	19,762,500
キヤノンマーケティングジャパン	28,300	3,235.00	91,550,500
西華産業	5,900	1,517.00	8,950,300
佐藤商事	9,400	1,145.00	10,763,000

菱洋エレクトロ	8,100	2,131.00	17,261,100
東京産業	11,200	774.00	8,668,800
ユアサ商事	11,000	3,625.00	39,875,000
神鋼商事	3,100	3,795.00	11,764,500
トルク	5,300	209.00	1,107,700
阪和興業	23,800	3,585.00	85,323,000
正栄食品工業	8,200	4,250.00	34,850,000
カナデン	11,200	1,040.00	11,648,000
菱電商事	10,900	1,584.00	17,265,600
ニプロ	96,300	1,092.00	105,159,600
岩谷産業	30,400	5,350.00	162,640,000
ナイス	4,200	1,419.00	5,959,800
ニチモウ	1,600	2,619.00	4,190,400
極東貿易	7,900	1,279.00	10,104,100
アステナホールディングス	17,900	422.00	7,553,800
兼松エレクトロニクス	7,400	4,050.00	29,970,000
三愛オブリ	30,600	1,199.00	36,689,400
稲畑産業	27,500	2,443.00	67,182,500
G S Iクレオス	6,600	1,400.00	9,240,000
明和産業	12,600	741.00	9,336,600
クワザワホールディングス	4,900	402.00	1,969,800
キムラタン	75,800	21.00	1,591,800
ゴールドウイン	22,600	7,640.00	172,664,000
ユニ・チャーム	241,300	4,570.00	1,102,741,000
デザート	23,300	3,620.00	84,346,000
キング	6,400	409.00	2,617,600
ワキタ	24,700	1,132.00	27,960,400
ヤマトインターナショナル	10,200	256.00	2,611,200
東邦ホールディングス	37,200	2,004.00	74,548,800
サンゲツ	33,200	1,582.00	52,522,400
ミツウロコグループホールディングス	15,700	967.00	15,181,900
シナネンホールディングス	4,500	4,000.00	18,000,000
伊藤忠エネクス	30,400	1,024.00	31,129,600
サンリオ	38,400	3,800.00	145,920,000
サンワテクノス	6,900	1,289.00	8,894,100
リョーサン	14,000	2,258.00	31,612,000
新光商事	18,000	897.00	16,146,000
トーヨー	5,100	1,622.00	8,272,200
三信電気	5,600	1,730.00	9,688,000
東陽テクニカ	13,600	1,235.00	16,796,000
モスフードサービス	18,000	3,120.00	56,160,000
加賀電子	11,200	4,010.00	44,912,000
三益半導体工業	10,800	2,168.00	23,414,400
都築電気	6,100	1,218.00	7,429,800
ソーダニッカ	10,900	579.00	6,311,100
立花エレテック	8,900	1,605.00	14,284,500
木曽路	18,400	2,172.00	39,964,800
S R Sホールディングス	20,000	882.00	17,640,000
千趣会	22,500	390.00	8,775,000
タカキュー	9,400	82.00	770,800

リテールパートナーズ	18,100	1,111.00	20,109,100
ケーヨー	25,300	918.00	23,225,400
上新電機	13,300	1,862.00	24,764,600
日本瓦斯	65,500	2,101.00	137,615,500
ロイヤルホールディングス	23,300	2,312.00	53,869,600
東天紅	600	791.00	474,600
いなげや	13,600	1,152.00	15,667,200
チヨダ	11,600	774.00	8,978,400
ライフコーポレーション	10,700	2,321.00	24,834,700
リンガーハット	15,700	2,148.00	33,723,600
MrMaxHD	17,200	642.00	11,042,400
テナアライド	13,600	248.00	3,372,800
AOKIホールディングス	26,500	729.00	19,318,500
オークワ	19,500	911.00	17,764,500
コメリ	21,200	2,810.00	59,572,000
青山商事	26,100	991.00	25,865,100
しまむら	15,900	11,690.00	185,871,000
はせがわ	7,100	389.00	2,761,900
高島屋	92,200	1,834.00	169,094,800
松屋	23,000	1,106.00	25,438,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	59,500	1,205.00	71,697,500
近鉄百貨店	3,900	2,425.00	9,457,500
丸井グループ	99,100	2,462.00	243,984,200
クレディセゾン	80,100	1,766.00	141,456,600
アクシアル リテイリング	9,100	3,460.00	31,486,000
井筒屋	6,400	383.00	2,451,200
イオン	451,800	2,802.00	1,265,943,600
イズミ	21,600	3,060.00	66,096,000
フォーバル	4,800	907.00	4,353,600
平和堂	20,500	1,900.00	38,950,000
フジ	30,000	1,828.00	54,840,000
ヤオコー	15,600	6,460.00	100,776,000
ゼビオホールディングス	18,600	990.00	18,414,000
ケーズホールディングス	116,600	1,183.00	137,937,800
PALTAC	19,300	4,250.00	82,025,000
三谷産業	21,300	302.00	6,432,600
Olympicグループ	6,000	531.00	3,186,000
日産東京販売ホールディングス	20,200	260.00	5,252,000
新生銀行	89,500	2,103.00	188,218,500
あおぞら銀行	76,700	2,530.00	194,051,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,029,300	646.30	5,189,336,590
りそなホールディングス	1,451,500	548.00	795,422,000
三井住友トラスト・ホールディングス	226,900	4,237.00	961,375,300
三井住友フィナンシャルグループ	890,200	4,125.00	3,672,075,000
千葉銀行	387,400	790.00	306,046,000
群馬銀行	220,700	399.00	88,059,300
武蔵野銀行	17,600	1,692.00	29,779,200
千葉興業銀行	29,500	290.00	8,555,000
筑波銀行	53,500	193.00	10,325,500
七十七銀行	36,500	1,758.00	64,167,000

秋田銀行	8,200	1,605.00	13,161,000
山形銀行	12,600	1,011.00	12,738,600
岩手銀行	8,300	1,785.00	14,815,500
東邦銀行	98,100	204.00	20,012,400
東北銀行	6,100	942.00	5,746,200
ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	2,595.00	256,905,000
スルガ銀行	120,300	372.00	44,751,600
八十二銀行	254,600	476.00	121,189,600
山梨中央銀行	13,800	1,092.00	15,069,600
大垣共立銀行	23,500	1,731.00	40,678,500
福井銀行	11,000	1,336.00	14,696,000
清水銀行	4,900	1,413.00	6,923,700
富山銀行	2,000	1,656.00	3,312,000
滋賀銀行	22,300	2,488.00	55,482,400
南都銀行	18,500	2,098.00	38,813,000
百五銀行	115,300	325.00	37,472,500
京都銀行	42,600	5,360.00	228,336,000
紀陽銀行	40,700	1,430.00	58,201,000
ほくほくフィナンシャルグループ	77,800	853.00	66,363,400
山陰合同銀行	76,300	691.00	52,723,300
鳥取銀行	4,400	1,077.00	4,738,800
百十四銀行	12,600	1,645.00	20,727,000
四国銀行	18,100	850.00	15,385,000
阿波銀行	18,200	1,847.00	33,615,400
大分銀行	7,300	1,797.00	13,118,100
宮崎銀行	7,400	2,168.00	16,043,200
佐賀銀行	7,200	1,533.00	11,037,600
琉球銀行	29,700	756.00	22,453,200
セブン銀行	407,400	258.00	105,109,200
みずほフィナンシャルグループ	1,644,700	1,614.50	2,655,368,150
高知銀行	4,300	632.00	2,717,600
山口フィナンシャルグループ	137,000	785.00	107,545,000
芙蓉総合リース	11,700	8,370.00	97,929,000
みずほリース	17,000	3,180.00	54,060,000
東京センチュリー	21,300	4,865.00	103,624,500
SBIホールディングス	169,400	2,596.00	439,762,400
日本証券金融	53,900	828.00	44,629,200
アイフル	230,300	385.00	88,665,500
日本アジア投資	10,900	213.00	2,321,700
長野銀行	4,200	1,194.00	5,014,800
名古屋銀行	8,300	3,055.00	25,356,500
北洋銀行	172,300	231.00	39,801,300
大光銀行	4,000	1,219.00	4,876,000
愛媛銀行	17,900	839.00	15,018,100
トマト銀行	4,100	982.00	4,026,200
京葉銀行	57,200	477.00	27,284,400
栃木銀行	61,400	281.00	17,253,400
北日本銀行	4,000	1,786.00	7,144,000
東和銀行	22,500	515.00	11,587,500
福島銀行	14,500	208.00	3,016,000

大東銀行	6,000	603.00	3,618,000	
リコーリース	12,100	3,545.00	42,894,500	
イオンフィナンシャルサービス	74,600	1,415.00	105,559,000	
アコム	270,600	315.00	85,239,000	
ジャックス	13,600	3,575.00	48,620,000	
オリエントコーポレーション	37,140	1,135.00	42,153,900	
オリックス	815,100	2,092.00	1,705,189,200	
三菱HCキャピタル	443,300	630.00	279,279,000	
ジャフコグループ	47,400	2,208.00	104,659,200	
九州リースサービス	5,900	596.00	3,516,400	
トモニホールディングス	99,000	311.00	30,789,000	
大和証券グループ本社	880,900	569.80	501,936,820	
野村ホールディングス	2,094,500	475.50	995,934,750	
岡三証券グループ	98,900	326.00	32,241,400	
丸三証券	40,800	433.00	17,666,400	
東洋証券	41,500	234.00	9,711,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	135,100	346.00	46,744,600	
光世証券	2,700	370.00	999,000	
水戸証券	33,700	237.00	7,986,900	
いちよし証券	22,700	591.00	13,415,700	
松井証券	67,100	770.00	51,667,000	
SOMPOホールディングス	195,100	5,995.00	1,169,624,500	
日本取引所グループ	319,500	1,917.00	612,481,500	
マネックスグループ	115,500	467.00	53,938,500	
極東証券	15,600	656.00	10,233,600	
岩井コスモホールディングス	12,800	1,194.00	15,283,200	
アイザワ証券グループ	18,500	668.00	12,358,000	
フィデアホールディングス	12,500	1,277.00	15,962,500	
池田泉州ホールディングス	145,600	211.00	30,721,600	
アニコムホールディングス	42,200	554.00	23,378,800	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	282,000	3,854.00	1,086,828,000	
マネーパートナーズグループ	14,600	267.00	3,898,200	
スパークス・グループ	12,660	1,385.00	17,534,100	
小林洋行	2,800	214.00	599,200	
第一生命ホールディングス	668,100	2,244.00	1,499,216,400	
東京海上ホールディングス	1,145,200	2,576.50	2,950,607,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	6,600	410.00	2,706,000	
イー・ギャランティ	20,400	2,470.00	50,388,000	
アサックス	7,200	578.00	4,161,600	
NECキャピタルソリューション	5,500	2,062.00	11,341,000	
T&Dホールディングス	305,200	1,363.00	415,987,600	
アドバンスクリエイト	6,600	980.00	6,468,000	
三井不動産	535,300	2,892.50	1,548,355,250	
三菱地所	781,100	1,941.50	1,516,505,650	
平和不動産	21,700	4,125.00	89,512,500	
東京建物	108,500	2,100.00	227,850,000	
京阪神ビルディング	18,000	1,183.00	21,294,000	
住友不動産	246,800	3,458.00	853,434,400	

太平洋興発	4,900	657.00	3,219,300
テーオーシー	20,500	762.00	15,621,000
東京楽天地	1,900	4,070.00	7,733,000
レオパレス21	142,200	352.00	50,054,400
スターツコーポレーション	18,600	2,649.00	49,271,400
フジ住宅	15,900	631.00	10,032,900
空港施設	13,700	540.00	7,398,000
明和地所	6,400	607.00	3,884,800
ゴールドクレスト	10,900	1,687.00	18,388,300
リログループ	72,700	2,242.00	162,993,400
エスリード	5,200	1,726.00	8,975,200
日神グループホールディングス	22,300	421.00	9,388,300
日本エスコン	25,500	820.00	20,910,000
MIRARTHホールディングス	57,500	390.00	22,425,000
AVANTIA	6,400	784.00	5,017,600
イオンモール	68,900	1,617.00	111,411,300
毎日コムネット	4,700	658.00	3,092,600
ファースト住建	5,000	1,085.00	5,425,000
ランド	746,700	10.00	7,467,000
カチタス	34,000	3,205.00	108,970,000
東祥	10,000	1,232.00	12,320,000
トーセイ	19,000	1,342.00	25,498,000
穴吹興産	3,000	1,987.00	5,961,000
サンフロンティア不動産	19,000	1,151.00	21,869,000
FJネクストホールディングス	13,500	1,000.00	13,500,000
インテリックス	3,100	541.00	1,677,100
ランドビジネス	4,600	220.00	1,012,000
サンネクスタグループ	4,100	949.00	3,890,900
グランディハウス	9,400	550.00	5,170,000
東武鉄道	126,700	3,500.00	443,450,000
相鉄ホールディングス	41,300	2,380.00	98,294,000
東急	323,700	1,738.00	562,590,600
京浜急行電鉄	154,800	1,489.00	230,497,200
小田急電鉄	175,000	1,910.00	334,250,000
京王電鉄	61,000	5,370.00	327,570,000
京成電鉄	84,500	4,040.00	341,380,000
富士急行	14,300	4,700.00	67,210,000
東日本旅客鉄道	212,100	7,940.00	1,684,074,000
西日本旅客鉄道	147,600	5,889.00	869,216,400
東海旅客鉄道	97,800	17,440.00	1,705,632,000
西武ホールディングス	167,600	1,445.00	242,182,000
鴻池運輸	19,700	1,529.00	30,121,300
西日本鉄道	33,500	2,917.00	97,719,500
ハマキョウレックス	9,000	3,210.00	28,890,000
サカイ引越センター	6,400	4,680.00	29,952,000
近鉄グループホールディングス	123,400	5,070.00	625,638,000
阪急阪神ホールディングス	153,700	4,445.00	683,196,500
南海電気鉄道	55,000	3,010.00	165,550,000
京阪ホールディングス	51,400	3,870.00	198,918,000
神戸電鉄	3,200	3,270.00	10,464,000

名古屋鉄道	127,400	2,250.00	286,650,000	
山陽電気鉄道	9,400	2,264.00	21,281,600	
アルプス物流	9,200	1,038.00	9,549,600	
トランコム	3,800	8,020.00	30,476,000	
ヤマトホールディングス	180,500	2,195.00	396,197,500	
山九	32,000	4,260.00	136,320,000	
日新	9,600	1,789.00	17,174,400	
丸運	6,200	212.00	1,314,400	
丸全昭和運輸	8,900	3,080.00	27,412,000	
センコーグループホールディングス	61,000	1,005.00	61,305,000	
トナミホールディングス	2,500	3,530.00	8,825,000	
ニッコンホールディングス	39,700	2,373.00	94,208,100	
日本石油輸送	800	2,262.00	1,809,600	
福山通運	16,900	3,285.00	55,516,500	
セイノーホールディングス	71,700	1,170.00	83,889,000	
エスライン	3,700	786.00	2,908,200	
神奈川中央交通	3,300	3,390.00	11,187,000	
日立物流	25,500	8,670.00	221,085,000	
AZ-COM丸和ホールディングス	22,200	1,461.00	32,434,200	
C&Fロジホールディングス	11,200	1,158.00	12,969,600	
日本郵船	330,100	2,595.00	856,609,500	
商船三井	203,100	2,794.00	567,461,400	
川崎汽船	121,700	2,138.00	260,194,600	
NSユナイテッド海運	6,100	3,755.00	22,905,500	
明治海運	12,400	626.00	7,762,400	
飯野海運	51,700	673.00	34,794,100	
共栄タンカー	2,400	863.00	2,071,200	
九州旅客鉄道	88,300	3,200.00	282,560,000	
SGホールディングス	221,200	1,977.00	437,312,400	
NIPPON EXPRESSホールディングス	43,000	7,340.00	315,620,000	
日本航空	283,100	2,789.00	789,565,900	
ANAホールディングス	313,600	2,907.00	911,635,200	
ビーウィズ	3,600	1,350.00	4,860,000	
パスコ	2,500	1,280.00	3,200,000	
TREホールディングス	24,900	1,581.00	39,366,900	
人・夢・技術グループ	5,100	2,559.00	13,050,900	
西本Wismettacホールディングス	3,200	3,970.00	12,704,000	
シルバーライフ	2,800	1,424.00	3,987,200	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,642.00	1,970,400	
Genky DrugStores	6,000	3,890.00	23,340,000	
コア商事ホールディングス	8,500	608.00	5,168,000	
KPPグループホールディングス	25,300	755.00	19,101,500	
ナルミヤ・インターナショナル	3,200	870.00	2,784,000	
ブックオフグループホールディングス	8,100	1,072.00	8,683,200	
ギフトホールディングス	2,000	3,325.00	6,650,000	
三菱倉庫	31,800	3,450.00	109,710,000	
三井倉庫ホールディングス	12,800	3,145.00	40,256,000	
住友倉庫	38,700	2,048.00	79,257,600	

澁澤倉庫	6,600	2,026.00	13,371,600
ヤマタネ	5,900	1,601.00	9,445,900
東陽倉庫	18,600	244.00	4,538,400
乾汽船	8,000	1,731.00	13,848,000
日本トランスシティ	23,200	457.00	10,602,400
ケイヒン	2,300	1,369.00	3,148,700
中央倉庫	6,800	924.00	6,283,200
川西倉庫	2,500	1,007.00	2,517,500
安田倉庫	8,800	921.00	8,104,800
ファイズホールディングス	2,800	830.00	2,324,000
東洋埠頭	3,800	1,127.00	4,282,600
上組	62,500	2,853.00	178,312,500
サンリツ	3,400	662.00	2,250,800
キムラユニティー	6,800	749.00	5,093,200
キューソー流通システム	6,600	1,107.00	7,306,200
東海運	7,500	273.00	2,047,500
エーアイテイナー	8,200	1,448.00	11,873,600
内外トランスライン	4,100	2,055.00	8,425,500
ショーエイコーポレーション	3,900	569.00	2,219,100
日本コンセプト	3,700	1,625.00	6,012,500
TBSホールディングス	66,800	1,570.00	104,876,000
日本テレビホールディングス	113,900	1,159.00	132,010,100
朝日放送グループホールディングス	10,900	617.00	6,725,300
テレビ朝日ホールディングス	32,800	1,420.00	46,576,000
スカパーJ S A Tホールディングス	115,600	513.00	59,302,800
テレビ東京ホールディングス	8,300	1,900.00	15,770,000
日本BS放送	4,600	942.00	4,333,200
ビジョン	15,100	1,459.00	22,030,900
スマートバリュー	3,200	449.00	1,436,800
USEN-NEXT HOLDINGS	10,400	2,046.00	21,278,400
ワイヤレスゲート	5,500	280.00	1,540,000
コネクシオ	9,600	1,170.00	11,232,000
日本通信	113,400	207.00	23,473,800
クロップス	2,500	991.00	2,477,500
日本電信電話	1,529,600	3,951.00	6,043,449,600
KDDI	994,900	4,234.00	4,212,406,600
ソフトバンク	2,067,100	1,467.50	3,033,469,250
光通信	15,500	17,830.00	276,365,000
エムティーアイ	10,600	509.00	5,395,400
GMOインターネットグループ	43,000	2,662.00	114,466,000
ファイバーゲート	6,100	871.00	5,313,100
アйдママーケティングコミュニケーション	2,900	282.00	817,800
KADOKAWA	73,500	2,633.00	193,525,500
学研ホールディングス	19,300	959.00	18,508,700
ゼンリン	22,200	901.00	20,002,200
昭文社ホールディングス	5,400	296.00	1,598,400
インプレスホールディングス	11,400	202.00	2,302,800
東京電力ホールディングス	1,040,900	457.00	475,691,300

中部電力	392,900	1,220.00	479,338,000
関西電力	486,400	1,111.00	540,390,400
中国電力	200,600	663.00	132,997,800
北陸電力	118,000	438.00	51,684,000
東北電力	304,100	591.00	179,723,100
四国電力	115,600	650.00	75,140,000
九州電力	266,200	692.00	184,210,400
北海道電力	120,900	426.00	51,503,400
沖縄電力	29,500	965.00	28,467,500
電源開発	102,800	2,020.00	207,656,000
エフオン	8,300	640.00	5,312,000
イーレックス	18,000	2,791.00	50,238,000
レノバ	27,300	3,570.00	97,461,000
東京瓦斯	244,000	2,561.00	624,884,000
大阪瓦斯	233,900	2,200.00	514,580,000
東邦瓦斯	54,500	2,927.00	159,521,500
北海道瓦斯	6,900	1,627.00	11,226,300
広島ガス	24,300	337.00	8,189,100
西部ガスホールディングス	13,200	1,656.00	21,859,200
静岡ガス	26,300	1,041.00	27,378,300
メタウォーター	14,400	1,862.00	26,812,800
アイネット	6,300	1,291.00	8,133,300
松竹	7,900	11,740.00	92,746,000
東宝	80,500	5,080.00	408,940,000
エイチ・アイ・エス	31,100	2,249.00	69,943,900
東映	3,900	17,700.00	69,030,000
ラックランド	3,800	2,735.00	10,393,000
エヌ・ティ・ティ・データ	363,400	1,936.00	703,542,400
共立メンテナンス	23,800	6,370.00	151,606,000
イチネンホールディングス	13,600	1,251.00	17,013,600
建設技術研究所	6,100	2,950.00	17,995,000
スペース	8,600	869.00	7,473,400
アインホールディングス	16,900	6,490.00	109,681,000
燦ホールディングス	5,800	1,807.00	10,480,600
ピー・シー・エー	8,100	1,074.00	8,699,400
スバル興業	600	8,900.00	5,340,000
東京テアトル	4,900	1,129.00	5,532,100
タナベコンサルティンググループ	4,300	611.00	2,627,300
ビジネスブレイン太田昭和	4,500	1,492.00	6,714,000
ナガワ	3,800	6,980.00	26,524,000
東京都競馬	10,000	3,960.00	39,600,000
常磐興産	4,500	1,211.00	5,449,500
カナモト	21,700	2,134.00	46,307,800
D T S	25,500	3,445.00	87,847,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	63,600	6,480.00	412,128,000
シーイーシー	14,700	1,481.00	21,770,700
カプコン	126,500	3,590.00	454,135,000
西尾レントオール	11,100	2,972.00	32,989,200
アイ・エス・ピー	5,900	1,224.00	7,221,600

アゴーラ ホスピタリティグループ	73,000	25.00	1,825,000	
日本空港ビルデング	44,300	6,210.00	275,103,000	
トランス・コスモス	16,900	3,460.00	58,474,000	
乃村工藝社	57,000	1,068.00	60,876,000	
ジャステック	7,200	1,247.00	8,978,400	
S C S K	94,500	2,132.00	201,474,000	
藤田観光	5,100	3,060.00	15,606,000	
K N T - C Tホールディングス	8,200	1,856.00	15,219,200	
日本管財	14,300	2,511.00	35,907,300	
トーカイ	10,500	1,870.00	19,635,000	
白洋舎	1,300	1,470.00	1,911,000	
セコム	131,000	8,520.00	1,116,120,000	
N S W	5,100	2,148.00	10,954,800	
セントラル警備保障	6,400	2,505.00	16,032,000	
アイネス	11,700	1,464.00	17,128,800	
丹青社	25,000	842.00	21,050,000	
メイテック	47,000	2,416.00	113,552,000	
T K C	20,700	3,630.00	75,141,000	
富士ソフト	13,000	7,930.00	103,090,000	
応用地質	11,600	2,123.00	24,626,800	
船井総研ホールディングス	24,800	2,586.00	64,132,800	
N S D	42,800	2,421.00	103,618,800	
進学会ホールディングス	4,300	306.00	1,315,800	
丸紅建材リース	800	1,736.00	1,388,800	
オオバ	8,200	691.00	5,666,200	
コナミグループ	49,600	6,230.00	309,008,000	
いであ	2,900	1,584.00	4,593,600	
学究社	4,200	1,616.00	6,787,200	
ベネッセホールディングス	44,300	2,164.00	95,865,200	
イオンディライト	15,300	2,904.00	44,431,200	
ナック	6,200	917.00	5,685,400	
福井コンピュータホールディングス	6,200	3,450.00	21,390,000	
ダイセキ	24,200	4,290.00	103,818,000	
ステップ	4,900	1,854.00	9,084,600	
日鉄物産	8,300	5,200.00	43,160,000	
泉州電業	3,100	5,390.00	16,709,000	
元気寿司	3,900	3,275.00	12,772,500	
トラスコ中山	25,600	2,025.00	51,840,000	
ヤマダホールディングス	484,600	478.00	231,638,800	
オートバックスセブン	42,600	1,419.00	60,449,400	
モリト	9,000	716.00	6,444,000	
アークランズ	21,400	1,732.00	37,064,800	
ニトリホールディングス	54,300	12,215.00	663,274,500	
グルメ杵屋	10,900	996.00	10,856,400	
愛眼	7,200	176.00	1,267,200	
ケーユーホールディングス	7,200	1,103.00	7,941,600	
吉野家ホールディングス	47,800	2,259.00	107,980,200	
加藤産業	14,800	3,390.00	50,172,000	
北恵	3,100	694.00	2,151,400	

イノテック	8,200	1,221.00	10,012,200	
イエローハット	21,500	1,787.00	38,420,500	
松屋フーズホールディングス	6,600	3,990.00	26,334,000	
JBCホールディングス	9,300	1,845.00	17,158,500	
JKホールディングス	9,600	1,013.00	9,724,800	
サガミホールディングス	19,700	1,216.00	23,955,200	
日伝	9,400	1,687.00	15,857,800	
関西フードマーケット	11,100	1,315.00	14,596,500	
ミロク情報サービス	12,000	1,456.00	17,472,000	
北沢産業	6,800	197.00	1,339,600	
杉本商事	6,400	1,895.00	12,128,000	
因幡電機産業	34,100	2,770.00	94,457,000	
王将フードサービス	9,100	6,340.00	57,694,000	
プレナス	15,300	1,921.00	29,391,300	
ミニストップ	10,200	1,412.00	14,402,400	
アークス	24,300	2,014.00	48,940,200	
パローホールディングス	28,000	1,722.00	48,216,000	
東テク	4,000	3,315.00	13,260,000	
ミスミグループ本社	172,000	3,160.00	543,520,000	
アルテック	7,500	288.00	2,160,000	
ベルク	6,100	5,640.00	34,404,000	
大 庄	7,300	1,078.00	7,869,400	
タキヒヨー	3,800	801.00	3,043,800	
ファーストリテイリング	18,300	78,580.00	1,438,014,000	
ソフトバンクグループ	818,400	5,500.00	4,501,200,000	
蔵王産業	1,900	1,738.00	3,302,200	
スズケン	49,200	3,250.00	159,900,000	
サンドラッグ	51,500	3,625.00	186,687,500	
サックスパー ホールディングス	12,800	721.00	9,228,800	
ジェコス	9,400	800.00	7,520,000	
ヤマザワ	2,700	1,200.00	3,240,000	
やまや	2,800	2,489.00	6,969,200	
グローセル	14,800	401.00	5,934,800	
ベルーナ	29,300	701.00	20,539,300	
合計	144,210,319		332,133,809,651	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,553,628,877
国債証券	684,504,696,450
地方債証券	33,695,034,788
特殊債証券	31,465,044,363
社債証券	26,513,506,870
未収利息	602,031,626
前払費用	193,344,262
流動資産合計	778,527,287,236
資産合計	778,527,287,236
負債の部	
流動負債	
未払解約金	110,568,000
流動負債合計	110,568,000
負債合計	110,568,000
純資産の部	
元本等	
元本	618,708,264,968
剰余金	
剰余金又は欠損金()	159,708,454,268
元本等合計	778,416,719,236
純資産合計	778,416,719,236
負債純資産合計	778,527,287,236

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	405,313,486,765円
同期中追加設定元本額	1,021,609,121,966円
同期中一部解約元本額	808,214,343,763円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	25,511,790,526円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	64,452,664円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	143,938,663円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	97,305,705円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	695,015,024円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	125,163,060円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	39,415,828円
たわらノーロード 国内債券	17,592,718,105円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	3,361,628,753円
たわらノーロード バランス（堅実型）	1,095,850,593円
たわらノーロード バランス（標準型）	1,907,422,238円
たわらノーロード バランス（積極型）	241,041,239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）	94,075,757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）	1,438,945,952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）	1,503,350,788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）	429,392,838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）	77,724,988円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	22,510,601円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	17,319,805円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	141,363,742円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	5,764,943円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	912,120円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,975,367,175円
Oneグローバルバランス	18,519,587円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	9,500,793,789円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	13,311,683,060円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	5,594,687,602円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,297,810,741円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,396,490,683円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	408,535,624円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	99,738,983円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,496,577,883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）	4,529,625,688円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,904,223,518円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	370,895,676円
投資のソムリエ	183,995,214,981円
クルーズコントロール	816,635,200円
投資のソムリエ<DC年金>	12,446,028,180円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,290,773,065円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,129,217,169円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	14,410,898,789円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	67,447,956,968円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	310,130,626円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	154,430,033円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	97,582,691円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,682,667,039円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,138,344,944円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,888,071,884円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,242,714,897円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	387,902,365円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	161,998,525円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	105,300,398円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	943,893,281円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	19,871,574円
DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	1,942,456,670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)	1,989,795,104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)	1,526,942,862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)	1,216,174,093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)	1,921,269,557円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	4,972,930,231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)	1,888,960,293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)	1,733,013,548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)	1,944,956,341円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,128,226,719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)	3,011,414,270円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	4,689,665,516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)	576,841,400円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,785,925円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,140,208,541円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,151,545,840円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	6,108,102,717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)	3,294,626,223円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s 用) (適格機関投資家専用)	71,815,554円
A M O n e 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)	1,076,896,904円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	174,303,238円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	152,687,070円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	97,450,555円
D I A M 国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	22,454,306円
D I A M 国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	92,634,563円
D I A M 国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	31,694,212円
D I A M 国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,194,540円
D I A M 世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	26,088,817円
D I A M 世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	105,540,013円
D I A M バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,196,833,490円
D I A M バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,138,551,493円
D I A M バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,125,452,763円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	61,424,670円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	151,870,550円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,874,654,212円
D I A M 世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	156,746,039円
D I A M 世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	510,283円
D I A M 世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	1,985,976,446円
D I A M 世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	43,266,479円
D I A M 世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	293,925,450円
D I A M 世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	447,629,517円
D I A M 世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	874,438,558円
D I A M 世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	276,810,491円
D I A M 国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	95,537,669円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	935,002,540円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	476,591,157円
コア資産形成ファンド	317,847,824円
M H A M 日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	45,231,050,880円
M H A M 動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	64,146,982,774円
M H A M 日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	13,128,332,040円
M H A M 動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定]	2,192,575,940円
計	618,708,264,968円
2. 受益権の総数	618,708,264,968口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在
	当期の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	11,364,856,100
地方債証券	516,213,056
特殊債券	735,615,290
社債券	502,903,170
合計	13,119,587,616

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月15日から2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.2581円

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	432回 利付国庫債券(2年)	2,800,000,000	2,803,752,000	
	433回 利付国庫債券(2年)	3,400,000,000	3,404,420,000	
	434回 利付国庫債券(2年)	3,500,000,000	3,504,585,000	
	435回 利付国庫債券(2年)	3,720,000,000	3,724,910,400	
	436回 利付国庫債券(2年)	6,700,000,000	6,708,777,000	
	437回 利付国庫債券(2年)	3,850,000,000	3,855,005,000	
	438回 利付国庫債券(2年)	3,800,000,000	3,804,864,000	
	439回 利付国庫債券(2年)	3,100,000,000	3,103,906,000	
	440回 利付国庫債券(2年)	3,500,000,000	3,504,270,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	5,900,000,000	5,915,045,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	9,350,000,000	9,375,432,000	
	140回 利付国庫債券(5年)	6,190,000,000	6,207,703,400	
	141回 利付国庫債券(5年)	6,410,000,000	6,429,871,000	
	142回 利付国庫債券(5年)	5,230,000,000	5,248,305,000	
	143回 利付国庫債券(5年)	3,100,000,000	3,111,687,000	
	144回 利付国庫債券(5年)	6,700,000,000	6,727,001,000	
	145回 利付国庫債券(5年)	7,050,000,000	7,080,033,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	6,000,000,000	6,025,800,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	7,580,000,000	7,587,807,400	
	148回 利付国庫債券(5年)	6,790,000,000	6,793,734,500	

149回 利付国庫債券(5年)	6,950,000,000	6,950,000,000	
150回 利付国庫債券(5年)	6,940,000,000	6,935,627,800	
151回 利付国庫債券(5年)	5,140,000,000	5,133,163,800	
152回 利付国庫債券(5年)	3,430,000,000	3,439,844,100	
153回 利付国庫債券(5年)	7,200,000,000	7,181,496,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	136,118,400	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	748,906,200	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	642,821,400	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	852,746,400	
5回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,147,067,100	
6回 利付国庫債券(40年)	1,720,000,000	1,901,494,400	
7回 利付国庫債券(40年)	1,690,000,000	1,785,079,400	
8回 利付国庫債券(40年)	1,850,000,000	1,809,633,000	
9回 利付国庫債券(40年)	2,830,000,000	2,022,035,000	
10回 利付国庫債券(40年)	2,530,000,000	2,129,703,400	
11回 利付国庫債券(40年)	2,220,000,000	1,800,064,800	
12回 利付国庫債券(40年)	1,910,000,000	1,380,357,000	
13回 利付国庫債券(40年)	2,680,000,000	1,922,310,400	
14回 利付国庫債券(40年)	2,770,000,000	2,113,814,700	
15回 利付国庫債券(40年)	1,200,000,000	1,001,688,000	
332回 利付国庫債券(10年)	7,310,000,000	7,372,061,900	
333回 利付国庫債券(10年)	6,330,000,000	6,392,603,700	
334回 利付国庫債券(10年)	6,520,000,000	6,593,676,000	
335回 利付国庫債券(10年)	7,910,000,000	7,995,823,500	
336回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,036,750,000	
337回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,837,824,000	
338回 利付国庫債券(10年)	4,630,000,000	4,681,300,400	
339回 利付国庫債券(10年)	5,580,000,000	5,647,462,200	
340回 利付国庫債券(10年)	7,540,000,000	7,638,623,200	
341回 利付国庫債券(10年)	6,720,000,000	6,791,769,600	

342回 利付国庫債券(10年)	7,880,000,000	7,913,805,200	
343回 利付国庫債券(10年)	7,850,000,000	7,881,792,500	
344回 利付国庫債券(10年)	7,830,000,000	7,859,205,900	
345回 利付国庫債券(10年)	9,290,000,000	9,321,028,600	
346回 利付国庫債券(10年)	7,570,000,000	7,591,725,900	
347回 利付国庫債券(10年)	7,110,000,000	7,124,931,000	
348回 利付国庫債券(10年)	6,590,000,000	6,598,039,800	
349回 利付国庫債券(10年)	7,230,000,000	7,233,687,300	
350回 利付国庫債券(10年)	8,660,000,000	8,660,000,000	
351回 利付国庫債券(10年)	7,400,000,000	7,395,782,000	
352回 利付国庫債券(10年)	6,990,000,000	6,981,751,800	
353回 利付国庫債券(10年)	7,240,000,000	7,226,606,000	
354回 利付国庫債券(10年)	6,260,000,000	6,242,033,800	
355回 利付国庫債券(10年)	6,910,000,000	6,882,567,300	
356回 利付国庫債券(10年)	6,840,000,000	6,804,774,000	
357回 利付国庫債券(10年)	7,810,000,000	7,751,893,600	
358回 利付国庫債券(10年)	7,250,000,000	7,178,442,500	
359回 利付国庫債券(10年)	8,300,000,000	8,206,044,000	
360回 利付国庫債券(10年)	8,340,000,000	8,239,419,600	
361回 利付国庫債券(10年)	8,100,000,000	7,996,077,000	
362回 利付国庫債券(10年)	7,840,000,000	7,733,219,200	
363回 利付国庫債券(10年)	7,500,000,000	7,391,775,000	
364回 利付国庫債券(10年)	7,600,000,000	7,483,948,000	
365回 利付国庫債券(10年)	6,340,000,000	6,251,747,200	
366回 利付国庫債券(10年)	6,300,000,000	6,308,757,000	

367回 利付国庫債券(10年)	6,490,000,000	6,468,453,200	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	129,923,200	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	115,864,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	242,386,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,170,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	228,874,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	283,882,500	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	270,969,900	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	175,321,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	412,763,400	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	319,168,200	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	294,900,000	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	329,113,800	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	483,428,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	338,903,600	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	407,965,800	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	375,772,700	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	359,385,400	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	434,371,000	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	335,545,200	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	401,504,400	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	763,666,400	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	773,003,600	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	961,699,200	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,061,996,800	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,074,048,800	
31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	867,117,600	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,183,545,500	

33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,380,458,400	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,442,076,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,706,039,200	
36回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	2,069,767,200	
37回 利付国庫債券(30年)	2,660,000,000	3,060,489,600	
38回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	2,093,978,000	
39回 利付国庫債券(30年)	1,980,000,000	2,275,673,400	
40回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,831,669,200	
41回 利付国庫債券(30年)	1,880,000,000	2,088,153,600	
42回 利付国庫債券(30年)	1,960,000,000	2,175,266,800	
43回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,907,359,600	
44回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	2,047,968,500	
45回 利付国庫債券(30年)	2,340,000,000	2,497,996,800	
46回 利付国庫債券(30年)	2,690,000,000	2,868,104,900	
47回 利付国庫債券(30年)	1,760,000,000	1,907,628,800	
48回 利付国庫債券(30年)	2,340,000,000	2,439,520,200	
49回 利付国庫債券(30年)	1,810,000,000	1,884,191,900	
50回 利付国庫債券(30年)	2,260,000,000	2,073,776,000	
51回 利付国庫債券(30年)	1,950,000,000	1,583,946,000	
52回 利付国庫債券(30年)	2,110,000,000	1,792,023,000	
53回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	1,620,186,700	
54回 利付国庫債券(30年)	2,050,000,000	1,854,758,000	
55回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,550,580,000	
56回 利付国庫債券(30年)	1,680,000,000	1,509,009,600	
57回 利付国庫債券(30年)	2,070,000,000	1,852,525,800	

58回 利付国庫債券(30年)	2,870,000,000	2,559,035,500	
59回 利付国庫債券(30年)	1,570,000,000	1,361,080,100	
60回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,332,672,600	
61回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,323,291,200	
62回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	1,437,682,500	
63回 利付国庫債券(30年)	1,810,000,000	1,422,442,800	
64回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,306,290,700	
65回 利付国庫債券(30年)	2,050,000,000	1,602,136,500	
66回 利付国庫債券(30年)	1,630,000,000	1,272,850,700	
67回 利付国庫債券(30年)	2,250,000,000	1,841,265,000	
68回 利付国庫債券(30年)	2,210,000,000	1,804,199,800	
69回 利付国庫債券(30年)	1,970,000,000	1,649,599,200	
70回 利付国庫債券(30年)	2,290,000,000	1,909,608,100	
71回 利付国庫債券(30年)	2,240,000,000	1,863,769,600	
72回 利付国庫債券(30年)	2,300,000,000	1,909,437,000	
73回 利付国庫債券(30年)	2,250,000,000	1,865,655,000	
74回 利付国庫債券(30年)	1,900,000,000	1,704,281,000	
75回 利付国庫債券(30年)	2,150,000,000	2,072,320,500	
65回 利付国庫債券(20年)	60,000,000	61,435,800	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,427,500	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,083,000	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,531,600	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	479,264,800	
73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	397,134,200	
74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,891,200	

75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	189,448,200	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	73,333,400	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	42,002,400	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	263,105,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,755,500	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	95,202,000	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	424,056,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	148,831,200	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	74,767,000	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	181,034,700	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	633,075,900	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	129,585,600	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	129,172,800	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	640,238,500	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,814,600	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	510,603,300	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	119,936,300	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,260,920,000	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	402,178,900	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	731,231,300	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	607,695,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	131,467,200	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	728,983,200	
98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	175,936,000	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	828,030,000	

100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	924,429,100	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	258,653,400	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	564,845,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	179,846,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	122,401,400	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	714,912,000	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	561,470,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	672,744,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	765,182,400	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	389,270,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	494,978,000	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	522,412,800	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	835,504,400	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,325,270,700	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	930,700,000	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	411,152,400	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	606,744,000	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,217,103,600	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	628,942,650	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	525,521,100	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	739,030,100	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	892,139,100	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	639,255,000	
123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,206,313,500	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	684,504,000	

125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	696,624,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	583,705,200	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	613,580,400	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,561,484,900	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	859,765,200	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,031,940,000	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	888,963,300	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	937,651,000	
133回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,172,830,100	
134回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,026,657,000	
135回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	837,332,200	
136回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	404,042,400	
137回 利付国庫債券(20年)	880,000,000	996,881,600	
138回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,024,861,600	
139回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,123,400,000	
140回 利付国庫債券(20年)	2,790,000,000	3,163,832,100	
141回 利付国庫債券(20年)	2,780,000,000	3,153,771,000	
142回 利付国庫債券(20年)	2,510,000,000	2,872,193,000	
143回 利付国庫債券(20年)	3,220,000,000	3,621,469,600	
144回 利付国庫債券(20年)	2,650,000,000	2,953,743,000	
145回 利付国庫債券(20年)	3,550,000,000	4,031,131,500	
146回 利付国庫債券(20年)	3,980,000,000	4,519,767,600	
147回 利付国庫債券(20年)	4,090,000,000	4,603,172,300	
148回 利付国庫債券(20年)	3,900,000,000	4,345,263,000	
149回 利付国庫債券(20年)	3,460,000,000	3,854,716,800	

150回 利付国庫債券(20年)	4,250,000,000	4,683,500,000	
151回 利付国庫債券(20年)	3,360,000,000	3,621,811,200	
152回 利付国庫債券(20年)	3,540,000,000	3,812,190,600	
153回 利付国庫債券(20年)	4,220,000,000	4,592,541,600	
154回 利付国庫債券(20年)	3,990,000,000	4,287,693,900	
155回 利付国庫債券(20年)	4,060,000,000	4,255,813,800	
156回 利付国庫債券(20年)	3,700,000,000	3,587,927,000	
157回 利付国庫債券(20年)	3,230,000,000	3,037,782,700	
158回 利付国庫債券(20年)	3,490,000,000	3,410,009,200	
159回 利付国庫債券(20年)	3,180,000,000	3,140,981,400	
160回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,696,463,000	
161回 利付国庫債券(20年)	3,190,000,000	3,132,899,000	
162回 利付国庫債券(20年)	3,530,000,000	3,456,540,700	
163回 利付国庫債券(20年)	3,570,000,000	3,485,105,400	
164回 利付国庫債券(20年)	3,930,000,000	3,768,005,400	
165回 利付国庫債券(20年)	3,190,000,000	3,048,108,800	
166回 利付国庫債券(20年)	3,340,000,000	3,278,878,000	
167回 利付国庫債券(20年)	2,770,000,000	2,626,430,900	
168回 利付国庫債券(20年)	3,070,000,000	2,854,332,500	
169回 利付国庫債券(20年)	3,500,000,000	3,186,085,000	
170回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,284,354,800	
171回 利付国庫債券(20年)	2,340,000,000	2,112,154,200	
172回 利付国庫債券(20年)	2,460,000,000	2,250,900,000	
173回 利付国庫債券(20年)	3,620,000,000	3,298,544,000	
174回 利付国庫債券(20年)	3,490,000,000	3,166,686,400	

	175回 利付国庫債券(20年)	3,830,000,000	3,524,442,600	
	176回 利付国庫債券(20年)	3,280,000,000	3,006,021,600	
	177回 利付国庫債券(20年)	3,330,000,000	2,984,878,800	
	178回 利付国庫債券(20年)	3,400,000,000	3,097,264,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	3,460,000,000	3,146,039,600	
	180回 利付国庫債券(20年)	3,300,000,000	3,164,271,000	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,900,000,000	2,824,426,000	
国債証券 合計		683,575,000,000	684,504,696,450	
地方債証券	726回 東京都公募公債	400,000,000	403,420,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,745,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	109,962,600	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	196,466,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	393,316,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	294,978,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	235,054,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	115,626,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	105,008,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	106,159,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	217,222,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	326,088,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	112,328,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	113,098,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	214,096,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,806,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	400,104,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	398,264,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	97,934,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	245,125,000	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	302,559,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,178,000	
	237回 神奈川県公募公債	200,000,000	198,526,000	
	251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	196,800,000	
	3回 神奈川県公募公債 30年	100,000,000	124,467,000	

11回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	111,918,000	
16回 神奈川県公募公債 20年	300,000,000	341,196,000	
19回 神奈川県公募公債 20年	100,000,000	112,591,000	
413回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	99,581,000	
419回 大阪府公募公債 10年	100,000,000	100,162,000	
464回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	194,734,000	
467回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	196,102,000	
469回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	195,340,000	
472回 大阪府公募公債 10年	200,000,000	194,288,000	
10回 大阪府公募公債 20年	200,000,000	224,084,000	
13回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	105,975,000	
14回 大阪府公募公債 20年	100,000,000	96,913,000	
190回 大阪府公募公債 5年	300,000,000	298,317,000	
26年度11回 京都府公募公債	350,000,000	353,251,500	
29年度13回 京都府公募公債	109,330,000	109,269,868	
令和2年度1回 京都府公募公債	400,000,000	393,268,000	
令和2年度14回 京都府公募公債	200,000,000	197,052,000	
26年度17回 兵庫県公募公債	200,000,000	201,948,000	
令和元年度16回 兵庫県公募公債	200,000,000	196,424,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公債	100,000,000	98,184,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	121,133,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	211,794,000	
1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	305,388,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	318,135,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	104,832,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	102,452,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	196,602,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	98,112,000	

令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	195,838,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	105,789,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	106,283,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	206,736,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	106,203,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	336,771,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	340,572,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	117,249,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	221,240,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	158,562,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,251,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	198,038,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	227,244,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	100,087,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	197,046,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	87,742,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	90,468,000	
25年度8回 埼玉県公募公債	100,000,000	100,832,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	404,020,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	197,004,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	183,526,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	232,902,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	113,259,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,233,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	331,944,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	106,079,000	
25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	201,866,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,456,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	199,316,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	196,640,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	98,053,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	105,734,000	

令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	154,256,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	110,928,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	113,569,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	333,882,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	203,010,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,034,000	
令和3年 5回 千葉県公募公債	200,000,000	194,716,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	106,465,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	105,641,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	95,499,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	100,904,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	196,626,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	110,428,000	
128回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	302,178,000	
132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,920,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,310,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	404,116,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	607,782,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,845,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,942,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,258,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	119,956,800	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,778,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	498,960,000	
166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,065,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,345,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	400,772,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,803,000	

178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,115,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	500,760,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,719,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	296,661,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	492,350,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,163,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	492,340,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	490,410,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	99,568,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	100,990,000	
25年度2回 島根県公募公債	106,000,000	106,786,520	
令和元年度1回 島根県公募公債	200,000,000	186,556,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	195,984,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	100,984,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,649,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	199,656,000	
令和2年2回 大阪市公募公債	300,000,000	294,690,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	223,806,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	454,774,500	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	195,850,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	110,375,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	106,389,000	
5回 京都市公募公債 30年 定時償還	200,000,000	184,056,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	109,401,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	227,972,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	224,660,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	100,980,000	
30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	300,351,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	162,536,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	392,868,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	121,668,000	

17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	111,050,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	110,432,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	116,778,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	100,834,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	289,926,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	199,366,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	225,120,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	116,953,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	110,739,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	110,316,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	119,803,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	193,754,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	89,531,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,899,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	193,948,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	300,297,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	97,337,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	298,344,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	196,906,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	195,984,000	
26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	100,928,000	
26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,892,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	198,482,000	
地方債証券 合計	33,245,330,000	33,695,034,788	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	210,340,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	208,654,000	
78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,333,000	
125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	445,315,000	
127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,841,000	
131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	80,992,000	
156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	394,904,000	
33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	299,691,000	
1回 高速道路機構債	300,000,000	395,082,000	

19回	高速道路機構債	150,000,000	190,365,000	
26回	高速道路機構債	200,000,000	249,292,000	
36回	高速道路機構債	300,000,000	385,869,000	
50回	高速道路機構債	300,000,000	277,848,000	
75回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,913,000	
124回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,101,000	
139回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,803,000	
155回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,866,000	
159回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,177,000	
162回	日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	105,347,000	
169回	高速道路機構債	100,000,000	96,792,000	
172回	高速道路機構債	200,000,000	186,776,000	
210回	高速道路機構債	100,000,000	95,829,000	
97回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,820,000	
116回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,782,000	
121回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	557,640,000	
153回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	112,875,000	
188回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,616,000	
202回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	105,000,000	105,792,750	
211回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,938,000	
218回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,061,000	
220回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,150,000	
239回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,176,000	
241回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,245,000	
250回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,683,000	
254回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,181,000	
260回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	204,800,000	
第262回	政保道路債	500,000,000	526,800,000	
268回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	99,994,000	

271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	299,634,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	189,164,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,042,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	800,536,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	195,494,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,553,000	
398回 政保道路債	300,000,000	232,341,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	149,054,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	160,690,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	162,840,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	619,855,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	221,426,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	338,226,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	338,814,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	113,631,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,269,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	224,960,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	111,775,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	223,872,000	
F147回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	209,724,000	
F174回 地方公共団体金融機構債券	300,000,000	341,394,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	547,279,080	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	110,423,000	
64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,988,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	543,610,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,927,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	213,820,000	

288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	317,253,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,504,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,958,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	97,590,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,000,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,070,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,922,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,085,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	261,948,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	232,707,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,560,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	222,946,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	102,893,910	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	106,286,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	104,879,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	207,030,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	162,478,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	108,382,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,045,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	224,156,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,461,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	397,512,500	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,628,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,985,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,980,000	
148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	282,762,500	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,796,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,211,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,859,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,244,000	

230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,655,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	95,026,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,160,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,160,000	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,573,000	30,838,985	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,408,000	47,359,364	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,418,000	10,513,012	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,910,000	50,374,661	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,850,000	30,077,457	
4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,167,000	10,248,030	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,817,000	17,633,129	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,745,000	110,746,888	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	159,560,000	167,368,866	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,291,000	23,330,206	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	19,122,000	19,989,565	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,431,000	23,351,119	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,540,000	24,507,494	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,194,000	30,324,683	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,730,000	74,137,976	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,433,000	33,582,425	
82回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,427,000	39,443,778	
84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,876,000	39,926,429	
86回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,746,000	43,868,937	
90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,686,000	45,559,164	
93回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,985,000	50,160,947	

9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,219,000	56,843,030	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,243,000	59,277,395	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	217,968,000	214,223,309	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,977,000	73,163,253	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,767,000	73,052,935	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,765,000	72,988,992	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	230,589,000	227,319,247	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	230,664,000	227,240,946	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,408,000	154,032,162	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	234,801,000	230,748,334	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	234,801,000	230,825,819	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	404,735,000	399,364,165	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,001,000	79,849,165	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,338,000	81,315,386	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	266,685,000	259,116,479	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	355,888,000	346,848,444	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	274,239,000	268,348,346	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	281,478,000	275,659,849	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	853,776,000	832,918,252	
6 回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	420,900,000	
2 1 回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,420,000	
い第8 2 8 号 利付商工債	100,000,000	100,064,000	
い第8 4 3 号 利付商工債	100,000,000	99,929,000	
い第8 5 1 号 利付商工債	300,000,000	299,049,000	
い第8 5 4 号 利付商工債	300,000,000	298,701,000	
い第8 5 5 号 利付商工債	200,000,000	199,076,000	
3 6 9 回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	399,200,000	
3 7 7 回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	298,731,000	

	7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債券	100,000,000	100,797,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	112,166,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,290,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	296,706,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,010,000	
	87回 中日本高速道路債券	400,000,000	398,092,000	
	71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,932,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	100,000,000	102,661,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整 備支援機構債券	200,000,000	195,684,000	
特殊債券 合計		30,836,251,000	31,465,044,363	
社債券	25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2 017)	300,000,000	295,581,000	
	2回 BPCE SA円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	99,621,000	
	6回 クレディ・アグリコル・ エス・エー円貨社債	200,000,000	201,066,000	
	11回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債(20 16)	100,000,000	98,574,000	
	25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,845,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,352,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	100,845,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	88,811,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,597,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	196,674,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,134,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,756,000	
	56回 中日本高速道路社債	100,000,000	100,829,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,684,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	496,200,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	201,738,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	101,243,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	300,123,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	200,558,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,710,000	
	62回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,195,000	
	24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	199,070,000	
	10回 キリンホールディング ス社債	100,000,000	101,041,000	
	9回 野村不動産ホールディ ングス社債	100,000,000	97,236,000	
	12回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	100,000,000	101,461,000	
	14回 セブン&アイ・ホール ディングス社債	200,000,000	199,534,000	
	30回 東レ社債	300,000,000	299,718,000	

42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	199,324,000	
49回 住友化学社債	100,000,000	101,206,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	194,838,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,391,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	296,019,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	483,320,000	
4回 住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,634,000	
14回 プリチストン社債	300,000,000	298,593,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	298,065,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	100,567,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	98,195,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	195,550,000	
29回 三菱重工業社債	100,000,000	100,909,000	
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	98,933,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	201,646,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	199,384,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	95,923,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	394,524,000	
12回 新生銀行社債	400,000,000	398,552,000	
13回 新生銀行社債	200,000,000	199,278,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	108,952,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,315,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,546,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,344,000	
11回 セブン銀行社債	200,000,000	201,446,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	296,787,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	298,617,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	394,640,000	
69回 ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,314,000	
81回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,653,000	
96回 トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,703,000	
80回 日立キャピタル社債	200,000,000	194,576,000	
86回 日立キャピタル社債	300,000,000	291,531,000	
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	98,416,000	
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,196,000	
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,266,000	

31回 三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	194,736,000	
56回 三菱UFJリース社債	300,000,000	298,605,000	
3回 野村ホールディングス社債	300,000,000	295,908,000	
72回 三菱地所社債	100,000,000	104,110,000	
106回 住友不動産社債	100,000,000	100,398,000	
108回 住友不動産社債	200,000,000	200,094,000	
80回 東京急行電鉄社債	100,000,000	104,245,000	
43回 京浜急行電鉄社債	100,000,000	92,966,000	
39回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,658,000	
42回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	211,004,000	
65回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	111,483,000	
71回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,499,000	
73回 東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	224,520,000	
107回 東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	100,565,000	
125回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	92,712,000	
127回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,300,000	
147回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,902,000	
160回 東日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,992,000	
163回 東日本旅客鉄道社債	300,000,000	297,603,000	
165回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	179,204,000	
171回 東日本旅客鉄道社債	200,000,000	162,062,000	
21回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,347,000	
60回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	195,548,000	
70回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	82,857,000	
71回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	76,697,000	
74回 西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,197,000	
75回 西日本旅客鉄道社債	200,000,000	178,888,000	
13回 東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,436,000	
14回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,901,000	
32回 東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,342,000	
4回 東京地下鉄社債	120,000,000	129,073,200	
47回 東京地下鉄社債	100,000,000	75,264,000	
6回 横浜高速鉄道社債	200,000,000	195,198,000	
12回 ソフトバンク社債	400,000,000	391,232,000	
30回 光通信社債	200,000,000	188,744,000	
527回 中部電力社債	100,000,000	95,153,000	
532回 中部電力社債	200,000,000	193,838,000	
497回 関西電力社債	100,000,000	101,530,000	
508回 関西電力社債	300,000,000	298,014,000	
530回 関西電力社債	400,000,000	390,224,000	
531回 関西電力社債	200,000,000	181,248,000	
541回 関西電力社債	300,000,000	286,710,000	
396回 中国電力社債	200,000,000	194,626,000	
425回 中国電力社債	100,000,000	96,706,000	
307回 北陸電力社債	100,000,000	102,258,000	

3 1 1 回	北陸電力社債	100,000,000	101,406,000	
4 7 1 回	東北電力社債	400,000,000	404,784,000	
4 8 8 回	東北電力社債	100,000,000	99,248,000	
5 2 1 回	東北電力社債	400,000,000	389,256,000	
5 2 5 回	東北電力社債	200,000,000	196,284,000	
5 3 6 回	東北電力社債	300,000,000	285,885,000	
4 2 4 回	九州電力社債	200,000,000	202,380,000	
4 2 6 回	九州電力社債	400,000,000	404,708,000	
4 2 8 回	九州電力社債	100,000,000	101,218,000	
4 6 3 回	九州電力社債	100,000,000	93,511,000	
4 6 6 回	九州電力社債	100,000,000	92,393,000	
4 9 1 回	九州電力社債	300,000,000	287,031,000	
4 9 2 回	九州電力社債	100,000,000	87,628,000	
4 9 3 回	九州電力社債	200,000,000	197,614,000	
5 0 7 回	九州電力社債	200,000,000	195,014,000	
3 2 1 回	北海道電力社債	261,000,000	264,515,670	
3 4 0 回	北海道電力社債	300,000,000	299,334,000	
3 5 0 回	北海道電力社債	200,000,000	186,640,000	
1 3 回	電源開発社債	200,000,000	209,256,000	
3 8 回	電源開発社債	300,000,000	302,940,000	
5 4 回	電源開発社債	100,000,000	98,884,000	
7 5 回	電源開発社債	200,000,000	191,106,000	
4 1 回	東京瓦斯社債	200,000,000	190,876,000	
5 2 回	東京瓦斯社債	100,000,000	90,810,000	
5 5 回	東京瓦斯社債	100,000,000	87,174,000	
5 7 回	東京瓦斯社債	300,000,000	213,213,000	
7 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	199,812,000	
8 回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	190,640,000	
社債券 合計		26,981,000,000	26,513,506,870	
合計			776,178,282,471	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	15,154,730,830
コール・ローン	1,552,831,734
株式	681,842,923,405
投資信託受益証券	1,122,300,050
投資証券	14,898,753,972
派生商品評価勘定	9,651,799
未収入金	20,462,962
未収配当金	633,223,619
差入委託証拠金	5,367,905,280
流動資産合計	720,602,783,651
資産合計	720,602,783,651
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,392,868,626
未払金	57,056,833
未払解約金	46,148,000
流動負債合計	1,496,073,459
負債合計	1,496,073,459
純資産の部	
元本等	
元本	124,720,616,433
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	594,386,093,759
元本等合計	719,106,710,192
純資産合計	719,106,710,192
負債純資産合計	720,602,783,651

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	108,379,642,938円
同期中追加設定元本額	85,151,480,969円
同期中一部解約元本額	68,810,507,474円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,397,686,782円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	2,034,460円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	13,618,897円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	47,505,888円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	21,836,658円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	11,884,598円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	19,351,438円
たわらノーロード 先進国株式	37,565,981,745円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	432,748,679円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,673,768,678円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	727,075,480円
たわらノーロード バランス(堅実型)	79,875,170円
たわらノーロード バランス(標準型)	669,397,442円
たわらノーロード バランス(積極型)	829,007,097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)	141,140,135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)	418,945,027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)	342,741,481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)	508,606,481円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,447円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,231,109円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	26,153,378円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,856,832円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,326,774円
たわらノーロード 全世界株式	447,706,958円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	54,708,888,675円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,613,315,086円
Oneグローバルバランス	1,775,859円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	151,739,824円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	776,568,959円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,015,173,673円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	93,596,765円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	251,992,929円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	246,630,553円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,659,398円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	617,942,926円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,721,570円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	169,431,813円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	193,548,504円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	311,905,045円
投資のソムリエ	2,397,192,722円
クルーズコントロール	88,243,893円
投資のソムリエ<DC年金>	161,468,621円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	197,584,513円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	205,838,628円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	87,193,586円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	407,677,404円
ワールドアセットバランス(基本コース)	153,105,106円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	100,020,996円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	21,056,409円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	10,484,522円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	590,711円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	28,401,941円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	127,995,001円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	52,168,485円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	147,254,446円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	21,736,566円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	10,986,499円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	6,981,688円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	80,855,342円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,315,118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)	76,865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)	57,046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)	42,234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)	50,879円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	126,341円
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)	101,992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)	446,716,602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)	40,552,810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)	1,171,389,351円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,480,043円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,082,213,680円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	60,979,501円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	1,102,339円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	7,399,992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)	191,354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)	929,531円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	1,061,600円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	27,685,445円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	53,123,412円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,094,399円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	20,195,807円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,379,129円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	239,118円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,788,899円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	23,009,580円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	174,384,117円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	271,848,613円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	900,382,030円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	44,649,585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)	39,759,016円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	272,883,778円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	11,383,141円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	166,855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)	108,394,861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)	9,452,805円

D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	32,049,287円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	48,804,487円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	114,373,986円
動的パッケージファンド<DC年金>	2,468,146円
コア資産形成ファンド	1,617,716円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,508,138,243円
MHAM外国株式インデックスファンド	141,268,863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）	9,188,010円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	333,355,393円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,553,076,209円
計	124,720,616,433円
2. 受益権の総数	124,720,616,433口

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	137,114,083,161	
投資信託受益証券	242,277,499	
投資証券	4,471,823,924	
合計	141,828,184,584	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年2月16日から2022年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年10月12日現在				
	契約額等（円）	うち		時価（円）	評価損益（円）
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	1,936,292,304	-	1,938,546,096	2,253,792	
イギリス・ポンド	1,433,949,030	-	1,436,958,481	3,009,451	
オーストラリア・ドル	148,468,172	-	147,581,777	886,395	
カナダ・ドル	45,239,425	-	45,139,351	100,074	
ユーロ	62,995,270	-	63,067,364	72,094	
ユーロ	245,640,407	-	245,799,123	158,716	
合計	1,936,292,304	-	1,938,546,096	2,253,792	

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

３．換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2022年10月12日現在			評価損益（円）
	契約額等（円）	うち		
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	23,147,904,963	-	21,762,434,344	1,385,470,619
合計	23,147,904,963	-	21,762,434,344	1,385,470,619

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

２．先物取引の残高表示は、契約額によっております。

３．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2022年10月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	5.7657円 (57,657円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,019,090	112.210	114,352,088.900	
	ABBOTT LABORATORIES	194,778	101.750	19,818,661.500	
	AES CORP	79,505	24.680	1,962,183.400	
	ABIOMED INC	5,283	243.140	1,284,508.620	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	100,187	117.800	11,802,028.600	
	ADVANCED MICRO DEVICES	180,154	57.630	10,382,275.020	
	ADOBE INC	52,525	284.830	14,960,695.750	
	CHUBB LTD	48,192	185.700	8,949,254.400	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,526	231.210	5,670,656.460	
	ALLEGHANY CORP	1,594	842.000	1,342,148.000	
	ALLSTATE CORP	31,078	132.970	4,132,441.660	

HONEYWELL INTERNATIONAL INC	76,042	173.620	13,202,412.040	
AMGEN INC	59,558	245.440	14,617,915.520	
HESS CORP	31,366	124.160	3,894,402.560	
AMERICAN EXPRESS CO	72,215	137.350	9,918,730.250	
AMERICAN ELECTRIC POWER	57,056	84.870	4,842,342.720	
AFLAC INC	68,561	58.100	3,983,394.100	
AMERICAN INTL GROUP	87,119	48.050	4,186,067.950	
AMERCO	980	523.830	513,353.400	
ANALOG DEVICES	57,753	138.800	8,016,116.400	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	79,236	51.050	4,044,997.800	
VALERO ENERGY CORP	46,059	109.690	5,052,211.710	
ANSYS INC	9,857	200.330	1,974,652.810	
APPLE INC	1,801,241	138.980	250,336,474.180	
APPLIED MATERIALS INC	95,987	76.300	7,323,808.100	
ALBEMARLE CORP	13,133	272.990	3,585,177.670	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	63,215	86.300	5,455,454.500	
AMEREN CORP	28,729	77.880	2,237,414.520	
ARROW ELECTRONICS INC	6,673	92.410	616,651.930	
AUTODESK INC	24,822	191.030	4,741,746.660	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	46,735	226.270	10,574,728.450	
AUTOZONE INC	2,139	2,267.510	4,850,203.890	
AVERY DENNISON CORP	9,514	166.370	1,582,844.180	
BALL CORP	36,411	48.470	1,764,841.170	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	143,111	267.310	38,255,001.410	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	83,697	38.480	3,220,660.560	
BAXTER INTERNATIONAL INC	54,640	55.810	3,049,458.400	
BECTON DICKINSON & CO	31,511	222.650	7,015,924.150	
AMETEK INC	24,597	115.060	2,830,130.820	
VERIZON COMM INC	467,596	35.940	16,805,400.240	
WR BERKLEY CORP	24,066	68.060	1,637,931.960	
BEST BUY CO INC	21,397	63.850	1,366,198.450	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	390.130	959,329.670	
YUM! BRANDS INC	32,015	105.250	3,369,578.750	
FIRSTENERGY CORP	61,472	36.720	2,257,251.840	
BOEING CO	62,367	131.570	8,205,626.190	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	79.490	945,692.530	
BORGWARNER INC	27,800	32.930	915,454.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	157,706	39.560	6,238,849.360	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	94.050	1,363,160.700	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	17,656	115.090	2,032,029.040	

METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,582	1,113.260	2,874,437.320	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	236,935	69.650	16,502,522.750	
ONEOK INC	48,237	53.590	2,585,020.830	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	126.780	1,000,420.980	
UNITED RENTALS INC	8,287	277.760	2,301,797.120	
SEMPRA ENERGY	35,320	146.960	5,190,627.200	
FEDEX CORP	28,131	152.080	4,278,162.480	
VERISIGN INC	10,834	174.890	1,894,758.260	
AMPHENOL CORP	64,235	67.680	4,347,424.800	
BROWN-FORMAN CORP	35,058	64.650	2,266,499.700	
QUANTA SERVICES INC	15,516	129.440	2,008,391.040	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	5.970	607,537.050	
CSX CORP	240,600	26.510	6,378,306.000	
COTERRA ENERGY INC	91,495	28.800	2,635,056.000	
CAMPBELL SOUP CO	21,144	48.620	1,028,021.280	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,254	221.390	4,041,253.060	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	70.330	2,240,502.810	
CARLISLE COS INC	5,298	293.490	1,554,910.020	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	101,102	6.640	671,317.280	
CATERPILLAR INC	59,281	179.750	10,655,759.750	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	109.320	1,185,575.400	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	6.670	647,476.910	
JPMORGAN CHASE & CO	326,684	101.960	33,308,700.640	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,423	71.910	1,971,987.930	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,259	96.560	1,666,529.040	
CINTAS CORP	9,998	393.500	3,934,213.000	
CISCO SYSTEMS INC	460,385	39.580	18,222,038.300	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	15.350	865,187.400	
CLOROX COMPANY	14,322	128.240	1,836,653.280	
COCA-COLA CO/THE	458,358	54.480	24,971,343.840	
COPART INC	22,756	109.860	2,499,974.160	
COGNEX CORP	20,432	42.740	873,263.680	
COLGATE-PALMOLIVE CO	88,304	69.050	6,097,391.200	
MARRIOTT INTERNATIONAL- CL A	31,293	138.790	4,343,155.470	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,695	352.690	2,361,259.550	
NRG ENERGY, INC.	23,951	41.060	983,428.060	
COMCAST CORP-CL A	496,860	28.680	14,249,944.800	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	33.890	1,892,519.270	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,788	81.600	3,165,100.800	
CMS ENERGY CORP	32,591	55.420	1,806,193.220	
COOPER COS INC	5,638	256.320	1,445,132.160	
MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	47.750	1,016,167.750	
CORNING INC	86,665	29.900	2,591,283.500	

SEALED AIR CORP	17,610	45.160	795,267.600	
HEICO CORP-CL A	7,767	115.520	897,243.840	
CUMMINS INC	15,824	220.070	3,482,387.680	
DR HORTON INC	35,441	72.700	2,576,560.700	
DANAHER CORP	76,774	254.140	19,511,344.360	
MOODY'S CORP	18,678	240.880	4,499,156.640	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	58,780	57.220	3,363,391.600	
TARGET CORP	51,260	154.500	7,919,670.000	
DEERE & CO	32,270	363.330	11,724,659.100	
MORGAN STANLEY	145,905	77.000	11,234,685.000	
REPUBLIC SERVICES INC	24,966	129.640	3,236,592.240	
COSTAR GROUP INC	43,267	72.370	3,131,232.790	
THE WALT DISNEY CO	202,497	93.100	18,852,470.700	
DOLLAR TREE INC	25,247	141.690	3,577,247.430	
DOVER CORP	16,217	119.570	1,939,066.690	
OMNICOM GROUP	23,275	64.760	1,507,289.000	
DTE ENERGY CO	21,579	106.300	2,293,847.700	
DUKE ENERGY CORP	87,541	89.530	7,837,545.730	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	128.530	1,791,579.670	
EBAY INC	60,401	36.950	2,231,816.950	
BANK OF AMERICA CORP	806,400	29.770	24,006,528.000	
CITIGROUP INC	215,983	40.450	8,736,512.350	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	72.170	1,018,390.870	
EATON CORP PLC	43,806	136.420	5,976,014.520	
CADENCE DESIGN SYS INC	31,336	148.040	4,638,981.440	
DISH NETWORK CORP	24,416	13.510	329,860.160	
ECOLAB INC	28,945	142.700	4,130,451.500	
PERKINELMER INC	13,622	119.000	1,621,018.000	
ELECTRONIC ARTS INC	31,306	119.250	3,733,240.500	
SALESFORCE INC	110,544	142.570	15,760,258.080	
ERIE INDEMNITY CO	2,431	234.570	570,239.670	
EMERSON ELECTRIC CO	65,292	78.000	5,092,776.000	
ATMOS ENERGY CORP	15,146	102.200	1,547,921.200	
ENTERGY CORP	21,950	101.150	2,220,242.500	
EOG RESOURCES INC	64,807	122.700	7,951,818.900	
EQUIFAX INC	13,970	163.820	2,288,565.400	
EQT CORP	36,492	43.550	1,589,226.600	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	26,040	214.050	5,573,862.000	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	17,306	89.050	1,541,099.300	
EXXON MOBIL CORP	468,251	98.000	45,888,598.000	
FMC CORP	13,192	112.420	1,483,044.640	
NEXTERA ENERGY INC	218,777	76.030	16,633,615.310	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,101	414.710	1,700,725.710	
FAIR ISAAC CORP	2,962	405.730	1,201,772.260	
ASSURANT INC	5,823	150.110	874,090.530	
FASTENAL CO	62,546	46.380	2,900,883.480	
FIFTH THIRD BANCORP	77,462	32.420	2,511,318.040	

M&T BANK CORP	19,301	179.090	3,456,616.090	
FISERV INC	69,266	95.450	6,611,439.700	
FORD MOTOR CO	436,043	11.560	5,040,657.080	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	21.380	810,644.080	
FREEMONT-MCMORAN INC	163,569	29.180	4,772,943.420	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	828.190	1,051,801.300	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23,283	176.130	4,100,834.790	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	28.160	720,867.840	
GENERAL DYNAMICS CORP	26,228	227.740	5,973,164.720	
GENERAL MILLS INC	66,312	77.390	5,131,885.680	
GENUINE PARTS CO	16,139	156.780	2,530,272.420	
GILEAD SCIENCES INC	139,579	65.670	9,166,152.930	
GARTNER INC	9,036	289.240	2,613,572.640	
MCKESSON CORP	15,910	351.550	5,593,160.500	
NVIDIA CORP	278,503	115.860	32,267,357.580	
GENERAL ELECTRIC CO	122,596	64.000	7,846,144.000	
WW GRAINGER INC	4,982	514.090	2,561,196.380	
HALLIBURTON CO	104,397	29.560	3,085,975.320	
MONSTER BEVERAGE CORP	44,230	89.460	3,956,815.800	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	38,240	294.210	11,250,590.400	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21,738	231.500	5,032,347.000	
HASBRO INC	15,437	67.760	1,046,011.120	
HENRY SCHEIN INC	15,048	68.000	1,023,264.000	
HEICO CORP	5,185	146.050	757,269.250	
HERSHEY FOODS CORP	16,042	225.460	3,616,829.320	
HP INC	118,420	24.780	2,934,447.600	
F5 INC	6,924	139.040	962,712.960	
CROWN HOLDINGS INC NPR	12,764	81.240	1,036,947.360	
JUNIPER NETWORKS INC	34,097	25.810	880,043.570	
HOLOGIC INC	28,090	61.950	1,740,175.500	
HOME DEPOT INC	114,289	282.890	32,331,215.210	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,012	88.070	1,762,456.840	
HORMEL FOODS CORP	34,578	46.000	1,590,588.000	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,052	26.600	1,889,983.200	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	224.360	808,144.720	
HUMANA INC	13,997	498.490	6,977,364.530	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	163.650	1,500,834.150	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	163,228	13.080	2,135,022.240	
BIOGEN INC	16,547	254.070	4,204,096.290	
IDEX CORP	7,786	205.560	1,600,490.160	
ILLINOIS TOOL WORKS	34,352	186.030	6,390,502.560	
INTUIT INC	29,785	383.480	11,421,951.800	
IDEXX LABORATORIES INC	9,126	325.710	2,972,429.460	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,475	147.310	3,900,032.250	

INTEL CORP	455,537	25.040	11,406,646.480	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	29,611	86.600	2,564,312.600	
INTERNATIONAL PAPER CO	37,464	31.580	1,183,113.120	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	26.170	1,195,419.430	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	183.990	1,499,886.480	
INCYTE CORP	21,658	67.250	1,456,500.500	
JOHNSON & JOHNSON	292,947	162.730	47,671,265.310	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35,131	64.220	2,256,112.820	
KLA CORPORATION	16,870	280.920	4,739,120.400	
DEVON ENERGY CORP	70,979	68.570	4,867,030.030	
KELLOGG CO	26,694	71.960	1,920,900.240	
KEYCORP	106,247	15.670	1,664,890.490	
KIMBERLY-CLARK CORP	37,556	111.370	4,182,611.720	
BLACKROCK INC/NEW YORK	16,845	531.140	8,947,053.300	
KROGER CO	77,870	45.680	3,557,101.600	
LAM RESEARCH CORP	15,207	327.050	4,973,449.350	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,380	333.160	1,792,400.800	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	114.420	1,261,938.180	
AKAMA I TECHNOLOGIES	17,689	78.060	1,380,803.340	
PLUG POWER INC	56,149	19.790	1,111,188.710	
LENNAR CORP	29,937	78.160	2,339,875.920	
ELI LILLY & CO	89,821	327.600	29,425,359.600	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	34.200	962,935.200	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	45.490	815,954.130	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	81,654	159.410	13,016,464.140	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	33,941	125.640	4,264,347.240	
LOCKHEED MARTIN CORP	26,681	411.060	10,967,491.860	
LOEWS CORP	23,530	51.920	1,221,677.600	
LOWE'S COS INC	70,981	196.430	13,942,797.830	
DOMINION ENERGY INC	90,582	64.830	5,872,431.060	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	30.560	1,234,654.560	
MCCORMICK & CO INC	26,555	75.840	2,013,931.200	
MCDONALD'S CORPORATION	82,281	237.050	19,504,711.050	
S&P GLOBAL INC	38,593	294.720	11,374,128.960	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	267.690	1,192,291.260	
MARKEL CORPORATION	1,512	1,146.410	1,733,371.920	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	69,970	82.150	5,748,035.500	
MARSH & MCLENNAN COS	55,369	152.360	8,436,020.840	
MASCO CORP	28,937	48.780	1,411,546.860	

MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,058	317.420	2,240,350.360	
METLIFE INC	76,607	63.320	4,850,755.240	
MEDTRONIC PLC	148,181	81.890	12,134,542.090	
ACTIVISION BLIZZARD INC	86,748	73.550	6,380,315.400	
CVS HEALTH CORP	145,787	88.500	12,902,149.500	
MERCK & CO. INC.	281,510	91.050	25,631,485.500	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	47,294	59.470	2,812,574.180	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	204.300	2,164,149.900	
MICROSOFT CORP	790,800	225.410	178,254,228.000	
MICRON TECH INC	123,798	53.710	6,649,190.580	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62,574	59.550	3,726,281.700	
3M CO	61,773	108.840	6,723,373.320	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	97.060	612,545.660	
ENTEGRIS INC	17,709	77.730	1,376,520.570	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	197.110	1,099,479.580	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,762	224.250	4,207,378.500	
ILLUMINA INC	17,754	199.160	3,535,886.640	
XCEL ENERGY INC	60,629	59.830	3,627,433.070	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	107.600	1,082,563.600	
NETAPP INC	24,953	62.060	1,548,583.180	
NEWELL BRANDS INC	41,984	14.170	594,913.280	
NEWMONT CORP	85,737	41.820	3,585,521.340	
NVR INC	365	4,167.680	1,521,203.200	
NIKE INC-CL B	140,852	87.990	12,393,567.480	
NORDSON CORP	5,664	214.510	1,214,984.640	
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,248	212.790	5,585,311.920	
EVERSOURCE ENERGY	37,532	74.430	2,793,506.760	
NISOURCE INC	44,573	24.870	1,108,530.510	
NORTHERN TRUST CORP	22,556	84.080	1,896,508.480	
NORTHROP GRUMMAN CORP	16,379	507.310	8,309,230.490	
WELLS FARGO & CO	421,216	40.230	16,945,519.680	
NUCOR CORP	29,469	118.860	3,502,685.340	
CHENIERE ENERGY INC	25,946	168.140	4,362,560.440	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	42,758	93.760	4,008,990.080	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,785	64.030	6,645,353.550	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,008	267.760	2,947,502.080	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,201	730.900	5,263,210.900	
ORACLE CORP	177,974	62.410	11,107,357.340	
PACCAR INC	38,135	89.070	3,396,684.450	
PTC INC	11,726	107.170	1,256,675.420	
EXELON CORP	109,446	37.470	4,100,941.620	

PARKER HANNIFIN CORP	13,935	255.000	3,553,425.000	
PAYCHEX INC	36,225	108.340	3,924,616.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	208.450	1,791,836.200	
PPL CORPORATION	79,504	24.740	1,966,928.960	
PEPSICO INC	154,067	162.590	25,049,753.530	
PENTAIR PLC	17,214	40.850	703,191.900	
PFIZER INC	624,273	41.920	26,169,524.160	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,796	40.720	1,131,853.120	
CONOCOPHILLIPS	143,688	115.580	16,607,459.040	
PG&E CORP	161,265	14.220	2,293,188.300	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25,409	246.130	6,253,917.170	
ALTRIA GROUP INC	201,063	44.350	8,917,144.050	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	46,237	147.680	6,828,280.160	
BROWN & BROWN INC	27,138	61.960	1,681,470.480	
GARMIN LTD	17,835	78.500	1,400,047.500	
PPG INDUSTRIES INC	26,678	110.760	2,954,855.280	
COSTCO WHOLESALE CORP	49,243	472.020	23,243,680.860	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,937	103.380	2,681,367.060	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	124.360	1,622,649.280	
PROCTER & GAMBLE CO	267,130	124.230	33,185,559.900	
PROGRESSIVE CORP	64,766	123.450	7,995,362.700	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,485	55.130	3,114,018.050	
PULTE GROUP INC	29,050	39.950	1,160,547.500	
GLOBAL PAYMENTS INC	31,571	107.810	3,403,669.510	
QUALCOMM INC	124,633	110.030	13,713,368.990	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21,036	104.630	2,200,996.680	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	32.160	606,730.560	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,994	737.410	8,844,495.540	
RESMED INC	15,873	215.000	3,412,695.000	
US BANCORP	155,785	38.790	6,042,900.150	
SEAGEN INC	15,075	133.180	2,007,688.500	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	38,689	46.590	1,802,520.510	
ROSS STORES INC	40,011	86.140	3,446,547.540	
ROLLINS INC	25,920	36.360	942,451.200	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,800	364.130	4,296,734.000	
ROCKWELL AUTOMATION INC	12,975	225.930	2,931,441.750	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	40.690	1,118,039.130	
RPM INTERNATIONAL INC	13,691	92.990	1,273,126.090	
ACCENTURE PLC-CL A	70,550	252.980	17,847,739.000	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	154,553	56.280	8,698,242.840	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	12,110	202.080	2,447,188.800	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	26,823	159.460	4,277,195.580	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	67,779	74.280	5,034,624.120	
BOOKING HOLDINGS INC	4,507	1,634.610	7,367,187.270	
SCHLUMBERGER LTD	159,299	41.760	6,652,326.240	
SCHWAB (CHARLES) CORP	161,530	71.710	11,583,316.300	
POOL CORP	4,660	319.420	1,488,497.200	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22,505	108.320	2,437,741.600	
BUNGE LTD	16,302	86.200	1,405,232.400	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	48.180	697,501.860	
ELEVANCE HEALTH INC	26,784	470.730	12,608,032.320	
AMERISOURCEBERGEN CORP	17,525	141.710	2,483,467.750	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	75.710	2,231,022.280	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	27,299	204.510	5,582,918.490	
CENTENE CORP	64,392	75.320	4,850,005.440	
SVB FINANCIAL GROUP	6,316	335.790	2,120,849.640	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	49.310	732,549.360	
SNAP-ON INC	6,118	209.040	1,278,906.720	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,080	90.840	3,822,547.200	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	168.860	1,209,881.900	
EDISON INTERNATIONAL	41,311	57.460	2,373,730.060	
SOUTHERN CO	118,660	63.640	7,551,522.400	
TRUIST FINANCIAL CORP	145,846	42.430	6,188,245.780	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	31.410	618,777.000	
AT&T INC	797,018	14.810	11,803,836.580	
CHEVRON CORP	207,535	157.170	32,618,275.950	
STANLEY BLACK & DECKER INC	16,183	76.650	1,240,426.950	
STATE STREET CORP	39,756	60.810	2,417,562.360	
STARBUCKS CORP	127,318	86.210	10,976,084.780	
STEEL DYNAMICS INC	20,170	79.110	1,595,648.700	
STRYKER CORP	37,705	211.460	7,973,099.300	
NETFLIX INC	49,326	214.290	10,570,068.540	
NORTONLIFELOCK INC	62,570	20.920	1,308,964.400	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	48.040	803,709.200	
SYNOPSIS INC	17,236	277.340	4,780,232.240	
SYSCO CORP	56,127	73.460	4,123,089.420	
INTUITIVE SURGICAL INC	39,660	185.900	7,372,794.000	
TELEFLEX INC	5,532	191.030	1,056,777.960	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	8.070	898,586.430	
TERADYNE INC	18,512	74.020	1,370,258.240	
TEXAS INSTRUMENTS INC	102,697	153.450	15,758,854.650	
TEXTRON INC	22,385	61.410	1,374,662.850	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43,535	500.810	21,802,763.350	
GLOBE LIFE INC	9,737	106.690	1,038,840.530	
DAVITA INC	6,813	87.940	599,135.220	
TRACTOR SUPPLY CO	12,713	200.760	2,552,261.880	
BIO-TECHNE CORP	4,403	281.980	1,241,557.940	
TRIMBLE INC	28,676	52.490	1,505,203.240	
TYLER TECHNOLOGIES INC	4,516	329.760	1,489,196.160	
TYSON FOODS INC	32,395	63.950	2,071,660.250	
UGI CORP	24,160	32.800	792,448.000	
MARATHON OIL CORP	74,806	27.040	2,022,754.240	
UNION PACIFIC CORP	69,899	192.640	13,465,343.360	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	165,674	84.590	14,014,363.660	
UNITEDHEALTH GROUP INC	104,355	499.810	52,157,672.550	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	92.060	745,317.760	
VF CORP	37,887	28.960	1,097,207.520	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	18.240	1,230,598.080	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28,404	295.160	8,383,724.640	
VULCAN MATERIALS CO	15,328	156.270	2,395,306.560	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86,056	32.610	2,806,286.160	
WALMART INC	168,308	132.670	22,329,422.360	
WASTE MANAGEMENT INC	45,722	156.270	7,144,976.940	
WATERS CORP	6,836	271.990	1,859,323.640	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	46.020	1,025,555.700	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7,870	239.680	1,886,281.600	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	141.460	1,793,571.340	
VAIL RESORTS INC	4,389	216.400	949,779.600	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	34.820	1,233,359.220	
WABTEC CORP	20,273	85.820	1,739,828.860	
WHIRLPOOL CORP	6,832	142.940	976,566.080	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	81.160	1,528,486.280	
WYNN RESORTS LTD	12,757	59.640	760,827.480	
NASDAQ INC	36,557	58.100	2,123,961.700	
CME GROUP INC	39,877	169.950	6,777,096.150	
WILLIAMS COS INC	135,860	29.750	4,041,835.000	
LKQ CORP	27,341	50.230	1,373,338.430	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	50.280	1,461,438.480	
WEC ENERGY GROUP INC	35,483	85.180	3,022,441.940	
CARMAX INC	18,673	63.040	1,177,145.920	
TJX COMPANIES INC	129,625	64.360	8,342,665.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	250.010	1,489,559.580	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.510	515,713.990	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	51.960	900,362.880	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	13,154	186.680	2,455,588.720	
SIGNATURE BANK	6,557	148.680	974,894.760	
CBRE GROUP INC	37,573	69.250	2,601,930.250	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	15.850	250,097.150	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	19.890	2,130,199.110	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	303.500	1,248,902.500	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,852	328.010	1,591,504.520	
WESTLAKE CORP	4,187	88.000	368,456.000	
T-MOBILE US INC	69,717	137.150	9,561,686.550	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	36.360	1,394,406.000	
MOSAIC CO/THE	42,561	49.560	2,109,323.160	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	231.600	971,098.800	
CELANESE CORP	11,005	91.010	1,001,565.050	
DEXCOM INC	44,066	99.680	4,392,498.880	
EXPEDIA GROUP INC	16,101	91.820	1,478,393.820	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	102.830	2,470,696.410	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,462	266.290	3,318,505.980	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	16.810	605,731.540	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	62,831	90.790	5,704,426.490	
LIVE NATION	17,759	77.750	1,380,762.250	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,157	1,491.060	4,707,276.420	
TRANSDIGM GROUP INC	5,661	522.590	2,958,381.990	
MASTERCARD INC	96,711	286.050	27,664,181.550	
WESTERN UNION CO	46,712	13.480	629,677.760	
OWENS CORNING	10,366	86.480	896,451.680	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	91.270	1,378,907.160	
AERCAP HOLDINGS NV	13,522	46.730	631,883.060	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12,212	142.400	1,738,988.800	
DELTA AIR LINES INC	15,786	28.840	455,268.240	
INSULET CORP	8,015	232.780	1,865,731.700	
DISCOVER FINANCIAL	30,126	90.890	2,738,152.140	
TE CONNECTIVITY LTD	36,520	109.920	4,014,278.400	
MASIMO CORP	5,688	129.630	737,335.440	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,211	295.680	3,906,228.480	
VMWARE INC	24,654	105.770	2,607,653.580	
MERCADOLIBRE INC	5,154	834.670	4,301,889.180	
ULTA BEAUTY INC	6,073	396.800	2,409,766.400	
INVESCO LTD	38,530	14.130	544,428.900	
MSCI INC	8,825	399.350	3,524,263.750	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	172,569	85.620	14,775,357.780	
VISA INC	183,289	179.140	32,834,391.460	
KEURIG DR PEPPER INC	84,836	37.550	3,185,591.800	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,554	127.720	2,497,436.880	
MARATHON PETROLEUM CORP	59,755	103.430	6,180,459.650	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	16,182	57.320	927,552.240	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,919	17.160	3,945,410.040	
XYLEM INC	20,869	89.050	1,858,384.450	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,975	77.720	2,329,657.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	234.700	1,106,141.100	
SPLUNK INC	18,478	70.170	1,296,601.260	
EPAM SYSTEMS INC	6,493	320.050	2,078,084.650	
HCA HEALTHCARE INC	26,065	202.690	5,283,114.850	
VERISK ANALYTICS INC	17,072	169.500	2,893,704.000	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	133.460	874,696.840	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	171.180	1,513,915.920	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	19,974	130.490	2,606,407.260	
NXP SEMICONDUCTOR NV	29,467	143.750	4,235,881.250	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	96.490	1,393,798.050	
TARGA RESOURCES CORP	22,585	65.850	1,487,222.250	
LEAR CORP	6,911	122.040	843,418.440	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	10,930	118.060	1,290,395.800	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	46.950	1,236,428.250	
DOLLAR GENERAL CORP	24,993	239.630	5,989,072.590	
FORTINET INC	77,005	48.580	3,740,902.900	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	63.620	1,572,113.820	
TESLA INC	293,941	216.500	63,638,226.500	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	152.060	1,051,342.840	
ENPHASE ENERGY INC	15,506	255.800	3,966,434.800	
GENERAL MOTORS CO	152,724	32.090	4,900,913.160	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	28.790	1,129,431.700	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	8,608	239.840	2,064,542.720	
APTIV PLC	28,695	81.920	2,350,694.400	
PHILLIPS 66	53,977	90.340	4,876,282.180	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	58.410	534,918.780	
META PLATFORMS INC	255,086	128.540	32,788,754.440	
IQVIA HOLDINGS INC	21,481	172.450	3,704,398.450	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,801	139.370	2,620,295.370	

SERVICENOW INC	22,211	371.300	8,246,944.300	
PALO ALTO NETWORKS INC	33,067	157.370	5,203,753.790	
WORKDAY INC	22,324	142.700	3,185,634.800	
ABBVIE INC	196,559	141.510	27,815,064.090	
ZOETIS INC	52,115	146.250	7,621,818.750	
NEWS CORP/NEW-CL A	40,345	15.460	623,733.700	
CDW CORP	15,145	152.600	2,311,127.000	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	33.000	1,399,629.000	
TWILIO INC	18,075	67.830	1,226,027.250	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	52.070	425,724.320	
SNAP INC	127,318	10.310	1,312,648.580	
TRADE DESK INC A	48,490	52.500	2,545,725.000	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,466	60.740	1,364,584.840	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	39.420	348,669.900	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	39.070	776,359.970	
OKTA INC	17,828	50.760	904,949.280	
BLACK KNIGHT INC	17,653	63.040	1,112,845.120	
BAKER HUGHES CO	108,170	22.250	2,406,782.500	
BROADCOM INC	44,950	430.760	19,362,662.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,939	34.280	340,708.920	
MONGODB INC	7,891	180.050	1,420,774.550	
BURLINGTON STORES INC	7,274	115.830	842,547.420	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	42,679	11.860	506,172.940	
VEEVA SYSTEMS INC	15,824	162.260	2,567,602.240	
TWITTER INC	75,611	50.070	3,785,842.770	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	16,816	38.180	642,034.880	
EVERGY INC	23,578	57.350	1,352,198.300	
ALLEGION PLC	9,404	91.580	861,218.320	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14,122	56.030	791,255.660	
STERIS PLC	10,912	168.660	1,840,417.920	
DOCUSIGN INC	21,673	44.540	965,315.420	
WIX.COM LTD	5,855	74.600	436,783.000	
DROPBOX INC	30,479	20.070	611,713.530	
KKR & CO INC	63,201	44.140	2,789,692.140	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	35.080	177,154.000	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	24,690	73.710	1,819,899.900	
MODERNA INC	38,522	120.720	4,650,375.840	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	29,880	117.880	3,522,254.400	
ARAMARK	21,244	32.980	700,627.120	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	6.120	366,514.560	
CIGNA CORP	35,229	290.950	10,249,877.550	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	33.870	1,109,919.900	
DOW INC	79,195	43.950	3,480,620.250	
AMCOR PLC	172,505	10.780	1,859,603.900	

PINTEREST INC	62,041	22.990	1,426,322.590	
FOX CORP-A	36,501	30.670	1,119,485.670	
FOX CORP-B	15,511	28.530	442,528.830	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	9.230	393,068.780	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	22,313	155.790	3,476,142.270	
CHEWY INC	9,648	34.030	328,321.440	
AVANTOR INC	65,960	19.870	1,310,625.200	
LYFT INC	36,887	11.270	415,716.490	
DYNATRACE INC	20,512	34.250	702,536.000	
CLOUDFLARE INC	29,770	49.980	1,487,904.600	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	52.210	720,498.000	
CARRIER GLOBAL CORP	96,568	35.150	3,394,365.200	
OTIS WORLDWIDE CORP	47,395	64.750	3,068,826.250	
UBER TECHNOLOGIES INC	165,469	24.660	4,080,465.540	
CORTEVA INC	78,919	60.760	4,795,118.440	
MATCH GROUP INC	31,784	47.140	1,498,297.760	
BILL.COM HOLDINGS INC	10,180	124.220	1,264,559.600	
BLACKSTONE INC	77,539	83.440	6,469,854.160	
CARLYLE GROUP INC	24,530	25.880	634,836.400	
DATADOG INC	26,832	82.720	2,219,543.040	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	51.970	1,159,346.760	
INGERSOLL RAND INC	46,398	45.420	2,107,397.160	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,733	319.420	1,831,234.860	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	32.330	1,239,596.860	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	23.960	222,037.320	
UNITY SOFTWARE INC	21,046	31.110	654,741.060	
AON PLC	23,481	276.230	6,486,156.630	
WARNER BROS DISCOVERY INC	253,362	11.600	2,938,999.200	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	2,056.750	1,513,768.000	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	31.750	716,470.500	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	70.160	918,675.040	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	19.350	358,516.800	
IAC INC	9,152	49.830	456,044.160	
AIRBNB INC	41,528	106.820	4,436,020.960	
ZENDESK INC	12,612	76.300	962,295.600	
CONSTELLATION ENERGY CORP	37,045	82.880	3,070,289.600	
APPROVIN CORP	13,206	17.770	234,670.620	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	41.270	1,547,707.540	
ROBLOX CORP	38,445	34.560	1,328,659.200	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	43.220	1,281,732.320	
VIATRIS INC	132,223	9.390	1,241,573.970	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	35.190	814,507.740	
SNOWFLAKE INC	24,559	153.530	3,770,543.270	

DOORDASH INC	20,697	44.850	928,260.450	
ARISTA NETWORKS INC	27,865	107.050	2,982,948.250	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	47.680	2,257,838.720	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	8.040	1,459,774.560	
FNF GROUP	31,004	38.240	1,185,592.960	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	1.760	105,402.880	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	111.960	1,630,249.560	
MARVELL TECHNOLOGY INC	93,099	38.660	3,599,207.340	
APA CORP	37,156	40.480	1,504,074.880	
LUCID GROUP INC	44,910	12.650	568,111.500	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.570	290,708.120	
CATALENT INC	20,564	73.180	1,504,873.520	
SYNCHRONY FINANCIAL	52,277	30.920	1,616,404.840	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	34.300	1,953,144.900	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	140.340	734,960.580	
WAYFAIR INC	7,350	30.820	226,527.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	20,584	156.000	3,211,104.000	
HUBSPOT INC	4,842	261.160	1,264,536.720	
QORVO INC	11,596	78.620	911,677.520	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	74.300	1,139,390.500	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	5,852	203.590	1,191,408.680	
GODADDY INC	17,185	73.510	1,263,269.350	
ETSY INC	13,841	105.600	1,461,609.600	
TRANSUNION	22,126	55.750	1,233,524.500	
ALCOA CORP	19,669	37.850	744,471.650	
BLOCK INC	59,110	53.450	3,159,429.500	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,674	51.800	2,987,513.200	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	44.680	1,001,234.120	
TELADOC HEALTH INC	20,256	24.710	500,525.760	
WESTROCK CO	27,826	31.410	874,014.660	
KRAFT HEINZ CO	80,856	34.940	2,825,108.640	
NOVOCURE LTD	10,423	78.660	819,873.180	
FORTIVE CORP	38,946	59.100	2,301,708.600	
WASTE CONNECTIONS INC	28,997	129.470	3,754,241.590	
ALPHABET INC-CL A	669,993	97.180	65,109,919.740	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	144,397	12.210	1,763,087.370	
PAYPAL HOLDINGS INC	122,267	83.090	10,159,165.030	
SEA LTD ADR	40,917	57.490	2,352,318.330	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	27.520	1,236,308.480	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	28.040	457,640.840	

	ALPHABET INC-CL C	626,815	98.050	61,459,210.750	
	ZSCALER INC	9,038	148.730	1,344,221.740	
	CABLE ONE INC	570	765.610	436,397.700	
	LINDE PLC	55,955	271.000	15,163,805.000	
	ROKU INC	12,563	51.700	649,507.100	
	AVALARA INC	11,113	92.350	1,026,285.550	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	12,932	308.440	3,988,746.080	
	VISTRA CORP	41,133	21.800	896,699.400	
アメリカ・ドル	小計	37,974,566		3,466,386,564.970 (506,785,715,797)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	10.930	502,375.590	
	ASHTREAD GROUP	50,699	41.590	2,108,571.410	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	22.530	662,314.410	
	BARCLAYS PLC	1,890,510	1.401	2,648,604.510	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	3.430	425,992.280	
	BT GROUP PLC	756,852	1.238	936,982.770	
	BUNZL PLC	38,593	26.640	1,028,117.520	
	AVIVA PLC	285,940	3.837	1,097,151.780	
	CRODA INTERNATIONAL	14,055	65.160	915,823.800	
	DIAGEO PLC	254,091	36.615	9,303,541.960	
	SCHRODERS PLC	71,635	3.737	267,699.990	
	DCC PLC	11,135	46.780	520,895.300	
	NATIONAL GRID PLC	409,380	8.838	3,618,100.440	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.110	475,577.120	
	BAE SYSTEMS PLC	350,927	8.342	2,927,433.030	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	243,703	32.790	7,991,021.370	
	HALMA PLC	41,997	20.970	880,677.090	
	NEXT PLC	13,982	45.480	635,901.360	
	IMPERIAL BRANDS PLC	96,657	20.270	1,959,237.390	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	18.160	362,764.160	
	ANGLO AMERICAN PLC	142,815	27.080	3,867,430.200	
	COMPASS GROUP PLC	200,991	18.085	3,634,922.230	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,230,220	4.545	10,136,349.900	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	607,824	2.123	1,290,410.350	
	UNILEVER PLC	283,827	39.455	11,198,394.280	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	8.370	599,425.920	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	12.750	539,975.250	
	PEARSON PLC	66,974	9.078	607,989.970	
	PERSIMMON PLC	35,252	12.135	427,783.020	
	PRUDENTIAL PLC	309,558	8.862	2,743,302.990	
	RIO TINTO PLC	124,818	49.985	6,239,027.730	
	VODAFONE GROUP PLC	3,044,329	1.013	3,083,905.270	

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	79,120	58.980	4,666,497.600	
RELX PLC	216,002	22.280	4,812,524.560	
RENTOKIL INITIAL PLC	279,183	4.735	1,321,931.500	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	847,047	0.694	587,850.610	
NATWEST GROUP PLC	563,549	2.216	1,248,824.580	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	9.606	647,905.480	
SSE PLC	115,425	14.565	1,681,165.120	
BP PLC	2,175,067	4.526	9,844,353.240	
SAGE GROUP PLC(THE)	99,129	6.864	680,421.450	
SMITHS GROUP PLC	36,732	15.440	567,142.080	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	104.550	934,258.800	
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	5.476	1,614,845.020	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,991,045	0.414	3,308,292.630	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	0.893	321,046.000	
TESCO PLC	846,543	2.070	1,752,344.010	
3I GROUP PLC	107,283	10.815	1,160,265.640	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	10.130	942,758.580	
GSK PLC	451,655	13.572	6,129,861.660	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,657	74.340	2,725,081.380	
WPP PLC	120,328	7.470	898,850.160	
ASTRAZENECA PLC	172,202	98.250	16,918,846.500	
WHITBREAD PLC	25,470	24.190	616,119.300	
INTERTEK GROUP PLC	17,114	36.720	628,426.080	
BURBERRY GROUP PLC	41,060	18.655	765,974.300	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	43.500	946,212.000	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	1.752	336,553.940	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	19.105	407,414.120	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	32.930	374,084.800	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	13.075	241,299.120	
AVEVA GROUP PLC	11,702	31.500	368,613.000	
ABRDN PLC	213,433	1.333	284,506.180	
EXPERIAN PLC	106,747	26.670	2,846,942.490	
MONDI PLC	58,887	13.755	809,990.680	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.266	305,362.570	
OCADO GROUP PLC	69,766	4.145	289,180.070	
INFORMA PLC	157,970	5.400	853,038.000	
GLENORE PLC	1,091,404	4.842	5,284,578.160	
ENTAIN PLC	61,865	10.980	679,277.700	
COCA-COLA HBC AG	21,338	19.530	416,731.140	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	5.200	448,359.600	
FERGUSON PLC	24,704	98.240	2,426,920.960	
M&G PLC	270,401	1.668	451,028.860	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	0.994	250,666.920	

	HALEON PLC	567,403	2.756	1,563,762.660	
	SHELL PLC	823,299	22.860	18,820,615.140	
	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.246	581,429.910	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	0.989	481,847.720	
イギリス・ポンド	小計	31,897,418		187,881,702.410 (30,141,861,518)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	30.840	4,524,320.520	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	30.510	5,502,264.930	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	6.164	1,773,832.770	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	720.000	1,838,160.000	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	157.200	1,976,632.800	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	17.600	2,867,814.400	
	ICL GROUP LTD	72,257	30.890	2,232,018.730	
	NICE LTD	7,640	663.700	5,070,668.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	121.000	2,110,240.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	246.800	1,153,049.600	
イスラエル・シュケル	小計	894,899		29,049,001.750 (1,184,923,306)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	57.160	1,243,458.640	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	328,635	23.950	7,870,808.250	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	392,465	21.600	8,477,244.000	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	194,047	17.240	3,345,370.280	
	TELSTRA CORP LTD	482,855	3.830	1,849,334.650	
	ASX LTD	18,983	67.640	1,284,010.120	
	BHP GROUP LTD	563,067	39.920	22,477,634.640	
	AMPOL LTD	22,088	30.380	671,033.440	
	COMPUTERSHARE LT	56,332	25.380	1,429,706.160	
	CSL LIMITED	53,483	282.860	15,128,201.380	
	REA GROUP LTD	6,134	116.950	717,371.300	
	TRANSURBAN GROUP	330,224	12.610	4,164,124.640	
	COCHLEAR LTD	7,836	193.830	1,518,851.880	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	5.620	1,198,346.980	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	189,147	94.000	17,779,818.000	
	RIO TINTO LIMITED	42,295	96.900	4,098,385.500	
	APA GROUP	125,299	9.460	1,185,328.540	
	ARISTOCRAT LEISU	65,513	34.380	2,252,336.940	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.730	1,332,270.720	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	49,035	32.970	1,616,683.950	
ORICA LTD	43,659	13.390	584,594.010		
LEND LEASE CORP LTD	65,475	8.480	555,228.000		

	BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	16.250	817,781.250	
	MACQUARIE GROUP LTD	41,229	158.560	6,537,270.240	
	SUNCORP GROUP LTD	154,162	10.320	1,590,951.840	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	362,624	29.490	10,693,781.760	
	NEWCREST MINING LTD	98,073	17.350	1,701,566.550	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.240	590,333.160	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	11.730	2,023,272.510	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	8.180	1,109,028.040	
	REECE LTD	31,558	14.530	458,537.740	
	SANTOS LTD	359,516	7.720	2,775,463.520	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	30.550	1,612,245.700	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	27.070	703,413.950	
	WESFARMERS LTD	124,086	44.020	5,462,265.720	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	210,573	33.750	7,106,838.750	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,728	33.210	4,540,736.880	
	SEEK LTD	38,405	19.890	763,875.450	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	51.870	325,951.080	
	MINERAL RESOURCES LTD	16,953	72.780	1,233,839.340	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.490	1,963,974.210	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	1.930	433,620.820	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.530	786,656.970	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	12.920	1,023,690.360	
	XERO LTD	14,590	72.850	1,062,881.500	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	27.950	664,678.950	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.010	912,114.600	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.840	1,097,614.800	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	3.550	1,059,944.800	
	SOUTH32 LTD(AUD)	488,701	3.670	1,793,532.670	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.400	2,480,221.200	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	53.920	799,256.160	
	オーストラリア・ドル 小計	7,760,537		164,905,482.540 (15,100,395,036)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	57.270	2,989,494.000	
	BARRICK GOLD CORP	200,288	20.740	4,153,973.120	
	BANK OF MONTREAL	74,231	114.860	8,526,172.660	
	BANK OF NOVA SCOTIA	132,609	64.060	8,494,932.540	
	NATIONAL BANK OF CANADA	38,087	83.120	3,165,791.440	
	BCE INC	7,697	57.210	440,345.370	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	155,952	53.570	8,354,348.640	
	BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	9.110	275,577.500	

SAPUTO INC	26,668	30.490	813,107.320	
BLACKBERRY LTD	49,855	5.740	286,167.700	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	65,601	14.590	957,118.590	
CGI INC	25,261	103.220	2,607,440.420	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	63.440	1,038,068.720	
CAE INC	32,283	22.420	723,784.860	
CAMECO CORP	45,781	35.620	1,630,719.220	
ROGERS COMM-CL B	40,412	51.680	2,088,492.160	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	98,538	56.030	5,521,084.140	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	127,827	72.860	9,313,475.220	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	145.160	888,959.840	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	34.510	563,548.300	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,497	148.960	9,905,393.120	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	39.710	862,223.230	
OPEN TEXT CORP	33,217	35.160	1,167,909.720	
EMPIRE CO LTD	16,169	33.640	543,925.160	
KINROSS GOLD CORP	123,889	5.030	623,161.670	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	83.390	1,107,919.540	
FORTIS INC	54,416	50.260	2,734,948.160	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,491	23.420	1,510,379.220	
TELUS CORP	31,890	26.920	858,478.800	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	29.030	993,058.240	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	62.560	1,704,509.760	
ENBRIDGE INC	225,905	49.710	11,229,737.550	
IGM FINANCIAL INC	12,478	34.280	427,745.840	
MANULIFE FINANCIAL CORP	219,912	21.260	4,675,329.120	
LOBLAW CO LTD	18,620	107.380	1,999,415.600	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	95,432	56.270	5,369,958.640	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	65.110	2,104,876.080	
SUN LIFE FINANCIAL INC	63,118	54.350	3,430,463.300	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,369	620.290	1,469,467.010	
METRO INC	23,118	68.230	1,577,341.140	
EMERA INC	30,947	53.090	1,642,976.230	
ONEX CORP	10,157	64.010	650,149.570	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	21.860	422,400.780	
POWER CORP OF CANADA	65,500	30.510	1,998,405.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	24.130	414,915.350	
ROYAL BANK OF CANADA	157,390	118.080	18,584,611.200	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	102,870	93.670	9,635,832.900	
SHAW COMM INC-B	52,487	33.580	1,762,513.460	
SUNCOR ENERGY INC	158,054	43.180	6,824,771.720	

LUNDIN MINING CORP	68,762	6.530	449,015.860	
TECK RESOURCES LTD-CL B	51,060	43.970	2,245,108.200	
THOMSON REUTERS CORP	19,979	139.130	2,779,678.270	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	97.360	940,984.400	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	201,499	80.830	16,287,164.170	
TC ENERGY CORP	110,440	55.250	6,101,810.000	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,862	102.880	603,082.560	
WESTON (GEORGE) LTD	8,379	142.340	1,192,666.860	
INTACT FINANCIAL CORP	20,070	192.860	3,870,700.200	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	43.770	2,337,930.780	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,184	1,848.600	4,037,342.400	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,662	162.160	3,512,709.920	
TOURMALINE OIL CORP	34,258	77.540	2,656,365.320	
KEYERA CORP	24,571	27.740	681,599.540	
PARKLAND CORP	15,665	29.240	458,044.600	
ALTAGAS LTD	33,833	25.210	852,929.930	
PEMBINA PIPELINE CORP	60,655	42.290	2,565,099.950	
DOLLARAMA INC	32,535	80.700	2,625,574.500	
CENOVUS ENERGY INC W/I	158,757	23.640	3,753,015.480	
ARC RESOURCES LTD	74,961	17.970	1,347,049.170	
NORTHLAND POWER INC	25,030	38.230	956,896.900	
TMX GROUP LTD	7,040	126.300	889,152.000	
BRP INC	4,307	84.200	362,649.400	
IVANHOE MINES LTD	64,027	8.780	562,157.060	
NUTRIEN LTD	62,480	113.880	7,115,222.400	
TFI INTERNATIONAL INC	9,399	131.010	1,231,362.990	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	23.980	291,357.000	
WSP GLOBAL INC	13,004	148.780	1,934,735.120	
IA FINANCIAL CORP INC	12,011	70.020	841,010.220	
GFL ENVIRONMENTAL INC	17,254	33.690	581,287.260	
NUVEI CORP	7,929	37.200	294,958.800	
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	41.810	673,266.430	
AIR CANADA	18,814	16.860	317,204.040	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,443	72.480	2,351,468.640	
SHOPIFY INC	124,310	35.370	4,396,844.700	
FIRSTSERVICE CORP	5,237	163.980	858,763.260	
HYDRO ONE LTD	37,626	32.250	1,213,438.500	
カナダ・ドル 小計	4,513,957		243,235,065.700 (25,785,349,315)	
シンガポール・ ドル				
SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.340	481,628.000	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	203,210	33.310	6,768,925.100	
CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.840	308,896.000	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	9.270	925,146.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.790	601,342.470	
	KEPPEL CORP LTD	144,600	6.950	1,004,970.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	368,898	11.770	4,341,929.460	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.500	2,358,325.000	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.060	823,262.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,766	26.320	3,415,441.120	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.340	276,424.000	
	VENTURE CORP LTD	21,600	16.470	355,752.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	3.650	709,560.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.360	1,030,142.400	
	シンガポール・ドル 小計	3,563,287		23,401,743.550 (2,377,851,162)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	280,209	4.385	1,228,716.460	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	43.880	832,974.040	
	NESTLE SA-REGISTERED	313,530	105.740	33,152,662.200	
	CIE FINANC RICHEMONT	57,566	95.540	5,499,855.640	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSSCHEIN	78,628	322.600	25,365,392.800	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	156.050	656,658.400	
	SIKA INHABER	16,475	203.000	3,344,425.000	
	SGS SA-REG	646	2,079.000	1,343,034.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	241,553	75.750	18,297,639.750	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	127.000	720,725.000	
	BARRY CALLEBAUT AG	326	1,807.000	589,082.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	16.060	338,416.320	
	SWISSCOM AG-REG	2,942	451.500	1,328,313.000	
	ABB LTD	180,184	24.900	4,486,581.600	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	27.290	541,488.180	
	GEBERIT AG	3,611	422.800	1,526,730.800	
	LONZA GROUP AG-REG	8,438	484.700	4,089,898.600	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	9,500.000	1,111,500.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	97,400.000	1,266,200.000	
	GIVAUDAN-REG	1,043	2,824.000	2,945,432.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,641	392.500	6,531,592.500	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,595	390.600	1,013,607.000	
	HOLCIM LTD	60,356	40.580	2,449,246.480	
	TEMENOS GROUP	7,082	65.040	460,613.280	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	65.850	173,185.500	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	215.200	1,320,252.000	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	199.250	1,187,330.750	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	93.220	1,208,970.180	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	217.900	682,027.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	40.680	204,457.680	

	SCHINDLER NAMEN	2,720	151.200	411,264.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	439.300	1,585,873.000	
	EMS-CHEMIE HOLDING	810	623.000	504,630.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	77.050	645,062.600	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,623	798.200	2,093,678.600	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	41.830	1,088,876.730	
	SWISS RE LTD	32,880	69.580	2,287,790.400	
	SIG GROUP AG	38,322	19.480	746,512.560	
	ALCON INC	57,507	57.140	3,285,949.980	
	UBS GROUP AG	389,130	14.265	5,550,939.450	
	VAT GROUP AG	3,325	204.800	680,960.000	
スイス・フラン	小計	1,942,914		142,778,545.480 (20,931,334,767)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	313,452	104.620	32,793,348.240	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	168,168	94.520	15,895,239.360	
	ERICSSON LM-B SHS	330,309	69.020	22,797,927.180	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	195.850	5,044,116.750	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	169.000	9,875,853.000	
	LUNDBERGS B	7,859	404.200	3,176,607.800	
	SKF AB-B SHS	46,594	155.400	7,240,707.600	
	SANDVIK AB	114,819	153.650	17,641,939.350	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	179,371	105.750	18,968,483.250	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	137.050	6,021,565.850	
	SWEDBANK AB	94,382	142.550	13,454,154.100	
	SVENSKA CELLULOOSA AB-B SHS	70,211	145.350	10,205,168.850	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	90.820	14,716,109.520	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	169.900	4,111,240.200	
	VOLVO AB-B SHS	168,857	162.400	27,422,376.800	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	441.700	4,479,721.400	
	SWEDISH MATCH AB	165,180	109.750	18,128,505.000	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	90.320	5,818,053.120	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	221.900	3,393,294.800	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	219.700	4,685,102.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	119.660	3,219,691.620	
	SECURITAS AB-B SHS	44,038	81.840	3,604,069.920	
	INVESTOR AB-B SHS	204,473	161.380	32,997,852.740	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	107.840	8,873,830.080	
	ASSA ABLOY AB-B	109,215	205.500	22,443,682.500	
	TELIA CO AB	344,810	31.920	11,006,335.200	
	BOLIDEN AB	29,779	358.650	10,680,238.350	
	ALFA LAVAL AB	35,313	270.700	9,559,229.100	
	KINNEVIK AB-B	22,633	139.800	3,164,093.400	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	40.935	2,985,880.770	
	INDUTRADE AB	29,769	173.000	5,150,037.000	

	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	60.560	2,892,890.640	
	NIBE INDUSTRIER AB	162,506	95.500	15,519,323.000	
	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	216.400	3,977,432.000	
	HEXAGON AB-B SHS	223,124	101.950	22,747,491.800	
	SAGAX AB	19,038	171.200	3,259,305.600	
	EPIROC AB-A	70,656	161.950	11,442,739.200	
	EPIROC AB-B	41,205	142.100	5,855,230.500	
	ESSITY AB-B	66,425	226.600	15,051,905.000	
	EQT AB	31,718	205.500	6,518,049.000	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	58.980	4,706,073.180	
	VOLVO CAR AB	63,710	44.500	2,835,095.000	
	LIFCO AB	26,835	149.650	4,015,857.750	
	EVOLUTION AB	19,664	879.200	17,288,588.800	
	NORDEA BANK ABP	371,709	96.090	35,717,517.810	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	170.250	2,645,514.750	
スウェーデン・クローナ 小計		4,344,975		514,027,469.380 (6,615,533,531)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	936.000	10,209,888.000	
	A P MOLLER A/S	557	14,080.000	7,842,560.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	13,530.000	4,857,270.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	92.420	6,736,216.540	
	GENMAB A/S	7,409	2,721.000	20,159,889.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	361.800	8,632,186.200	
	ROCKWOOL AS	873	1,266.500	1,105,654.500	
	NOVO NORDISK A/S-B	184,080	797.200	146,748,576.000	
	GN STORE NORD A/S	15,343	123.650	1,897,161.950	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	114,856	135.000	15,505,560.000	
	COLOPLAST-B	12,434	758.200	9,427,458.800	
	DSV A/S	20,065	893.600	17,930,084.000	
	DEMANT A/S	11,367	190.150	2,161,435.050	
	TRYG A/S	34,386	159.700	5,491,444.200	
	PANDORA A/S	9,912	372.200	3,689,246.400	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	365.100	4,577,623.800	
	ORSTED A/S	20,956	580.400	12,162,862.400	
デンマーク・クローネ 小計		552,789		279,135,116.840 (5,323,106,678)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.185	1,180,790.080	
	FISHER & PAYKEL	60,887	18.650	1,135,542.550	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.120	1,121,474.560	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.250	329,878.500	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.695	620,477.110	
ニュージーランド・ドル 小計		639,257		4,388,162.800 (358,161,848)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	140.200	6,379,660.800	

	NORSK HYDRO ASA	162,971	58.700	9,566,397.700	
	TELENOR ASA	66,610	97.460	6,491,810.600	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	342.000	3,825,270.000	
	ORKLA ASA	72,906	77.580	5,656,047.480	
	EQUINOR ASA	110,053	372.350	40,978,234.550	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	410.700	8,145,823.800	
	AKER BP ASA	33,719	310.400	10,466,377.600	
	SALMAR ASA	7,248	331.200	2,400,537.600	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	189.700	4,879,273.700	
	ADEVINTA ASA	24,382	67.300	1,640,908.600	
	DNB BANK ASA	105,251	176.100	18,534,701.100	
	ノルウェー・クローネ 小計	685,384		118,965,043.530 (1,614,355,641)	
ユーロ	CRH PLC	85,408	33.290	2,843,232.320	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	114.350	2,281,625.550	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	89.500	1,634,986.000	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	47.450	828,049.950	
	UMICORE	24,290	31.230	758,576.700	
	AIR LIQUIDE	57,857	117.600	6,803,983.200	
	AIRBUS SE	65,329	93.930	6,136,352.970	
	AXA SA	204,183	23.005	4,697,229.910	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	72,439	19.465	1,410,025.130	
	ADIDAS AG	18,678	115.080	2,149,464.240	
	ASSICURAZIONI GENERALI	111,929	13.985	1,565,327.060	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	127.900	399,048.000	
	DANONE	69,770	47.785	3,333,959.450	
	SAFRAN SA	38,630	98.820	3,817,416.600	
	INTESA SANPAOLO	1,851,944	1.695	3,139,045.080	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,969	72.380	2,531,056.220	
	ACCOR SA	18,305	21.200	388,066.000	
	BOUYGUES	21,499	26.570	571,228.430	
	BNP PARIBAS	121,850	42.765	5,210,915.250	
	THALES SA	12,886	112.850	1,454,185.100	
	CAPGEMINI SA	18,395	160.550	2,953,317.250	
	UNICREDIT SPA	241,149	10.714	2,583,670.380	
	D'IETEREN TRDG	2,736	150.600	412,041.600	
	KONINKLIJKE DSM NV	18,672	114.800	2,143,545.600	
	COMMERZBANK AG	112,781	7.162	807,737.520	
	EIFFAGE	8,993	82.820	744,800.260	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	20.570	1,006,860.360	
	UNITED INTERNET	10,010	19.155	191,741.550	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	52.560	1,391,368.320	
	IBERDROLA SA	659,035	9.348	6,160,659.180	
	ENI SPA	278,442	11.570	3,221,573.940	
	JERONIMO MARTINS	34,644	18.820	652,000.080	
	KESKO OYJ-B	35,252	18.285	644,582.820	

KBC GROUPE	28,279	47.780	1,351,170.620	
HANNOVER RUECK SE	7,105	152.300	1,082,091.500	
WARTSILA OYJ	50,956	6.746	343,749.170	
L'OREAL	26,724	327.500	8,752,110.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,788	610.500	18,796,074.000	
GEA GROUP AG	17,490	33.510	586,089.900	
BOLLORE	114,808	4.604	528,576.030	
MEDIOBANCA SPA	60,688	7.908	479,920.700	
MICHELIN(CGDE) -B	77,776	22.575	1,755,793.200	
CONTINENTAL AG	12,921	47.880	618,657.480	
DEUTSCHE POST AG-REG	111,656	32.320	3,608,721.920	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	17.885	398,674.530	
OMV AG	17,258	38.210	659,428.180	
VERBUND AG	7,320	83.650	612,318.000	
PERNOD-RICARD	23,542	177.900	4,188,121.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	56.640	954,610.560	
RENAULT SA	19,671	30.730	604,489.830	
REPSOL SA	161,783	12.175	1,969,708.020	
REMY COINTREAU	2,866	163.600	468,877.600	
MERCK KGAA	15,234	165.250	2,517,418.500	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	56,977	38.510	2,194,184.270	
RWE AG	70,182	36.840	2,585,504.880	
SEB SA	2,596	59.700	154,981.200	
SOCIETE GENERALE-A	90,814	21.365	1,940,241.110	
VINCI S.A.	58,633	84.020	4,926,344.660	
SODEXO	9,822	81.060	796,171.320	
SOFINA	1,449	180.100	260,964.900	
SOLVAY SA	9,070	82.760	750,633.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	59,760	118.620	7,088,731.200	
VIVENDI SE	76,073	7.730	588,044.290	
SAP SE	116,225	86.040	9,999,999.000	
TELEFONICA S.A	614,947	3.337	2,052,078.130	
TOTALENERGIES SE	275,411	50.440	13,891,730.840	
VALEO	26,570	16.035	426,049.950	
E.ON SE	256,515	7.606	1,951,053.090	
VOEST-ALPINE AG	10,593	19.010	201,372.930	
HENKEL AG & CO KGAA	10,047	58.300	585,740.100	
SIEMENS AG-REG	85,284	103.100	8,792,780.400	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	33.470	2,082,938.510	
ING GROEP NV-CVA	424,755	8.828	3,749,737.140	
PUMA AG	10,980	47.490	521,440.200	
BAYER AG	108,984	48.415	5,276,460.360	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	13.500	790,222.500	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	62.000	1,217,928.000	

MERCEDES-BENZ GROUP AG	89,877	52.850	4,749,999.450	
BASF SE	104,334	41.465	4,326,209.310	
BEIERSDORF AG	10,944	100.700	1,102,060.800	
HEIDELBERGCEMENT AG	13,626	41.340	563,298.840	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	27.220	649,333.100	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	235.800	1,223,330.400	
ORANGE	228,746	9.295	2,126,194.070	
SAMPO OYJ-A SHS	50,339	44.530	2,241,595.670	
RANDSTAD NV	11,897	44.120	524,895.640	
ALLIANZ SE	45,480	164.620	7,486,917.600	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.223	1,342,728.180	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	113,300	27.015	3,060,799.500	
HERMES INTL	3,559	1,261.000	4,487,899.000	
ENDESA S.A.	37,701	14.715	554,770.210	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	6.142	444,324.560	
ERSTE GROUP BANK AG	38,446	23.390	899,251.940	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	15,818	240.700	3,807,392.600	
ARCELOR MITTAL (NL)	57,374	21.490	1,232,967.260	
DASSAULT SYSTEMES SA	75,193	33.840	2,544,531.120	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	22.480	529,876.080	
RHEINMETALL STAMM	4,693	147.700	693,156.100	
HEINEKEN NV	29,630	90.100	2,669,663.000	
AKZO NOBEL	19,812	59.240	1,173,662.880	
ASML HOLDING NV	45,107	414.900	18,714,894.300	
AEGON NV	196,332	3.973	780,027.030	
VOLKSWAGEN AG	3,315	164.500	545,317.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,739	123.300	2,557,118.700	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	724,172	4.577	3,314,535.240	
KERING	8,379	445.250	3,730,749.750	
ACCIONA S.A.	2,642	171.700	453,631.400	
FORTUM OYJ	54,194	12.785	692,870.290	
AGEAS	18,136	37.570	681,369.520	
UCB SA	13,322	72.840	970,374.480	
NEMETSCHEK SE	5,104	47.240	241,112.960	
CARREFOUR SA	64,831	14.785	958,526.330	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	22.810	403,212.370	
NOKIA OYJ	592,026	4.504	2,666,485.100	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	101,426	15.480	1,570,074.480	
WOLTERS KLUWER-CVA	27,935	101.450	2,834,005.750	
SANOFI	126,570	81.810	10,354,691.700	
STMICROELECTRONICS NV	72,806	31.980	2,328,335.880	
ELISA OYJ	14,618	46.220	675,643.960	
BANCO SANTANDER SA	1,937,631	2.458	4,762,696.990	

RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	15.135	741,781.480	
QIAGEN N.V.	27,412	44.350	1,215,722.200	
DEUTSCHE BANK AG-REG	226,269	7.778	1,759,920.280	
BMW VORZUG	7,821	67.700	529,481.700	
ENEL SPA	889,883	4.076	3,627,163.100	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	360,127	17.704	6,375,688.400	
SARTORIUS AG	2,847	361.400	1,028,905.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	27.540	303,821.280	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	148,000	23.300	3,448,400.000	
RATIONAL AG	516	521.500	269,094.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	115.900	563,969.400	
BECHTLE AG	8,139	35.070	285,434.730	
KONINKLIJKE KPN NV	358,749	2.739	982,613.510	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	60.200	889,695.800	
TELEPERFORMANCE	6,746	252.900	1,706,063.400	
DEUTSCHE BOERSE AG	21,263	166.000	3,529,658.000	
EURAZEO	5,673	53.950	306,058.350	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	71.480	809,010.640	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	71.300	773,818.900	
INDITEX	126,694	22.080	2,797,403.520	
ESSILORLUXOTTICA	31,438	150.350	4,726,703.300	
SNAM SPA	210,122	4.087	858,768.610	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	8.332	1,197,475.040	
ENAGAS	24,864	14.820	368,484.480	
WENDEL	2,354	75.100	176,785.400	
TENARIS SA	55,855	14.490	809,338.950	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.176	159,858.330	
ATLANTIA SPA	55,336	22.410	1,240,079.760	
PROXIMUS	14,640	9.580	140,251.200	
TERNA SPA	166,064	6.150	1,021,293.600	
BIOMERIEUX	4,870	81.040	394,664.800	
GRIFOLS SA	31,982	8.582	274,469.520	
FERROVIAL SA	55,374	23.160	1,282,461.840	
NESTE OYJ	45,715	44.330	2,026,545.950	
RECORDATI SPA	10,908	35.830	390,833.640	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.160	529,219.000	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	160.350	963,382.800	
KONE OYJ	39,178	39.490	1,547,139.220	
ELIA GROUP	4,078	116.100	473,455.800	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	329.800	1,025,348.200	
ENGIE	206,708	11.572	2,392,024.970	
ALSTOM	37,007	17.005	629,304.030	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	11.915	774,617.980	
IPSEN SA	3,873	102.100	395,433.300	
ARKEMA SA	6,392	72.380	462,652.960	
LEGRAND SA	30,081	68.880	2,071,979.280	

AMPLIFON SPA	12,300	25.420	312,666.000	
ADP	3,975	121.250	481,968.750	
ORION OYJ	13,559	42.920	581,952.280	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.265	609,802.590	
SYMRISE AG	15,064	96.580	1,454,881.120	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	25,552	29.220	746,629.440	
PRYSMIAN SPA	30,728	31.160	957,484.480	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	115.250	279,942.250	
CAIXABANK	498,058	3.331	1,659,031.190	
BUREAU VERITAS SA	31,295	23.250	727,608.750	
GETLINK	44,292	15.275	676,560.300	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	20.060	592,993.660	
AMADEUS IT GROUP SA	51,056	49.870	2,546,162.720	
BRENTAG SE	17,934	57.440	1,030,128.960	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	17.365	428,689.750	
EDENRED	26,160	46.950	1,228,212.000	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.102	221,706.340	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	57.780	474,316.020	
KION GROUP AG	7,874	20.460	161,102.040	
VONOVIA SE	77,032	20.320	1,565,290.240	
KNORR-BREMSE AG	7,195	44.470	319,961.650	
OCI NV	12,329	42.520	524,229.080	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	44.960	1,354,195.200	
FERRARI NV	14,074	190.050	2,674,763.700	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	12.060	1,355,387.220	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.065	233,809.620	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8,858	30.570	270,789.060	
MONCLER SPA	25,014	44.370	1,109,871.180	
NEXI SPA	58,847	8.586	505,260.340	
PROSUS NV	93,541	53.460	5,000,701.860	
JDE PEET'S BV	7,893	29.120	229,844.160	
EXOR NV	14,142	66.360	938,463.120	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	10.635	494,612.580	
EURONEXT NV	10,081	63.400	639,135.400	
IMCD NV	6,823	117.050	798,632.150	
WORLDLINE SA	24,912	42.560	1,060,254.720	
NN GROUP NV	31,214	40.040	1,249,808.560	
FINECOBANK SPA	75,180	12.400	932,232.000	
ARGENX SE	5,978	361.800	2,162,840.400	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	17.248	1,423,529.180	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	47,088	24.890	1,172,020.320	
ZALANDO SE	24,405	21.620	527,636.100	
STELLANTIS NV	245,839	12.320	3,028,736.480	
AENA SME SA	8,494	103.500	879,129.000	
CELLNEX TELECOM SAU	58,013	31.190	1,809,425.470	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	13.344	302,508.480	

	ABN AMRO BANK NV	52,835	8.870	468,646.450	
	SCOUT24 SE	10,048	53.400	536,563.200	
	COVESTRO AG	20,258	32.100	650,281.800	
	HELLOFRESH SE	17,856	21.480	383,546.880	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	97,316	46.650	4,539,791.400	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	7.840	461,689.760	
	AMUNDI SA	6,292	41.360	260,237.120	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	8.524	356,976.590	
	ADYEN NV	2,458	1,266.600	3,113,302.800	
	DELIVERY HERO SE	17,246	33.330	574,809.180	
ユーロ 小計		20,256,871		422,997,164.320 (59,997,917,787)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	12.920	3,320,440.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	57.250	11,295,196.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	38.050	2,180,797.700	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	132,991	268.400	35,694,784.400	
	MTR CORP	192,441	35.100	6,754,679.100	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	118.700	11,287,895.200	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	21.900	3,744,286.800	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	38.150	5,772,858.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	6.860	8,543,485.160	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	44.900	11,714,589.600	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	26.200	11,003,869.000	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	20.500	3,547,853.000	
	SINO LAND CO	411,200	10.020	4,120,224.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,065	89.550	14,423,370.750	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	58.000	3,075,160.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	78.650	12,517,619.400	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	11.460	2,039,880.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	15.120	3,522,960.000	
	AIA GROUP LTD	1,334,716	67.300	89,826,386.800	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	9.010	4,172,855.360	
	SANDS CHINA LTD	260,600	18.820	4,904,492.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	14.540	2,035,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	17.100	1,956,240.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	37.150	7,286,415.250	
	ESR GROUP LTD	216,400	19.400	4,198,160.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.300	1,306,450.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	161,300	20.500	3,306,650.000	
	WH GROUP LTD	931,500	5.010	4,666,815.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	43.300	13,442,268.500	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	221,695	47.400	10,508,343.000	
香港・ドル	小計	9,146,069		302,170,624.020 (5,626,417,019)	
合計		124,172,923		681,842,923,405 (681,842,923,405)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益 証券	オーストラリ ア・ドル	DEXUS	108,264.000	817,393.200		
		GOODMAN GROUP	181,510.000	2,882,378.800		
		GPT GROUP	219,223.000	841,816.320		
		MIRVAC GROUP	432,802.000	830,979.840		
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,669,768.260		
		STOCKLAND	259,328.000	840,222.720		
		VICINITY CENTRES	386,564.000	682,285.460		
		オーストラリア・ドル 小計		2,234,888.000	8,564,844.600 (784,282,820)	
	シンガポール・ ドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	568,831.000	1,080,778.900		
		CAPLAND ASCENDAS REIT	440,678.000	1,163,389.920		
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	725,373.000		
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	206,400.000	357,072.000		
		シンガポール・ドル 小計		1,690,009.000	3,326,613.820 (338,017,230)	
	投資信託受益証券 合計			3,924,897	1,122,300,050 (1,122,300,050)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,590.000	2,231,023.200		
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,348.000	1,096,388.160		
		AMERICAN TOWER CORP	50,756.000	9,606,588.120		
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	45,448.000	767,162.240		
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,391.000	2,688,961.610		
		BOSTON PROPERTIES INC	15,623.000	1,112,513.830		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,279.000	1,279,715.340		
		CROWN CASTLE INC	48,038.000	6,366,476.140		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	32,050.000	2,886,102.500		

	EQUINIX INC	10,086.000	5,288,089.800	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,254,562.640	
	EQUITY RESIDENTIAL	37,873.000	2,387,892.650	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,316.000	1,659,634.600	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,919.000	2,509,674.180	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,405,436.500	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	824,115.950	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,388,965.200	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,301,158.950	
	INVITATION HOMES INC	69,205.000	2,281,688.850	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,587,989.140	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,350,240.960	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	794,150.460	
	MID AMERICA	11,879.000	1,744,668.730	
	PROLOGIS INC	102,410.000	10,305,518.300	
	PUBLIC STORAGE	17,682.000	5,126,188.620	
	REALTY INCOME CORP	69,294.000	4,023,209.640	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,067,318.970	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,240.000	3,124,015.200	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,061.000	3,514,124.020	
	SUN COMMUNITIES INC	12,719.000	1,604,374.660	
	UDR INC	34,650.000	1,336,104.000	
	VENTAS INC	42,412.000	1,568,819.880	
	VICI PROPERTIES INC	105,199.000	3,231,713.280	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	343,765.370	
	WELLTOWER INC	49,690.000	2,890,467.300	
	WEYERHAEUSER CO	83,741.000	2,467,009.860	
	WP CAREY INC	21,266.000	1,520,944.320	
アメリカ・ドル	小計	1,457,290.000	95,936,773.170 (14,025,956,236)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	395,329.400	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	385,614.180	
	SEGRO PLC	139,569.000	994,010.410	
イギリス・ポンド	小計	335,772.000	1,774,953.990 (284,755,869)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	348,443.900	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	262,805.280	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	611,249.180 (64,798,526)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	244,890.440	
	GECINA SA	5,045.000	398,555.000	
	KLEPIERRE	25,279.000	449,460.620	

		UNIBAIL-RODAMCO	13,535.000	565,221.600	
		WESTFIELD			
		WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	396,244.000	
	ユーロ 小計		65,715.000	2,054,371.660 (291,392,076)	
	香港・ドル	LINK REIT	233,616.000	12,451,732.800	
	香港・ドル 小計		233,616.000	12,451,732.800 (231,851,265)	
投資証券 合計			2,115,539	14,898,753,972 (14,898,753,972)	
合計				16,021,054,022 (16,021,054,022)	

(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 投資証券 37銘柄	70.47 -	- -	- 1.95	74.63
イギリス・ポンド	株式 79銘柄 投資証券 3銘柄	4.19 -	- -	- 0.04	4.36
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.16	-	-	0.17
オーストラリア・ドル	株式 52銘柄 投資信託受益証券 7銘柄	2.10 -	- 0.11	- -	2.28
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	3.59 -	- -	- 0.01	3.70
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	0.33 -	- 0.05	- -	0.39
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.91	-	-	3.00
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	0.92	-	-	0.95
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.74	-	-	0.76
ニュージーランド・ドル	株式 5銘柄	0.05	-	-	0.05
ノルウェー・クローネ	株式 12銘柄	0.22	-	-	0.23
ユーロ	株式 222銘柄 投資証券 5銘柄	8.34 -	- -	- 0.04	8.64
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 1銘柄	0.78 -	- -	- 0.03	0.84

(注) 「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,429,285,526
コール・ローン	1,572,688,359
国債証券	175,926,853,476
派生商品評価勘定	2,703,919
未収入金	15,996,593
未収利息	1,132,754,251
前払費用	129,824,282
流動資産合計	180,210,106,406
資産合計	
180,210,106,406	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	478,885
未払金	1,892,809,463
未払解約金	41,689,000
流動負債合計	1,934,977,348
負債合計	
1,934,977,348	
純資産の部	
元本等	
元本	86,195,830,752
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	92,079,298,306
元本等合計	178,275,129,058
純資産合計	
178,275,129,058	
負債純資産合計	
180,210,106,406	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	73,151,994,654円
同期中追加設定元本額	52,957,891,590円
同期中一部解約元本額	39,914,055,492円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	7,951,811,955円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	4,991,167円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	33,165,761円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	87,572,081円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	53,757,169円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	28,781,229円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	35,477,617円
たわらノーロード 先進国債券	15,592,686,605円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	233,187,134円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,080,990,787円
たわらノーロード バランス(堅実型)	56,108,732円
たわらノーロード バランス(標準型)	274,834,186円
たわらノーロード バランス(積極型)	57,452,895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)	11,452,474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)	538,364,294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)	729,080,398円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	274,023,237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)	188,731,837円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	1,008,194円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	6,858,333円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	83,053,072円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,521,779円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,205,953円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,497,191,468円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	702,743,037円

Oneグローバルバランス	8,324,750円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	698,721,986円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,217,676,675円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,469,908,256円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	397,152,202円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	818,803,013円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	711,149,666円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,352,119円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	503,003,585円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	36,330,259円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	141,979,694円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	145,999,241円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	226,484,099円
クルーズコントロール	744,714,501円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	168,044,942円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	494,168,528円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	542,567,671円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	168,767,510円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	231,045,804円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,123,735,235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)	258,326,231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)	264,600,550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)	106,316,279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)	161,898,192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)	255,636,599円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	492,509,140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)	274,510,334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)	230,497,335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)	320,033,637円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	4,889,119,300円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	2,609,757,399円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,557,214,039円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,285,983,925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)	94,948,564円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	48,110,643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)	438,289,325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)	370,217,686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)	236,434,886円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	13,609,927円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	37,424,397円

D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,683,665円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	331,947円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	15,813,511円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	42,638,231円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,699,038,264円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,405,027,751円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,503,836,566円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	62,146,769円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	129,190,760円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,523,355,377円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	348,023,362円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	154,610円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	301,361,787円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	271,559,414円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	424,258,808円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	51,102,920円
動的パッケージファンド<DC年金>	34,858,043円
コア資産形成ファンド	23,167,201円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	2,531,708,456円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	259,356,612円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	4,671,113,170円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,539,684,010円
計	86,195,830,752円
2. 受益権の総数	86,195,830,752口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	24,910,265,442
合計	24,910,265,442

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年2月22日から2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	1,300,000,000	-	-	1,302,225,034	2,225,034
アメリカ・ドル	727,314,000	-	-	729,537,262	2,223,262
イギリス・ポンド	52,322,000	-	-	51,940,035	381,965
オーストラリア・ドル	28,540,000	-	-	28,443,080	96,920
カナダ・ドル	26,695,000	-	-	26,743,037	48,037
ユーロ	465,129,000	-	-	465,561,620	432,620
合計	1,300,000,000	-	-	1,302,225,034	2,225,034

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年10月12日現在
1口当たり純資産額	2.0683円
(1万口当たり純資産額)	(20,683円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 01/15/24	1,660,000.000	1,571,553.120	
		US T N/B 0.125 02/15/24	4,800,000.000	4,528,874.970	
		US T N/B 0.125 10/15/23	120,000.000	114,979.680	
		US T N/B 0.125 12/15/23	2,160,000.000	2,052,168.730	
		US T N/B 0.25 03/15/24	3,910,000.000	3,683,953.120	
		US T N/B 0.25 05/15/24	7,500,000.000	7,016,601.520	
		US T N/B 0.25 05/31/25	3,890,000.000	3,494,314.060	
		US T N/B 0.25 06/15/24	3,780,000.000	3,525,735.910	
		US T N/B 0.25 06/30/25	3,500,000.000	3,136,875.000	
		US T N/B 0.25 07/31/25	3,800,000.000	3,392,093.750	
		US T N/B 0.25 08/31/25	3,590,000.000	3,192,856.250	
		US T N/B 0.25 09/30/23	2,500,000.000	2,404,101.550	
		US T N/B 0.25 09/30/25	3,720,000.000	3,300,773.400	
		US T N/B 0.25 10/31/25	4,000,000.000	3,535,156.240	
		US T N/B 0.25 11/15/23	800,000.000	764,125.000	
		US T N/B 0.375 01/31/26	3,700,000.000	3,250,796.860	
		US T N/B 0.375 04/15/24	4,140,000.000	3,892,893.740	
		US T N/B 0.375 04/30/25	2,560,000.000	2,315,500.000	
		US T N/B 0.375 07/15/24	4,000,000.000	3,730,937.470	
		US T N/B 0.375 07/31/27	3,780,000.000	3,159,991.390	
US T N/B 0.375 08/15/24	4,100,000.000	3,810,757.790			
US T N/B 0.375 09/15/24	2,000,000.000	1,853,750.000			
US T N/B 0.375 09/30/27	3,310,000.000	2,749,368.750			

US T N/B 0.375 11/30/25	3,190,000.000	2,821,654.680	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,000,000.000	2,647,382.790	
US T N/B 0.5 02/28/26	3,370,000.000	2,965,205.060	
US T N/B 0.5 03/31/25	2,860,000.000	2,606,063.280	
US T N/B 0.5 04/30/27	2,370,000.000	2,008,575.000	
US T N/B 0.5 05/31/27	1,980,000.000	1,673,100.000	
US T N/B 0.5 06/30/27	2,780,000.000	2,343,778.880	
US T N/B 0.5 08/31/27	3,060,000.000	2,567,650.770	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,660,000.000	3,048,951.540	
US T N/B 0.5 11/30/23	3,000,000.000	2,870,273.430	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,200,000.000	1,880,054.670	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,650,000.000	4,411,193.360	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,900,000.000	3,401,835.910	
US T N/B 0.625 08/15/30	8,100,000.000	6,284,460.880	
US T N/B 0.625 10/15/24	4,000,000.000	3,715,624.990	
US T N/B 0.625 11/30/27	2,700,000.000	2,259,984.370	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,320,000.000	2,771,032.810	
US T N/B 0.75 01/31/28	4,380,000.000	3,669,960.910	
US T N/B 0.75 03/31/26	3,220,000.000	2,851,460.910	
US T N/B 0.75 04/30/26	3,700,000.000	3,268,574.190	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,630,000.000	3,199,221.060	
US T N/B 0.75 08/31/26	2,950,000.000	2,578,138.660	
US T N/B 0.75 11/15/24	2,610,000.000	2,422,406.250	
US T N/B 0.75 12/31/23	1,990,000.000	1,901,382.810	
US T N/B 0.875 01/31/24	200,000.000	190,781.250	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,310,000.000	2,922,885.130	
US T N/B 0.875 09/30/26	3,110,000.000	2,724,894.510	
US T N/B 0.875 11/15/30	7,180,000.000	5,669,395.260	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,770,000.000	3,157,375.000	
US T N/B 1.0 12/15/24	4,610,000.000	4,291,261.690	
US T N/B 1.125 01/15/25	4,880,000.000	4,540,687.500	
US T N/B 1.125 02/15/31	7,890,000.000	6,333,574.150	
US T N/B 1.125 02/28/25	2,980,000.000	2,762,553.120	
US T N/B 1.125 02/28/27	1,100,000.000	964,648.430	
US T N/B 1.125 02/29/28	3,860,000.000	3,298,490.620	
US T N/B 1.125 05/15/40	2,300,000.000	1,410,367.170	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,160,000.000	1,920,440.600	
US T N/B 1.125 08/31/28	3,730,000.000	3,140,193.750	
US T N/B 1.125 10/31/26	3,390,000.000	2,994,323.430	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,610,000.000	3,097,549.190	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,010,000.000	3,430,742.940	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,373,797.620	
US T N/B 1.25 05/31/28	4,500,000.000	3,844,335.910	
US T N/B 1.25 06/30/28	3,710,000.000	3,163,064.820	
US T N/B 1.25 08/15/31	8,130,000.000	6,503,364.770	
US T N/B 1.25 08/31/24	2,870,000.000	2,709,907.810	
US T N/B 1.25 09/30/28	3,980,000.000	3,366,831.250	
US T N/B 1.25 11/30/26	3,700,000.000	3,279,558.560	
US T N/B 1.25 12/31/26	3,890,000.000	3,440,522.630	

US T N/B 1.375 01/31/25	750,000.000	701,191.390	
US T N/B 1.375 08/15/50	4,870,000.000	2,743,560.100	
US T N/B 1.375 08/31/26	1,100,000.000	986,304.680	
US T N/B 1.375 09/30/23	1,830,000.000	1,778,674.200	
US T N/B 1.375 10/31/28	3,210,000.000	2,732,010.930	
US T N/B 1.375 11/15/31	7,990,000.000	6,424,147.190	
US T N/B 1.375 11/15/40	3,190,000.000	2,024,403.880	
US T N/B 1.375 12/31/28	3,500,000.000	2,974,179.670	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,940,000.000	5,302,378.110	
US T N/B 1.5 02/15/25	4,550,000.000	4,260,292.940	
US T N/B 1.5 02/15/30	3,730,000.000	3,139,319.500	
US T N/B 1.5 02/29/24	4,000,000.000	3,841,562.480	
US T N/B 1.5 08/15/26	3,730,000.000	3,362,682.380	
US T N/B 1.5 09/30/24	4,310,000.000	4,081,704.680	
US T N/B 1.5 10/31/24	2,760,000.000	2,606,259.350	
US T N/B 1.5 11/30/24	2,300,000.000	2,166,132.800	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,424,687.480	
US T N/B 1.625 02/15/26	2,890,000.000	2,647,285.140	
US T N/B 1.625 05/15/26	3,670,000.000	3,345,434.370	
US T N/B 1.625 05/15/31	7,750,000.000	6,440,673.750	
US T N/B 1.625 08/15/29	3,960,000.000	3,390,131.240	
US T N/B 1.625 09/30/26	1,550,000.000	1,402,144.520	
US T N/B 1.625 10/31/23	2,800,000.000	2,721,031.230	
US T N/B 1.625 10/31/26	1,710,000.000	1,543,275.000	
US T N/B 1.625 11/15/50	4,780,000.000	2,887,045.260	
US T N/B 1.625 11/30/26	1,810,000.000	1,631,262.500	
US T N/B 1.75 01/31/29	3,000,000.000	2,601,796.860	
US T N/B 1.75 03/15/25	4,000,000.000	3,761,562.480	
US T N/B 1.75 06/30/24	1,340,000.000	1,281,479.680	
US T N/B 1.75 07/31/24	1,990,000.000	1,899,517.180	
US T N/B 1.75 08/15/41	4,930,000.000	3,306,181.250	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,050,000.000	1,768,765.620	
US T N/B 1.75 12/31/24	1,990,000.000	1,881,949.200	
US T N/B 1.75 12/31/26	2,110,000.000	1,908,478.490	
US T N/B 1.875 02/15/32	7,280,000.000	6,104,109.350	
US T N/B 1.875 02/15/41	4,700,000.000	3,265,765.610	
US T N/B 1.875 02/15/51	4,720,000.000	3,043,293.710	
US T N/B 1.875 02/28/27	3,610,000.000	3,273,254.680	
US T N/B 1.875 02/28/29	4,000,000.000	3,495,000.000	
US T N/B 1.875 06/30/26	1,880,000.000	1,725,781.240	
US T N/B 1.875 07/31/26	2,000,000.000	1,832,109.360	
US T N/B 1.875 08/31/24	820,000.000	783,100.000	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,070,000.000	3,261,832.000	
US T N/B 2.0 02/15/25	2,040,000.000	1,932,581.250	
US T N/B 2.0 02/15/50	3,720,000.000	2,488,912.490	
US T N/B 2.0 04/30/24	4,720,000.000	4,545,581.220	
US T N/B 2.0 05/31/24	800,000.000	769,437.490	
US T N/B 2.0 06/30/24	290,000.000	278,467.960	
US T N/B 2.0 08/15/25	4,280,000.000	4,011,831.240	

US T N/B 2.0 08/15/51	5,110,000.000	3,397,750.730	
US T N/B 2.0 11/15/26	2,830,000.000	2,590,113.260	
US T N/B 2.0 11/15/41	4,250,000.000	2,981,308.550	
US T N/B 2.125 02/29/24	1,650,000.000	1,597,921.870	
US T N/B 2.125 03/31/24	3,340,000.000	3,229,101.540	
US T N/B 2.125 05/15/25	3,950,000.000	3,734,755.840	
US T N/B 2.125 05/31/26	1,550,000.000	1,436,050.770	
US T N/B 2.125 07/31/24	380,000.000	364,889.060	
US T N/B 2.125 09/30/24	590,000.000	565,616.400	
US T N/B 2.125 11/30/23	2,000,000.000	1,949,218.740	
US T N/B 2.125 11/30/24	1,780,000.000	1,699,621.870	
US T N/B 2.25 01/31/24	710,000.000	689,698.430	
US T N/B 2.25 02/15/27	2,580,000.000	2,376,724.190	
US T N/B 2.25 02/15/52	4,300,000.000	3,042,250.000	
US T N/B 2.25 03/31/24	4,750,000.000	4,600,449.190	
US T N/B 2.25 03/31/26	1,300,000.000	1,214,078.110	
US T N/B 2.25 04/30/24	3,300,000.000	3,190,429.670	
US T N/B 2.25 05/15/41	3,420,000.000	2,536,410.900	
US T N/B 2.25 08/15/27	5,240,000.000	4,794,804.660	
US T N/B 2.25 08/15/46	2,070,000.000	1,456,924.200	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,040,000.000	2,166,712.460	
US T N/B 2.25 10/31/24	2,350,000.000	2,253,613.260	
US T N/B 2.25 11/15/24	3,080,000.000	2,950,062.500	
US T N/B 2.25 11/15/25	2,920,000.000	2,744,229.650	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,270,000.000	2,979,148.800	
US T N/B 2.25 12/31/23	280,000.000	272,781.250	
US T N/B 2.25 12/31/24	3,000,000.000	2,871,562.500	
US T N/B 2.375 02/15/42	3,610,000.000	2,712,858.570	
US T N/B 2.375 03/31/29	3,000,000.000	2,698,945.290	
US T N/B 2.375 04/30/26	1,760,000.000	1,647,868.730	
US T N/B 2.375 05/15/27	4,430,000.000	4,090,828.110	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,470,000.000	3,116,764.800	
US T N/B 2.375 05/15/51	4,760,000.000	3,469,593.740	
US T N/B 2.375 08/15/24	4,610,000.000	4,446,128.880	
US T N/B 2.375 11/15/49	2,760,000.000	2,025,365.600	
US T N/B 2.5 01/31/24	2,550,000.000	2,484,855.440	
US T N/B 2.5 01/31/25	3,550,000.000	3,407,445.310	
US T N/B 2.5 02/15/45	2,310,000.000	1,722,935.130	
US T N/B 2.5 02/15/46	1,770,000.000	1,314,363.260	
US T N/B 2.5 02/28/26	580,000.000	546,853.890	
US T N/B 2.5 03/31/27	2,650,000.000	2,464,603.500	
US T N/B 2.5 04/30/24	4,010,000.000	3,892,206.250	
US T N/B 2.5 05/15/24	5,100,000.000	4,948,593.750	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,130,000.000	1,578,612.870	
US T N/B 2.5 05/31/24	4,180,000.000	4,051,824.180	
US T N/B 2.625 01/31/26	2,460,000.000	2,329,120.290	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,330,000.000	3,962,288.250	
US T N/B 2.625 03/31/25	1,790,000.000	1,719,378.880	
US T N/B 2.625 04/15/25	3,000,000.000	2,876,601.540	

US T N/B 2.625 05/31/27	1,040,000.000	971,912.500	
US T N/B 2.625 07/31/29	2,570,000.000	2,343,819.900	
US T N/B 2.625 12/31/23	3,530,000.000	3,451,126.550	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,290,000.000	2,170,669.510	
US T N/B 2.75 02/15/24	2,090,000.000	2,041,995.300	
US T N/B 2.75 02/15/28	4,580,000.000	4,265,840.610	
US T N/B 2.75 02/28/25	1,960,000.000	1,890,328.100	
US T N/B 2.75 04/30/27	3,000,000.000	2,818,007.790	
US T N/B 2.75 05/15/25	4,000,000.000	3,841,875.000	
US T N/B 2.75 05/31/29	2,500,000.000	2,299,414.050	
US T N/B 2.75 06/30/25	1,040,000.000	998,074.990	
US T N/B 2.75 07/31/27	1,000,000.000	937,421.870	
US T N/B 2.75 08/15/42	1,540,000.000	1,227,668.750	
US T N/B 2.75 08/15/47	2,240,000.000	1,748,949.990	
US T N/B 2.75 08/31/25	1,830,000.000	1,750,652.320	
US T N/B 2.75 11/15/23	6,360,000.000	6,246,215.590	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,556,000.000	1,236,776.870	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,360,000.000	1,843,750.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	2,000,000.000	1,928,593.740	
US T N/B 2.875 04/30/29	3,000,000.000	2,780,390.600	
US T N/B 2.875 05/15/28	4,090,000.000	3,822,871.870	
US T N/B 2.875 05/15/32	6,650,000.000	6,082,412.050	
US T N/B 2.875 05/15/43	2,290,000.000	1,851,142.940	
US T N/B 2.875 05/15/49	2,300,000.000	1,871,085.920	
US T N/B 2.875 05/15/52	4,510,000.000	3,687,101.150	
US T N/B 2.875 05/31/25	1,570,000.000	1,511,002.320	
US T N/B 2.875 06/15/25	1,000,000.000	962,500.000	
US T N/B 2.875 07/31/25	2,200,000.000	2,115,437.500	
US T N/B 2.875 08/15/28	4,530,000.000	4,223,517.180	
US T N/B 2.875 08/15/45	1,770,000.000	1,413,234.370	
US T N/B 2.875 09/30/23	1,220,000.000	1,203,749.200	
US T N/B 2.875 10/31/23	3,990,000.000	3,928,903.120	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,080,000.000	862,818.740	
US T N/B 2.875 11/30/25	2,360,000.000	2,257,671.860	
US T N/B 3.0 02/15/47	1,960,000.000	1,603,678.090	
US T N/B 3.0 02/15/48	2,650,000.000	2,181,281.250	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,310,000.000	2,758,419.500	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,080,000.000	901,800.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	400,000.000	326,812.500	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,620,000.000	1,325,489.040	
US T N/B 3.0 07/15/25	3,200,000.000	3,086,749.970	
US T N/B 3.0 08/15/48	2,810,000.000	2,322,640.620	
US T N/B 3.0 09/30/25	1,750,000.000	1,685,195.300	
US T N/B 3.0 10/31/25	1,270,000.000	1,221,233.970	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,560,000.000	1,276,275.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	860,000.000	702,176.550	
US T N/B 3.125 02/15/42	860,000.000	735,635.930	
US T N/B 3.125 02/15/43	390,000.000	329,001.550	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,830,000.000	2,392,234.370	

US T N/B 3.125 08/15/25	2,030,000.000	1,963,311.310	
US T N/B 3.125 08/15/44	2,090,000.000	1,749,395.300	
US T N/B 3.125 08/31/27	1,730,000.000	1,651,068.750	
US T N/B 3.125 11/15/28	4,380,000.000	4,135,678.110	
US T N/B 3.125 11/15/41	1,020,000.000	872,020.300	
US T N/B 3.25 05/15/42	2,070,000.000	1,802,436.310	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,500,000.000	3,357,812.500	
US T N/B 3.25 06/30/29	2,000,000.000	1,897,421.860	
US T N/B 3.375 05/15/44	1,430,000.000	1,249,350.760	
US T N/B 3.375 08/15/42	1,500,000.000	1,333,593.750	
US T N/B 3.375 11/15/48	3,200,000.000	2,849,249.960	
US T N/B 3.5 02/15/39	500,000.000	469,023.420	
US T N/B 3.5 09/15/25	3,000,000.000	2,930,390.640	
US T N/B 3.625 02/15/44	1,630,000.000	1,484,573.430	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,470,000.000	1,345,624.200	
US T N/B 3.75 08/15/41	820,000.000	773,106.240	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,360,000.000	1,266,712.500	
US T N/B 3.875 08/15/40	1,290,000.000	1,248,175.760	
US T N/B 4.25 05/15/39	950,000.000	975,679.680	
US T N/B 4.375 02/15/38	600,000.000	629,484.370	
US T N/B 4.375 05/15/40	910,000.000	942,632.020	
US T N/B 4.375 05/15/41	1,150,000.000	1,185,218.750	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,000,000.000	1,039,843.750	
US T N/B 4.5 02/15/36	900,000.000	960,960.930	
US T N/B 4.5 05/15/38	600,000.000	637,546.860	
US T N/B 4.5 08/15/39	980,000.000	1,036,809.360	
US T N/B 4.625 02/15/40	890,000.000	952,995.290	
US T N/B 4.75 02/15/41	830,000.000	898,799.210	
US T N/B 5.0 05/15/37	555,000.000	621,036.320	
US T N/B 5.25 11/15/28	850,000.000	897,812.500	
US T N/B 5.375 02/15/31	860,000.000	941,968.750	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,100,000.000	1,156,632.800	
US T N/B 6.125 11/15/27	900,000.000	977,906.250	
US T N/B 6.25 05/15/30	759,000.000	866,861.000	
アメリカ・ドル 小計	728,500,000.000 (106,506,700,000)	637,687,189.240 (93,229,867,066)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	950,000.000	823,555.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,800,000.000	1,707,858.000
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	250,000.000	198,815.000
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	1,350,000.000	1,222,168.500
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,470,000.000	1,024,310.700
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,390,000.000	1,178,803.940

UK TREASURY 0.375 10/22/30	1,220,000.000	888,904.200	
UK TREASURY 0.5 01/31/29	680,000.000	530,440.800	
UK TREASURY 0.5 10/22/61	300,000.000	84,973.800	
UK TREASURY 0.625 06/07/25	860,000.000	779,967.020	
UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,350,000.000	833,652.000	
UK TREASURY 0.625 10/22/50	450,000.000	165,062.510	
UK TREASURY 0.875 01/31/46	870,000.000	384,888.000	
UK TREASURY 0.875 07/31/33	700,000.000	482,441.680	
UK TREASURY 0.875 10/22/29	670,000.000	526,908.100	
UK TREASURY 1.0 01/31/32	1,900,000.000	1,396,595.000	
UK TREASURY 1.0 04/22/24	950,000.000	905,502.000	
UK TREASURY 1.125 01/31/39	760,000.000	444,075.600	
UK TREASURY 1.125 10/22/73	1,210,000.000	430,566.400	
UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,000,000.000	860,280.000	
UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,330,000.000	601,300.980	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	1,300,000.000	717,769.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,100,000.000	987,855.000	
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,000,000.000	518,956.000	
UK TREASURY 1.5 07/31/53	350,000.000	167,254.500	
UK TREASURY 1.625 10/22/28	930,000.000	791,885.700	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	870,000.000	427,135.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	830,000.000	382,439.100	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	630,000.000	344,167.740	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	680,000.000	345,725.600	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,390,000.000	943,073.300	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	890,000.000	833,912.200	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	1,100,000.000	693,935.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	810,000.000	787,647.240	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,470,000.000	1,140,808.200	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,350,000.000	1,086,222.410	

	UK TREASURY 3.5 07/22/68	930,000.000	760,461.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	870,000.000	729,460.200	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	900,000.000	807,595.200	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,100,000.000	1,046,705.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	1,170,000.000	1,153,707.750	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,000,000.000	924,850.790	
	UK TREASURY 4.25 12/07/27	910,000.000	897,936.290	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,070,000.000	984,457.780	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	1,080,000.000	975,278.440	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	1,017,000.000	926,320.210	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,212,000.000	1,117,694.280	
	UK TREASURY 4.5 09/07/34	900,000.000	896,139.000	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	1,265,000.000	1,197,468.480	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	1,095,000.000	1,121,739.900	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	980,000.000	968,524.200	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,095,000.000	1,107,756.750	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	680,000.000	731,890.800	
	イギリス・ボンド 小計	53,434,000.000 (8,572,416,620)	41,987,841.490 (6,736,109,410)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	290,000.000	273,730.130	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	260,000.000	236,990.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,890,000.000	1,763,638.380	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,860,000.000	2,429,770.200	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,450,000.000	1,115,922.900	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	2,300,000.000	2,205,189.400	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,110,000.000	1,998,127.800	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,460,000.000	1,376,909.940	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	1,630,000.000	1,644,120.690	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,250,000.000	1,250,353.750	

	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	1,190,000.000	1,505,094.150	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	220,000.000	244,343.440	
イスラエル・シュケル 小計		16,910,000.000 (689,767,355)	16,044,190.780 (654,450,564)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,590,000.000	1,489,606.300	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	1,230,000.000	1,111,818.570	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	1,510,000.000	1,338,385.190	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	2,020,000.000	1,558,889.640	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,670,000.000	1,325,395.290	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	1,890,000.000	1,475,929.880	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	1,610,000.000	1,316,558.410	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,350,000.000	792,180.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	1,370,000.000	1,112,240.160	
	AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	800,000.000	741,200.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	1,810,000.000	1,641,440.230	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	1,160,000.000	1,152,875.240	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	900,000.000	719,424.100	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	650,000.000	559,713.750	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,230,000.000	1,177,602.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	360,000.000	339,461.300	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	1,550,000.000	1,446,150.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	980,000.000	785,404.680	
	AUSTRALIAN 3.0 11/21/33	1,110,000.000	1,004,126.970	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	1,380,000.000	1,373,164.550	
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	1,100,000.000	1,062,946.990		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	520,000.000	454,991.580		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	930,000.000	880,763.150		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	1,200,000.000	1,226,566.660		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	1,030,000.000	1,070,543.270		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,440,000.000	1,505,483.130		
オーストラリア・ドル 小計		32,390,000.000 (2,965,952,300)	28,662,861.040 (2,624,658,185)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	4,200,000.000	4,211,822.160	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	8,500,000.000	8,478,155.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.24 05/25/25	8,490,000.000	8,486,812.170	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	23,500,000.000	23,521,081.850	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	12,000,000.000	12,058,678.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	15,300,000.000	15,427,699.920	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	30,100,000.000	30,065,987.000	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	12,410,000.000	12,402,389.190	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	17,000,000.000	17,123,420.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	2,300,000.000	2,270,924.820	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	6,600,000.000	6,547,511.580	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	26,600,000.000	26,880,515.620	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	3,000,000.000	2,988,857.610	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	20,000,000.000	19,922,669.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 06/15/29	17,000,000.000	17,044,710.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	3,000,000.000	2,996,975.520	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,071,436.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.88 11/05/23	730,000.000	737,892.900	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.89 11/18/31	4,100,000.000	4,130,734.830	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	15,600,000.000	15,815,138.040	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	1,000,000.000	1,017,891.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	3,500,000.000	3,629,880.800	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.29 10/18/23	800,000.000	811,947.520	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	8,320,000.000	8,578,296.060	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	18,950,000.000	20,205,342.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	2,100,000.000	2,299,029.180	
	オフショア・人民元 小計	276,100,000.000 (5,623,328,700)	278,725,800.920 (5,676,808,387)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	1,010,000.000	896,106.340	
	CANADA 0.25 04/01/24	1,500,000.000	1,418,865.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	1,910,000.000	1,734,853.000	
	CANADA 0.5 11/01/23	620,000.000	596,887.640	
	CANADA 0.5 12/01/30	1,800,000.000	1,419,933.600	
	CANADA 0.75 02/01/24	1,200,000.000	1,148,644.800	
	CANADA 0.75 10/01/24	810,000.000	760,085.370	
	CANADA 1.0 06/01/27	550,000.000	489,728.250	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,270,000.000	1,144,520.190	
	CANADA 1.25 03/01/25	700,000.000	656,359.200	

CANADA 1.25 03/01/27	970,000.000	875,646.160	
CANADA 1.25 06/01/30	1,850,000.000	1,573,937.450	
CANADA 1.5 04/01/25	1,300,000.000	1,223,827.800	
CANADA 1.5 05/01/24	940,000.000	903,022.280	
CANADA 1.5 06/01/26	700,000.000	646,872.800	
CANADA 1.5 06/01/31	2,070,000.000	1,763,097.660	
CANADA 1.5 09/01/24	440,000.000	419,944.360	
CANADA 1.5 12/01/31	2,440,000.000	2,064,488.880	
CANADA 1.75 12/01/53	1,610,000.000	1,121,250.690	
CANADA 2.0 06/01/28	730,000.000	673,812.630	
CANADA 2.0 06/01/32	1,740,000.000	1,533,206.220	
CANADA 2.0 12/01/51	2,580,000.000	1,937,218.800	
CANADA 2.25 03/01/24	900,000.000	877,585.500	
CANADA 2.25 06/01/25	800,000.000	766,787.200	
CANADA 2.25 06/01/29	430,000.000	398,855.100	
CANADA 2.25 12/01/29	500,000.000	462,108.500	
CANADA 2.5 06/01/24	970,000.000	945,965.340	
CANADA 2.5 12/01/32	300,000.000	275,736.600	
CANADA 2.75 08/01/24	590,000.000	576,391.650	
CANADA 2.75 09/01/27	570,000.000	548,055.570	
CANADA 2.75 12/01/48	820,000.000	731,973.820	
CANADA 2.75 12/01/64	510,000.000	444,928.590	
CANADA 3.5 12/01/45	700,000.000	708,761.200	
CANADA 4.0 06/01/41	570,000.000	611,197.890	
CANADA 5.0 06/01/37	340,000.000	398,049.560	
CANADA 5.75 06/01/29	690,000.000	781,796.910	
CANADA 5.75 06/01/33	610,000.000	731,639.490	
カナダ・ドル 小計	38,040,000.000 (4,032,620,400)	34,262,142.040 (3,632,129,678)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	380,000.000	347,510.000
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	410,000.000	374,330.000
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	350,000.000	299,846.260
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	490,000.000	369,460.000
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	490,000.000	373,039.450
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	280,000.000	275,324.000
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	370,000.000	352,314.000
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	590,000.000	527,999.850
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	730,000.000	711,020.000
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	10,000.000	8,790.000
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	420,000.000	400,260.000
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	500,000.000	459,000.000
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	340,000.000	314,916.500
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	550,000.000	527,450.000
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	620,000.000	590,798.000
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	660,000.000	657,049.800
SINGAPORE 3.375 09/01/33	330,000.000	327,195.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	800,000.000	797,600.000	
シンガポール・ドル 小計	8,320,000.000	7,713,902.860	

		(845,395,200)	(783,809,670)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	3,040,000.000	2,526,031.450	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	2,890,000.000	2,641,457.500	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	3,010,000.000	2,690,549.900	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	6,210,000.000	5,865,347.150	
	SWEDEN 1.5 11/13/23	5,780,000.000	5,737,993.440	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	3,300,000.000	3,302,343.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	8,440,000.000	8,448,461.100	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	3,900,000.000	4,604,540.060	
スウェーデン・クローナ 小計		36,570,000.000 (470,655,900)	35,816,723.600 (460,961,233)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	2,050,000.000	1,961,542.500	
	DENMARK 0.0 11/15/31	4,180,000.000	3,268,942.550	
	DENMARK 0.25 11/15/52	2,280,000.000	1,143,299.160	
	DENMARK 0.5 11/15/27	6,350,000.000	5,754,068.360	
	DENMARK 0.5 11/15/29	5,750,000.000	4,972,385.740	
	DENMARK 1.75 11/15/25	5,540,000.000	5,457,744.890	
	DENMARK 4.5 11/15/39	7,810,000.000	9,543,087.400	
デンマーク・クローネ 小計		33,960,000.000 (647,617,200)	32,101,070.600 (612,167,416)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	2,650,000.000	2,177,793.850	
	NORWAY 1.375 08/19/30	4,310,000.000	3,654,302.460	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,400,000.000	4,111,527.200	
	NORWAY 1.75 02/17/27	2,400,000.000	2,222,479.920	
	NORWAY 1.75 03/13/25	5,200,000.000	4,984,636.800	
	NORWAY 1.75 09/06/29	3,420,000.000	3,033,177.480	
	NORWAY 2.0 04/26/28	2,070,000.000	1,905,642.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	1,100,000.000	966,460.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	2,770,000.000	2,753,588.540	
ノルウェー・クローネ 小計		28,320,000.000 (384,302,400)	25,809,608.250 (350,236,384)	
ポーランド・ズ ロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,880,000.000	1,406,240.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	2,570,000.000	2,179,488.500	
	POLAND 07/25/24	1,710,000.000	1,501,731.140	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,930,000.000	2,433,456.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	1,660,000.000	1,000,648.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	2,150,000.000	1,936,490.360	
	POLAND 2.5 04/25/24	780,000.000	725,298.600	
	POLAND 2.5 07/25/26	2,790,000.000	2,319,396.750	
	POLAND 2.5 07/25/27	2,360,000.000	1,861,686.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,480,000.000	2,714,643.600	
	POLAND 2.75 10/25/29	710,000.000	518,406.500	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,780,000.000	2,468,362.000	
	POLAND 4.0 10/25/23	2,740,000.000	2,649,936.200	
POLAND 5.75 04/25/29	1,440,000.000	1,299,844.800		

ポーランド・ズロチ 小計		30,980,000.000 (905,576,380)	25,015,628.450 (731,231,835)	
マレーシア・リンギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,000,000.000	867,526.720	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,000,000.000	996,371.720	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	1,400,000.000	1,306,695.260	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,941,405.760	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,300,000.000	1,124,214.200	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,820,000.000	1,664,822.140	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	1,660,000.000	1,552,628.870	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	300,000.000	299,801.610	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	400,000.000	385,773.520	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	600,000.000	592,400.920	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,430,000.000	1,410,395.450	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,660,000.000	1,642,829.490	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	320,000.000	317,843.620	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	2,400,000.000	2,398,134.240	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	900,000.000	904,858.830	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	400,000.000	344,784.680	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,030,000.000	1,037,919.360	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	480,000.000	469,568.540	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,050,000.000	1,060,410.640	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,200,000.000	1,199,327.730	
	MALAYSIA 4.504 04/30/29	300,000.000	303,455.730	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	500,000.000	497,456.780	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	680,000.000	665,400.730	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	300,000.000	283,993.400		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	1,700,000.000	1,705,646.210		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	620,000.000	621,520.480		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,990,000.000	1,920,080.560		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	1,600,000.000	1,589,965.120		
マレーシア・リンギット 小計		30,040,000.000 (939,290,720)	29,105,232.310 (910,062,404)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	7,880,000.000	6,651,902.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	1,700,000.000	1,513,901.000	
	MEXICAN BONDS 07/31/53	2,500,000.000	2,079,808.950	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,085,000.000	5,168,139.750	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	17,802,000.000	17,714,414.160	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	28,522,000.000	25,061,996.180	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	21,546,000.000	19,656,415.800	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	23,558,000.000	20,835,637.520	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	15,977,000.000	13,112,004.360	

	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	8,435,000.000	7,218,673.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,070,000.000	21,194,703.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	14,801,000.000	12,321,092.450	
	MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	15,151,000.000	14,710,408.920	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	20,159,000.000	18,924,261.250	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	15,642,000.000	13,996,461.600	
	メキシコ・ペソ 小計	220,828,000.000 (1,609,394,464)	200,159,820.740 (1,458,764,774)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	850,000.000	693,802.300	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	710,000.000	559,711.350	
	AUSTRIA 0.0 04/20/25	580,000.000	550,328.360	
	AUSTRIA 0.0 10/20/28	370,000.000	315,329.540	
	AUSTRIA 0.0 10/20/40	410,000.000	232,511.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	380,000.000	256,842.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	920,000.000	804,128.760	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	1,010,000.000	927,780.950	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	210,000.000	88,931.850	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	835,000.000	759,815.760	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	500,000.000	282,460.000	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,070,000.000	1,005,572.090	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	300,000.000	121,564.800	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	400,000.000	332,163.200	
	AUSTRIA 07/15/24	860,000.000	832,755.200	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	820,000.000	796,529.140	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	640,000.000	464,734.720	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	180,000.000	102,816.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	740,000.000	736,451.700	
	AUSTRIA 1.75 10/20/23	900,000.000	899,533.800	
	AUSTRIA 1.85 05/23/49	280,000.000	217,571.200	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	390,000.000	281,880.300	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	620,000.000	578,838.200	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	490,000.000	495,878.530	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	230,000.000	262,486.580	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	940,000.000	1,039,546.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	610,000.000	663,707.450	
	AUSTRIA 6.25 07/15/27	415,000.000	485,832.200	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	580,000.000	513,706.000	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	940,000.000	731,972.360	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	660,480.000	
	BELGIUM 0.2 10/22/23	810,000.000	796,902.300	
	BELGIUM 0.35 06/22/32	800,000.000	626,960.000	
	BELGIUM 0.4 06/22/40	330,000.000	203,392.070	
	BELGIUM 0.5 10/22/24	750,000.000	729,007.030	

BELGIUM 0.65 06/22/71	520,000.000	208,549.120	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,400,000.000	1,356,364.800	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,110,000.000	1,034,020.500	
BELGIUM 0.8 06/22/28	890,000.000	811,324.000	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,180,000.000	1,059,427.600	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,030,000.000	987,400.630	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,070,000.000	928,522.460	
BELGIUM 1.25 04/22/33	810,000.000	690,473.970	
BELGIUM 1.4 06/22/53	610,000.000	389,039.260	
BELGIUM 1.45 06/22/37	530,000.000	420,022.350	
BELGIUM 1.6 06/22/47	780,000.000	561,171.000	
BELGIUM 1.7 06/22/50	790,000.000	563,823.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	610,000.000	509,972.200	
BELGIUM 2.15 06/22/66	450,000.000	347,760.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	390,000.000	313,564.680	
BELGIUM 2.6 06/22/24	1,040,000.000	1,052,360.400	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,180,000.000	1,170,808.980	
BELGIUM 3.75 06/22/45	560,000.000	597,454.480	
BELGIUM 4.0 03/28/32	630,000.000	688,899.700	
BELGIUM 4.25 03/28/41	1,250,000.000	1,402,001.250	
BELGIUM 4.5 03/28/26	610,000.000	656,907.780	
BELGIUM 5.0 03/28/35	1,320,000.000	1,566,246.000	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,390,000.000	1,608,509.390	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	2,110,000.000	1,977,006.700	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,590,000.000	1,520,456.580	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	1,360,000.000	1,242,894.480	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,360,000.000	1,257,374.400	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,750,000.000	1,657,215.000	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	650,000.000	617,012.500	
BUNDESOBL 04/05/24	1,260,000.000	1,228,872.070	
BUNDESOBL 10/13/23	1,540,000.000	1,512,711.200	
BUNDESOBL 10/18/24	1,590,000.000	1,534,365.900	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,500,000.000	1,464,585.000	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	60,000.000	58,815.780	
BUNDESSCHAT 0.2 06/14/24	1,250,000.000	1,217,875.000	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	900,000.000	875,763.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	1,820,000.000	1,555,608.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	1,540,000.000	1,283,990.400	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,620,000.000	2,124,421.760	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,660,000.000	1,223,735.400	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	1,580,000.000	1,137,015.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	2,630,000.000	2,221,166.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	590,000.000	498,343.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,890,000.000	1,554,940.800	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	800,000.000	659,021.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,230,000.000	1,179,632.350	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	710,000.000	376,718.900	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,130,000.000	572,322.400	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,620,000.000	1,461,807.000	

DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	2,060,000.000	1,816,302.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	2,120,000.000	1,970,836.800	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	2,080,000.000	1,852,990.880	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	1,070,000.000	962,860.900	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,900,000.000	1,843,589.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	2,010,000.000	1,921,580.100	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	2,440,000.000	2,251,266.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,910,000.000	1,779,890.800	
DEUTSCHLAND 08/15/26	1,980,000.000	1,841,801.940	
DEUTSCHLAND 08/15/29	1,990,000.000	1,721,937.050	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	350,000.000	282,292.500	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	1,820,000.000	1,796,160.480	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	1,620,000.000	1,582,610.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,040,000.000	1,616,314.440	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,520,000.000	1,515,351.840	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,430,000.000	1,432,330.900	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	1,810,000.000	1,833,349.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,240,000.000	2,292,962.560	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,330,000.000	1,493,151.100	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,830,000.000	2,167,053.060	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,430,000.000	1,769,653.600	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	160,000.000	182,516.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,320,000.000	1,641,367.200	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,410,000.000	1,866,036.300	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,520,000.000	1,891,032.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,310,000.000	1,537,023.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	910,000.000	959,613.200	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	780,000.000	990,646.800	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	850,000.000	1,015,282.500	
FINLAND 0.0 09/15/24	430,000.000	414,511.400	
FINLAND 0.0 09/15/26	210,000.000	191,163.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	210,000.000	168,558.230	
FINLAND 0.125 04/15/36	290,000.000	196,664.810	
FINLAND 0.125 04/15/52	280,000.000	126,412.720	
FINLAND 0.125 09/15/31	300,000.000	235,825.800	
FINLAND 0.25 09/15/40	290,000.000	177,015.420	
FINLAND 0.5 04/15/26	460,000.000	433,411.080	

FINLAND 0.5 04/15/43	280,000.000	170,942.800	
FINLAND 0.5 09/15/27	420,000.000	381,668.280	
FINLAND 0.5 09/15/28	560,000.000	494,053.840	
FINLAND 0.5 09/15/29	300,000.000	258,218.550	
FINLAND 0.75 04/15/31	200,000.000	168,843.840	
FINLAND 0.875 09/15/25	330,000.000	317,122.740	
FINLAND 1.125 04/15/34	580,000.000	472,382.740	
FINLAND 1.375 04/15/27	90,000.000	85,821.310	
FINLAND 1.375 04/15/47	310,000.000	226,665.180	
FINLAND 2.0 04/15/24	430,000.000	431,303.230	
FINLAND 2.625 07/04/42	340,000.000	315,020.880	
FINLAND 2.75 07/04/28	540,000.000	543,857.760	
FINLAND 4.0 07/04/25	130,000.000	136,562.160	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	1,620,000.000	1,579,812.980	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,990,000.000	1,895,081.910	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,910,000.000	2,706,361.110	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	2,450,000.000	2,216,132.800	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,800,000.000	2,143,400.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,890,000.000	2,416,276.980	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,480,000.000	2,816,210.880	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,270,000.000	2,554,190.460	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	2,620,000.000	2,414,180.660	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	3,060,000.000	2,937,888.470	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,260,000.000	3,069,351.940	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	3,590,000.000	3,156,417.750	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,650,000.000	1,053,548.100	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	790,000.000	295,675.670	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	1,150,000.000	680,328.500	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	940,000.000	859,959.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	3,460,000.000	3,153,617.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	2,360,000.000	1,282,749.680	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,650,000.000	875,374.500	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	3,400,000.000	3,071,492.000	
FRANCE OAT 03/25/24	3,020,000.000	2,940,371.660	
FRANCE OAT 03/25/25	3,320,000.000	3,157,605.520	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	2,360,000.000	2,223,474.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	2,740,000.000	2,647,444.170	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	2,860,000.000	2,365,360.140	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	2,390,000.000	1,899,094.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,780,000.000	3,457,611.360	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,630,000.000	1,830,711.440	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	990,000.000	681,006.150	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,070,000.000	1,706,673.600	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	2,790,000.000	2,775,165.570	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,950,000.000	1,549,294.500	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	2,500,000.000	2,513,204.490	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,930,000.000	3,924,880.130	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	3,490,000.000	3,548,848.380	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,030,000.000	2,048,797.800	

FRANCE OAT 3.5 04/25/26	3,000,000.000	3,132,300.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,140,000.000	1,314,420.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,170,000.000	1,363,577.670	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,940,000.000	2,134,403.520	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	3,375,000.000	3,457,950.750	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,640,000.000	3,098,288.160	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,980,000.000	2,317,526.430	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	2,780,000.000	3,264,498.400	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	2,510,000.000	3,127,083.500	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	2,170,000.000	2,414,053.390	
IRISH 0.0 10/18/31	770,000.000	604,191.280	
IRISH 0.2 05/15/27	520,000.000	473,230.160	
IRISH 0.2 10/18/30	550,000.000	455,215.320	
IRISH 0.35 10/18/32	60,000.000	47,114.110	
IRISH 0.4 05/15/35	390,000.000	286,355.160	
IRISH 0.55 04/22/41	240,000.000	152,108.900	
IRISH 0.9 05/15/28	700,000.000	644,617.400	
IRISH 1.0 05/15/26	800,000.000	769,829.600	
IRISH 1.1 05/15/29	600,000.000	549,944.230	
IRISH 1.3 05/15/33	390,000.000	334,578.130	
IRISH 1.35 03/18/31	360,000.000	327,110.400	
IRISH 1.5 05/15/50	450,000.000	311,726.250	
IRISH 1.7 05/15/37	490,000.000	410,636.660	
IRISH 2.0 02/18/45	730,000.000	593,847.700	
IRISH 2.4 05/15/30	590,000.000	584,989.130	
IRISH 3.4 03/18/24	390,000.000	398,549.580	
IRISH 5.4 03/13/25	750,000.000	810,448.500	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,000,000.000	967,180.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	850,000.000	752,165.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	1,400,000.000	1,344,140.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	1,250,000.000	1,092,000.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	890,000.000	844,565.500	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	1,360,000.000	1,275,612.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	1,460,000.000	1,198,952.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	1,800,000.000	1,690,732.800	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	1,200,000.000	956,520.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,610,000.000	1,461,942.790	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,100,000.000	903,540.000	
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	1,380,000.000	1,355,309.040	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	1,310,000.000	1,167,341.000	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	1,900,000.000	1,433,876.800	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	1,080,000.000	671,760.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	1,380,000.000	1,000,500.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,350,000.000	1,052,460.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	1,180,000.000	1,030,848.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,300,000.000	958,080.500	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,100,000.000	981,090.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	1,500,000.000	1,411,800.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	1,530,000.000	1,393,424.550	

ITALY BTPS 1.35 04/01/30	1,750,000.000	1,428,941.500	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	1,120,000.000	773,584.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	1,540,000.000	1,471,131.200	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	1,040,000.000	1,009,068.320	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	810,000.000	462,429.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	1,460,000.000	1,395,415.440	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,350,000.000	1,263,465.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,690,000.000	1,328,909.530	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	1,740,000.000	1,421,127.600	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	1,020,000.000	570,595.850	
ITALY BTPS 1.75 05/30/24	360,000.000	353,426.400	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,200,000.000	1,177,770.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,240,000.000	804,884.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	990,000.000	974,922.300	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	1,400,000.000	1,346,660.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,350,000.000	1,228,699.800	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	1,200,000.000	1,151,545.200	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	1,640,000.000	1,517,295.200	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	890,000.000	845,800.820	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	360,000.000	201,744.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	510,000.000	311,967.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	1,290,000.000	1,207,956.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	860,000.000	664,522.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	1,330,000.000	1,081,317.670	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,150,000.000	769,350.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	930,000.000	929,852.130	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,350,000.000	1,315,172.700	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	1,637,000.000	1,619,813.130	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	840,000.000	696,838.800	
ITALY BTPS 2.65 12/01/27	300,000.000	282,150.000	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	1,330,000.000	974,092.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	700,000.000	466,760.000	
ITALY BTPS 2.8 06/15/29	1,200,000.000	1,103,400.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	2,040,000.000	1,907,897.760	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	1,210,000.000	967,395.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	1,610,000.000	1,502,753.070	
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	1,240,000.000	1,007,048.640	
ITALY BTPS 3.25 03/01/38	600,000.000	501,600.000	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,180,000.000	953,802.260	
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	1,020,000.000	894,799.080	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,190,000.000	989,382.660	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	1,870,000.000	1,791,656.350	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,620,000.000	1,644,674.860	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	850,000.000	750,249.950	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,830,000.000	1,718,370.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	1,710,000.000	1,750,204.660	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,910,000.000	1,979,333.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	1,680,000.000	1,744,984.080	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	1,110,000.000	1,122,186.690	

ITALY BTPS 5.0 03/01/25	60,000.000	62,539.860	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	1,660,000.000	1,717,436.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	830,000.000	859,133.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,550,000.000	1,607,195.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	2,140,000.000	2,296,862.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,530,000.000	1,678,716.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,480,000.000	2,776,608.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	1,510,000.000	1,700,713.000	
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	350,000.000	400,225.000	
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	1,270,000.000	1,354,289.900	
NETHERLANDS 0.0 01/15/26	640,000.000	598,655.260	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,180,000.000	1,076,934.080	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	910,000.000	783,941.340	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	550,000.000	361,408.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,000,000.000	476,574.000	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	700,000.000	580,484.800	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	700,000.000	564,501.000	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	630,000.000	601,603.690	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	860,000.000	746,197.920	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	920,000.000	635,077.840	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	1,160,000.000	1,094,228.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	1,160,000.000	1,084,199.800	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	1,380,000.000	1,264,578.180	
NETHERLANDS 01/15/24	1,440,000.000	1,407,611.520	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	1,440,000.000	1,444,268.160	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,110,000.000	1,093,591.240	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,520,000.000	1,544,795.760	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,330,000.000	1,521,606.450	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	1,190,000.000	1,350,293.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	490,000.000	564,725.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,400,000.000	1,328,600.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,470,000.000	1,356,085.580	
SPAIN 0.0 01/31/27	430,000.000	383,495.500	
SPAIN 0.0 01/31/28	1,160,000.000	996,324.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	1,260,000.000	1,217,578.060	
SPAIN 0.0 05/31/25	670,000.000	629,617.760	
SPAIN 0.1 04/30/31	1,840,000.000	1,408,520.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,080,000.000	1,043,622.360	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,500,000.000	1,242,030.000	
SPAIN 0.5 10/31/31	1,640,000.000	1,283,987.160	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,295,704.980	
SPAIN 0.7 04/30/32	1,550,000.000	1,213,495.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,750,000.000	1,591,362.500	

	SPAIN 0.8 07/30/29	700,000.000	602,455.000	
	SPAIN 0.85 07/30/37	730,000.000	491,735.300	
	SPAIN 1.0 07/30/42	540,000.000	337,392.000	
	SPAIN 1.0 10/31/50	1,240,000.000	648,852.320	
	SPAIN 1.2 10/31/40	1,260,000.000	837,821.110	
	SPAIN 1.25 10/31/30	1,750,000.000	1,511,125.000	
	SPAIN 1.3 10/31/26	1,730,000.000	1,650,227.970	
	SPAIN 1.4 04/30/28	1,640,000.000	1,518,784.320	
	SPAIN 1.4 07/30/28	1,570,000.000	1,442,045.000	
	SPAIN 1.45 04/30/29	1,400,000.000	1,275,517.600	
	SPAIN 1.45 10/31/27	1,560,000.000	1,463,546.760	
	SPAIN 1.45 10/31/71	630,000.000	298,897.200	
	SPAIN 1.5 04/30/27	2,210,000.000	2,100,163.000	
	SPAIN 1.6 04/30/25	1,970,000.000	1,938,318.460	
	SPAIN 1.85 07/30/35	1,640,000.000	1,349,646.200	
	SPAIN 1.9 10/31/52	670,000.000	434,612.650	
	SPAIN 1.95 04/30/26	1,330,000.000	1,307,380.090	
	SPAIN 1.95 07/30/30	1,770,000.000	1,627,157.460	
	SPAIN 2.15 10/31/25	1,710,000.000	1,701,963.000	
	SPAIN 2.35 07/30/33	1,470,000.000	1,320,795.000	
	SPAIN 2.55 10/31/32	880,000.000	812,183.680	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,190,000.000	979,550.880	
	SPAIN 2.75 10/31/24	1,540,000.000	1,557,308.060	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,180,000.000	1,022,784.890	
	SPAIN 3.45 07/30/66	880,000.000	797,597.500	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,470,000.000	1,507,402.810	
	SPAIN 4.2 01/31/37	1,500,000.000	1,596,819.000	
	SPAIN 4.4 10/31/23	1,110,000.000	1,136,615.580	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,635,000.000	1,740,071.640	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,480,000.000	1,681,048.370	
	SPAIN 4.8 01/31/24	1,300,000.000	1,344,512.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	1,290,000.000	1,491,240.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	790,000.000	884,405.000	
	SPAIN 5.15 10/31/44	870,000.000	1,053,984.990	
	SPAIN 5.75 07/30/32	1,615,000.000	1,944,395.400	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,630,000.000	1,833,111.040	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,680,000.000	1,982,015.610	
	ユーロ 小計	445,162,000.000 (63,141,778,080)	409,373,917.580 (58,065,596,470)	
国債証券	合計	197,334,795,719 (197,334,795,719)	175,926,853,476 (175,926,853,476)	
合計			175,926,853,476 (175,926,853,476)	

(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 253銘柄	52.30	52.99
イギリス・ポンド	国債証券 53銘柄	3.78	3.83
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.37	0.37
オーストラリア・ドル	国債証券 26銘柄	1.47	1.49
オフショア・人民元	国債証券 26銘柄	3.18	3.23
カナダ・ドル	国債証券 37銘柄	2.04	2.06
シンガポール・ドル	国債証券 18銘柄	0.44	0.45
スウェーデン・クローナ	国債証券 8銘柄	0.26	0.26
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.34	0.35
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.20	0.20
ポーランド・ズロチ	国債証券 14銘柄	0.41	0.42
マレーシア・リングgit	国債証券 28銘柄	0.51	0.52
メキシコ・ペソ	国債証券 15銘柄	0.82	0.83
ユーロ	国債証券 348銘柄	32.57	33.01

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,471,860,335
コール・ローン	933,699,266
国債証券	206,982,380,127
派生商品評価勘定	113,926,457
未収利息	1,228,289,311
前払費用	226,082,049
流動資産合計	210,956,237,545
資産合計	210,956,237,545
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,307,925,415
未払金	470,014,945
未払解約金	10,191,000
流動負債合計	1,788,131,360
負債合計	1,788,131,360
純資産の部	
元本等	
元本	175,347,896,102
剰余金	
剰余金又は欠損金()	33,820,210,083
元本等合計	209,168,106,185
純資産合計	209,168,106,185
負債純資産合計	210,956,237,545

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	366,229,927,093円
同期中追加設定元本額	843,082,527,163円
同期中一部解約元本額	1,033,964,558,154円
元本の内訳	
ファンド名	
たわらノーロード 先進国債券<為替ヘッジあり>	8,639,971,046円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,057,916,494円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,768,415,756円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,318,030,477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)	48,636,165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)	1,421,415,657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)	1,615,561,327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)	425,012,636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)	54,157,577円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,270,275円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	19,205,766円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	179,030,528円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	10,443,176円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,408,159円
投資のソムリエ	73,779,276,589円
投資のソムリエ<DC年金>	4,920,676,805円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	4,900,859,824円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	23,315,982,268円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,188,409,504円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,387,350,620円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	404,111,864円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	201,213,107円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	33,564,577円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	902,325,240円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,529,976,521円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,448,784,186円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	464,154,996円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	211,070,739円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	135,706,469円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	25,613,719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)	19,877,785,121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)	7,252,558,511円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,074,800,585円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	16,393,029円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	37,311,210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)	518,984,817円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	45,223,979円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	307,186,103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)	584,057,543円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	912,573,322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)	586,901,535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	175,347,896,102円
2. 受益権の総数	175,347,896,102口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。</p> <p>(3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
国債証券	9,750,363,533	
合計	9,750,363,533	

（注）「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間（2022年6月23日から2022年10月12日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年10月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	209,769,533,226	-	210,963,532,184	1,193,998,958
アメリカ・ドル	110,277,095,670	-	111,451,394,238	1,174,298,568
イギリス・ポンド	8,690,074,363	-	8,631,944,936	58,129,427
イスラエル・シュケル	791,165,534	-	793,443,504	2,277,970
オーストラリア・ドル	3,193,983,494	-	3,145,234,098	48,749,396
オフショア・人民元	6,652,137,589	-	6,682,426,543	30,288,954
カナダ・ドル	4,348,802,394	-	4,379,393,443	30,591,049

シンガポール・ドル	933,760,629	-	940,832,675	7,072,046
スウェーデン・クローナ	533,889,990	-	527,039,676	6,850,314
デンマーク・クローネ	748,846,011	-	748,834,222	11,789
ノルウェー・クローネ	428,484,842	-	438,286,286	9,801,444
ポーランド・ズロチ	884,218,931	-	884,033,400	185,531
マレーシア・リンギット	1,131,126,214	-	1,134,200,802	3,074,588
メキシコ・ペソ	1,749,212,795	-	1,774,506,517	25,293,722
ユーロ	69,406,734,770	-	69,431,961,844	25,227,074
合計	209,769,533,226	-	210,963,532,184	1,193,998,958

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年10月12日現在
1口当たり純資産額	1.1929円
(1万口当たり純資産額)	(11,929円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 02/15/24	4,870,000.000	4,594,921.060	
		US T N/B 0.25 03/15/24	10,000,000.000	9,421,875.000	
		US T N/B 0.25 05/15/24	550,000.000	514,550.770	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,000,000.000	3,593,125.000	
		US T N/B 0.25 06/30/25	5,000,000.000	4,481,250.000	
		US T N/B 0.25 07/31/25	2,570,000.000	2,294,126.560	
		US T N/B 0.25 08/31/25	20,000.000	17,787.500	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,810,000.000	2,483,447.250	
		US T N/B 0.375 01/31/26	7,000,000.000	6,150,156.250	
		US T N/B 0.375 04/15/24	7,740,000.000	7,278,018.750	

US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,213,861.340	
US T N/B 0.375 07/31/27	5,000,000.000	4,179,882.800	
US T N/B 0.375 09/15/24	60,000.000	55,612.500	
US T N/B 0.375 11/30/25	5,020,000.000	4,440,346.870	
US T N/B 0.375 12/31/25	5,400,000.000	4,765,289.020	
US T N/B 0.5 02/28/26	5,000,000.000	4,399,414.050	
US T N/B 0.5 03/31/25	6,790,000.000	6,187,122.280	
US T N/B 0.5 05/31/27	3,830,000.000	3,236,350.000	
US T N/B 0.5 06/30/27	3,170,000.000	2,672,582.390	
US T N/B 0.5 08/31/27	4,520,000.000	3,792,739.050	
US T N/B 0.5 10/31/27	6,000,000.000	4,998,281.220	
US T N/B 0.5 11/30/23	2,000,000.000	1,913,515.620	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,630,000.000	2,247,519.910	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,150,000.000	4,020,822.270	
US T N/B 0.625 07/31/26	6,000,000.000	5,233,593.720	
US T N/B 0.625 08/15/30	7,190,000.000	5,578,428.870	
US T N/B 0.625 10/15/24	20,000.000	18,578.120	
US T N/B 0.625 12/31/27	5,160,000.000	4,306,785.950	
US T N/B 0.75 01/31/28	5,270,000.000	4,415,683.560	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,140,000.000	4,551,710.910	
US T N/B 0.75 04/30/26	900,000.000	795,058.580	
US T N/B 0.75 05/31/26	7,000,000.000	6,169,296.840	
US T N/B 0.75 08/31/26	5,000,000.000	4,369,726.550	
US T N/B 0.75 11/15/24	4,040,000.000	3,749,625.000	
US T N/B 0.75 12/31/23	4,940,000.000	4,720,015.620	
US T N/B 0.875 01/31/24	6,000,000.000	5,723,437.500	
US T N/B 0.875 06/30/26	6,250,000.000	5,519,042.930	
US T N/B 0.875 11/15/30	8,060,000.000	6,364,251.520	
US T N/B 1.0 07/31/28	5,670,000.000	4,748,625.000	
US T N/B 1.125 01/15/25	2,940,000.000	2,735,578.120	
US T N/B 1.125 02/15/31	7,230,000.000	5,803,769.490	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,468,290.620	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,380,000.000	4,597,378.120	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,930,000.000	1,183,482.020	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,760,000.000	2,285,081.230	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,370,000.000	3,678,993.750	
US T N/B 1.125 10/31/26	7,000,000.000	6,182,968.750	
US T N/B 1.25 03/31/28	6,880,000.000	5,903,362.460	
US T N/B 1.25 04/30/28	7,000,000.000	5,988,828.090	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,373,797.630	
US T N/B 1.25 05/31/28	6,850,000.000	5,851,933.550	
US T N/B 1.25 06/30/28	5,000,000.000	4,262,890.600	
US T N/B 1.25 08/15/31	6,680,000.000	5,343,478.090	
US T N/B 1.25 08/31/24	5,400,000.000	5,098,781.250	
US T N/B 1.25 11/30/26	7,000,000.000	6,204,570.260	
US T N/B 1.375 08/15/50	7,330,000.000	4,129,424.170	
US T N/B 1.375 08/31/26	4,750,000.000	4,259,042.940	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,000,000.000	3,404,375.000	
US T N/B 1.375 11/15/31	8,580,000.000	6,898,521.020	

US T N/B 1.375 11/15/40	5,890,000.000	3,737,849.180	
US T N/B 1.375 12/31/28	6,900,000.000	5,863,382.770	
US T N/B 1.5 01/31/27	8,290,000.000	7,400,120.310	
US T N/B 1.5 02/15/25	5,580,000.000	5,224,710.900	
US T N/B 1.5 02/15/30	8,730,000.000	7,347,522.610	
US T N/B 1.5 02/29/24	8,520,000.000	8,182,528.080	
US T N/B 1.5 08/15/26	4,990,000.000	4,498,601.910	
US T N/B 1.5 09/30/24	6,490,000.000	6,146,232.810	
US T N/B 1.5 11/30/24	7,100,000.000	6,686,757.770	
US T N/B 1.5 11/30/28	7,000,000.000	5,993,203.090	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,900,000.000	3,572,460.910	
US T N/B 1.625 05/15/26	7,000,000.000	6,380,937.500	
US T N/B 1.625 05/15/31	7,460,000.000	6,199,667.910	
US T N/B 1.625 08/15/29	7,400,000.000	6,335,093.750	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,455,607.790	
US T N/B 1.625 11/15/50	7,470,000.000	4,511,763.240	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,000,000.000	3,469,062.480	
US T N/B 1.75 03/15/25	6,100,000.000	5,736,382.780	
US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,464,778.090	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,140,000.000	3,447,012.500	
US T N/B 1.75 11/15/29	6,900,000.000	5,953,406.250	
US T N/B 1.875 02/15/32	9,010,000.000	7,554,673.800	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,330,000.000	3,703,517.180	
US T N/B 1.875 02/15/51	8,700,000.000	5,609,460.880	
US T N/B 1.875 02/28/27	4,690,000.000	4,252,510.930	
US T N/B 1.875 02/28/29	6,000,000.000	5,242,500.000	
US T N/B 1.875 06/30/26	4,920,000.000	4,516,406.250	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,690,000.000	3,660,714.810	
US T N/B 2.0 02/15/50	1,290,000.000	863,090.620	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	6,606,501.520	
US T N/B 2.0 05/31/24	6,440,000.000	6,193,971.840	
US T N/B 2.0 08/15/25	2,190,000.000	2,052,782.810	
US T N/B 2.0 08/15/51	7,310,000.000	4,860,578.860	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	3,789,070.280	
US T N/B 2.0 11/15/41	6,400,000.000	4,489,499.960	
US T N/B 2.125 02/29/24	5,000,000.000	4,842,187.500	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,600,000.000	4,447,265.600	
US T N/B 2.125 05/15/25	2,500,000.000	2,363,769.520	
US T N/B 2.125 05/31/26	50,000.000	46,324.210	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	5,924,646.050	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,400,000.000	2,300,812.480	
US T N/B 2.125 11/30/24	6,670,000.000	6,368,807.800	
US T N/B 2.25 01/31/24	6,160,000.000	5,983,862.490	
US T N/B 2.25 02/15/27	500,000.000	460,605.460	
US T N/B 2.25 02/15/52	6,020,000.000	4,259,150.000	
US T N/B 2.25 03/31/24	8,510,000.000	8,242,067.920	
US T N/B 2.25 04/30/24	5,000,000.000	4,833,984.350	
US T N/B 2.25 05/15/41	3,220,000.000	2,388,082.790	
US T N/B 2.25 08/15/27	5,640,000.000	5,160,820.290	

US T N/B 2.25 08/15/46	1,080,000.000	760,134.360	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,030,000.000	2,159,585.140	
US T N/B 2.25 11/15/24	9,000,000.000	8,620,312.500	
US T N/B 2.25 11/15/25	1,820,000.000	1,710,444.510	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,340,000.000	3,042,922.630	
US T N/B 2.375 02/15/42	1,000,000.000	751,484.370	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,636,421.840	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,598,593.720	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,007,317.170	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,000,000.000	4,617,187.500	
US T N/B 2.375 05/15/29	6,450,000.000	5,793,410.120	
US T N/B 2.375 05/15/51	8,210,000.000	5,984,320.310	
US T N/B 2.375 08/15/24	4,000,000.000	3,857,812.480	
US T N/B 2.375 11/15/49	4,880,000.000	3,581,081.220	
US T N/B 2.5 01/31/24	2,000,000.000	1,948,906.240	
US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	5,759,062.500	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,210,000.000	902,489.830	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,130,000.000	2,324,269.510	
US T N/B 2.5 02/28/26	3,520,000.000	3,318,837.490	
US T N/B 2.5 04/30/24	7,100,000.000	6,891,437.500	
US T N/B 2.5 05/15/24	9,050,000.000	8,781,328.120	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,360,000.000	1,749,073.430	
US T N/B 2.625 01/31/26	1,280,000.000	1,211,899.990	
US T N/B 2.625 02/15/29	7,530,000.000	6,890,538.230	
US T N/B 2.625 04/15/25	2,280,000.000	2,186,217.170	
US T N/B 2.625 05/31/27	5,000,000.000	4,672,656.250	
US T N/B 2.625 07/31/29	1,500,000.000	1,367,988.270	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,000,000.000	1,895,781.240	
US T N/B 2.75 02/15/24	3,470,000.000	3,390,298.430	
US T N/B 2.75 02/15/28	6,000,000.000	5,588,437.500	
US T N/B 2.75 02/28/25	10,000.000	9,644.530	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,740,000.000	2,573,780.440	
US T N/B 2.75 05/15/25	6,500,000.000	6,243,046.870	
US T N/B 2.75 05/31/29	5,000,000.000	4,598,828.100	
US T N/B 2.75 06/30/25	70,000.000	67,178.120	
US T N/B 2.75 07/31/27	2,000,000.000	1,874,843.740	
US T N/B 2.75 08/15/42	3,000,000.000	2,391,562.500	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,450,000.000	1,132,132.810	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,869,921.860	
US T N/B 2.75 11/15/23	2,500,000.000	2,455,273.420	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,030,000.000	818,689.060	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,160,000.000	1,687,500.000	
US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,780,043.720	
US T N/B 2.875 05/15/32	3,840,000.000	3,512,249.970	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,446,963.270	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,050,000.000	2,481,222.640	
US T N/B 2.875 05/15/52	1,000,000.000	817,539.060	
US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,379,019.500	
US T N/B 2.875 06/15/25	4,000,000.000	3,850,000.000	

US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,144,309.370	
US T N/B 2.875 08/15/28	5,860,000.000	5,463,534.370	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,400,000.000	1,916,250.000	
US T N/B 2.875 09/30/23	7,810,000.000	7,705,968.300	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,020,000.000	814,884.370	
US T N/B 2.875 11/30/23	2,070,000.000	2,036,039.060	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,140,000.000	1,090,570.300	
US T N/B 3.0 02/15/47	3,170,000.000	2,593,703.890	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,080,000.000	2,535,225.000	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,030,000.000	2,525,078.890	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	835,000.000	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,930,000.000	1,576,870.310	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,210,000.000	990,025.770	
US T N/B 3.0 07/15/25	5,000,000.000	4,823,046.850	
US T N/B 3.0 08/15/48	4,070,000.000	3,364,109.370	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,925,937.500	
US T N/B 3.0 10/31/25	40,000.000	38,464.060	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,320,000.000	1,079,925.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	2,370,000.000	1,935,067.950	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,310,000.000	1,120,561.710	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,760,000.000	2,328,318.750	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,360,000.000	1,994,937.500	
US T N/B 3.125 08/15/25	2,500,000.000	2,417,871.070	
US T N/B 3.125 08/15/44	3,650,000.000	3,055,164.060	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,380,000.000	5,079,896.870	
US T N/B 3.125 11/15/41	80,000.000	68,393.740	
US T N/B 3.25 05/15/42	1,950,000.000	1,697,947.250	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,000,000.000	2,878,125.000	
US T N/B 3.375 05/15/44	900,000.000	786,304.680	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,840,000.000	2,528,709.360	
US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	834,861.710	
US T N/B 3.625 02/15/44	3,660,000.000	3,333,459.370	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,000,000.000	915,390.620	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	942,812.500	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	931,406.250	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	2,496,351.540	
US T N/B 4.25 05/15/39	2,000,000.000	2,054,062.500	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	1,016,171.870	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	786,855.460	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,220,000.000	2,299,607.790	
US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	896,643.750	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,247,812.500	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,410,000.000	1,505,505.460	
US T N/B 4.5 08/15/39	30,000.000	31,739.060	
US T N/B 4.75 02/15/41	2,470,000.000	2,674,739.820	
US T N/B 5.0 05/15/37	750,000.000	839,238.270	
US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,795,625.000	
US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	2,508,265.620	
US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,903,186.700	

	US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,284,218.710	
アメリカ・ドル	小計	856,840,000.000 (125,270,008,000)	750,133,638.150 (109,669,537,895)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	900,000.000	780,210.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,120,000.000	1,062,667.200	
	UK TREASURY 0.125 01/31/28	1,790,000.000	1,423,515.400	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	580,000.000	525,079.800	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	1,110,000.000	773,459.100	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	970,000.000	822,618.580	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	2,240,000.000	1,632,086.400	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,000,000.000	780,060.000	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,810,000.000	512,675.260	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,410,000.000	1,278,783.140	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	2,920,000.000	1,803,158.400	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,430,000.000	524,532.000	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	650,000.000	287,560.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	2,560,000.000	1,764,358.140	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	90,000.000	70,778.700	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	770,000.000	565,988.500	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,990,000.000	1,896,788.400	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	710,000.000	252,646.400	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	1,290,000.000	1,109,761.200	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,270,000.000	574,174.620	
	UK TREASURY 1.25 10/22/41	620,000.000	342,320.600	
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,040,000.000	933,972.000		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,110,000.000	576,041.160		
UK TREASURY 1.5 07/31/53	70,000.000	33,450.900		
UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,320,000.000	1,123,966.800		
UK TREASURY 1.625 10/22/54	880,000.000	432,044.800		
UK TREASURY 1.625 10/22/71	670,000.000	308,715.900		

	UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	278,611.980	
	UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,510,000.000	767,714.200	
	UK TREASURY 1.75 09/07/37	3,760,000.000	2,551,047.200	
	UK TREASURY 2.0 09/07/25	910,000.000	852,651.800	
	UK TREASURY 2.5 07/22/65	950,000.000	599,307.500	
	UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,050,000.000	1,021,024.200	
	UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,210,000.000	939,032.600	
	UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,630,000.000	1,311,512.990	
	UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,410,000.000	1,152,957.000	
	UK TREASURY 3.75 07/22/52	880,000.000	737,844.800	
	UK TREASURY 4.0 01/22/60	740,000.000	664,022.720	
	UK TREASURY 4.25 03/07/36	2,120,000.000	2,017,286.000	
	UK TREASURY 4.25 06/07/32	850,000.000	838,163.750	
	UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,020,000.000	943,347.810	
	UK TREASURY 4.25 12/07/40	1,190,000.000	1,094,864.260	
	UK TREASURY 4.25 12/07/46	960,000.000	866,914.170	
	UK TREASURY 4.25 12/07/49	570,000.000	519,176.520	
	UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,540,000.000	1,420,172.600	
	UK TREASURY 4.5 12/07/42	2,010,000.000	1,902,696.950	
	UK TREASURY 4.75 12/07/30	860,000.000	881,001.200	
	UK TREASURY 4.75 12/07/38	2,060,000.000	2,035,877.400	
	UK TREASURY 5.0 03/07/25	2,270,000.000	2,296,445.500	
	UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,560,649.500	
	イギリス・ポンド 小計	63,780,000.000 (10,232,225,400)	49,443,736.050 (7,932,258,575)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	2,390,000.000	2,255,913.830	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	2,470,000.000	2,251,405.000	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	2,680,000.000	2,500,820.560	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,810,000.000	2,387,291.700	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	90,000.000	75,213.180	

	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	70,000.000	53,872.140	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,630,000.000	1,562,808.140	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	100,000.000	94,698.000	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,093,983.240	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	3,130,000.000	3,130,885.790	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	930,000.000	1,176,250.050	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,100,000.000	2,332,369.200	
イスラエル・シュケル 小計		19,560,000.000 (797,862,180)	18,915,510.830 (771,573,145)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	2,800,000.000	2,623,206.120	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	560,000.000	506,193.820	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	2,610,000.000	2,313,367.780	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,470,000.000	1,134,439.490	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	2,510,000.000	1,992,061.220	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	3,220,000.000	2,514,547.230	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	3,520,000.000	2,878,438.320	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	100,000.000	58,680.000	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,340,000.000	2,122,082.980	
	AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	90,000.000	89,447.210	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	590,000.000	471,622.470	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	1,140,000.000	981,651.820	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	1,200,000.000	1,148,880.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	895,800.670	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,060,000.000	1,921,980.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	1,180,000.000	945,691.360	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	400,000.000	398,018.710	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,500,000.000	3,382,104.100	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	1,170,000.000	1,023,731.080	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	680,000.000	643,998.870	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	780,000.000	797,268.340		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,290,000.000	3,419,502.290		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,490,000.000	1,557,756.840		
オーストラリア・ドル 小計		37,650,000.000 (3,447,610,500)	33,820,470.720 (3,096,940,504)	
オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	5,300,000.000	5,314,918.440	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	9,600,000.000	9,575,328.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	22,000,000.000	22,019,736.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	25,000,000.000	25,122,247.500	

	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	4,973,241.450	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	34,000,000.000	34,283,777.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	22,000,000.000	21,975,140.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	5,000,000.000	4,996,933.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.56 10/21/23	3,720,000.000	3,747,007.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	23,500,000.000	23,313,109.430	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	52,310,000.000	52,861,645.560	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	4,000,000.000	3,985,143.480	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	5,000,000.000	4,980,667.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	11,000,000.000	11,071,436.200	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	5,500,000.000	5,575,849.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	17,000,000.000	17,345,596.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	21,500,000.000	21,884,673.700	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	17,500,000.000	18,149,404.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	13,400,000.000	13,816,005.680	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	16,400,000.000	17,486,418.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,950,000.000	8,703,467.610	
	オフショア・人民元 小計	326,680,000.000 (6,653,491,560)	331,181,747.400 (6,745,178,649)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	2,200,000.000	1,951,914.800	
	CANADA 0.25 04/01/24	2,600,000.000	2,459,366.000	
	CANADA 0.5 09/01/25	750,000.000	681,225.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	4,500,000.000	3,549,834.000	
	CANADA 0.75 02/01/24	890,000.000	851,911.560	
	CANADA 0.75 10/01/24	410,000.000	384,734.570	
	CANADA 1.0 06/01/27	100,000.000	89,041.500	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,860,000.000	1,676,226.420	
	CANADA 1.25 03/01/25	1,400,000.000	1,312,718.400	
	CANADA 1.25 03/01/27	1,380,000.000	1,245,764.640	
	CANADA 1.25 06/01/30	3,090,000.000	2,628,900.930	
	CANADA 1.5 04/01/25	2,080,000.000	1,958,124.480	
	CANADA 1.5 05/01/24	1,620,000.000	1,556,272.440	

	CANADA 1.5 06/01/31	4,500,000.000	3,832,821.000	
	CANADA 1.5 09/01/24	120,000.000	114,530.280	
	CANADA 1.75 12/01/53	2,650,000.000	1,845,536.850	
	CANADA 2.0 06/01/32	1,870,000.000	1,647,756.110	
	CANADA 2.0 12/01/51	2,390,000.000	1,794,555.400	
	CANADA 2.25 03/01/24	1,550,000.000	1,511,397.250	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,260,000.000	1,207,689.840	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	1,771,658.700	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,300,000.000	1,201,482.100	
	CANADA 2.5 06/01/24	660,000.000	643,646.520	
	CANADA 2.75 09/01/27	1,040,000.000	999,961.040	
	CANADA 2.75 12/01/48	760,000.000	678,414.760	
	CANADA 2.75 12/01/64	780,000.000	680,479.020	
	CANADA 3.5 12/01/45	790,000.000	799,887.640	
	CANADA 4.0 06/01/41	10,000.000	10,722.770	
	CANADA 5.0 06/01/37	80,000.000	93,658.720	
	CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	863,574.480	
カナダ・ドル 小計		45,270,000.000 (4,799,072,700)	40,043,807.220 (4,245,044,003)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	610,000.000	557,845.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	630,000.000	575,190.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	400,000.000	342,681.450	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	780,000.000	588,120.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	400,000.000	304,522.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	750,000.000	737,475.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	280,000.000	250,576.200	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	740,000.000	720,760.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	40,000.000	35,160.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	300,000.000	285,900.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	190,000.000	174,420.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	780,000.000	722,455.500	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	290,000.000	278,110.000	
	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,143,480.000	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	520,000.000	517,675.600	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	1,080,000.000	1,070,820.000	
SINGAPORE 3.5 03/01/27	970,000.000	967,090.000		
シンガポール・ドル 小計		9,960,000.000 (1,012,035,600)	9,272,280.750 (942,156,447)	
スウェーデン・クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	550,000.000	457,012.270	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	10,680,000.000	9,761,510.790	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	10,000.000	8,938.700	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	13,500,000.000	12,750,754.720	
	SWEDEN 2.25 06/01/32	200,000.000	200,142.000	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	11,220,000.000	11,231,248.050	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	5,290,000.000	6,245,645.370	
スウェーデン・クローナ 小計		41,450,000.000 (533,461,500)	40,655,251.900 (523,233,092)	

デンマーク・クローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	3,370,000.000	3,224,584.500	
	DENMARK 0.0 11/15/31	8,860,000.000	6,928,906.990	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,060,000.000	2,035,874.820	
	DENMARK 0.5 11/15/27	4,940,000.000	4,476,393.350	
	DENMARK 0.5 11/15/29	15,520,000.000	13,421,117.710	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,430,000.000	3,379,073.100	
	DENMARK 4.5 11/15/39	4,250,000.000	5,193,101.350	
デンマーク・クローネ 小計		44,430,000.000 (847,280,100)	38,659,051.820 (737,228,118)	
ノルウェー・クローネ	NORWAY 1.375 08/19/30	4,430,000.000	3,756,046.380	
	NORWAY 1.5 02/19/26	4,220,000.000	3,943,328.360	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,840,000.000	4,482,001.160	
	NORWAY 1.75 03/13/25	500,000.000	479,292.000	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,870,000.000	2,545,385.780	
	NORWAY 2.0 04/26/28	13,360,000.000	12,299,216.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	560,000.000	492,016.000	
	NORWAY 3.0 03/14/24	3,270,000.000	3,250,626.190	
ノルウェー・クローネ 小計		34,050,000.000 (462,058,500)	31,247,911.870 (424,034,164)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	822,800.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	3,670,000.000	3,112,343.500	
	POLAND 07/25/24	220,000.000	193,205.170	
	POLAND 1.25 10/25/30	4,490,000.000	2,780,208.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	100,000.000	60,280.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	4,690,000.000	4,224,251.100	
	POLAND 2.5 04/25/24	200,000.000	185,974.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	9,000,000.000	7,481,925.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	6,690,000.000	5,277,406.500	
	POLAND 2.75 04/25/28	3,310,000.000	2,582,031.700	
	POLAND 2.75 10/25/29	160,000.000	116,824.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	3,240,000.000	2,876,796.000	
ポーランド・ズロチ 小計		36,870,000.000 (1,077,746,970)	29,714,044.970 (868,571,249)	
マレーシア・リングギット	MALAYSIA 2.632 04/15/31	2,090,000.000	1,813,130.840	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,830,000.000	1,823,360.240	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	200,000.000	193,901.560	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,090,000.000	2,028,769.010	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,750,000.000	1,513,365.280	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,560,000.000	1,426,990.410	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,010,000.000	1,879,990.400	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	2,410,000.000	2,324,285.450	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,352,648.780	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,300,000.000	1,282,177.680	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	1,090,000.000	1,078,725.390	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	1,810,000.000	1,797,803.000	

	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,750,000.000	1,748,639.550	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	420,000.000	422,267.450	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,220,000.000	1,913,555.010	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	1,700,000.000	1,713,070.790	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	1,000,000.000	978,267.820	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	200,000.000	189,647.210	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,030,000.000	1,040,212.340	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,050,000.000	1,049,411.770	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	820,000.000	802,394.990	
	MALAYSIA 4.736 03/15/46	780,000.000	738,382.850	
	MALAYSIA 4.762 04/07/37	2,840,000.000	2,849,432.490	
	MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,030,000.000	1,032,525.970	
	MALAYSIA 4.921 07/06/48	1,400,000.000	1,350,810.450	
	MALAYSIA 4.935 09/30/43	580,000.000	576,362.360	
マレーシア・リングgit 小計		36,330,000.000 (1,135,966,440)	34,920,129.090 (1,091,882,596)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	16,883,000.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	14,710,000.000	13,099,696.300	
	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,000,000.000	5,081,750.000	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	24,350,000.000	24,230,198.000	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	38,254,000.000	33,613,407.260	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	9,585,000.000	8,744,395.500	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	32,700,000.000	28,921,188.000	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	22,828,000.000	18,734,483.040	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,011,000.000	3,432,613.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	22,120,000.000	21,242,720.800	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,346,000.000	16,104,577.700	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	47,501,000.000	44,591,563.750	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	4,773,000.000	4,270,880.400	
	メキシコ・ペソ 小計		265,178,000.000 (1,932,617,264)	238,950,474.550 (1,741,471,059)
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	1,260,000.000	1,028,459.880	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,000,000.000	788,325.870	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	1,250,000.000	844,875.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	440,000.000	384,583.320	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	4,010,000.000	3,683,565.950	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	100,000.000	42,348.500	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,130,000.000	1,028,253.670	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	160,000.000	90,387.200	

AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,249,916.710	
AUSTRIA 0.85 06/30/20	110,000.000	44,573.760	
AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,300,000.000	1,079,530.400	
AUSTRIA 07/15/24	490,000.000	474,476.800	
AUSTRIA 1.2 10/20/25	200,000.000	194,275.400	
AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,140,000.000	827,808.720	
AUSTRIA 1.5 11/02/86	80,000.000	45,696.000	
AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,800,000.000	1,791,369.000	
AUSTRIA 2.1 09/20/17	970,000.000	701,086.900	
AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,660,000.000	1,549,792.600	
AUSTRIA 3.15 06/20/44	520,000.000	526,238.440	
AUSTRIA 3.8 01/26/62	160,000.000	182,599.360	
AUSTRIA 4.85 03/15/26	940,000.000	1,022,762.300	
BELGIUM 0.0 10/22/27	140,000.000	123,998.000	
BELGIUM 0.0 10/22/31	1,290,000.000	1,004,515.260	
BELGIUM 0.1 06/22/30	1,600,000.000	1,320,960.000	
BELGIUM 0.2 10/22/23	70,000.000	68,868.100	
BELGIUM 0.4 06/22/40	800,000.000	493,071.720	
BELGIUM 0.5 10/22/24	830,000.000	806,767.800	
BELGIUM 0.65 06/22/71	360,000.000	144,380.160	
BELGIUM 0.8 06/22/25	1,100,000.000	1,065,715.200	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,830,000.000	1,704,736.500	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,030,000.000	924,754.600	
BELGIUM 1.0 06/22/26	2,000,000.000	1,917,282.800	
BELGIUM 1.0 06/22/31	2,110,000.000	1,831,011.580	
BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,045,848.800	
BELGIUM 1.4 06/22/53	510,000.000	325,262.340	
BELGIUM 1.45 06/22/37	80,000.000	63,399.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,330,000.000	956,868.500	
BELGIUM 1.7 06/22/50	780,000.000	556,686.000	
BELGIUM 1.9 06/22/38	80,000.000	66,881.600	
BELGIUM 2.15 06/22/66	530,000.000	409,584.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	560,000.000	450,246.720	
BELGIUM 2.6 06/22/24	360,000.000	364,278.600	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,540,000.000	1,528,004.940	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,250,000.000	1,366,864.490	
BELGIUM 4.25 03/28/41	450,000.000	504,720.450	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,300,000.000	1,399,967.400	
BELGIUM 5.0 03/28/35	3,430,000.000	4,069,866.500	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,500,000.000	1,735,801.500	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,100,000.000	2,904,607.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,670,000.000	1,596,957.540	
BUNDESOBL 0.0 04/16/27	2,910,000.000	2,659,428.630	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,710,000.000	1,580,963.400	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	240,000.000	227,820.000	
BUNDESOBL 04/05/24	2,280,000.000	2,223,673.290	
BUNDESOBL 10/18/24	2,040,000.000	1,968,620.400	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,450,000.000	1,415,765.500	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	2,080,000.000	2,038,947.040	

DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,490,000.000	2,128,277.700	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	3,300,000.000	2,751,408.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	1,070,000.000	867,607.360	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	1,810,000.000	1,334,313.900	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,010,000.000	1,446,456.300	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	3,700,000.000	3,124,835.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	692,613.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	3,610,000.000	2,970,019.200	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,000,000.000	823,777.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,500,000.000	1,322,457.820	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	470,000.000	249,377.300	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	750,000.000	379,860.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,060,000.000	956,491.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	3,000,000.000	2,645,100.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	5,540,000.000	4,935,369.940	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	500,000.000	449,935.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,300,000.000	1,261,403.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,490,000.000	3,336,474.900	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	660,000.000	608,949.000	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,491,008.000	
DEUTSCHLAND 08/15/26	3,680,000.000	3,423,147.040	
DEUTSCHLAND 08/15/29	3,930,000.000	3,400,609.350	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,000,000.000	806,550.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,020,000.000	1,993,540.760	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,220,000.000	2,168,762.400	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,370,000.000	1,877,777.070	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	2,270,000.000	2,263,058.340	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,980,000.000	1,983,227.400	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,420,000.000	2,451,218.000	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,300,000.000	2,354,381.200	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,520,000.000	1,706,458.400	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,630,000.000	1,930,216.660	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,220,000.000	1,509,774.400	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	1,880,000.000	2,337,704.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,690,000.000	2,236,596.700	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	2,640,000.000	3,284,424.000	
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	1,130,000.000	1,325,829.000	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,244,333.600	

DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	400,000.000	508,024.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	1,994,731.500	
FINLAND 0.0 09/15/26	720,000.000	655,416.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	880,000.000	706,339.250	
FINLAND 0.125 04/15/36	280,000.000	189,883.280	
FINLAND 0.125 04/15/52	40,000.000	18,058.960	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	141,495.480	
FINLAND 0.25 09/15/40	360,000.000	219,743.280	
FINLAND 0.5 04/15/26	1,100,000.000	1,036,417.800	
FINLAND 0.5 09/15/27	860,000.000	781,511.240	
FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	79,401.510	
FINLAND 0.5 09/15/29	1,060,000.000	912,372.210	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	827,334.810	
FINLAND 1.125 04/15/34	120,000.000	97,734.360	
FINLAND 1.375 04/15/47	50,000.000	36,558.900	
FINLAND 2.0 04/15/24	140,000.000	140,424.310	
FINLAND 2.625 07/04/42	1,070,000.000	991,389.240	
FINLAND 2.75 07/04/28	200,000.000	201,428.800	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	5,000,000.000	4,875,966.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	3,500,000.000	3,333,058.640	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	5,550,000.000	5,161,616.550	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,500,000.000	4,070,448.000	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	2,430,000.000	1,860,165.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	4,760,000.000	3,979,750.320	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	4,680,000.000	3,787,318.080	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	6,070,000.000	4,741,264.860	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	460,000.000	423,863.780	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,680,000.000	1,612,958.390	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,220,000.000	3,031,691.180	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	11,600,000.000	10,199,010.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,100,000.000	702,365.400	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	1,510,000.000	565,152.230	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	650,000.000	384,533.500	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,000,000.000	1,829,700.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	480,000.000	437,496.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	3,110,000.000	1,690,403.180	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,980,000.000	1,050,449.400	
FRANCE OAT 03/25/24	2,000,000.000	1,947,266.000	
FRANCE OAT 03/25/25	2,810,000.000	2,672,551.660	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	5,000,000.000	4,710,750.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,230,000.000	1,188,451.210	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	1,950,000.000	1,612,745.550	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	3,110,000.000	2,471,206.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	100,000.000	76,300.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	4,910,000.000	4,491,235.920	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	2,770,000.000	1,928,163.760	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	910,000.000	625,975.350	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	1,100,000.000	906,928.000	

FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,490,000.000	3,471,443.670	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	2,520,000.000	2,002,165.200	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	4,880,000.000	4,905,775.180	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	5,620,000.000	5,612,678.480	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,280,000.000	2,301,112.800	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,640,000.000	1,890,920.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	1,864,721.600	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,900,000.000	2,090,395.200	
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	4,710,000.000	4,825,762.380	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	2,900,000.000	3,403,422.600	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,410,000.000	1,650,359.730	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	1,000,000.000	1,174,280.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	6,690,000.000	8,334,736.500	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,000,000.000	4,449,868.000	
IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	729,737.520	
IRISH 0.2 10/18/30	1,660,000.000	1,373,922.650	
IRISH 0.35 10/18/32	200,000.000	157,047.030	
IRISH 0.4 05/15/35	250,000.000	183,561.000	
IRISH 0.9 05/15/28	60,000.000	55,252.920	
IRISH 1.0 05/15/26	2,680,000.000	2,578,929.160	
IRISH 1.1 05/15/29	420,000.000	384,960.970	
IRISH 1.3 05/15/33	70,000.000	60,052.480	
IRISH 1.35 03/18/31	820,000.000	745,084.800	
IRISH 1.5 05/15/50	300,000.000	207,817.500	
IRISH 1.7 05/15/37	130,000.000	108,944.420	
IRISH 2.0 02/18/45	1,160,000.000	943,648.400	
IRISH 2.4 05/15/30	1,610,000.000	1,596,326.270	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,789,283.000	
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	3,000,000.000	2,899,470.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	3,420,000.000	3,026,358.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	2,730,000.000	2,621,073.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,000,000.000	1,747,200.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,000,000.000	948,950.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	3,000,000.000	2,813,850.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	4,610,000.000	3,785,732.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	2,810,000.000	2,639,421.760	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	5,000,000.000	3,985,500.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	3,100,000.000	2,814,920.900	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,500,000.000	1,232,100.000	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	30,000.000	26,733.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	2,210,000.000	1,374,620.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	80,000.000	58,000.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	2,750,000.000	2,143,900.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,000,000.000	1,747,200.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,350,000.000	994,929.750	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	2,000,000.000	1,783,800.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	70,000.000	65,884.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	110,000.000	100,180.850	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	2,000,000.000	1,633,076.000	

ITALY BTPS 1.45 03/01/36	2,050,000.000	1,415,935.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	330,000.000	315,242.400	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,630,000.000	930,567.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	330,000.000	315,402.120	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,640,000.000	1,289,592.680	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,660,000.000	2,172,528.400	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	300,000.000	167,822.310	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,000,000.000	981,475.000	
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,570,000.000	1,019,087.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	2,800,000.000	2,757,356.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	190,000.000	182,761.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,200,000.000	1,092,177.600	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	610,000.000	585,368.810	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.000	950,338.000	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	780,000.000	437,112.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,180,000.000	721,806.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,060,000.000	1,928,984.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	340,000.000	262,718.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	2,090,000.000	1,699,213.500	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,770,000.000	1,184,130.000	
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	40,000.000	39,993.640	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	3,000,000.000	2,922,606.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	1,240,000.000	1,028,666.800	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	402,820.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,230,000.000	820,164.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	4,660,000.000	4,358,237.040	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,240,000.000	1,790,880.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	3,890,000.000	3,630,875.430	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,940,000.000	1,568,115.580	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	200,000.000	166,282.800	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,360,000.000	2,261,127.800	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,200,000.000	1,218,277.680	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,800,000.000	1,588,764.600	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	2,590,000.000	2,432,010.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,070,000.000	3,142,180.300	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	3,220,000.000	3,336,886.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	790,000.000	798,673.410	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,620,000.000	1,688,576.220	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	690,000.000	713,874.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,360,000.000	1,407,736.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,450,000.000	1,503,505.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	3,940,000.000	4,228,802.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,390,000.000	1,525,108.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	4,300,000.000	4,814,280.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	770,000.000	867,251.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	2,500,000.000	2,281,640.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	990,000.000	852,859.260	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,260,000.000	827,953.560	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,030,000.000	490,871.220	

NETHERLANDS 0.0 07/15/30	2,140,000.000	1,774,624.960	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	980,000.000	790,301.400	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	2,970,000.000	2,836,131.760	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	510,000.000	442,512.720	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	150,000.000	103,545.300	
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	210,000.000	198,093.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	3,130,000.000	2,925,470.150	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	200,000.000	183,272.200	
NETHERLANDS 01/15/24	300,000.000	293,252.400	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	970,000.000	972,875.080	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,620,000.000	1,596,052.080	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,670,000.000	1,697,242.710	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,850,000.000	2,116,520.250	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	980,000.000	1,112,006.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	760,000.000	875,900.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,750,000.000	1,660,750.000	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,690,000.000	1,559,037.160	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,000,000.000	1,783,700.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	2,740,000.000	2,647,749.130	
SPAIN 0.0 05/31/25	2,000,000.000	1,879,456.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	2,890,000.000	2,212,295.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,230,000.000	1,188,569.910	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,540,000.000	1,275,150.800	
SPAIN 0.5 10/31/31	390,000.000	305,338.410	
SPAIN 0.6 10/31/29	2,530,000.000	2,142,570.980	
SPAIN 0.7 04/30/32	370,000.000	289,673.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	3,500,000.000	3,182,725.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	860,650.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,219,234.100	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,180,000.000	737,264.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,100,000.000	575,594.800	
SPAIN 1.2 10/31/40	2,780,000.000	1,848,525.970	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,970,000.000	2,564,595.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	2,540,000.000	2,422,878.060	
SPAIN 1.4 07/30/28	2,010,000.000	1,846,185.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	3,930,000.000	3,580,560.120	
SPAIN 1.45 10/31/27	5,000,000.000	4,690,855.000	
SPAIN 1.45 10/31/71	250,000.000	118,610.000	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,840,000.000	1,748,552.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	120,000.000	98,754.600	
SPAIN 1.9 10/31/52	780,000.000	505,966.960	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,770,000.000	1,739,896.830	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,660,000.000	1,526,034.680	

	SPAIN 2.35 07/30/33	1,260,000.000	1,132,110.000	
	SPAIN 2.7 10/31/48	1,530,000.000	1,259,422.560	
	SPAIN 2.75 10/31/24	2,900,000.000	2,932,593.100	
	SPAIN 2.9 10/31/46	1,980,000.000	1,716,198.420	
	SPAIN 3.45 07/30/66	1,230,000.000	1,114,823.790	
	SPAIN 3.8 04/30/24	1,510,000.000	1,548,420.590	
	SPAIN 4.2 01/31/37	2,330,000.000	2,480,392.180	
	SPAIN 4.65 07/30/25	1,500,000.000	1,596,396.000	
	SPAIN 4.7 07/30/41	90,000.000	102,225.910	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,120,000.000	2,450,720.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	690,000.000	772,455.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	4,010,000.000	4,827,879.600	
	SPAIN 5.9 07/30/26	3,100,000.000	3,486,284.800	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,140,000.000	1,344,939.160	
	ユーロ 小計	524,520,000.000 (74,397,916,800)	480,776,019.680 (68,193,270,631)	
国債証券 合計		232,599,353,514 (232,599,353,514)	206,982,380,127 (206,982,380,127)	
合計			206,982,380,127 (206,982,380,127)	

(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 207銘柄	52.43	52.98
イギリス・ポンド	国債証券 50銘柄	3.79	3.83
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.37	0.37
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	1.48	1.50
オフショア・人民元	国債証券 21銘柄	3.22	3.26
カナダ・ドル	国債証券 30銘柄	2.03	2.05
シンガポール・ドル	国債証券 17銘柄	0.45	0.46
スウェーデン・クローナ	国債証券 7銘柄	0.25	0.25
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.35	0.36
ノルウェー・クローネ	国債証券 8銘柄	0.20	0.20
ポーランド・ズロチ	国債証券 12銘柄	0.42	0.42
マレーシア・リングgit	国債証券 26銘柄	0.52	0.53
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.83	0.84
ユーロ	国債証券 298銘柄	32.60	32.95

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,953,272,603
コール・ローン	558,316,175
株式	80,400,770,850
投資信託受益証券	514,190,996
投資証券	79,609,693
派生商品評価勘定	1,398,142
未収入金	4,382,332
未収配当金	102,644,385
差入委託証拠金	2,718,383,054
流動資産合計	88,332,968,230
資産合計	
88,332,968,230	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	799,747,626
未払金	14,620
未払解約金	4,034,000
流動負債合計	803,796,246
負債合計	
803,796,246	
純資産の部	
元本等	
元本	66,356,355,641
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	21,172,816,343
元本等合計	87,529,171,984
純資産合計	
87,529,171,984	
負債純資産合計	
88,332,968,230	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	43,320,766,854円
同期中追加設定元本額	69,305,024,347円
同期中一部解約元本額	46,269,435,560円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	8,612,399,712円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	244,035,636円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,620,860円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	17,598,327円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	61,375,679円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,251,973円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	15,345,817円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	24,977,053円
たわらノーロード 新興国株式	10,243,896,845円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,699,474,243円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,223,481,402円
たわらノーロード バランス(堅実型)	29,204,634円
たわらノーロード バランス(標準型)	104,184,681円
たわらノーロード バランス(積極型)	180,752,156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)	99,765,055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)	245,667,121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)	172,343,290円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	296,296,565円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	653,715円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	16,312,101円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,198,487円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,933,040円
たわらノーロード 全世界株式	257,767,063円
One DC 新興国株式インデックスファンド	565,904,134円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	393,970,478円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	361,058,649円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	553,954,413円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,008,512,458円
投資のソムリエ	21,708,788,237円
クルーズコントロール	380,662,762円
投資のソムリエ<DC年金>	1,447,275,137円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	418,883,386円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,690,803,138円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	8,046,477,181円
ワールドアセットバランス(基本コース)	615,131,636円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	377,419,031円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	54,178,485円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	26,990,462円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,709,059円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	211,105,273円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	560,902,508円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	328,691,743円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	56,955,239円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	28,264,246円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	18,230,808円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,437,027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)	11,872,360円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	547,630,437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)	4,722,798円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	12,026,696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)	228,155,163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)	102,014,151円
計	66,356,355,641円

2. 受益権の総数

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	13,253,390,848	
投資信託受益証券	80,352,000	
投資証券	4,976,349	
合計	13,338,719,197	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年4月19日から2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引					
売建	1,260,184	-	1,252,000	8,184	
ブラジル・リアル	1,260,184	-	1,252,000	8,184	
買建	452,762,704	-	454,152,662	1,389,958	
アメリカ・ドル	452,762,704	-	454,152,662	1,389,958	
合計	454,022,888	-	455,404,662	1,398,142	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2022年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引 先物取引 買建	7,318,724,485	-	6,518,976,859	799,747,626	
合計	7,318,724,485	-	6,518,976,859	799,747,626	

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2022年10月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3191円 (13,191円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年10月12日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	53,901	23.630	1,273,680.630	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,333	6.500	125,664.500	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,120	127.850	910,292.000	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,443	47.280	399,185.040	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	265,492	1.110	294,696.120	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	90,200	1.553	140,080.600	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.791	68,412.000	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	40,940	2.853	116,801.820	
	EFG-HERMES HOLDINGS GDR	50,259	1.100	55,284.900	
	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 GDR	107,951	0.000	0.000	
SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000		
TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000		

	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,473	7.980	346,914.540	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	3.920	181,084.400	
	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	19,159	31.050	594,886.950	
	JOYY INC-ADR	4,368	24.430	106,710.240	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	48.840	292,844.640	
	ZAI LAB LTD ADR	8,902	28.760	256,021.520	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	360 DIGITECH INC ADR	9,625	13.630	131,188.750	
	NIO INC ADR	134,586	12.830	1,726,738.380	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	72,505	3.960	287,119.800	
	AUTOHOME INC ADR	7,801	28.210	220,066.210	
	WEIBO CORP ADR	6,293	14.040	88,353.720	
	KANZHUN LTD ADR	18,254	15.780	288,048.120	
	RLX TECHNOLOGY INC ADR	30,011	1.000	30,011.000	
	KE HOLDINGS INC ADR	65,788	14.140	930,242.320	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,058	38.800	196,250.400	
	LI AUTO INC ADR	53,865	19.680	1,060,063.200	
	XPENG INC ADR	41,917	9.410	394,438.970	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	2.260	136,589.880	
	PINDUODUO INC ADR	49,642	55.710	2,765,555.820	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	41,390	44.240	1,831,093.600	
	IQIYI INC ADR	27,254	2.270	61,866.580	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	9,743	8.060	78,528.580	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	41,642	22.530	938,194.260	
	BEIGENE LTD ADR	4,717	125.510	592,030.670	
アメリカ・ドル	小計	307,785,480		16,918,940.160 (2,473,549,051)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	149,810	9.130	1,367,765.300	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	289,285	6.000	1,735,710.000	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	340,747	23.820	8,116,593.540	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	275,693	9.030	2,489,507.790	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	429,052	17.440	7,482,666.880	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	392,432	5.680	2,229,013.760	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	376,332	4.230	1,591,884.360	

	EMIRATES NBD BANK PJSC	187,144	13.100	2,451,586.400	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	307,502	4.380	1,346,858.760	
	アラブ首長国連邦・ディルハム 小計	2,747,997		28,811,586.790 (1,148,717,965)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	297,652	2,357.900	701,833,650.800	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	88,686	299.750	26,583,628.500	
	ASIAN PAINTS LTD	37,513	3,298.700	123,744,133.100	
	EICHER MOTORS LTD	13,548	3,408.000	46,171,584.000	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	25,957	1,644.500	42,686,286.500	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	85,411	1,229.550	105,017,095.050	
	SHREE CEMENT LTD	1,110	20,802.100	23,090,331.000	
	ICICI BANK LTD	501,813	870.600	436,878,397.800	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	68,931	210.200	14,489,296.200	
	STATE BANK OF INDIA LTD	172,899	527.400	91,186,932.600	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	691.050	19,551,877.650	
	TATA STEEL LTD	726,289	100.350	72,883,101.150	
	TATA MOTORS LTD	162,216	393.350	63,807,663.600	
	JSW STEEL LTD	71,233	642.750	45,785,010.750	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	54,602	742.600	40,547,445.200	
	TATA POWER CO LTD	141,916	217.150	30,817,059.400	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,830	3,727.900	40,373,157.000	
	NESTLE INDIA LTD	3,296	18,449.950	60,811,035.200	
	GAIL INDIA LTD	215,317	86.200	18,560,325.400	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	54,544	1,787.900	97,519,217.600	
	VEDANTA LTD	74,877	286.050	21,418,565.850	
	AXIS BANK LTD	222,656	785.550	174,907,420.800	
	TITAN COMPANY LTD	34,606	2,624.500	90,823,447.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	255,742	131.100	33,527,776.200	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,609	1,537.200	17,845,354.800	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	362,967	103.050	37,403,749.350	
	LUPIN LTD	19,147	680.950	13,038,149.650	
	MPHASIS LTD	8,886	2,093.800	18,605,506.800	
	ACC LTD	6,327	2,311.650	14,625,809.550	
	BAJAJ FINANCE LTD	26,621	7,202.800	191,745,738.800	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	168,458	2,271.250	382,610,232.500	
	INFOSYS LTD	329,086	1,423.800	468,552,646.800	
	WIPRO LTD	134,766	404.400	54,499,370.400	
	TATA ELXSI LTD	3,406	8,509.900	28,984,719.400	
	MRF LTD	161	81,081.050	13,054,049.050	
	INDIAN OIL CORP LTD	263,140	65.950	17,354,083.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	80,280	2,550.650	204,766,182.000	

TRENT LTD	18,269	1,423.050	25,997,700.450	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,027	4,275.550	42,870,939.850	
HCL TECHNOLOGIES LTD	106,697	938.600	100,145,804.200	
DABUR INDIA LTD	61,644	518.950	31,990,153.800	
HERO MOTOCORP LTD	11,148	2,548.150	28,406,776.200	
SRF LTD	14,620	2,501.700	36,574,854.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,428	1,908.350	12,266,873.800	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	11,683	4,282.750	50,035,368.250	
BHARTI AIRTEL LTD	214,924	780.300	167,705,197.200	
UNITED SPIRITS LTD	26,462	815.600	21,582,407.200	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	93,758	944.750	88,577,870.500	
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,232	3,502.200	46,341,110.400	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,841	8,684.150	102,829,020.150	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,755	510.350	12,123,364.250	
HAVELLS INDIA LTD	24,994	1,279.400	31,977,323.600	
INDRAPRASTHA GAS LTD	30,576	367.350	11,232,093.600	
JINDAL STEEL & POWER LTD	35,331	428.550	15,141,100.050	
BIOCON LTD	37,897	268.750	10,184,818.750	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	210,454	73.150	15,394,710.100	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	19,175	1,173.850	22,508,573.750	
PETRONET LNG LTD	65,873	198.750	13,092,258.750	
CIPLA LTD/INDIA	48,137	1,110.100	53,436,883.700	
LARSEN & TOUBRO LTD	67,047	1,878.950	125,977,960.650	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,888	6,076.750	60,086,904.000	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	89,025	3,069.550	273,266,688.750	
ADANI ENTERPRISES LTD	27,829	3,273.950	91,110,754.550	
NTPC LTD	381,139	161.050	61,382,435.950	
YES BANK LTD	955,944	16.150	15,438,495.600	
AMBUJA CEMENTS LTD	59,555	500.200	29,789,411.000	
BHARAT FORGE LTD	26,609	774.150	20,599,357.350	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	133,783	396.050	52,984,757.150	
ITC LTD	288,979	326.300	94,293,847.700	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,019	2,612.000	39,229,628.000	
UNITED PHOSPHORUS LTD	48,286	664.150	32,069,146.900	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,851	1,588.100	15,644,373.100	
SIEMENS INDIA LTD	7,173	2,726.350	19,556,108.550	
INFO EDGE INDIA LTD	7,181	3,763.700	27,027,129.700	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,356	824.950	34,116,632.200	
TECH MAHINDRA LTD	57,779	1,004.850	58,059,228.150	
MINDTREE LTD	5,472	3,310.400	18,114,508.800	

MARICO LTD	52,342	506.850	26,529,542.700	
PAGE INDUSTRIES LTD	613	51,306.200	31,450,700.600	
DLF LTD	60,549	358.500	21,706,816.500	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	308,608	208.350	64,298,476.800	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	51,713	797.350	41,233,360.550	
BAJAJ FINSERV LTD	37,350	1,672.650	62,473,477.500	
BAJAJ AUTO LTD	6,864	3,528.750	24,221,340.000	
JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	600.200	24,336,909.600	
ADANI POWER LTD	77,437	356.850	27,633,393.450	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,565	1,027.300	11,880,724.500	
COAL INDIA LTD	153,824	225.450	34,679,620.800	
INDUS TOWERS LTD	64,346	190.400	12,251,478.400	
PI INDUSTRIES LTD	7,535	2,964.500	22,337,507.500	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,306	4,604.700	24,432,538.200	
ADANI GREEN ENERGY LTD	31,246	2,128.800	66,516,484.800	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	94,595	522.550	49,430,617.250	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	582.800	9,207,657.200	
BANDHAN BANK LTD	54,907	263.600	14,473,485.200	
ADANI TOTAL GAS LTD	26,973	3,173.600	85,601,512.800	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,175.500	14,914,744.000	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	40,943	719.200	29,446,205.600	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	23,890	872.500	20,844,025.000	
PIRAMAL PHARMA LTD	40,324	219.125	8,835,996.500	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	21,490	725.600	15,593,144.000	
ZOMATO LTD	223,089	65.550	14,623,483.950	
BERGER PAINTS INDIA LTD	21,517	617.650	13,289,975.050	
ADANI TRANSMISSIONS LTD	27,334	3,154.350	86,221,002.900	
AVENUE SUPERMARTS LTD	15,958	4,381.100	69,913,593.800	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	24,802	1,135.050	28,151,510.100	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	508.800	18,656,169.600	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,662	1,769.950	17,101,256.900	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	44,309	1,206.350	53,452,162.150	
インド・ルビー 小計	9,738,424		6,941,001,515.000 (12,424,392,712)	
インドネシア・ルビア				
ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	1,895.000	1,709,669,000.000	
BARITO PACIFIC TBK PT	2,875,400	825.000	2,372,205,000.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	169,701	32,200.000	5,464,372,200.000	

	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	391,300	6,125.000	2,396,712,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	650,500	4,730.000	3,076,865,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,992,500	6,525.000	13,001,062,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,868,100	4,310.000	20,981,511,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	752,600	5,525.000	4,158,115,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	22,750.000	737,100,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	8,875.000	2,595,050,000.000	
	BANK MANDIRI	1,831,800	9,300.000	17,035,740,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	6,657,300	4,430.000	29,491,839,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	756,200	8,700.000	6,578,940,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,875,300	1,835.000	3,441,175,500.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	273,600	7,525.000	2,058,840,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,390,200	8,250.000	44,469,150,000.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	168,900	6,550.000	1,106,295,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,455,300	3,930.000	5,719,329,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	9,000.000	2,333,700,000.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	460,700	2,600.000	1,197,820,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,340.000	3,973,086,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,220.000	2,706,692,000.000	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK PT	847,400	1,775.000	1,504,135,000.000	
	BANK JAGO TBK PT	428,300	6,075.000	2,601,922,500.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	3,760.000	4,634,132,320.000	
	インドネシア・ルピア 小計	38,480,383		185,345,458,520.000 (1,779,316,402)	
オフショア・人 民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	87.160	1,135,869.120	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	39.650	229,970.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	13.150	298,505.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	9.550	56,727.000	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	110.220	330,660.000	

DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	5,100	36.810	187,731.000	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	48,300	5.640	272,412.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	19.630	58,890.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	7.940	95,280.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	74.110	895,248.800	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	5,200	9.220	47,944.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	14.540	254,450.000	
UNISPLENDOR CORP LTD	21,240	15.390	326,883.600	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	19.370	203,385.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	11.630	222,133.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	78.400	94,080.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	23.300	377,460.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	18.460	138,450.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	161.570	339,297.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	20.930	186,277.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	23.680	125,504.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	22.210	308,719.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	13.000	310,700.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	8.430	265,545.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	3.840	237,312.000	
GEM CO LTD	29,100	7.280	211,848.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	105.050	273,130.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	36.380	251,022.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	3.700	68,820.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	13.130	221,897.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	116.600	1,142,680.000	

WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	11.280	135,303.600	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	22.060	130,242.240	
ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	21.230	579,833.760	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	21.560	57,349.600	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	20.300	133,980.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	23.110	117,861.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	7.910	20,566.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	62.000	576,600.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	31.320	325,728.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	41,400	11.280	466,992.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	26.800	308,200.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	58.260	1,940,058.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	11,300	78.180	883,434.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	5,700	28.370	161,709.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	14.830	266,940.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	10.970	197,460.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	100.600	1,016,060.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	8.170	91,504.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	8.380	84,638.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	5.170	162,338.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	11.380	63,728.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	17.560	247,596.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	16.720	232,408.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	6.790	18,536.700	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	18,300	21.560	394,548.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	17.480	136,344.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	13.200	947,100.000	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	38.910	233,460.000	

UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	139.780	858,109.420	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	19.090	68,151.300	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	8.130	103,251.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	5.180	44,548.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	4.400	161,480.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	7.110	227,520.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	36,967	27.140	1,003,284.380	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	25.420	274,536.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	784	28.800	22,579.200	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	11,100	24.240	269,064.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	20.580	142,002.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	4.380	167,316.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	32.450	159,005.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	7.720	118,116.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	4.810	101,010.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	38.730	290,475.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	33.000	165,000.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	2.600	257,660.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	15.120	99,792.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	24.750	242,550.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,800	216.350	1,687,530.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	58.540	1,042,012.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	8.060	120,497.000	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	6.500	115,050.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	22,300	43.400	967,820.000	

SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	10.880	64,627.200	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	11.410	84,981.680	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	76.960	161,616.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	5.750	209,760.000	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	6.800	97,240.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	27.750	1,250,248.500	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	23.270	695,773.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.110	140,525.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	5.380	383,594.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	14.440	287,356.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	11.300	215,830.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	5.270	20,026.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	31.100	366,980.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.280	212,952.000	
GOERTEK INC	25,100	24.900	624,990.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.510	138,663.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	45,200	30.950	1,398,940.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	9.160	362,736.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	135,200	3.710	501,592.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.250	148,575.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	4.650	174,840.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	38,688	12.160	470,446.080	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	5.890	133,703.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	24.170	662,258.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	51.580	542,621.600	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	84,349	17.390	1,466,829.110	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	153.800	1,199,640.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	23,400	158.590	3,711,006.000	

SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	76,600	5.230	400,618.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.260	711,006.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	16.890	775,251.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	31.940	597,278.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.510	359,973.000	
PING AN BANK CO LTD	128,100	11.480	1,470,588.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	34,080	21.900	746,352.000	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	3.880	567,644.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	16.980	935,598.000	
ZTE CORP	19,700	20.520	404,244.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	5.570	158,745.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,100	9.300	447,330.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	29.880	125,496.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	14.410	557,667.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.310	238,641.000	
BYD CO LTD	11,200	255.010	2,856,112.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	111.360	233,856.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	6.870	207,474.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.370	149,017.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	45.760	442,041.600	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	42.930	224,094.600	
LB GROUP CO LTD	11,000	15.500	170,500.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	16.600	297,140.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	26.000	218,400.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	48.250	101,325.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	30.110	289,056.000	

SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	19.900	232,830.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	44.000	127,600.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	16.620	132,960.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	19.980	253,746.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	225.500	789,250.000	
JIANGXI ZHENGBOANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	4.450	16,020.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	7.220	217,322.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	14.210	181,888.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.600	225,720.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.110	235,503.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	12.240	67,932.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,000	256.500	513,000.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.590	118,404.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	65.060	429,396.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	44.820	26,892.000	
NINESTAR CORP	5,700	41.040	233,928.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	14.950	380,029.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.200	108,160.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	7.360	88,320.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	42.770	68,432.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	15.640	264,316.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	131.180	238,747.600	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	117.950	212,310.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	4.080	61,608.000	
SF HOLDING CO LTD	32,000	45.020	1,440,640.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	86.040	154,872.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.460	128,856.000	

BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	65.320	261,280.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	64.750	161,875.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	119,490	5.880	702,601.200	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	6.380	248,182.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	5.000	365,000.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	65.190	149,937.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	22.970	599,517.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	5,880	57.700	339,276.000	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	15.670	142,597.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,200	16.620	551,784.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	59.400	184,140.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	9.460	212,850.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,872	30.000	56,160.000	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	9.360	363,168.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	47.400	175,380.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	25.870	134,524.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	10,913	20.800	226,990.400	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	61.560	193,914.000	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	4,600	174.210	801,366.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	59.660	161,082.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	48.700	150,970.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	111.910	235,011.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	62.620	570,843.920	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	13.250	125,875.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	26.550	79,650.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	18.490	190,447.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	49.820	234,154.000	

HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	34.800	240,120.000	
SHENAN CIRCUITS CO LTD	4,540	72.600	329,604.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	133.380	400,140.000	
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	47.320	127,764.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	47.090	378,132.700	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	52.340	68,042.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	78.520	235,560.000	
CHINA MINMETALS RARE EARTH CO LTD	11,600	26.100	302,760.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	27.760	88,832.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	6.750	85,725.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	117.880	282,912.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	16.150	343,995.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	14.890	196,548.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	61.070	116,033.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	7.880	77,224.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	8.180	458,898.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	301.770	2,233,098.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.470	115,785.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	4,400	87.500	385,000.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	19.890	169,065.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	37.350	151,641.000	
SG MICRO CORP	1,350	133.970	180,859.500	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	13,800	416.300	5,744,940.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	83.380	251,474.080	
WUXI APPTec CO LTD	17,572	69.400	1,219,496.800	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	31.660	326,098.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	3.630	334,323.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	44.700	326,310.000	

MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	79.400	203,264.000	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	12.920	383,724.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	49.610	245,569.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	276.550	165,930.000	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,900	123.780	358,962.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	193.970	213,367.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	60.260	66,286.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	109.740	427,986.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	106.800	192,240.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	81.220	243,660.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	42.960	231,984.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	4.220	316,500.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	79.800	215,460.000	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO	3,500	49.200	172,200.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	38.320	314,224.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	11.590	304,817.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	9,130	75.500	689,315.000	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	139.190	331,272.200	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	54.280	174,781.600	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	24.400	312,320.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	6.600	288,420.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.940	336,042.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	4.780	337,946.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	25.580	273,706.000	

CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.100	200,880.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	110.420	242,924.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	170.490	214,817.400	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	70.860	205,494.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	285,200	4.480	1,277,696.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	306.000	244,800.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	474.500	455,520.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	4.180	773,300.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.510	220,710.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	46.450	106,835.000	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD	32,900	8.840	290,836.000	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	3,900	65.130	254,007.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	199.900	279,860.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	42.100	256,810.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	37.500	60,000.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,440	19.470	28,036.800	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	125.710	276,562.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,580	62.170	719,928.600	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.490	231,044.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	2,755	110.700	304,978.500	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	9,100	38.010	345,891.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	155.310	403,806.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	33.440	250,800.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	52.250	240,350.000	

SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	2,900	91.300	264,770.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	800	470.280	376,224.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	54.890	175,648.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,047	198.550	406,431.850	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	11,000	16.780	184,580.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	637	241.880	154,077.560	
SHANGHAI MEDICILON INC	800	201.330	161,064.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.260	419,456.000	
PETROCHINA CO LTD	100,600	5.210	524,126.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	332,300	4.370	1,452,151.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	433,000	2.870	1,242,710.000	
BANK OF CHINA LTD	135,800	3.060	415,548.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	143,200	4.320	618,624.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,700	30.840	700,068.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,000	31.610	1,043,130.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	123,100	31.400	3,865,340.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	64,700	41.200	2,665,640.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	16.330	2,121,267.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	156,900	7.010	1,099,869.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	3.420	744,534.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.160	601,800.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,300	1,779.990	12,993,927.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	4.610	1,040,477.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	83,100	17.390	1,445,109.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	19.860	808,302.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.530	211,799.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	130,000	23.420	3,044,600.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.750	557,550.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	2.820	606,582.000	

CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	220,000	5.130	1,128,600.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.620	478,410.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	5.030	355,621.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	33,300	32.360	1,077,588.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.120	362,148.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	3.370	644,344.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	169,900	5.220	886,878.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	27.950	648,440.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	59,800	12.190	728,962.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	8.060	475,540.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	26.090	305,253.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	63,600	17.890	1,137,804.000	
CRRC CORP LTD	141,700	4.660	660,322.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	43,252	34.100	1,474,893.200	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	16,800	25.770	432,936.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	12.050	596,475.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	157,500	5.310	836,325.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	16,300	26.590	433,417.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	45,500	24.840	1,130,220.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	13.610	656,002.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.470	452,811.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	5.520	310,224.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	27.970	486,678.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	12.760	336,864.000	
GEMDALE CORP	39,700	10.990	436,303.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	92.770	1,855,400.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	3.890	306,143.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	140,200	7.880	1,104,776.000	

FOUNDER SECURITIES CO LTD	67,400	6.490	437,426.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	11.150	352,340.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	35,044	25.040	877,501.760	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	4.540	135,292.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	12,000	185.630	2,227,560.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	11.930	368,637.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	1.830	407,175.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	104.060	457,864.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.040	76,000.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	4.110	419,220.000	
AIR CHINA LTD	28,400	10.100	286,840.000	
TBEA CO LTD	18,600	21.780	405,108.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.870	342,345.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	164,900	3.010	496,349.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	71,300	7.140	509,082.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	33,700	22.960	773,752.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	57.680	190,344.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	25.650	176,985.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	15.290	227,821.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.900	133,770.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	16.360	466,260.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	7.710	114,108.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	12.300	291,510.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	16.370	186,618.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	12,600	41.500	522,900.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	10.490	601,077.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	11.580	88,008.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	11.310	1,014,167.700	

CMOC GROUP LIMITED	119,700	4.560	545,832.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	84,800	5.410	458,768.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	46.300	416,700.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	16.970	341,436.400	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	26.080	198,208.000	
BBMG CORP	54,200	2.550	138,210.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	49.470	692,580.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	4.830	186,438.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	21.250	319,153.750	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	6.470	375,260.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	17.010	130,977.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	32.440	332,964.160	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	16.730	271,862.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	22.670	74,811.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	96,500	6.490	626,285.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.540	149,860.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	34.880	355,776.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	14.160	267,624.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.350	162,560.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	38.250	175,950.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.260	105,168.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	16.870	254,737.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	49,500	4.400	217,800.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	14,900	19.670	293,083.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	3.950	155,630.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.180	121,128.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	9.330	217,389.000	

ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	252.820	985,998.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	283.100	2,117,588.000	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	12.310	14,772.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	16.470	207,522.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	7.370	418,616.000	
KINGFA SCI & TECH CO LTD	26,600	9.420	250,572.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.550	163,750.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	14.150	287,245.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	13.610	264,034.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.010	78,862.000	
BEIJING TIANAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	6,480	19.930	129,146.400	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	22.450	282,870.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	17.190	448,659.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	31.000	130,200.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.600	277,120.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	33,900	10.370	351,543.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	22.720	288,544.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	18.040	105,173.200	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	10.360	122,248.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	26,800	12.770	342,236.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	47.440	1,375,760.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	8,879	35.600	316,092.400	
JCET GROUP CO LTD	10,900	20.640	224,976.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	30.500	207,400.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	96.150	240,375.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	55.250	292,825.000	

HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	16.050	89,880.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	28.850	302,636.500	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	160.550	272,935.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	13.060	264,412.760	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	3.240	202,176.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	20.380	269,016.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	5,924	44.500	263,618.000	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	9.280	181,888.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	19.380	379,848.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	9.960	196,212.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	13.420	210,694.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	100.960	171,632.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	40.250	197,225.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	32.840	183,904.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,400	79.740	111,636.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	166.000	149,400.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	415.100	332,080.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	41.510	107,926.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	127.470	127,470.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	44.750	317,725.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	63.720	707,292.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.730	1,041,141.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	28.000	324,800.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	401.010	401,010.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	46.510	2,184,481.680	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	16.900	214,630.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	148.400	267,120.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	22.530	1,425,045.030	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	24,016	73.450	1,763,975.200	

JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	44.320	221,600.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	14.180	17,016.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	34.420	240,940.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	7.370	97,284.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	72.120	504,840.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	13.600	553,520.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	6.290	660,450.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	44.160	150,144.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	55.140	292,242.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	85.500	171,000.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	7.380	614,016.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	13.930	632,422.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	17.470	199,158.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	17.500	35,000.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	20.420	577,886.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	37.320	330,282.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	9.270	281,808.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	118.920	95,136.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	19.880	423,444.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,480	50.900	278,932.000	
TOLY BREAD CO LTD	7,056	13.430	94,762.080	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	49.170	140,626.200	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	34.650	101,871.000	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	23.000	260,130.000	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	7.640	376,652.000	
CHIFENG JILONG GOLD MINING CO LTD	14,700	20.190	296,793.000	
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	13.140	210,240.000	
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	43.250	194,625.000	

	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	16.420	175,694.000	
オフショア・人民元 小計		14,393,569		212,316,483.220 (4,324,249,814)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	450,826	19.600	8,836,189.600	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	325,231	7.150	2,325,401.650	
	OOREDOO QSC	65,947	9.100	600,117.700	
	QATAR FUEL QSC	50,528	19.000	960,032.000	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,060	17.570	651,144.200	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	65,041	11.290	734,312.890	
	INDUSTRIES QATAR QSC	148,624	17.100	2,541,470.400	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	163,055	24.980	4,073,113.900	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	4.098	1,022,401.820	
	MASRAF AL RAYAN	562,961	4.022	2,264,229.140	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	3.330	678,697.290	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	2.410	1,088,505.420	
カタール・リアル 小計		2,774,236		25,775,616.010 (1,025,354,005)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	499,107	0.786	392,298.100	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	216,726	0.587	127,218.160	
	GULF BANK KSCP	137,969	0.315	43,460.230	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	697,988	1.023	714,041.720	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	149,005	0.677	100,876.380	
	MABANEE CO KPSC	53,023	0.850	45,069.550	
	BOUBYAN BANK KSCP	136,266	0.805	109,694.130	
クウェート・ディナール 小計		1,890,084		1,532,658.270 (721,422,248)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	37,356	18,590.000	694,448,040.000	
	ECOPETROL SA	508,321	2,179.000	1,107,631,459.000	
	BANCOLOMBIA SA	29,016	34,200.000	992,347,200.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	40,127	28,500.000	1,143,619,500.000	
コロンビア・ペソ 小計		614,820		3,938,046,199.000 (124,910,887)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,055	46.750	1,218,071.250	
	JARIR MARKETING CO	6,127	169.600	1,039,139.200	
	ETIHAD ETISALAT CO	38,569	35.050	1,351,843.450	
	SAUDI BRITISH BANK	91,386	40.500	3,701,133.000	

AL RAJHI BANK	191,199	81.900	15,659,198.100	
ARAB NATIONAL BANK	60,216	31.050	1,869,706.800	
BANK ALBILAD	48,763	50.900	2,482,036.700	
BANK AL-JAZIRA	41,743	23.800	993,483.400	
BANQUE SAUDI FRANSI	58,427	42.350	2,474,383.450	
RIYAD BANK	132,730	32.600	4,326,998.000	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	17.800	935,461.200	
SAUDI TELECOM CO	146,310	37.800	5,530,518.000	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	21,085	165.000	3,479,025.000	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	87,305	91.400	7,979,677.000	
SAUDI ELECTRICITY CO	81,360	25.950	2,111,292.000	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	22.440	871,928.640	
SAVOLA GROUP	22,831	29.350	670,089.850	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	26,550	13.760	365,328.000	
ALMARAI CO JSC	24,903	53.300	1,327,329.900	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,070	204.400	627,508.000	
EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	10.040	284,242.440	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	35,820	42.600	1,525,932.000	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	45.500	655,063.500	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	13.740	1,043,030.880	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	45,345	16.000	725,520.000	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	35,214	14.640	515,532.960	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	53,271	12.640	673,345.440	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	5,610	171.600	962,676.000	
ALINMA BANK	96,142	36.500	3,509,183.000	
SAUDI ARABIAN MINING CO	84,602	71.500	6,049,043.000	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	214.000	1,077,704.000	
SAUDI ARABIAN OIL CO	235,349	35.700	8,401,959.300	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,656	235.800	2,041,084.800	
ACWA POWER CO	7,940	162.200	1,287,868.000	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,616	209.400	757,190.400	
ELM CO	2,420	321.400	777,788.000	

	THE SAUDI NATIONAL BANK	213,622	61.300	13,095,028.600	
サウジアラビア・リアル	小計	2,151,302		102,396,343.260 (3,990,385,497)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	90,400	31.500	2,847,600.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	302,300	16.700	5,048,410.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	39.250	4,878,775.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,039,555	5.100	5,301,730.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	52,000	143.500	7,462,000.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	162.000	4,762,800.000	
	SHIN CORP PCL	96,300	69.750	6,716,925.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	25.000	9,805,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	118,600	185.000	21,941,000.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	517,120	13.300	6,877,696.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	30,900	666.000	20,579,400.000	
	PTT PCL	963,100	34.500	33,226,950.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	265,000	18.400	4,876,000.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	83,100	55.250	4,591,275.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	8.550	7,063,155.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	75,650	312.000	23,602,800.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	413,700	71.500	29,579,550.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	201,700	63.000	12,707,100.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,028,300	29.000	29,820,700.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	62,700	228.000	14,295,600.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	328,110	25.500	8,366,805.000	
	THAI OIL PCL NVDR	124,700	52.000	6,484,400.000	
	CP ALL PCL NVDR	573,200	55.000	31,526,000.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	7.900	6,848,510.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	138,845	170.000	23,603,650.000	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	142,922	38.500	5,502,497.000	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	234,908	40.500	9,513,774.000	
	JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	56,700	61.250	3,472,875.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	168,000	88.000	14,784,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	860,800	8.900	7,661,120.000	

	B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	30.500	2,995,100.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	286,200	48.500	13,880,700.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	142,800	25.750	3,677,100.000	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	201,700	14.800	2,985,160.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	5.750	4,698,900.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	154,733	38.750	5,995,903.750	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	108,300	52.000	5,631,600.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	40.000	2,760,000.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	25.500	7,530,150.000	
	SCB X PCL NVDR	90,300	103.500	9,346,050.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	24,000	82.000	1,968,000.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	57,900	34.000	1,968,600.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	58.500	4,352,400.000	
	タイ・パーツ 小計	12,627,543		441,537,761.250 (1,686,674,248)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,555	673.000	4,411,515.000	
	CEZ	15,836	800.000	12,668,800.000	
	MONETA MONEY BANK AS	40,915	70.500	2,884,507.500	
	チェコ・コルナ 小計	63,306		19,964,822.500 (115,348,758)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,868,510	33.220	228,171,902.200	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,121	24,188.000	123,866,748.000	
	BANCO DE CHILE	4,571,902	85.400	390,440,430.800	
	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,390.000	165,768,620.000	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	6,050.000	244,559,150.000	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	4,860.000	51,107,760.000	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,250,262	63.770	79,729,207.740	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	105.970	226,050,117.440	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	13,966	84,295.000	1,177,263,970.000	
	FALABELLA SA	63,666	1,812.000	115,362,792.000	
	CENCOSUD SA	152,261	1,191.000	181,342,851.000	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	28.300	68,364,366.600	
	チリ・ペソ 小計	17,644,739		3,052,027,915.780 (480,486,859)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	335,192	13.060	4,377,607.520	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	84,401	32.260	2,722,776.260	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	121,748	30.220	3,679,224.560	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	348.500	2,582,385.000	
	KOC HOLDING AS	70,710	52.200	3,691,062.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	121,871	29.420	3,585,444.820	
	TURK HAVA YOLLARI	49,093	84.500	4,148,358.500	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	137,757	25.140	3,463,210.980	
	TURKIYE IS BANKASI	331,103	8.290	2,744,843.870	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFFINE	10,975	343.500	3,769,912.500	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	94,865	28.580	2,711,241.700	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,467	122.900	5,956,594.300	
トルコ・リラ 小計		1,413,592		43,432,662.010 (341,593,543)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,715	7,820.000	107,251,300.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,781	2,454.000	100,076,574.000	
	OTP BANK NYRT	22,689	8,050.000	182,646,450.000	
ハンガリー・フォロント 小計		77,185		389,974,324.000 (128,811,249)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	752,600	22.700	17,084,020.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158,120	56.800	8,981,216.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	188,130	93.350	17,561,935.500	
	AYALA CORP	22,173	596.500	13,226,194.500	
	GLOBE TELECOM INC	1,995	2,230.000	4,448,850.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	103,500	178.000	18,423,000.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	318,290	42.300	13,463,667.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46,960	233.000	10,941,680.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	159,865	48.500	7,753,452.500	
	BDO UNIBANK INC	200,993	114.800	23,073,996.400	
	PLDT INC	8,985	1,402.000	12,596,970.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,121,775	31.000	34,775,025.000	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	76,860	110.400	8,485,344.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,153	759.000	18,332,127.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	889,900	3.350	2,981,165.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,720	290.000	7,168,800.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	393.000	2,594,193.000	
ACEN CORP	763,119	5.700	4,349,778.300		
MONDE NISSIN CORP	649,200	11.720	7,608,624.000		

	CONVERGE INFORMATION AND COMMUNICATIONS TECHNOLOGY SOLUTIONS INC	132,900	12.440	1,653,276.000	
フィリピン・ペソ 小計		5,650,839		235,503,314.200 (584,684,078)	
ブラジル・リアル	BRF SA	54,692	14.330	783,736.360	
	VALE SA	392,389	73.490	28,836,667.610	
	RAIA DROGASIL SA	106,700	23.440	2,501,048.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,950	48.170	1,153,671.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	103,700	45.550	4,723,535.000	
	BANCO DO BRASIL SA	84,500	39.110	3,304,795.000	
	ITAUSA SA	453,388	10.080	4,570,151.040	
	GERDAU SA	115,430	25.860	2,985,019.800	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	366,710	36.740	13,472,925.400	
	VIBRA ENERGIA SA	117,700	17.380	2,045,626.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	464,312	33.000	15,322,296.000	
	CCR SA	121,020	12.290	1,487,335.800	
	WEG SA	165,044	33.900	5,594,991.600	
	BANCO BRADESCO SA PREF	521,702	20.110	10,491,427.220	
	BANCO BRADESCO SA	155,292	16.600	2,577,847.200	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64,606	13.780	890,270.680	
	SUZANO SA	74,375	47.630	3,542,481.250	
	CPFL ENERGIA SA	23,600	34.000	802,400.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	471,547	28.810	13,585,269.070	
	AMERICANAS SA	46,471	20.560	955,443.760	
	BRASKEM SA	19,900	33.580	668,242.000	
	ENGIE BRASIL SA	17,987	39.060	702,572.220	
	LOCALIZA RENT A CAR	72,089	65.790	4,742,735.310	
	LOJAS RENNER SA	99,120	29.950	2,968,644.000	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	66,304	12.460	826,147.840	
	COSAN SA	119,800	15.660	1,876,068.000	
	TOTVS SA	53,400	30.300	1,618,020.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	100,500	28.650	2,879,325.000	
	JBS SA	76,700	24.630	1,889,121.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	136,462	10.650	1,453,320.300	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,098	57.440	1,958,589.120	
HYPERA SA	41,200	46.590	1,919,508.000		
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	597,648	14.350	8,576,248.800		
MAGAZINE LUIZA SA	271,500	5.170	1,403,655.000		
HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	70,200	31.500	2,211,300.000		

	TELEFONICA BRASIL SA	50,528	40.010	2,021,625.280	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,700	27.440	1,885,128.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	463,461	7.470	3,462,053.670	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	42,700	18.760	801,052.000	
	AMBEV SA	459,295	14.990	6,884,832.050	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	13.200	1,223,640.000	
	TIM SA	69,800	12.220	852,956.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	34,800	30.070	1,046,436.000	
	LOCALIZA RENT A CAR SA-RTS	221	16.390	3,622.190	
	RUMO SA	127,600	19.000	2,424,400.000	
	ブラジル・リアル 小計	7,113,841		175,926,180.070 (4,847,346,817)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	183.900	247,161.600	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,187	89.080	1,352,857.960	
	BANK PEKAO SA	20,059	65.000	1,303,835.000	
	ORANGE POLSKA SA	52,852	5.334	281,912.560	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	40,886	52.500	2,146,515.000	
	LPP SA	112	8,040.000	900,480.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,881	194.500	560,354.500	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	120.800	845,720.800	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	90,467	21.700	1,963,133.900	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	180,060	4.840	871,490.400	
	CYFROWY POLSAT SA	19,008	16.630	316,103.040	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,101	5.748	425,932.540	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	60,071	23.970	1,439,901.870	
	DINO POLSKA SA	4,847	286.200	1,387,211.400	
	ALLEGRO.EU SA	30,158	19.500	588,081.000	
	ポーランド・ズロチ 小計	599,034		14,630,691.570 (427,669,745)	
マレーシア・リンギット	AMMB HOLDINGS BHD	157,100	3.950	620,545.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	674,000	5.290	3,565,460.000	
	DIGI.COM BHD	275,700	3.400	937,380.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	47,920	5.600	268,352.000	
	RHB BANK BHD	133,680	5.500	735,240.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	60,000	6.050	363,000.000	

	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	0.625	312,937.500	
	GENTING BHD	182,400	4.420	806,208.000	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	18.500	334,036.000	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	20.400	1,336,363.200	
	IOI CORP BHD	276,613	3.680	1,017,935.840	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	37,900	19.800	750,420.000	
	MALAYAN BANKING BHD	453,375	8.440	3,826,485.000	
	MISC BHD	115,180	7.000	806,260.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,800	129.500	880,600.000	
	PPB GROUP BHD	70,260	15.960	1,121,349.600	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	20.400	701,760.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	16.100	1,279,950.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	275,400	2.690	740,826.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	99,500	5.240	521,380.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	252,550	8.050	2,033,027.500	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.110	589,949.500	
	DIALOG GROUP BHD	418,344	1.900	794,853.600	
	PUBLIC BANK BHD(LOCAL)	1,419,350	4.200	5,961,270.000	
	SIME DARBY BERHAD	320,700	2.130	683,091.000	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	105,800	1.670	176,686.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	317,100	2.580	818,118.000	
	MAXIS BHD	214,200	3.430	734,706.000	
	INARI AMERTRON BHD	236,500	2.470	584,155.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	238,100	8.590	2,045,279.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	177,700	5.650	1,004,005.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.190	1,575,859.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.020	887,616.000	
	MR DIY GROUP M BHD	259,200	1.970	510,624.000	
	マレーシア・リンギット 小計	8,235,886		39,325,727.740 (1,229,636,855)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	254,900	12.310	3,137,819.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	132,300	71.980	9,522,954.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,700	199.880	4,337,396.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,660	132.960	3,012,873.600	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	36,400	73.750	2,684,500.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	255,800	143.870	36,801,946.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	85,925	33.090	2,843,258.250	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	12,455	222.370	2,769,618.350	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	133,000	26.330	3,501,890.000	

	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	19,220	409.560	7,871,743.200	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	308,752	67.250	20,763,572.000	
	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,737,378	16.790	45,960,576.620	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	219,900	34.140	7,507,386.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,700	140.860	6,296,442.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	511,300	73.370	37,514,081.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	35,785	276.410	9,891,331.850	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	117,000	17.400	2,035,800.000	
	SITIOS LATINOAMERICA SAB DE CV	136,869	6.300	862,274.700	
メキシコ・ペソ	小計	5,086,044		207,315,462.570 (1,510,915,091)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	198,844	0.848	168,619.710	
	NATIONAL BANK OF GREECE	62,656	3.189	199,809.980	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,850	15.060	314,001.000	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	220,526	0.888	195,827.080	
	MYTILINEOS HOLDINGS	10,944	14.550	159,235.200	
	OPAP SA	19,031	12.160	231,416.960	
	JUMBO SA	9,875	13.260	130,942.500	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	5.340	114,494.940	
ユーロ	小計	567,297		1,514,347.370 (214,795,031)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,775	84,000.000	149,100,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	8,603	22,850.000	196,578,550.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,498	79,400.000	277,741,200.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,110	191,500.000	595,565,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,976	55,300.000	219,872,800.000	
	COWAY CO LTD	5,833	52,800.000	307,982,400.000	
	KT&G CORP	10,777	86,900.000	936,521,300.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	56,300.000	87,659,100.000	
	CJ CORP	1,958	67,800.000	132,752,400.000	
	KAKAO CORP	30,480	50,100.000	1,527,048,000.000	
	CJ ENM CO LTD	1,490	73,600.000	109,664,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	6,100.000	190,490,800.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,664	336,000.000	559,104,000.000	
	LG UPLUS CORP	19,033	10,500.000	199,846,500.000	
	DOOSAN ENERBILITY	40,670	13,500.000	549,045,000.000	

LG H&H CO LTD	981	613,000.000	601,353,000.000	
LG CHEM LTD	4,903	597,000.000	2,927,091,000.000	
LG CHEM LTD	622	276,500.000	171,983,000.000	
LG H&H CO LTD	102	311,500.000	31,773,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	45,807	34,650.000	1,587,212,550.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	27,028	17,800.000	481,098,400.000	
S-OIL CORP	4,649	84,500.000	392,840,500.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	11,502	46,200.000	531,392,400.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	17,730	3,455.000	61,257,150.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	31,050.000	194,869,800.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,719	163,000.000	443,197,000.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,831	153,000.000	280,143,000.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,641	73,000.000	265,793,000.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	76,600.000	335,737,800.000	
HYUNDAI MOBIS	6,038	201,500.000	1,216,657,000.000	
SK HYNIX INC	53,581	90,200.000	4,833,006,200.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,044	36,750.000	258,867,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,064	78,900.000	162,849,600.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,617	168,000.000	2,287,656,000.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,657	30,100.000	230,475,700.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,131	9,840.000	227,609,040.000	
KIA CORPORATION	25,784	67,400.000	1,737,841,600.000	
KOREA ZINC CO LTD	861	609,000.000	524,349,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	25,278	18,450.000	466,379,100.000	
KOREAN AIR CO LTD	17,387	21,400.000	372,081,800.000	
CJ LOGISTICS	958	80,300.000	76,927,400.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,557	131,500.000	204,745,500.000	
HLB INC	9,695	41,500.000	402,342,500.000	
LG ELECTRONICS INC	10,517	78,200.000	822,429,400.000	
LG CORP	9,347	75,700.000	707,567,900.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	8,870.000	135,622,300.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	6,167	21,550.000	132,898,850.000	
NAVER CORP	12,842	158,500.000	2,035,457,000.000	
L&F CO LTD	2,321	193,500.000	449,113,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,706	46,950.000	173,996,700.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,234	24,300.000	54,286,200.000	
KANGWON LAND INC	9,245	23,650.000	218,644,250.000	

POSCO HOLDINGS INC	7,765	230,000.000	1,785,950,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	13,977	23,100.000	322,868,700.000	
SAMSUNG SDI CO LTD	5,386	600,000.000	3,231,600,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,630	117,000.000	658,710,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	117,500.000	48,175,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	467,131	55,400.000	25,879,057,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	54,875	5,270.000	289,191,250.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	79,802	50,200.000	4,006,060,400.000	
YUHAN CORP	4,610	54,900.000	253,089,000.000	
HANON SYSTEMS	19,141	7,460.000	142,791,860.000	
GS HOLDINGS CORP	4,259	43,850.000	186,757,150.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	13,900.000	330,013,800.000	
CELLTRION INC	9,724	165,000.000	1,604,460,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	29,761	36,850.000	1,096,692,850.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	161,500.000	311,372,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,680	60,400.000	101,472,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	88,400.000	90,610,000.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	2,499	28,350.000	70,846,650.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,005	65,100.000	521,125,500.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	98,300.000	298,045,600.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,484	156,000.000	855,504,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	709	400,000.000	283,600,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	4,570.000	143,009,010.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	288,000.000	413,568,000.000	
SK INC	3,655	199,500.000	729,172,500.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	38,671	44,650.000	1,726,660,150.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	45,050.000	334,541,300.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,508	56,800.000	142,454,400.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,277	20,850.000	47,475,450.000	
HANMI PHARM CO LTD	545	228,500.000	124,532,500.000	
SEEGENE INC	3,334	27,050.000	90,184,700.000	
E-MART CO LTD	1,887	83,500.000	157,564,500.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	34,950.000	269,010,150.000	
HD HYUNDAI CO LTD	4,097	57,600.000	235,987,200.000	
BGF RETAIL CO LTD	715	172,000.000	122,980,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,318	98,200.000	227,627,600.000	
SK CHEMICALS CO LTD	1,094	80,700.000	88,285,800.000	
NETMARBLE CORP	2,597	48,700.000	126,473,900.000	

	WOORI FINANCIAL GROUP INC	56,041	11,100.000	622,055,100.000	
	ECOPRO BM CO LTD	4,843	98,400.000	476,551,200.000	
	SD BIOSENSOR INC	2,353	26,450.000	62,236,850.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,850	53,800.000	153,330,000.000	
	KRAFTON INC	2,486	178,000.000	442,508,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,482	116,500.000	172,653,000.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	51,400.000	139,808,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	10,144	37,500.000	380,400,000.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	1,958	68,800.000	134,710,400.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	38,200.000	124,684,800.000	
	HYBE CO LTD	1,920	118,500.000	227,520,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	2,285	497,500.000	1,136,787,500.000	
	KAKAOBANK CORP	10,111	17,800.000	179,975,800.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,439	136,000.000	195,704,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,640	114,500.000	416,780,000.000	
	ALTEOGEN INC	3,010	36,350.000	109,413,500.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,288	109,500.000	907,536,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,737	802,000.000	1,393,074,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	41,900.000	87,152,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	29,450.000	135,470,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,748	65,000.000	568,620,000.000	
	韓国・ウォン 小計	1,562,271		87,491,006,660.000 (8,932,831,780)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	98,000	8.950	877,100.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	5.550	799,200.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	152,000	4.030	612,560.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12,000	111.100	1,333,200.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,500	24.800	3,062,800.000	
	BEIJING ENTERPRISES	58,000	22.950	1,331,100.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	390,000	3.680	1,435,200.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	496,000	3.560	1,765,760.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	150,000	27.650	4,147,500.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	56,749	7.720	438,102.280	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	67,500	32.900	2,220,750.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	885,600	7.510	6,650,856.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	377,120	21.000	7,919,520.000	

CHINA RESOURCES LAND LTD	312,888	31.300	9,793,394.400	
CITIC LTD	570,000	7.360	4,195,200.000	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	164,000	4.210	690,440.000	
LENOVO GROUP LTD	718,000	5.430	3,898,740.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,090,000	3.390	7,085,100.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	170,790	6.240	1,065,729.600	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,501,200	3.390	8,479,068.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	81,000	12.140	983,340.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	263,000	9.400	2,472,200.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	77,900	99.200	7,727,680.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	392,000	5.600	2,195,200.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	150,000	4.250	637,500.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	152,200	9.640	1,467,208.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	128,000	9.420	1,205,760.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	2.590	984,200.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	121,000	25.350	3,067,350.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	130,500	5.350	698,175.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	304,400	8.550	2,602,620.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	57,500	22.000	1,265,000.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	592,000	10.220	6,050,240.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	93,400	23.750	2,218,250.000	
BYD CO LTD	79,500	188.900	15,017,550.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	154,000	8.040	1,238,160.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	0.340	397,800.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	2.970	1,222,428.240	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	238,000	4.940	1,175,720.000	
MMG LTD	380,000	1.940	737,200.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	128.100	1,665,300.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	679,788	8.160	5,547,070.080	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	2.950	646,050.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	191,200	12.940	2,474,128.000	

GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	314,000	7.510	2,358,140.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	706,000	9.730	6,869,380.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	547,000	7.640	4,179,080.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	256,000	10.420	2,667,520.000	
WEICHAI POWER CO LTD	189,440	7.290	1,381,017.600	
TINGYI HOLDING CORP	202,000	13.360	2,698,720.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	60,000	72.150	4,329,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	258,000	5.740	1,480,920.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	2.880	910,080.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	159,333	53.650	8,548,215.450	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	5.120	593,920.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,044,250	3.650	3,811,512.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	311,000	31.000	9,641,000.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	612,000	254.600	155,815,200.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	618,500	38.350	23,719,475.000	
LI NING CO LTD	231,500	59.750	13,832,125.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	522,000	1.750	913,500.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	3.040	1,650,720.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	5.720	1,121,120.000	
ZTE CORP	65,288	13.720	895,751.360	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	336,500	23.450	7,890,925.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	300,750	9.100	2,736,825.000	
BANK OF COMMUNICATIONS	843,205	4.080	3,440,276.400	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	172,250	7.190	1,238,477.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	85,000	11.660	991,100.000	
BAIDU INC	216,200	109.400	23,652,280.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,370,530	4.480	41,979,974.400	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	82,000	61.550	5,047,100.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	238,000	4.170	992,460.000	
MINTH GROUP LTD	64,000	16.160	1,034,240.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	4.730	766,260.000	

CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	390,000	5.670	2,211,300.000	
BANK OF CHINA LTD	7,714,200	2.570	19,825,494.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	84,000	15.060	1,265,040.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	380,470	33.150	12,612,580.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,507,235	3.650	20,101,407.750	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	137,000	5.710	782,270.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	7.110	799,875.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	2.530	722,568.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	7.600	1,588,400.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	74,000	14.300	1,058,200.000	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	30.000	1,605,000.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	675,142	1.610	1,086,978.620	
CMOC GROUP LIMITED	282,000	2.930	826,260.000	
CHINA CITIC BANK-H	869,800	3.100	2,696,380.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	70,400	73.650	5,184,960.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	120,200	83.300	10,012,660.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	17.140	599,900.000	
FOSUN INTERNATIONAL	288,028	4.860	1,399,816.080	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.650	920,700.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	274,000	4.040	1,106,960.000	
KINGSOFT CORP LTD	98,800	18.700	1,847,560.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	65,500	6.870	449,985.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	395,000	3.870	1,528,650.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	6.170	937,840.000	
DONGYUE GROUP	116,000	7.940	921,040.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	71,000	17.020	1,208,420.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	492,000	5.040	2,479,680.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	260,600	14.020	3,653,612.000	
CRRG CORP LTD - H	349,000	2.490	869,010.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	110,000	7.940	873,400.000	

CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	9.180	1,312,740.000	
SINOPHARM GROUP CO	140,400	15.560	2,184,624.000	
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	125,000	2.790	348,750.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	222,000	3.470	770,340.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	5.440	1,580,466.880	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	194,000	6.310	1,224,140.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	327,000	10.020	3,276,540.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,900	10.540	789,446.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	107,200	2.700	289,440.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	99,000	7.100	702,900.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	182,000	20.000	3,640,000.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	14.300	1,262,690.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	2.300	1,444,758.800	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	62,200	8.650	538,030.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	6.970	738,820.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.120	530,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,807,000	2.340	6,568,380.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	61,500	31.000	1,906,500.000	
FAR EAST HORIZON LTD	188,000	5.300	996,400.000	
MICROPORIT SCIENTIFIC CORP	61,200	13.080	800,496.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	196,000	12.760	2,500,960.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	212,000	1.700	360,400.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	236,400	3.960	936,144.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	746,000	2.280	1,700,880.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	17.660	812,360.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	3.360	1,169,280.000	

HANERGY THIN FILM POWER GROUP	986,000	0.000	0.000	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	323,000	0.000	0.000	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD	108,000	4.530	489,240.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	767,000	4.170	3,198,390.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	42,000	14.460	607,320.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	116,000	15.020	1,742,320.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	204,000	11.060	2,256,240.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	13.940	782,034.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	62,000	12.500	775,000.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	108,500	5.770	626,045.000	
CHINA TOWER CORP LTD	4,406,000	0.820	3,612,920.000	
XIAOMI CORP	1,503,800	8.740	13,143,212.000	
WUXI APPTTEC CO LTD	32,812	61.000	2,001,532.000	
MEITUAN	431,600	151.400	65,344,240.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	14.760	1,889,280.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	96,000	14.320	1,374,720.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	484,000	7.820	3,784,880.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	22.650	2,355,600.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	0.800	797,600.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	50,000	10.800	540,000.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	176,500	13.020	2,298,030.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	107,500	3.630	390,225.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	41.400	256,680.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	163,000	5.050	823,150.000	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	102,000	11.400	1,162,800.000	
CHINA FEIHE LTD	374,000	5.190	1,941,060.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,487,868	76.000	113,077,968.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	32.350	624,355.000	
JD.COM INC	211,535	182.400	38,583,984.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	8.510	1,565,840.000	

JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	14.380	992,220.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	172,200	50.400	8,678,880.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	218,800	24.000	5,251,200.000	
BILIBILI INC	18,540	104.200	1,931,868.000	
NETEASE INC	203,200	115.900	23,550,880.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	65,000	4.630	300,950.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	14.640	1,324,920.000	
NONGFU SPRING CO LTD	172,600	44.050	7,603,030.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	111,150	42.100	4,679,415.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	29,400	40.950	1,203,930.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	69,200	30.000	2,076,000.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	54.400	685,440.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	171,761	13.800	2,370,301.800	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	151,900	17.800	2,703,820.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	13.180	653,728.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	50,000	15.840	792,000.000	
CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.690	1,762,670.000	
GF SECURITIES CO LTD	106,000	8.280	877,680.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	30.250	1,863,400.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	149,400	8.750	1,307,250.000	
3SBIO INC	146,500	6.730	985,945.000	
CHINA LITERATURE LTD	38,600	20.300	783,580.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	17.980	773,140.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	3.340	873,410.000	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	105,000	6.700	703,500.000	
BOC AVIATION LTD	16,400	51.100	838,040.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	62,600	17.020	1,065,452.000	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	11.820	1,465,680.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	150,400	11.120	1,672,448.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	352,000	46.250	16,280,000.000	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	396,000	1.610	637,560.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,240	52.450	1,743,438.000	
香港・ドル 小計	81,888,237		972,721,638.240 (18,112,076,905)	

台湾・ドル	ACCTON TECHNOLOGY CORP	50,000	270.500	13,525,000.000	
	ACER INC	278,532	21.500	5,988,438.000	
	ASUSTEK COMPUTER INC	69,554	225.000	15,649,650.000	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	247.000	11,514,152.000	
	ASIA CEMENT CORP	223,928	39.700	8,889,941.600	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	96,000	61.000	5,856,000.000	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	70,000	104.000	7,280,000.000	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	123,000	112.000	13,776,000.000	
	QUANTA COMPUTER INC	263,858	73.000	19,261,634.000	
	EVA AIRWAYS CORP	255,000	28.100	7,165,500.000	
	CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	65,760	169.500	11,146,320.000	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	465,030	16.650	7,742,749.500	
	CHINA AIRLINES	290,000	19.500	5,655,000.000	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	178,169	34.550	6,155,738.950	
	CHINA STEEL CORP	1,161,058	27.350	31,754,936.300	
	ADVANTECH CO LTD	41,675	292.500	12,189,937.500	
	COMPAL ELECTRONICS INC	423,304	21.350	9,037,540.400	
	DELTA ELECTRONICS INC	188,663	264.500	49,901,363.500	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	134,000	49.750	6,666,500.000	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	364,427	109.000	39,722,543.000	
	AUO CORP	652,155	16.450	10,727,949.750	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	168,800	92.900	15,681,520.000	
	EVERGREEN MARINE CORP	83,528	156.000	13,030,368.000	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	314,824	31.400	9,885,473.600	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	157.500	7,050,960.000	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	398.000	7,690,156.000	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	236.500	13,784,402.500	
	FORMOSA PLASTICS CORP	403,633	84.500	34,106,988.500	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	338,594	67.300	22,787,376.200	
	GIANT MANUFACTURING	30,151	204.000	6,150,804.000	
	MEDIATEK INC	148,507	553.000	82,124,371.000	
	FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	721,289	49.500	35,703,805.500	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	865,441	21.500	18,606,981.500	
	HOTAI MOTOR CO LTD	28,000	555.000	15,540,000.000	

FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	165,000	68.700	11,335,500.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	961,090	19.100	18,356,819.000	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	765,941	39.600	30,331,263.600	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,503,011	12.150	18,261,583.650	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,260,383	24.400	30,753,345.200	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,213,225	104.000	126,175,400.000	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,083,607	30.050	32,562,390.350	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	1,695.000	15,627,900.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,067,114	13.250	14,139,260.500	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,303,345	8.140	10,609,228.300	
INVENTEC CO LTD	270,005	22.850	6,169,614.250	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	197,845	63.800	12,622,511.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,007,777	16.850	16,981,042.450	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,720,048	20.100	34,572,964.800	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,027,662	25.000	25,691,550.000	
NAN YA PLASTICS CORP	460,828	66.100	30,460,730.800	
POU CHEN CORP	233,990	27.200	6,364,528.000	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	464,297	65.800	30,550,742.600	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	55,392	268.000	14,845,056.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,480	79.000	8,648,920.000	
E INK HOLDINGS INC	84,000	201.000	16,884,000.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	116,224	51.500	5,985,536.000	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	114,899	53.500	6,147,096.500	
TAIWAN CEMENT CORP	585,662	33.800	19,795,375.600	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,411,083	401.500	968,049,824.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,165,525	35.400	41,259,585.000	
WAN HAI LINES LTD	58,425	72.200	4,218,285.000	
WALSIN LIHWA CORP	257,421	36.850	9,485,963.850	
WINBOND ELECTRONICS CORP	278,000	19.000	5,282,000.000	
YAGEO CORP	43,160	272.500	11,761,100.000	

	YANG MING MARINE TRANSPORT	173,000	63.700	11,020,100.000	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	28.400	5,481,200.000	
	INNOLUX CORPORATION	910,742	11.450	10,427,995.900	
	WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	46.850	7,739,760.550	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	19,000	187.500	3,562,500.000	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,120.000	6,720,000.000	
	PEGATRON CORP	196,554	57.300	11,262,544.200	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,371	690.000	9,225,990.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	29,000	119.000	3,451,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	133,922	176.000	23,570,272.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	650.000	5,200,000.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	652.000	1,304,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	60,385	105.500	6,370,617.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	953,564	25.050	23,886,778.200	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	353,993	47.750	16,903,165.750	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	6,000	1,335.000	8,010,000.000	
	WIWYNN CORP	8,000	792.000	6,336,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	320,903	74.600	23,939,363.800	
	SILERGY CORP	32,000	420.000	13,440,000.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	267,000	28.050	7,489,350.000	
	MOMO.COM INC	6,600	528.000	3,484,800.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	340.500	7,150,500.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	252.500	3,787,500.000	
	台湾・ドル 小計	32,553,767		2,385,442,656.150 (10,934,630,592)	
南アフリカ・ラ ンド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,125	259.850	2,630,981.250	
	BIDVEST GROUP LTD	28,428	201.200	5,719,713.600	
	CLICKS GROUP LTD	24,148	287.070	6,932,166.360	
	DISCOVERY LTD	49,614	106.670	5,292,325.380	
	GOLD FIELDS LTD	88,078	152.540	13,435,418.120	
	REMGRO LTD	51,843	135.310	7,014,876.330	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	121.110	3,995,540.010	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	48,229	50.510	2,436,046.790	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,734	193.400	4,783,555.600	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,511	1,803.870	15,352,737.570	
	MTN GROUP LTD	166,841	120.970	20,182,755.770	

ANGLOGOLD ASHANTI LTD	41,441	253.470	10,504,050.270	
FIRSTRAND LTD	488,807	61.510	30,066,518.570	
NASPERS LTD	21,352	2,233.420	47,687,983.840	
NEDBANK GROUP LTD	45,103	197.810	8,921,824.430	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,182	1,412.020	7,317,087.640	
SASOL LTD	55,931	307.000	17,170,817.000	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	49,019	218.500	10,710,651.500	
MR PRICE GROUP LTD	25,493	180.500	4,601,486.500	
STANDARD BANK GROUP LTD	130,035	146.300	19,024,120.500	
SPAR GROUP LTD/THE	21,004	143.000	3,003,572.000	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	99,816	60.620	6,050,845.920	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	140.930	5,434,683.590	
ABSA GROUP LTD	82,519	178.470	14,727,165.930	
SANLAM LTD	172,142	48.630	8,371,265.460	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	83,354	177.000	14,753,658.000	
KUMBA IRON ORE LTD	5,412	388.860	2,104,510.320	
VODACOM GROUP PTY LTD	62,110	124.760	7,748,843.600	
NEPI ROCKCASTLE NV	43,623	82.680	3,606,749.640	
OLD MUTUAL LTD	479,238	9.470	4,538,383.860	
REINET INVESTMENTS SCA	13,711	273.000	3,743,103.000	
PEPKOR HOLDINGS LTD	166,142	21.200	3,522,210.400	
MULTICHOICE GROUP LTD	37,859	117.150	4,435,181.850	
SIBANYE STILLWATER LTD	280,658	42.450	11,913,932.100	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	34,041	170.500	5,803,990.500	
BID CORP LTD	32,800	285.880	9,376,864.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,048,897		352,915,617.200 (2,840,970,718)	
合計	558,708,773		80,400,770,850 (80,400,770,850)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	114,400.000	3,004,144.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,158,620.000	
		ENERGISA SA	18,000.000	786,600.000	
		KLABIN SA	78,200.000	1,508,478.000	
	ブラジル・リアル 小計		248,600.000	6,457,842.000 (177,934,858)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,508,275.000	10,286,435.500	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	52,300.000	6,254,034.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	192,300.000	24,358,641.000	

		GRUPO TELEVISIA SAB	246,900.000	5,239,218.000	
	メキシコ・ペソ	小計	1,999,775.000	46,138,328.500 (336,256,138)	
投資信託受益証券 合計			2,248,375	514,190,996 (514,190,996)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	303,700.000	6,474,884.000	
	メキシコ・ペソ	小計	303,700.000	6,474,884.000 (47,188,955)	
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	323,228.000	4,027,420.880	
	南アフリカ・ランド	小計	323,228.000	4,027,420.880 (32,420,738)	
投資証券 合計			626,928	79,609,693 (79,609,693)	
合計				593,800,689 (593,800,689)	

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

(注)

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

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率 (%)	組入 投資信託受益証 券 時価比率 (%)	組入 投資証券 時価比率 (%)	有価証券の合計金額 に 対する比率 (%)
アメリカ・ドル	株式 54銘柄	2.83	-	-	3.05
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 9銘柄	1.31	-	-	1.42
インド・ルピー	株式 109銘柄	14.19	-	-	15.34
インドネシア・ルピア	株式 25銘柄	2.03	-	-	2.20
オフショア・人民元	株式 464銘柄	4.94	-	-	5.34
カタール・リアル	株式 12銘柄	1.17	-	-	1.27
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.82	-	-	0.89
コロンビア・ペソ	株式 4銘柄	0.14	-	-	0.15
サウジアラビア・リアル	株式 37銘柄	4.56	-	-	4.93
タイ・バーツ	株式 43銘柄	1.93	-	-	2.08
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.13	-	-	0.14
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.55	-	-	0.59
トルコ・リラ	株式 12銘柄	0.39	-	-	0.42
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.15	-	-	0.16
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.67	-	-	0.72
ブラジル・レアル	株式 45銘柄	5.54	-	-	6.20
	投資信託受益証券 4銘柄	-	0.20	-	
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.49	-	-	0.53
マレーシア・リンギット	株式 34銘柄	1.40	-	-	1.52

メキシコ・ペソ	株式	18銘柄	1.73	-	-	2.34
	投資信託受益証券	4銘柄	-	0.38	-	
	投資証券	1銘柄	-	-	0.05	
ユーロ	株式	9銘柄	0.25	-	-	0.27
韓国・ウォン	株式	111銘柄	10.21	-	-	11.03
香港・ドル	株式	193銘柄	20.69	-	-	22.36
台湾・ドル	株式	87銘柄	12.49	-	-	13.50
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.25	-	-	3.55
	投資証券	1銘柄	-	-	0.04	

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,656,760,947
コール・ローン	632,179,050
国債証券	85,906,660,248
派生商品評価勘定	1,222,726
未収利息	702,740,043
前払費用	395,541,512
流動資産合計	92,295,104,526
資産合計	92,295,104,526
負債の部	
流動負債	
未払金	3,038,122,258
未払解約金	1,527,000
流動負債合計	3,039,649,258
負債合計	3,039,649,258
純資産の部	
元本等	
元本	44,658,897,542
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	44,596,557,726
元本等合計	89,255,455,268
純資産合計	89,255,455,268
負債純資産合計	92,295,104,526

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	52,254,579,544円
同期中追加設定元本額	177,375,158,177円
同期中一部解約元本額	184,970,840,179円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>(ファンドラップ)	123,826,676円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,143,349,928円
たわらノーロード バランス(堅実型)	153,660,500円
たわらノーロード バランス(標準型)	430,425,256円
たわらノーロード バランス(積極型)	181,405,008円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	845,206円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	3,586,649円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	38,081,399円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,443,343円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	4,627,319円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,598,674円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国10)	245,032,564円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国20)	378,242,915円
D I A M D C 8資産バランスファンド(新興国30)	690,781,648円
投資のソムリエ	9,124,203,904円
クルーズコントロール	256,168,150円
投資のソムリエ<DC年金>	617,987,398円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	285,222,038円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	665,236,868円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,116,457,590円
ワールドアセットバランス(基本コース)	441,460,595円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	294,258,643円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	57,945,107円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	28,853,604円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,506,974円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	188,622,990円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	541,161,108円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	218,674,312円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	67,616,484円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	30,266,653円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	19,473,556円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,673,606円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	19,382,309,947円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	232,237,414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)	1,000,885,420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)	317,132,344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)	3,545,615円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	8,081,086円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	8,062,253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)	157,238,520円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	70,670,516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)	3,063,037,762円
計	44,658,897,542円
2. 受益権の総数	44,658,897,542口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
----	---------------

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	8,633,208,580	
合計	8,633,208,580	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年4月19日から2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	400,000,000	-	-	401,222,726	1,222,726
	400,000,000	-	-	401,222,726	1,222,726
合計	400,000,000	-	-	401,222,726	1,222,726

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

値で評価しております。

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9986円 (19,986円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	3,000,000.000	2,898,834.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	5,000,000.000	4,211,000.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	3,000,000.000	2,362,800.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	3,000,000.000	2,377,620.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	6,000,000.000	5,712,246.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	7,000,000.000	6,622,700.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	6,000,000.000	5,192,010.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	2,000,000.000	1,172,300.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	6,000,000.000	5,387,070.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	5,000,000.000	3,420,250.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27	8,000,000.000	7,457,552.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	7,000,000.000	5,558,308.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 4.125 10/11/47	4,000,000.000	3,339,600.000	
		BRAZIL 2.875 06/06/25	8,000,000.000	7,488,771.760	
		BRAZIL 3.75 09/12/31	4,000,000.000	3,228,527.800	
		BRAZIL 3.875 06/12/30	9,000,000.000	7,449,391.890	
BRAZIL 4.5 05/30/29	5,000,000.000	4,463,500.000			
BRAZIL 4.625 01/13/28	7,000,000.000	6,522,243.630			

BRAZIL 4.75 01/14/50	9,000,000.000	6,066,106.020	
BRAZIL 5.625 01/07/41	2,100,000.000	1,677,469.160	
BRAZIL 6.0 04/07/26	2,800,000.000	2,846,799.730	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,620,286.920	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,570,867.840	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	5,000,000.000	3,525,593.900	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	7,000,000.000	4,765,385.940	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	6,000,000.000	3,976,438.860	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	4,000,000.000	2,068,897.960	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	4,000,000.000	3,633,290.800	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	5,000,000.000	4,027,679.850	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	7,000,000.000	4,272,100.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	1,000,000.000	640,166.830	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	14,000,000.000	12,123,516.440	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	13,000,000.000	8,616,004.410	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	15,200,000.000	12,490,939.870	
HUNGARY 2.125 09/22/31	8,000,000.000	5,533,760.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	8,000,000.000	4,179,832.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	7,000,000.000	6,251,708.540	
HUNGARY 5.375 03/25/24	2,380,000.000	2,349,214.700	
HUNGARY 7.625 03/29/41	2,400,000.000	2,334,595.200	
INDONESIA 1.85 03/12/31	2,200,000.000	1,693,403.930	
INDONESIA 2.85 02/14/30	2,000,000.000	1,692,930.640	
INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,217,027.450	
INDONESIA 3.4 09/18/29	1,200,000.000	1,053,406.580	
INDONESIA 3.5 01/11/28	3,200,000.000	2,935,483.710	
INDONESIA 3.85 10/15/30	6,400,000.000	5,726,999.040	
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	2,809,485.000	
INDONESIA 4.125 01/15/25	1,200,000.000	1,179,000.400	
INDONESIA 4.2 10/15/50	4,000,000.000	3,019,020.520	
INDONESIA 4.35 01/08/27	1,600,000.000	1,543,975.680	
INDONESIA 4.35 01/11/48	3,600,000.000	2,816,820.460	
INDONESIA 4.75 01/08/26	2,000,000.000	1,972,391.260	
INDONESIA 5.25 01/17/42	1,500,000.000	1,338,976.530	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	3,954,457.500	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	6,000,000.000	5,608,800.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	5,000,000.000	4,699,155.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	6,000,000.000	5,650,554.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.75 01/17/48	2,000,000.000	1,665,000.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	8,000,000.000	5,583,589.840	

PANAMA 3.16 01/23/30	5,000,000.000	4,069,500.000	
PANAMA 3.87 07/23/60	9,000,000.000	5,215,066.560	
PANAMA 4.5 01/19/63	5,000,000.000	3,218,106.300	
PANAMA 4.5 04/01/56	7,000,000.000	4,613,121.730	
PANAMA 4.5 04/16/50	6,300,000.000	4,285,645.810	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,047,745.000	
PERU 2.392 01/23/26	2,000,000.000	1,808,148.060	
PERU 2.78 12/01/60	6,000,000.000	3,197,351.940	
PERU 2.783 01/23/31	11,000,000.000	8,628,997.190	
PERU 3.0 01/15/34	7,000,000.000	5,176,558.660	
PERU 3.55 03/10/51	6,000,000.000	3,917,391.360	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	1,600,000.000	1,207,776.780	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	1,800,000.000	1,496,199.420	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	5,000,000.000	3,010,188.500	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	7,000,000.000	6,334,388.690	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	6,000,000.000	3,959,636.580	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	1,000,000.000	732,402.080	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	6,200,000.000	5,753,028.980	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	4,200,000.000	3,348,742.020	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	5,200,000.000	4,067,265.280	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	6,000,000.000	4,460,529.240	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	5,200,000.000	4,676,767.100	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	4,000,000.000	2,286,454.520	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	7,000,000.000	4,660,192.390	
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	4,600,000.000	4,147,224.430	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	4,000,000.000	2,690,814.360	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	5,200,000.000	4,195,373.930	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	2,608,573.640	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	5,000,000.000	3,903,664.500	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	10,000,000.000	9,553,213.300	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	8,000,000.000	7,056,263.440	
ROMANIA 3.0 02/14/31	1,000,000.000	714,572.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	8,000,000.000	4,589,304.000	

ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	3,234,223.200	
ROMANIA 6.125 01/22/44	2,600,000.000	2,095,574.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	6,000,000.000	4,703,364.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	6,000,000.000	5,658,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	5,200,000.000	4,635,113.600	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	2,600,440.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28	9,000,000.000	8,444,700.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,137,728.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	9,000,000.000	8,784,000.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	8,000,000.000	7,789,256.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	7,000,000.000	6,798,470.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	5,000,000.000	4,050,455.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.625 10/04/47	6,000,000.000	4,956,030.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	3,000,000.000	2,620,230.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	4,000,000.000	3,638,720.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	8,000,000.000	6,674,528.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	2,400,000.000	2,251,195.200	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	12,000,000.000	7,801,440.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	2,000,000.000	1,736,200.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	8,000,000.000	6,220,728.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	6,000,000.000	5,869,200.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	5,000,000.000	4,803,750.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	6,000,000.000	5,610,000.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	8,000,000.000	7,640,000.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	10,000,000.000	8,624,000.000	
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	6,000,000.000	5,906,400.000	

STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	11,000,000.000	9,982,335.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	11,000,000.000	10,429,100.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	4,000,000.000	2,759,200.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	3,000,000.000	2,798,040.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	6,000,000.000	4,654,911.360	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,049,949.380	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	5,000,000.000	3,850,038.700	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	4,200,000.000	3,871,061.580	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,054,888.390	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	4,000,000.000	2,361,502.280	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,559,580.290	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	1,400,000.000	1,343,306.440	
UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	5,000,000.000	3,648,484.650	
UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	5,000,000.000	3,449,740.750	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	3,000,000.000	2,157,297.420	
UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	5,000,000.000	4,649,338.400	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	2,000,000.000	1,472,850.720	
UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	2,400,000.000	1,751,087.780	
UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	4,000,000.000	3,619,291.160	
UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	4,000,000.000	3,548,980.360	
UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	4,000,000.000	3,076,060.280	
アメリカ・ドル 小計	726,380,000.000 (106,196,756,000)	587,596,855.320 (85,906,660,248)	
国債証券 合計	106,196,756,000 (106,196,756,000)	85,906,660,248 (85,906,660,248)	
合計		85,906,660,248 (85,906,660,248)	

(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 138銘柄	96.25	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,178,004,834
投資証券	171,875,882,600
未収配当金	2,162,729,405
前払金	220,379,100
差入委託証拠金	265,249,500
流動資産合計	178,702,245,439
資産合計	178,702,245,439
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	208,951,170
未払金	1,972,281,135
未払解約金	2,751,000
流動負債合計	2,183,983,305
負債合計	2,183,983,305
純資産の部	
元本等	
元本	74,211,288,424
剰余金	
剰余金又は欠損金()	102,306,973,710
元本等合計	176,518,262,134
純資産合計	176,518,262,134
負債純資産合計	178,702,245,439

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	79,688,101,403円
同期中追加設定元本額	95,807,683,394円
同期中一部解約元本額	101,284,496,373円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	203,368円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,354,800円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	4,747,574円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,181,320円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,183,733円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	1,934,177円
たわらノーロード 国内リート	5,144,287,287円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	957,186,562円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,800,740,451円
たわらノーロード バランス(堅実型)	32,416,732円
たわらノーロード バランス(標準型)	603,128,492円
たわらノーロード バランス(積極型)	663,663,239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)	137,676,610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)	361,646,956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)	214,065,460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)	272,681,379円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,221,820円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	36,060,306円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,045,790円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	10,544,437円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,475,526円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	437,198,412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)	123,614,144円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	189,017,609円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	343,299,630円
投資のソムリエ	4,425,813,198円
投資のソムリエ<DC年金>	298,942,667円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	144,964,707円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	321,835,142円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,509,686,065円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	23,894,476円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,924,188円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,184,266円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	87,859,864円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	130,132,757円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,689,684円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	28,115,184円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	12,205,047円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	8,159,955円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,540,482円
Jリートインデックスファンド(DC)	58,859,701円
DIAM J-REITインデックス私募ファンド201212(適格機関投資家限定)	78,337,891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)	708,552,106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)	251,520,125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)	34,576,899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)	178,193,287円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	80,564,848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)	229,105,272円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	527,083円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	2,869,206円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-05(適格機関投資家限定)	60,699,596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)	100,197,515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)	70,011,966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)	80,506,875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)	69,764,093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)	100,840,714円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	3,510,175,775円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	112,459,641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)	38,345,895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)	598,148,298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)	1,705,366円
日米資産配分戦略ファンド(TIPS活用型)(為替ヘッジ比率調整型)(適格機関投資家限定)	130,069,719円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	3,827,614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)	1,267,972,927円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,786,890,574円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	37,450,616,493円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,626,249,327円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	98,246,377円
計	74,211,288,424円
2. 受益権の総数	74,211,288,424口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	6,461,344,242	
合計	6,461,344,242	

(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2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2022年10月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	4,701,576,600	-		208,694,100
合計	4,701,576,600	-		208,694,100

(注)時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

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

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2022年10月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,3786円 (23,786円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	6,198	1,253,235,600	
	GLP投資法人	49,288	7,792,432,800	
	NTT都市開発リート投資法人	15,385	2,244,671,500	
	Oneリート投資法人	2,792	725,920,000	
	SOSILA物流リート投資法人	7,482	1,107,336,000	
	いちごオフィスリート投資法人	13,114	1,122,558,400	
	いちごホテルリート投資法人	2,651	275,969,100	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	8,450	3,629,275,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	16,002	5,464,683,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	6,241	893,711,200	
	イオンリート投資法人	17,717	2,749,678,400	
	インヴィンシブル投資法人	70,444	3,247,468,400	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,253	365,637,200	
	オリックス不動産投資法人	31,889	5,877,142,700	
	グローバル・ワン不動産投資法人	10,965	1,205,053,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	4,704	3,222,240,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	11,479	2,416,329,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	6,727	1,772,564,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	7,445	2,326,562,500	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,160	505,024,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	5,127	489,115,800	
	ザイマックス・リート投資法人	2,596	316,452,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	51,612	3,803,804,400	
ジャパンエクセレント投資法人	14,682	1,942,428,600		

ジャパンリアルエステイト投資法人	16,005	9,394,935,000	
スターアジア不動産投資法人	19,983	1,105,059,900	
スターツプロシード投資法人	2,492	603,562,400	
タカラレーベン不動産投資法人	7,010	712,917,000	
トーセイ・リート投資法人	3,550	497,000,000	
ヒューリックリート投資法人	14,974	2,550,072,200	
フロンティア不動産投資法人	5,938	3,111,512,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	3,946	728,431,600	
マリモ地方創生リート投資法人	1,999	267,266,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	36,030	5,354,058,000	
ラサルロジポート投資法人	19,593	3,107,449,800	
阪急阪神リート投資法人	7,229	1,089,410,300	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	6,322	3,157,839,000	
三菱地所物流リート投資法人	4,939	2,192,916,000	
産業ファンド投資法人	23,917	3,867,378,900	
森トラスト・ホテルリート投資法人	3,755	497,537,500	
森トラスト総合リート投資法人	11,439	1,606,035,600	
森ヒルズリート投資法人	18,820	2,952,858,000	
星野リゾート・リート投資法人	2,799	1,892,124,000	
積水ハウス・リート投資法人	48,638	3,949,405,600	
大江戸温泉リート投資法人	2,583	171,511,200	
大和ハウスリート投資法人	24,125	7,237,500,000	
大和証券オフィス投資法人	3,345	2,287,980,000	
大和証券リビング投資法人	22,178	2,528,292,000	
投資法人みらい	19,444	944,006,200	
東海道リート投資法人	1,941	230,590,800	
東急リアル・エステート投資法人	10,731	2,178,393,000	
日本アコモデーションファンド投資法人	5,526	3,503,484,000	
日本ビルファンド投資法人	18,671	11,818,743,000	
日本プライムリアルティ投資法人	10,945	4,263,077,500	
日本プロロジスリート投資法人	26,226	8,156,286,000	
日本リート投資法人	5,199	1,889,836,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	10,792	3,437,252,000	
日本都市ファンド投資法人	80,753	8,624,420,400	
福岡リート投資法人	8,277	1,372,326,600	
平和不動産リート投資法人	10,938	1,641,793,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	51,756	8,203,326,000	
投資証券 合計	943,211	171,875,882,600	
合計		171,875,882,600	

(注) 投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年10月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	279,686,488
コール・ローン	69,985,754
投資信託受益証券	5,048,158,578
投資証券	45,284,281,736
派生商品評価勘定	3,581
未収入金	7,413,454
未収配当金	172,258,988
流動資産合計	50,861,788,579
資産合計	50,861,788,579
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	525
未払金	238,690,255
未払解約金	3,925,000
流動負債合計	242,615,780
負債合計	242,615,780
純資産の部	
元本等	
元本	32,366,670,054
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	18,252,502,745
元本等合計	50,619,172,799
純資産合計	50,619,172,799
負債純資産合計	50,861,788,579

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年10月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	40,756,471,365円
同期中追加設定元本額	111,231,616,042円
同期中一部解約元本額	119,621,417,353円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	79,964,550円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	33,673,230円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,335,671円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	22,384,606円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	79,403,095円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	35,932,622円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	19,556,050円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	31,799,758円
たわらノーロード 先進国リート	13,922,196,321円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,245,101,695円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	293,673,670円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,708,404,847円
たわらノーロード バランス(堅実型)	24,262,655円

たわらノーロード バランス(標準型)	448,804,577円
たわらノーロード バランス(積極型)	904,545,031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)	207,104,434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)	217,941,984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)	375,039,461円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	126,975円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	20,641,354円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,704,473円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,643,299円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,466,238,412円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	14,409,019円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	505,367,504円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	178,542,803円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	276,651,433円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	509,063,919円
投資のソムリエ	3,537,005,719円
投資のソムリエ<DC年金>	239,683,314円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	211,167,541円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	251,035,258円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,177,526,601円
ワールドアセットバランス(基本コース)	355,965,633円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	228,113,051円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	22,196,118円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	11,200,291円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	1,704,848円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	58,491,881円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	193,758,555円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	162,084,938円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	26,233,444円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	11,774,514円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	7,544,749円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,416,342円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	271,456,892円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	270,065,074円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	983,915円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	656,048円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	459,027円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	583,400円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	826,526円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	692,408円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	87,419,618円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	3,917,008円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,380,735円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	1,335,356円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	2,947,029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)	83,854,069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)	199,263,552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)	1,042,387,289円
DIAM海外リートインデックスファンド(適格機関投資家限定)	213,292,170円
計	32,366,670,054円
2. 受益権の総数	32,366,670,054口

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2021年10月13日 至 2022年10月12日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年10月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年10月12日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券	497,980,820	
投資証券	6,739,792,741	
合計	7,237,773,561	

(注)「当期の損益に含まれた評価差額」は、当該親投資信託の計算期間開始日から開示対象ファンドの期末日までの期間(2022年6月23日から2022年10月12日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年10月12日現在				
	契約額等(円)	うち		時価(円)	評価損益(円)
		1年超			
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建					
アメリカ・ドル	82,073,116	-	82,076,172	3,056	
イギリス・ポンド	58,473,360	-	58,474,200	840	
オーストラリア・ドル	4,812,120	-	4,812,519	399	
カナダ・ドル	6,409,270	-	6,408,927	343	
シンガポール・ドル	6,359,976	-	6,359,964	12	
シンガポール・ドル	3,047,340	-	3,047,682	342	
韓国・ウォン	2,040,000	-	2,042,000	2,000	
香港・ドル	931,050	-	930,880	170	
合計	82,073,116	-	82,076,172	3,056	

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2022年10月12日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5639円 (15,639円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

（2）株式以外の有価証券

2022年10月12日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	96,300.000	64,521.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	260,200.000	147,013.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	509,200.000	201,134.000		
		PRIME US REIT	167,700.000	84,688.500		
		アメリカ・ドル	小計	1,106,100.000	497,356.500 (72,713,520)	
	オーストラリア・ドル		ABACUS PROPERTY GROUP	117,754.000	292,029.920	
			ARENA REIT	100,303.000	341,030.200	
			BWP TRUST	148,456.000	546,318.080	
			CENTURIA CAPITAL GROUP	219,073.000	331,895.590	
			CENTURIA INDUSTRIAL REIT	168,029.000	443,596.560	
			CENTURIA OFFICE REIT	128,357.000	182,266.940	
			CHARTER HALL GROUP	143,633.000	1,694,869.400	
			CHARTER HALL LONG WALE REIT	191,828.000	771,148.560	
			CHARTER HALL RETAIL REIT	159,091.000	599,773.070	
			CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	102,444.000	318,600.840	
			CROMWELL PROPERTY GROUP	404,807.000	267,172.620	
			DEXUS	325,039.000	2,454,044.450	
			DEXUS INDUSTRIA REIT	67,736.000	165,953.200	
			GDI PROPERTY GROUP	148,226.000	122,286.450	
		GOODMAN GROUP	511,848.000	8,128,146.240		
	GPT GROUP	579,271.000	2,224,400.640			
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	83,619.000	255,874.140			
	HEALTHCO REIT	92,113.000	129,879.330			
	HOME CONSORTIUM LTD	54,305.000	242,200.300			
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	453,351.000	523,620.400			

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	52,358.000	152,885.360	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	106,566.000	397,491.180	
	MIRVAC GROUP	1,195,779.000	2,295,895.680	
	NATIONAL STORAGE REIT	316,814.000	715,999.640	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	101,748.670	
	RURAL FUNDS GROUP	117,005.000	283,152.100	
	SCENTRE GROUP	1,565,412.000	4,038,762.960	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	329,126.000	789,902.400	
	STOCKLAND	721,689.000	2,338,272.360	
	VICINITY CENTRES	1,170,852.000	2,066,553.780	
	WAYPOINT REIT LTD	216,402.000	538,840.980	
	オーストラリア・ドル 小計	10,131,629.000	33,754,612.040 (3,090,909,823)	
シンガポール・ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	163,795.000	206,381.700	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	606,616.000	579,318.280	
	CAPITALAND CHINA TRUST	363,180.000	366,811.800	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,520,109.000	2,888,207.100	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,014,960.000	2,679,494.400	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	242,000.000	271,040.000	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	146,600.000	86,494.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	58,448.000	
	ESR LOGOS REIT	1,647,940.000	585,018.700	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	294,900.000	172,516.500	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	317,300.000	80,911.500	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	316,100.000	673,293.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	878,764.000	1,054,516.800	
	KEPPEL DC REIT	389,900.000	666,729.000	
	KEPPEL REIT	607,400.000	583,104.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	544,200.000	413,592.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	596,520.000	1,407,787.200	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	959,720.000	1,468,371.600	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	699,400.000	1,209,962.000	
	QUE COMMERCIAL REIT	775,655.000	259,844.420	
	PARKWAY LIFE REIT	119,300.000	479,586.000	

		SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	153,200.000	106,474.000	
		SPH REIT	327,700.000	293,291.500	
		STARHILL GLOBAL REIT	459,500.000	241,237.500	
		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	679,890.000	1,019,835.000	
	シンガポール・ドル	小計	13,937,049.000	17,852,266.000 (1,813,968,748)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	110,640.000	188,088.000	
	ユーロ	小計	110,640.000	188,088.000 (26,678,402)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	427,000.000	2,357,040.000	
	香港・ドル	小計	427,000.000	2,357,040.000 (43,888,085)	
投資信託受益証券 合計			25,712,418	5,048,158,578 (5,048,158,578)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	27,799.000	355,549.210	
		AGREE REALTY CORP	24,194.000	1,578,416.560	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	21,261.000	368,027.910	
		ALEXANDER'S INC.	601.000	124,431.040	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	44,910.000	6,039,496.800	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,825.000	76,331.500	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	16,038.000	405,761.400	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	91,209.000	2,911,391.280	
		AMERICOLD REALTY TRUST	81,322.000	1,946,848.680	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	46,583.000	1,698,882.010	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	47,689.000	336,207.450	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	64,732.000	957,386.280	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	21,237.000	225,324.570	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	79,758.180	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	42,282.000	7,387,088.220	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	26,753.760	
		BOSTON PROPERTIES INC	42,994.000	3,061,602.740	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	85,735.250	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	50,197.000	309,213.520	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	90,765.000	1,714,550.850	
		BROADSTONE NET LEASE INC	51,407.000	800,921.060	
		BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	82,290.000	

CAMDEN PROPERTY TRUST	32,097.000	3,641,725.620	
CARETRUST REIT INC	29,664.000	497,168.640	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	6,997.000	179,752.930	
CENTERSPACE	4,480.000	296,217.600	
CHATHAM LODGING TRUST	15,533.000	164,028.480	
CITY OFFICE REIT INC	11,358.000	107,446.680	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	33,262.440	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	7,309.000	230,745.130	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	34,185.000	788,989.800	
COUSINS PROPERTIES INC	46,017.000	1,038,603.690	
CTO REALTY GROUTH INC	5,120.000	90,470.400	
CUBESMART	67,691.000	2,612,872.600	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	64,527.000	506,536.950	
DIGITAL REALTY TRUST INC	86,899.000	7,825,254.950	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	80,576.400	
DOUGLAS EMMETT INC	52,267.000	870,245.550	
EAST GROUP	13,158.000	1,886,594.040	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	27,885.000	434,727.150	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	38,656.000	252,037.120	
EPR PROPERTIES	22,895.000	825,364.750	
EQUINIX INC	27,523.000	14,430,308.900	
EQUITY COMMONWEALTH	33,031.000	795,056.170	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	52,719.000	3,228,511.560	
EQUITY RESIDENTIAL	102,374.000	6,454,680.700	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	43,095.000	842,938.200	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	19,614.000	4,449,435.900	
EXTRA SPACE STORAGE INC	40,496.000	6,812,237.120	
FARMLAND PARTNERS INC	13,797.000	176,049.720	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	21,985.000	1,995,358.600	
FIRST INDUSTRIAL RT	39,895.000	1,768,545.350	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	24,090.000	567,319.500	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	87,584.640	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	76,986.000	3,595,246.200	
GETTY REALTY CORP	13,325.000	362,706.500	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	11,299.000	174,343.570	

GLADSTONE LAND CORP	9,054.000	161,432.820	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	17,479.000	127,946.280	
GLOBAL NET LEASE INC	32,544.000	349,522.560	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	114,820.000	2,233,249.000	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	162,583.000	3,609,342.600	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,753.000	68,273.400	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	31,228.000	794,440.320	
HOST HOTELS & RESORTS INC	215,432.000	3,561,090.960	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	39,679.000	403,932.220	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	67,383.000	1,072,737.360	
INDUS REALTY TRUST INC	1,612.000	80,986.880	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	18,185.000	86,560.600	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	8,540.000	801,564.400	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	20,677.000	451,172.140	
INVITATION HOMES INC	175,391.000	5,782,641.270	
IRON MOUNTAIN INC	87,570.000	4,029,095.700	
ISTAR INC	24,704.000	214,430.720	
JBG SMITH PROPERTIES	30,397.000	546,234.090	
KILROY REALTY CORP	31,907.000	1,274,046.510	
KIMCO REALTY	186,380.000	3,518,854.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	66,522.000	1,166,795.880	
LIFE STORAGE INC	25,446.000	2,689,896.660	
LTC PROPERTIES INC	12,414.000	450,379.920	
LXP INDUSTRIAL TRUST	83,026.000	751,385.300	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	180,845.000	1,985,678.100	
MID AMERICA	34,924.000	5,129,287.880	
NATIONAL HEALTH INVS INC	13,243.000	682,146.930	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	53,464.000	2,098,462.000	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	25,931.000	1,025,052.430	
NETSTREIT CORP	15,654.000	288,659.760	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	6,662.000	271,609.740	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	13,613.000	174,382.530	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	70,670.000	2,089,711.900	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	119,359.520	
ORION OFFICE REIT INC	15,979.000	142,852.260	

PARAMOUNT GROUP INC	49,292.000	294,766.160	
PARK HOTELS & RESORTS INC	68,645.000	786,671.700	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	38,832.000	561,122.400	
PHILLIPS EDISON & CO INC	35,348.000	1,021,910.680	
PHYSICIANS REALTY TRUST	68,977.000	949,813.290	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	37,043.000	355,983.230	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	10,213.000	164,735.690	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,420.000	81,516.800	
PROLOGIS INC	278,928.000	28,068,524.640	
PUBLIC STORAGE	47,746.000	13,842,042.860	
REALTY INCOME CORP	186,671.000	10,838,118.260	
REGENCY CENTERS CORP	46,455.000	2,567,567.850	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	38,074.000	523,517.500	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	51,590.000	2,651,726.000	
RLJ LODGING TRUST	49,762.000	518,022.420	
RPT REALTY	26,186.000	219,962.400	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	16,733.000	1,321,405.010	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	70,454.000	871,515.980	
SAFEHOLD INC	4,781.000	117,421.360	
SAUL CENTERS INC	4,425.000	165,450.750	
SERVICE PROPERTIES TRUST	47,852.000	264,143.040	
SIMON PROPERTY GROUP INC	98,736.000	9,362,147.520	
SITE CENTERS CORP	55,062.000	608,985.720	
SL GREEN	19,069.000	723,096.480	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	41,328.000	1,481,608.800	
STAG INDUSTRIAL INC	54,318.000	1,486,683.660	
STORE CAPITAL CORP	80,162.000	2,513,078.700	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	33,480.000	230,677.200	
SUN COMMUNITIES INC	37,315.000	4,706,914.100	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	62,789.000	617,215.870	
TANGER FACTORY OUTLET	31,979.000	494,715.130	
TERRENO REALTY CORP	20,200.000	1,061,712.000	
THE MACERICH COMPANY	65,602.000	574,017.500	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	38,492.000	230,952.000	
UDR INC	92,030.000	3,548,676.800	
UMH PROPERTIES INC	14,711.000	235,523.110	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,601.000	155,059.060	

	URBAN EDGE PROPERTIES	35,960.000	482,223.600	
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES	8,488.000	141,749.600	
	VENTAS INC	120,378.000	4,452,782.220	
	VERIS RESIDENTIAL INC	23,005.000	256,965.850	
	VICI PROPERTIES INC	290,499.000	8,924,129.280	
	VORNADO REALTY TRUST	49,055.000	1,039,475.450	
	WASHINGTON REIT	26,794.000	448,799.500	
	WELLTOWER INC	140,097.000	8,149,442.490	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	138,919.360	
	WP CAREY INC	62,511.000	4,470,786.720	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	34,988.000	495,430.080	
アメリカ・ドル	小計	6,662,455.000	270,125,832.680 (39,492,396,738)	
イギリス・ポンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	108,127.000	60,659.240	
	AEW UK REIT PLC	58,660.000	52,735.340	
	ASSURA PLC	872,708.000	430,245.040	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	229,937.000	165,784.570	
	BIG YELLOW GROUP PLC	51,695.000	524,704.250	
	BRITISH LAND CO PLC	283,771.000	941,835.940	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	265,624.000	262,170.880	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	207,438.000	125,292.550	
	CUSTODIAN REIT PLC	123,355.000	109,169.170	
	DERWENT LONDON PLC	34,312.000	650,555.520	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	74,836.000	46,398.320	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	171,658.000	133,206.600	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	78,094.000	344,706.910	
	HAMMERSON PLC	1,091,673.000	200,867.830	
	HOME REIT PLC	228,031.000	197,246.810	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	129,629.000	123,147.550	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	227,409.000	1,137,499.810	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	299,389.000	488,303.450	
	LXI REIT PLC	517,278.000	606,249.810	
	NEWRIVER REIT PLC	80,716.000	55,613.320	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	174,833.000	131,998.910	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	392,906.000	396,835.060	

	PRS REIT PLC/THE	173,828.000	146,015.520	
	REGIONAL REIT LTD	150,233.000	92,243.060	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	64,313.000	522,864.690	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	150,738.000	64,666.600	
	SEGRO PLC	364,554.000	2,596,353.580	
	SHAFTESBURY PLC	88,897.000	299,938.470	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	363,816.000	359,450.200	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	107,616.000	70,596.090	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	567,864.000	722,323.000	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	261,326.000	142,945.320	
	UNITE GROUP PLC	121,519.000	977,012.760	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	139,429.000	177,771.970	
	WAREHOUSE REIT PLC	120,511.000	133,285.160	
	WORKSPACE GROUP PLC	42,383.000	151,307.310	
イギリス・ボンド 小計		8,650,146.000	13,642,000.610 (2,188,586,158)	
イスラエル・ シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,208.000	421,993.030	
	REIT 1 LTD	53,934.000	981,598.800	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	62,298.000	544,796.010	
イスラエル・シュケル 小計		353,440.000	1,948,387.840 (79,475,714)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	18,366.000	487,617.300	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,633.000	168,069.660	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,816.000	60,777.920	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,967.000	307,662.720	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,905.000	93,195.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	49,816.290	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	25,358.000	1,013,052.100	
	CHOICE PROPERTIES REIT	49,285.000	606,698.350	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	14,544.000	200,998.080	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,888.000	214,536.080	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	38,674.000	401,049.380	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	6,155.000	92,694.300	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	49,874.040	

	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,357.000	477,912.890	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,449.000	602,562.730	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	40,397.000	424,572.470	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	20,336.340	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,639.000	218,778.460	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,430.000	259,358.400	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,191.000	91,038.060	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	94,480.540	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,194.000	60,357.660	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	36,379.000	362,334.840	
	PRIMARIS REIT	14,740.000	188,819.400	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,243.000	55,926.780	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	44,243.000	806,107.460	
	SLATE GROCERY REIT	9,780.000	126,944.400	
	SLATE OFFICE REIT	15,735.000	67,503.150	
	SMARTCENTRES REIT	21,859.000	552,158.340	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	27,192.000	460,360.560	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	11,009.000	61,870.580	
	カナダ・ドル 小計	571,828.000	8,677,464.280 (919,897,988)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	258,932.000	308,129.080	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	315,505.000	637,320.100	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	489,415.000	440,473.500	
	PRECINCT PROPERTIES	392,905.000	481,308.620	
	STRIDE STAPLED GROUP	153,242.000	246,719.620	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	143,882.000	342,439.160	
	ニュージーランド・ドル 小計	1,753,881.000	2,456,390.080 (200,490,558)	
ユーロ	AEDIFICA	12,037.000	884,117.650	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,244.000	17,952.000	
	ALTAREA	1,481.000	188,679.400	
	CARE PROPERTY INVEST NV	8,871.000	144,597.300	
	CARMILA SA	16,540.000	221,966.800	
	COFINIMMO SA	8,891.000	706,834.500	

	COVIVIO	13,982.000	675,889.880	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	12,724.000	255,243.440	
	GECINA SA	16,456.000	1,300,024.000	
	HAMBORNER REIT AG	21,674.000	144,782.320	
	ICADE	9,869.000	355,678.760	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	19,492.000	51,653.800	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	90,673.000	433,054.240	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	6,928.000	139,945.600	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	126,063.000	135,895.910	
	KLEPIERRE	58,747.000	1,044,521.660	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	18,487.000	75,611.830	
	MERCIALYS	22,861.000	180,716.200	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	98,898.000	769,426.440	
	MONTEA SCA	3,839.000	255,677.400	
	NSI NV	5,491.000	126,842.100	
	RETAIL ESTATES	3,433.000	190,188.200	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	32,274.000	1,347,762.240	
	VASTNED RETAIL	5,270.000	97,284.200	
	WAREHOUSES DE PAUW	42,995.000	1,014,682.000	
	WERELDHAVE NV	12,435.000	141,883.350	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	5,941.000	160,704.050	
	ユーロ 小計	678,596.000	11,061,615.270 (1,568,979,510)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,294.000	58,658,400.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	4,764.000	24,629,880.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	45,553.000	210,910,390.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	46,389,560.000	
	JR REIT XXVII	48,344.000	211,263,280.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	10,081.000	46,675,030.000	
	LOTTE REIT CO LTD	33,244.000	158,241,440.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	29,586.000	120,267,090.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	10,401.000	40,719,915.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,743.000	127,217,310.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	39,108,470.000	
	SK REITS CO LTD	24,053.000	116,536,785.000	
韓国・ウォン 小計	260,946.000	1,200,617,550.000		

				(122,583,052)	
香港・ドル	CHAMPION REIT	588,070.000	1,628,953.900		
	LINK REIT	636,120.000	33,905,196.000		
	PROSPERITY REIT	360,000.000	702,000.000		
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	299,000.000	876,070.000		
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	704,000.000	1,119,360.000		
香港・ドル 小計		2,587,190.000	38,231,579.900	(711,872,018)	
投資証券 合計		21,518,482	45,284,281,736	(45,284,281,736)	
合計			50,332,440,314	(50,332,440,314)	

(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	0.14	-	78.61
	投資証券 140銘柄	-	78.02	
イギリス・ポンド	投資証券 37銘柄	-	4.32	4.35
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-	0.16	0.16
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	6.11	-	6.14
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	-	1.82	1.83
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	3.58	-	3.60
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-	0.40	0.40
	投資信託受益証券 1銘柄	0.05	-	
ユーロ	投資証券 27銘柄	-	3.10	3.17
	投資信託受益証券 1銘柄	0.05	-	
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-	0.24	0.24
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.09	-	1.50
	投資証券 5銘柄	-	1.41	

(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。

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

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

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期中間計算期間(2022年10月13日から2023年4月12日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【たわらノーロード 最適化バランス（保守型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	472,985	428,087
親投資信託受益証券	41,721,399	46,367,933
未収入金	37,000	-
流動資産合計	42,231,384	46,796,020
資産合計	42,231,384	46,796,020
負債の部		
流動負債		
未払解約金	142,333	60,145
未払受託者報酬	8,968	9,696
未払委託者報酬	103,662	111,978
その他未払費用	732	733
流動負債合計	255,695	182,552
負債合計	255,695	182,552
純資産の部		
元本等		
元本	43,697,254	48,208,177
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	1,721,565	1,594,709
（分配準備積立金）	565,017	514,543
元本等合計	41,975,689	46,613,468
純資産合計	41,975,689	46,613,468
負債純資産合計	42,231,384	46,796,020

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	第6期中間計算期間 自 2022年10月13日 至 2023年4月12日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,484,476	444,534
営業収益合計	1,484,476	444,534
営業費用		
支払利息	-	7
受託者報酬	7,852	9,696
委託者報酬	90,767	111,978
その他費用	585	733
営業費用合計	99,204	122,414
営業利益又は営業損失()	1,583,680	322,120
経常利益又は経常損失()	1,583,680	322,120
中間純利益又は中間純損失()	1,583,680	322,120
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	14,229	13
期首剰余金又は期首欠損金()	1,217,281	1,721,565
剰余金増加額又は欠損金減少額	265,462	172,097
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	172,097
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	265,462	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	105,570	367,348
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	105,570	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	367,348
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	192,278	1,594,709

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自	至
	2022年10月13日	2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 期首元本額	32,087,475円	43,697,254円
期中追加設定元本額	18,138,145円	8,860,967円
期中一部解約元本額	6,528,366円	4,350,044円
2. 受益権の総数	43,697,254口	48,208,177口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,721,565円であります。	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,594,709円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	0.9606円	0.9669円
(1万口当たり純資産額)	(9,606円)	(9,669円)

【たわらノーロード 最適化バランス(安定型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	754,249	844,959
親投資信託受益証券	88,552,307	102,406,051
流動資産合計	89,306,556	103,251,010
資産合計	89,306,556	103,251,010
負債の部		
流動負債		
未払解約金	9,313	60,445
未払受託者報酬	18,997	21,022
未払委託者報酬	218,996	242,211
その他未払費用	1,604	1,775
流動負債合計	248,910	325,453
負債合計	248,910	325,453
純資産の部		
元本等		
元本	85,563,031	97,095,190
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3,494,615	5,830,367
(分配準備積立金)	2,687,237	2,585,975
元本等合計	89,057,646	102,925,557
純資産合計	89,057,646	102,925,557
負債純資産合計	89,306,556	103,251,010

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	第6期中間計算期間 自 2022年10月13日 至 2023年4月12日
営業収益		
受取利息	1	1
有価証券売買等損益	2,862,528	2,061,744
営業収益合計	2,862,527	2,061,745
営業費用		
支払利息	6	65
受託者報酬	16,184	21,022
委託者報酬	186,704	242,211
その他費用	1,377	1,775
営業費用合計	204,271	265,073
営業利益又は営業損失()	3,066,798	1,796,672
経常利益又は経常損失()	3,066,798	1,796,672
中間純利益又は中間純損失()	3,066,798	1,796,672
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	350,329	34,722
期首剰余金又は期首欠損金()	6,693,275	3,494,615
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,476,428	721,132
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,476,428	721,132
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,233,778	147,330
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,233,778	147,330
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	6,219,456	5,830,367

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自	至
	2022年10月13日	2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 期首元本額	53,251,724円	85,563,031円
期中追加設定元本額	57,763,582円	15,074,186円
期中一部解約元本額	25,452,275円	3,542,027円
2. 受益権の総数	85,563,031口	97,095,190口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.0408円	1.0600円
(1万口当たり純資産額)	(10,408円)	(10,600円)

【たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,435,603	10,841,404
親投資信託受益証券	1,072,637,359	1,305,256,003
未収入金	211,000	-
流動資産合計	1,083,283,962	1,316,097,407
資産合計	1,083,283,962	1,316,097,407
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,174,574	881,200
未払受託者報酬	213,875	262,722
未払委託者報酬	2,460,114	3,021,769
その他未払費用	18,950	23,293
流動負債合計	3,867,513	4,188,984
負債合計	3,867,513	4,188,984
純資産の部		
元本等		
元本	989,813,623	1,172,802,663
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	89,602,826	139,105,760
(分配準備積立金)	21,873,873	20,508,266
元本等合計	1,079,416,449	1,311,908,423
純資産合計	1,079,416,449	1,311,908,423
負債純資産合計	1,083,283,962	1,316,097,407

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	第6期中間計算期間 自 2022年10月13日 至 2023年4月12日
営業収益		
受取利息	24	43
有価証券売買等損益	19,364,884	33,651,644
営業収益合計	19,364,860	33,651,687
営業費用		
支払利息	524	1,859
受託者報酬	155,584	262,722
委託者報酬	1,789,769	3,021,769
その他費用	13,765	23,293
営業費用合計	1,959,642	3,309,643
営業利益又は営業損失()	21,324,502	30,342,044
経常利益又は経常損失()	21,324,502	30,342,044
中間純利益又は中間純損失()	21,324,502	30,342,044
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	846,678	806,004
期首剰余金又は期首欠損金()	77,450,706	89,602,826
剰余金増加額又は欠損金減少額	62,150,927	26,493,397
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	62,150,927	26,493,397
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,453,854	6,526,503
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,453,854	6,526,503
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	102,669,955	139,105,760

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2022年10月13日	至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 期首元本額	468,979,128円	989,813,623円
期中追加設定元本額	676,989,235円	253,658,793円
期中一部解約元本額	156,154,740円	70,669,753円
2. 受益権の総数	989,813,623口	1,172,802,663口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.0905円	1.1186円
(1万口当たり純資産額)	(10,905円)	(11,186円)

【たわらノーロード 最適化バランス(成長型)】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	738,211	892,462
親投資信託受益証券	96,406,278	115,799,391
未収入金	581,000	-
流動資産合計	97,725,489	116,691,853
資産合計	97,725,489	116,691,853
負債の部		
流動負債		
未払解約金	508,002	17,943
未払受託者報酬	20,986	23,380
未払委託者報酬	241,916	269,318
その他未払費用	1,751	2,004
流動負債合計	772,655	312,645
負債合計	772,655	312,645
純資産の部		
元本等		
元本	82,681,937	95,653,907
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	14,270,897	20,725,301
(分配準備積立金)	6,053,907	5,846,299
元本等合計	96,952,834	116,379,208
純資産合計	96,952,834	116,379,208
負債純資産合計	97,725,489	116,691,853

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	第6期中間計算期間 自 2022年10月13日 至 2023年4月12日
営業収益		
受取利息	-	1
有価証券売買等損益	4,117	4,181,113
営業収益合計	4,117	4,181,114
営業費用		
支払利息	29	86
受託者報酬	18,653	23,380
委託者報酬	214,965	269,318
その他費用	1,596	2,004
営業費用合計	235,243	294,788
営業利益又は営業損失()	239,360	3,886,326
経常利益又は経常損失()	239,360	3,886,326
中間純利益又は中間純損失()	239,360	3,886,326
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	378,904	81,286
期首剰余金又は期首欠損金()	15,456,799	14,270,897
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,520,547	3,182,005
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,520,547	3,182,005
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,738,811	532,641
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,738,811	532,641
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	16,620,271	20,725,301

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2022年10月13日	至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 期首元本額	67,259,471円	82,681,937円
期中追加設定元本額	39,935,902円	16,023,463円
期中一部解約元本額	24,513,436円	3,051,493円
2. 受益権の総数	82,681,937口	95,653,907口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.1726円	1.2167円
(1万口当たり純資産額)	(11,726円)	(12,167円)

【たわらノーロード 最適化バランス(積極型)】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,999,706	2,007,722
親投資信託受益証券	228,926,338	263,576,529
流動資産合計	230,926,044	265,584,251
資産合計	230,926,044	265,584,251
負債の部		
流動負債		
未払解約金	90,270	1,644
未払受託者報酬	51,594	54,197
未払委託者報酬	593,917	623,742
その他未払費用	4,500	4,741
流動負債合計	740,281	684,324
負債合計	740,281	684,324
純資産の部		
元本等		
元本	184,907,976	203,300,647
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	45,277,787	61,599,280
(分配準備積立金)	14,643,383	13,619,455
元本等合計	230,185,763	264,899,927
純資産合計	230,185,763	264,899,927
負債純資産合計	230,926,044	265,584,251

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 2021年10月13日 至 2022年4月12日	第6期中間計算期間 自 2022年10月13日 至 2023年4月12日
営業収益		
受取利息	2	6
有価証券売買等損益	2,236,646	11,944,191
その他収益	-	32
営業収益合計	2,236,648	11,944,229
営業費用		
支払利息	110	323
受託者報酬	45,955	54,197
委託者報酬	528,880	623,742
その他費用	3,996	4,741
営業費用合計	578,941	683,003
営業利益又は営業損失()	1,657,707	11,261,226
経常利益又は経常損失()	1,657,707	11,261,226
中間純利益又は中間純損失()	1,657,707	11,261,226
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	72,757	556,947
期首剰余金又は期首欠損金()	39,437,505	45,277,787
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,195,325	9,051,689
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	24,195,325	9,051,689
剰余金減少額又は欠損金増加額	12,204,133	3,434,475
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,204,133	3,434,475
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	53,013,647	61,599,280

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第6期中間計算期間	
	自 2022年10月13日	至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 期首元本額	137,707,368円	184,907,976円
期中追加設定元本額	116,848,868円	32,272,722円
期中一部解約元本額	69,648,260円	13,880,051円
2. 受益権の総数	184,907,976口	203,300,647口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第5期	第6期中間計算期間末
	2022年10月12日現在	2023年4月12日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第5期 2022年10月12日現在	第6期中間計算期間末 2023年4月12日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1,2449円 (12,449円)	1,3030円 (13,030円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,482,260,267
株式	404,558,467,690
派生商品評価勘定	123,923,300
未収入金	177,914,860
未収配当金	4,473,690,952
差入委託証拠金	522,600,000
流動資産合計	428,338,857,069
資産合計	428,338,857,069
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	16,830
前受金	122,155,000
未払金	10,082,018,700
未払解約金	16,224,000
流動負債合計	10,220,414,530
負債合計	10,220,414,530
純資産の部	
元本等	
元本	120,958,324,633
剰余金	
剰余金又は欠損金()	297,160,117,906
元本等合計	418,118,442,539
純資産合計	418,118,442,539
負債純資産合計	428,338,857,069

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	107,927,334,401円
同期中追加設定元本額	37,572,556,675円
同期中一部解約元本額	24,541,566,443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	2,620,320,243円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,030,114,852円
One DC 国内株式インデックスファンド	25,706,359,984円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,577,597,891円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	1,919,058円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	13,395,348円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	31,541,567円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	25,579,473円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	25,798,286円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,291,464円
たわらノーロード TOPIX	1,796,553,253円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,521,586,575円
たわらノーロード バランス(堅実型)	54,851,143円
たわらノーロード バランス(標準型)	364,466,407円
たわらノーロード バランス(積極型)	574,188,982円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	3,056,972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)	173,459,098円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	438,175,145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)	338,509,354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)	459,846,838円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	405,785円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,786,170円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	34,006,230円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,384,665円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,880,699円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,546,731,559円
Oneグローバルバランス	9,054,173円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,066,287,692円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,609,880,254円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,962,187,689円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	337,878,636円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,063,557,688円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,121,111,160円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	29,168,729円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	1,079,733,764円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	14,869,106円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	318,283,368円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	352,114,301円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	569,947,782円
投資のソムリエ	8,737,871,541円
クルーズコントロール	311,449,467円
投資のソムリエ<DC年金>	669,850,886円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	366,602,662円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	919,122,845円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	677,477,770円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,757,689,654円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	46,683,411円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	22,826,719円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	4,775,003円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	85,823,147円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	506,414,734円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,213,057,772円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	271,281,488円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	28,139,572円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	25,830,979円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	15,558,108円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	397,364,656円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,245,596円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,871,610円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	44,544,349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)	129,769,877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)	132,860,485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)	43,870,370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)	81,171,010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)	128,215,435円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	327,038,104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)	223,027,233円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	115,712,697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)	229,715,121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)	474,241,632円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	229,049,905円
AMOn e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)	32,017,881円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	29,099,759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)	122,480,799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)	216,046,401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)	4,088,837円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	7,683,767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)	43,648,082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)	88,766,045円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,046,344円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	15,226,943円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,073,899円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	90,461円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,844,652円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	26,217,983円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	398,256,834円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	503,504,992円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,489,530,487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)	13,641,749円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	19,667,504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)	210,586,531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)	42,418,286円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	64,481円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	264,913,937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)	15,805,334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)	53,065,622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)	119,487,354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)	165,758,437円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	23,170,138円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	14,745,169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)	1,191,581,310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>	40,500,156円
コア資産形成ファンド	27,000,970円
MHAMトピックスファンド	772,566,623円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	45,819,479円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,070,166,129円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,451,027,339円

計	120,958,324,633円
2. 受益権の総数	120,958,324,633口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年4月12日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)	うち		
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	10,733,785,000	-	10,857,870,000	124,085,000
合計	10,733,785,000	-	10,857,870,000	124,085,000

(注)時価の算定方法

株価指数先物取引

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

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	3.4567円
(1万口当たり純資産額)	(34,567円)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	974,287,228
国債証券	373,603,708,350
地方債証券	32,631,547,110
特殊債券	30,302,339,362
社債券	25,546,155,890
未収利息	392,894,051
前払費用	62,795,944
流動資産合計	463,513,727,935
資産合計	463,513,727,935
負債の部	
流動負債	
未払金	105,679,744,000
未払解約金	43,112,000
流動負債合計	105,722,856,000
負債合計	105,722,856,000
純資産の部	
元本等	
元本	284,347,737,586
剰余金	
剰余金又は欠損金()	73,443,134,349
元本等合計	357,790,871,935
純資産合計	357,790,871,935
負債純資産合計	463,513,727,935

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	618,708,264,968円
同期中追加設定元本額	450,477,076,814円
同期中一部解約元本額	784,837,604,196円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	25,318,957,177円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	56,639,596円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	103,063,638円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	57,363,333円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	755,367,664円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	198,921,872円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	53,417,978円
たわらノーロード 国内債券	18,044,887,471円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,931,960,798円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,292,768,679円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,314,252,422円
たわらノーロード バランス(積極型)	294,633,419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)	134,741,076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)	1,743,341,796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)	1,843,041,911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)	515,728,538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)	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	27,129,403円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	18,982,849円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	159,203,009円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,043,523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>	13,845,172,243円
Oneグローバルバランス	36,046,785円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	9,765,550,933円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	13,894,241,813円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	5,903,657,173円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,369,130,057円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,452,201,881円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	424,577,054円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	76,877,550円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,843,395,929円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	13,036,864円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,815,667,330円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,981,824,622円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	386,710,142円
投資のソムリエ	147,430,115円
クルーズコントロール	838,368,810円
投資のソムリエ<DC年金>	10,733,787円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,668,436,610円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,365,928,676円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	12,645,799円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	55,061,979円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	386,201,713円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	191,731,732円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	90,701円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,630,908,641円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,557,264,455円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	11,679,610,379円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,555,312,192円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	524,435,348円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	210,846,564円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	126,051,286円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,312,625,083円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	27,110,580円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	124,967,595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)	1,897,673,325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)	1,942,677,079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)	1,518,119,197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)	1,187,236,346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)	1,874,972,061円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	4,851,393,991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)	1,872,849,045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)	1,692,083,076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)	1,920,767,549円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,420,261,520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)	3,644,596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)	567,293,469円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	260,483,312円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,397,074,453円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	5,408,411,752円
One収益追求型マルチアセット戦略ファンド(適格機関投資家限定)	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)	3,142,705,670円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(F O F s 用)(適格機関投資家専用)	81,869円
A M O n e 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
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	152,237円
D I A M グローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	142,486,544円
D I A M グローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	96,451,982円
D I A M 国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	19,357,856円
D I A M 国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	62,321,476円
D I A M 国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	27,741,495円
D I A M 国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	327,756円
D I A M 世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	23,869,834円
D I A M 世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	107,103,367円
D I A M バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,893,675,174円
D I A M バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,057,689,110円
D I A M バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,055,314,827円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	54,609,092円
D I A M グローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	135,398,074円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,710,001,886円
D I A M 世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	115,364,210円
D I A M 世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	524,627円
D I A M 世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	1,920,967,606円
D I A M 世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	43,048,681円
D I A M 世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	289,188,698円
D I A M 世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	433,150,792円
D I A M 世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	751,603,447円
D I A M 世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	208,678,628円
D I A M 国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	93,864,455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< D C 年金 >	265,216,045円
コア資産形成ファンド	176,691,750円
M H A M 日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	21,093,909,977円
M H A M 動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	33,089,939,525円
M H A M 日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,315,982,072円
M H A M 動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,130,876,407円
計	284,347,737,586円
2. 受益権の総数	284,347,737,586口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年4月12日現在	
1口当たり純資産額	1,2583円
(1万口当たり純資産額)	(12,583円)

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,942,073,999
コール・ローン	182,697,704
株式	891,701,654,426
投資信託受益証券	1,488,402,006
投資証券	18,332,526,374
派生商品評価勘定	339,698,468
未収入金	285,719,109
未収配当金	1,024,751,546
差入委託証拠金	6,349,671,953
流動資産合計	931,647,195,585
資産合計	931,647,195,585
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	622,236
未払金	535,670,990
未払解約金	4,140,000
流動負債合計	540,433,226
負債合計	540,433,226
純資産の部	
元本等	
元本	148,316,796,993
剰余金	
剰余金又は欠損金()	782,789,965,366
元本等合計	931,106,762,359
純資産合計	931,106,762,359
負債純資産合計	931,647,195,585

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	124,720,616,433円
同期中追加設定元本額	36,557,788,868円
同期中一部解約元本額	12,961,608,308円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,862,761,303円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,230,953円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	10,643,179円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	28,033,674円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	29,753,043円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	20,543,016円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	26,108,663円
たわらノーロード 先進国株式	45,347,653,716円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	365,947,679円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,127,929,382円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	844,171,084円
たわらノーロード バランス(堅実型)	89,207,273円
たわらノーロード バランス(標準型)	770,342,315円
たわらノーロード バランス(積極型)	972,012,482円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,335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)	73,020,769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)	286,520,338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)	256,547,661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)	427,558,869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)	661,891円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	21,031,012円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,523,376円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,869,011円
たわらノーロード 全世界株式	697,689,244円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,784,332,875円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,891,044,937円
Oneグローバルバランス	5,122,722円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	156,476,894円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	809,363,663円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,061,690,829円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	95,553,682円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	257,788,918円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	251,266,514円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	17,883,685円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	662,291,338円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	122,553,509円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	177,552,525円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	199,406,404円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	319,526,274円
投資のソムリエ	10,162,032,226円
クルーズコントロール	86,233,214円
投資のソムリエ<DC年金>	778,887,195円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	205,789,448円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	249,194,937円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	790,458,035円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,216,688,659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)	259,854,926円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	49,406,726円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	24,529,978円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,569,943円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	120,018,081円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	143,568,204円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	677,964,875円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	151,685,492円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	47,147,995円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	26,976,183円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	16,126,471円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	112,839,147円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,468,438円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	40,784,698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)	2,493,515円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	2,516,192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)	1,537,550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)	2,479,618円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	5,852,529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)	2,203,472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)	370,051,641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)	40,436,660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)	1,107,673,530円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,277,287円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,283,515,069円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	266,494,547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)	363,221円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	6,969,821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)	3,967,803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)	4,697,751円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	8,962,985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)	24,407,645円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	49,640,435円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,703,543円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,788,020円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,138,684円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,738円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,268,353円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,996,310円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	148,417,888円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	246,491,943円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	832,111,684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)	38,367,606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)	33,724,664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)	235,649,145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)	7,892,879円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	159,619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)	98,436,060円

D I A M世界アセットバランスファンド40VA（適格機関投資家限定）	8,839,082円
D I A M世界アセットバランスファンド25VA（適格機関投資家限定）	29,676,926円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	44,414,281円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA（適格機関投資家限定）	92,488,367円
動的パッケージファンド<DC年金>	3,773,335円
コア資産形成ファンド	2,584,005円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,649,531,651円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,542,667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）	6,527,922円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	486,698,977円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,384,954,153円
計	148,316,796,993円
2. 受益権の総数	148,316,796,993口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建	5,313,921,254	-	5,314,012,682	91,428
アメリカ・ドル	3,823,626,600	-	3,823,663,767	37,167
イギリス・ポンド	231,091,670	-	231,099,593	7,923
オーストラリア・ドル	126,193,769	-	126,199,862	6,093
カナダ・ドル	202,402,431	-	202,404,468	2,037

ユーロ	930,606,784	-	930,644,992	38,208
合計	5,313,921,254	-	5,314,012,682	91,428

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

株式関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等(円)	時価(円)		評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	24,349,744,120	-	24,688,728,924	338,984,804
合計	24,349,744,120	-	24,688,728,924	338,984,804

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2023年4月12日現在	
1口当たり純資産額	6.2778円
(1万口当たり純資産額)	(62,778円)

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	680,489,598
コール・ローン	633,332,689
国債証券	207,472,646,509
派生商品評価勘定	45,256
未収利息	1,307,759,422
前払費用	286,249,252
流動資産合計	210,380,522,726
資産合計	210,380,522,726
負債の部	
流動負債	
未払金	2,192,644,341
未払解約金	2,122,000
流動負債合計	2,194,766,341
負債合計	2,194,766,341
純資産の部	
元本等	
元本	100,632,893,691
剰余金	
剰余金又は欠損金()	107,552,862,694
元本等合計	208,185,756,385
純資産合計	208,185,756,385
負債純資産合計	210,380,522,726

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	86,195,830,752円
同期中追加設定元本額	36,275,077,624円
同期中一部解約元本額	21,838,014,685円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国債券パッシブ・ファンド	6,368,331,045円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,409,545円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	18,257,473円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	45,292,920円
グローバル8資産ラップファンド（安定型）	32,114,554円
グローバル8資産ラップファンド（中立型）	35,165,924円
グローバル8資産ラップファンド（積極型）	42,064,859円
たわらノーロード 先進国債券	17,396,291,671円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	247,468,565円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,518,372,814円
たわらノーロード バランス（堅実型）	67,920,927円
たわらノーロード バランス（標準型）	344,293,578円
たわらノーロード バランス（積極型）	72,385,645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）	16,628,720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）	984,897,149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）	1,598,545,233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）	737,306,579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）	442,465,488円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	2,049,424円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	13,964,293円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	183,971,829円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	15,242,513円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	24,890,117円
D I A M外国債券インデックスファンド<DC年金>	6,661,427,286円
O n e D C 先進国債券インデックスファンド	924,633,989円

Oneグローバルバランス	25,999,770円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	746,657,608円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	2,391,956,199円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	2,644,308,212円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	423,631,209円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	854,188,656円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	747,165,731円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	24,213,150円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	895,628,565円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	35,241,998円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	159,329,380円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	154,656,740円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	236,921,033円
クルーズコントロール	774,039,251円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	180,603,325円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	618,165,579円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	634,168,943円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	182,818,638円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	330,647,342円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	9,420,835円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	85,733,603円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	1,031,313,518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)	35,754,103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)	36,603,522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)	140,709,276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)	22,362,993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)	35,323,477円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	56,738,918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)	403,153,228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)	31,878,275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)	417,866,540円
DIAM為替フルヘッジ型外国債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	5,405,003,451円
DIAM外国債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	1,391,843,687円
外国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	2,059,193,028円
先進国債券パッシブファンド(適格機関投資家限定)	5,167,390,587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)	80,223,864円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	48,940,676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)	59,490,694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)	352,674,300円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	239,002,001円

D I A M国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	11,961,981円
D I A M国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,669,377円
D I A M国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	6,851,642円
D I A M国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	50,371円
D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	14,749,966円
D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	44,100,734円
D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	1,564,518,584円
D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	1,377,595,768円
D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,505,940,123円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	57,487,654円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	117,339,632円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,420,833,575円
D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	261,895,142円
D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	162,358円
D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	296,449,087円
D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	267,675,328円
D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	371,500,440円
D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	39,076,430円
動的パッケージファンド<DC年金>	45,736,316円
コア資産形成ファンド	32,386,904円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ)	2,368,184,082円
MHAM外国債券インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ)	12,571,646,174円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	5,828,776,105円
MHAM外国債券パッシブファンド[適格機関投資家限定]	3,434,951,873円
計	100,632,893,691円
2. 受益権の総数	100,632,893,691口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	1,937,501,000	-	1,937,546,256	45,256
イギリス・ポンド	1,027,106,000	-	1,027,115,983	9,983
オーストラリア・ドル	120,245,000	-	120,249,121	4,121
カナダ・ドル	38,843,000	-	38,844,875	1,875
ユーロ	50,583,000	-	50,583,508	508
ユーロ	700,724,000	-	700,752,769	28,769
合計	1,937,501,000	-	1,937,546,256	45,256

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.0688円
（1万口当たり純資産額）	（20,688円）

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,509,371,308
コール・ローン	592,433,292
国債証券	307,237,280,742
派生商品評価勘定	17,982,533
未収利息	866,717,606
前払費用	1,393,249,858
流動資産合計	311,617,035,339
資産合計	311,617,035,339
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,460,501,845
未払金	2,374,113,527
未払解約金	508,000
流動負債合計	4,835,123,372
負債合計	4,835,123,372
純資産の部	
元本等	
元本	252,845,760,687
剰余金	
剰余金又は欠損金()	53,936,151,280
元本等合計	306,781,911,967
純資産合計	306,781,911,967
負債純資産合計	311,617,035,339

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	175,347,896,102円
同期中追加設定元本額	272,128,028,873円
同期中一部解約元本額	194,630,164,288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>	9,939,811,805円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,251,055,491円
たわらノーロード バランス(標準型)	3,327,074,288円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,615,076,474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)	36,481,622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)	1,238,009,804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)	1,147,845,709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)	113,805,305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)	173,393円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	3,860,270円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	16,071,768円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	139,827,555円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,817,032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	112,723,637,070円
投資のソムリエ<DC年金>	8,640,558,962円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,536,912,429円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	38,822,983,306円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,165,962,802円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	4,037,508,481円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	377,912,752円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	187,622,365円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	67,200,710円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,322,536,715円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,236,623,618円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,795,903,313円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	534,502,246円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	206,318,840円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	123,350,969円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	26,529,552円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	17,856,777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)	21,383,946,216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)	7,177,938,621円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,955,271,996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)	50,846,072円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	108,123,043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)	502,733,243円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	45,112,248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)	303,053,358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)	567,478,579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)	787,645,173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	252,845,760,687円
2. 受益権の総数	252,845,760,687口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	306,809,107,925	-	309,254,965,413	2,445,857,488
アメリカ・ドル	151,768,428,723	-	152,723,262,574	954,833,851
イギリス・ポンド	15,025,374,598	-	15,198,955,753	173,581,155
イスラエル・シケル	995,313,330	-	985,147,861	10,165,469
オーストラリア・ドル	4,889,527,534	-	4,890,709,788	1,182,254
オフショア・人民元	15,454,519,148	-	15,487,399,039	32,879,891
カナダ・ドル	6,328,675,038	-	6,401,464,994	72,789,956
シンガポール・ドル	1,342,460,611	-	1,348,318,787	5,858,176
スウェーデン・クローナ	635,802,831	-	636,043,653	240,822
デンマーク・クローネ	973,424,908	-	984,371,940	10,947,032
ニュージーランド・ドル	710,432,469	-	707,832,590	2,599,879
ノルウェー・クローネ	493,328,363	-	492,950,489	377,874
ポーランド・ズロチ	1,420,387,141	-	1,441,091,804	20,704,663
マレーシア・リンギット	1,634,478,840	-	1,638,552,432	4,073,592
メキシコ・ペソ	2,763,017,109	-	2,762,467,826	549,283
ユーロ	102,373,937,282	-	103,556,395,883	1,182,458,601
買建	1,480,002,000	-	1,483,340,176	3,338,176
アメリカ・ドル	746,327,000	-	747,579,661	1,252,661
イギリス・ポンド	31,190,000	-	31,236,237	46,237
オーストラリア・ドル	23,045,000	-	23,100,897	55,897
オフショア・人民元	149,559,000	-	149,908,951	349,951
カナダ・ドル	31,456,000	-	31,575,324	119,324
メキシコ・ペソ	26,867,000	-	26,967,797	100,797
ユーロ	471,558,000	-	472,971,309	1,413,309
合計	308,289,109,925	-	310,738,305,589	2,442,519,312

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.2133円
(1万口当たり純資産額)	(12,133円)

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,251,206,810
コール・ローン	119,986,127
株式	83,702,091,766
投資信託受益証券	586,912,225
投資証券	86,410,929
派生商品評価勘定	209,925,132
未収配当金	244,506,572
差入委託証拠金	2,142,670,294
流動資産合計	90,343,709,855
資産合計	90,343,709,855
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	943,149
未払金	47,282
未払解約金	168,000
流動負債合計	1,158,431
負債合計	1,158,431
純資産の部	
元本等	
元本	64,381,690,141
剰余金	
剰余金又は欠損金()	25,960,861,283
元本等合計	90,342,551,424
純資産合計	90,342,551,424
負債純資産合計	90,343,709,855

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	66,356,355,641円
同期中追加設定元本額	24,001,129,627円
同期中一部解約元本額	25,975,795,127円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国株式インデックスファンド< D C 年金 >	9,193,343,756円
D I A M新興国株式インデックスファンド< 為替ヘッジなし > (ファンドラップ)	5,679,646,401円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,988,235円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	14,255,247円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	37,603,317円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	39,846,275円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	27,514,357円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	35,019,794円
たわらノーロード 新興国株式	11,428,525,628円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,944,581,428円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,764,326,050円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,287,967円
たわらノーロード バランス(標準型)	128,707,496円
たわらノーロード バランス(積極型)	215,412,225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)	53,628,684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)	181,555,573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)	148,792,815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)	281,242,743円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	737,010円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,362,262円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,476,460円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,547,862円
たわらノーロード 全世界株式	408,291,370円
One DC 新興国株式インデックスファンド	845,454,366円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	374,552,081円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	401,972,605円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	590,895,258円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,073,737,043円
投資のソムリエ	12,735,011,767円
クルーズコントロール	384,934,440円
投資のソムリエ<DC年金>	975,612,401円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	458,074,216円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,233,206,315円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,023,886,319円
ワールドアセットバランス(基本コース)	594,531,654円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,113,507,333円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	58,245,017円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	28,896,334円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	8,707,497円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	192,404,036円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,484,206,059円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	337,580,035円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	62,142,083円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	31,730,467円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	19,009,359円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,079,621円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	26,127,942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)	11,070,276円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	333,931,723円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	5,883,890円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	14,009,387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)	219,659,777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)	98,844,794円
計	64,381,690,141円

2. 受益権の総数	64,381,690,141口
-----------	-----------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超	時価(円)	
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	505,537,200	-	505,542,114	4,914
合計	505,537,200	-	505,542,114	4,914

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

株式関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	6,250,426,350	-	6,459,403,419	208,977,069
合計	6,250,426,350	-	6,459,403,419	208,977,069

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引

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

2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.4032円
(1万口当たり純資産額)	(14,032円)

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	10,275,362,236
コール・ローン	156,826,072
国債証券	132,091,259,187
派生商品評価勘定	6,804
未収利息	1,142,185,647
前払費用	428,164,950
流動資産合計	144,093,804,896
資産合計	144,093,804,896
負債の部	
流動負債	
未払金	8,566,578,220
流動負債合計	8,566,578,220
負債合計	8,566,578,220
純資産の部	
元本等	
元本	66,734,962,250
剰余金	
剰余金又は欠損金()	68,792,264,426
元本等合計	135,527,226,676
純資産合計	135,527,226,676
負債純資産合計	144,093,804,896

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	44,658,897,542円
同期中追加設定元本額	50,256,996,254円
同期中一部解約元本額	28,180,931,546円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M新興国債券インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファンドラップ）	97,921,292円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,580,508,155円
たわらノーロード バランス（堅実型）	185,847,928円
たわらノーロード バランス（標準型）	529,704,108円
たわらノーロード バランス（積極型）	222,766,701円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	933,491円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	5,605,978円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	64,858,568円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,536,422円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	6,520,439円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	64,865,239円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国10）	271,810,079円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国20）	401,041,112円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	730,749,125円
投資のソムリエ	17,722,855,370円
クルーズコントロール	264,427,903円
投資のソムリエ<DC年金>	1,358,904,418円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	309,625,511円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,393,530,117円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,664,430,474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）	732,673,075円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	63,053,419円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	31,199,558円

リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	9,823,913円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	207,037,744円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,516,476,083円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	233,286,363円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	81,019,243円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	34,114,129円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	20,547,297円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	4,309,870円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	4,278,720円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	22,466,091円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	26,069,579,957円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	465,427,198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)	1,387,494,881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)	367,784,786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)	8,075,202円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	15,798,541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)	7,537,009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)	151,367,285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)	68,329,390円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,910,229,952円
計	66,734,962,250円
2. 受益権の総数	66,734,962,250口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	700,000,000	-	700,006,804	6,804
	700,000,000	-	700,006,804	6,804
合計	700,000,000	-	700,006,804	6,804

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.0308円
（1万口当たり純資産額）	（20,308円）

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,833,153,916
投資証券	194,019,074,620
未収配当金	2,346,215,836
前払金	5,351,730
差入委託証拠金	253,564,500
流動資産合計	198,457,360,602
資産合計	198,457,360,602
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,484,300
未払金	208,560,948
未払解約金	15,601,000
流動負債合計	256,646,248
負債合計	256,646,248
純資産の部	
元本等	
元本	87,731,968,490
剰余金	
剰余金又は欠損金()	110,468,745,864
元本等合計	198,200,714,354
純資産合計	198,200,714,354
負債純資産合計	198,457,360,602

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	74,211,288,424円
同期中追加設定元本額	38,589,824,058円
同期中一部解約元本額	25,069,143,992円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	248,892円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,199,919円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	3,153,092円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	3,318,464円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	2,314,693円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	2,936,516円
たわらノーロード 国内リート	5,658,177,011円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,194,205,574円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,278,341,605円
たわらノーロード バランス(堅実型)	41,199,937円
たわらノーロード バランス(標準型)	770,762,514円
たわらノーロード バランス(積極型)	849,567,665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)	232,912,998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)	561,354,037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)	367,213,378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)	405,988,079円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,805,979円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	47,468,886円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,162,838円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,808,229円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	12,819,640円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	473,699,700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)	143,513,616円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	210,067,895円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	385,773,952円
投資のソムリエ	8,764,289,841円
投資のソムリエ<DC年金>	671,222,898円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	161,194,790円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	834,227,213円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,394,093,064円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	36,083,893円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	17,904,395円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,879,941円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	116,064,843円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	329,117,766円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	124,551,535円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	42,216,349円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	19,520,904円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	11,757,574円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,441,152円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	44,630,907円
Jリートインデックスファンド(DC)	65,308,080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)	694,958,051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)	63,115,300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)	26,910,161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)	64,619,624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)	34,776,351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)	39,479,672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)	193,284,223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)	85,598,465円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(株式先物活用型・シグナルヘッジ付き)21-03(適格機関投資家限定)	61,967,387円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03(適格機関投資家限定)	62,360,746円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	158,998,961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)	119,773,817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)	197,063,808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)	137,340,420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)	85,543,896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)	56,279,373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)	137,092,547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）	197,707,007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）	74,837,120円
DIAM J-REITインデックスファンド（適格機関投資家向け）	3,533,428,332円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	229,889,817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）	89,963,828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）	439,807,342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）	105,061,210円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	4,031,088円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	9,460,086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）	1,253,267,635円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,809,580,214円
MHAM J-REITインデックスファンド（毎月決算型）	36,703,361,194円
MHAM J-REITインデックスファンド（年1回決算型）	2,649,686,421円
MHAM J-REITインデックスファンド（ファンドラップ）	4,101,897,176円
計	87,731,968,490円
2. 受益権の総数	87,731,968,490口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（デリバティブ取引等に関する注記）

不動産投信関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等（円）	うち 1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引				

先物取引 買建	4,213,120,230	-	4,180,893,000	32,227,230
合計	4,213,120,230	-	4,180,893,000	32,227,230

(注) 時価の算定方法

不動産投信指数先物取引

1. 原則として計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
2. 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	2.2592円
(1万口当たり純資産額)	(22,592円)

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年4月12日現在

資産の部	
流動資産	
預金	265,495,490
コール・ローン	111,121,227
投資信託受益証券	8,191,583,488
投資証券	69,631,983,662
派生商品評価勘定	121,108
未収入金	2,064,204
未収配当金	232,453,845
流動資産合計	78,434,823,024
資産合計	78,434,823,024
負債の部	
流動負債	
未払金	292,960,733
未払解約金	238,000
流動負債合計	293,198,733
負債合計	293,198,733
純資産の部	
元本等	
元本	48,604,686,309
剰余金	
剰余金又は欠損金()	29,536,937,982
元本等合計	78,141,624,291
純資産合計	78,141,624,291
負債純資産合計	78,434,823,024

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10月13日 至 2023年4月12日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年4月12日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	32,366,670,054円
同期中追加設定元本額	35,680,877,033円
同期中一部解約元本額	19,442,860,778円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	1,784,161,038円
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジあり> (ファンドラップ)	23,912,861円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,989,918円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	19,026,744円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	50,079,832円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	53,208,585円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	36,736,872円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	46,658,907円
たわらノーロード 先進国リート	15,228,682,563円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,814,127,339円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	347,525,522円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,341,032,135円
たわらノーロード バランス(堅実型)	30,592,338円

たわらノーロード バランス(標準型)	564,242,460円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,149,302,985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)	47,571,142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)	480,651,966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)	480,477,733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)	814,901,166円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	648,876円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	32,969,915円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,498,711円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	24,935,557円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,693,160,273円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	18,689,774円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	690,947,972円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	57,534,103円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	214,120,117円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	312,458,906円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	567,129,006円
投資のソムリエ	9,579,749,749円
投資のソムリエ<DC年金>	733,928,723円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	240,510,446円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	810,667,543円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,297,325,753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)	679,778,402円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	41,512,162円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	20,597,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,709,497円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	115,772,573円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,555,768円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	47,819,847円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	22,462,593円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	13,527,691円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,900,725円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	85,541,069円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	294,016,942円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	315,396,675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)	4,070,778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)	3,950,091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)	2,326,971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)	4,138,523円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	8,968,317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)	3,808,861円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	251,050,347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)	1,243,561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)	3,875,267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)	4,429,105円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	9,187,187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)	61,980,179円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	192,923,375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)	1,286,633,481円
計	48,604,686,309円
2. 受益権の総数	48,604,686,309口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	2023年4月12日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年4月12日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建				
アメリカ・ドル	176,921,143	-	177,042,251	121,108
イギリス・ポンド	93,631,720	-	93,632,490	770
オーストラリア・ドル	4,988,205	-	4,988,379	174
シンガポール・ドル	41,766,140	-	41,862,289	96,149
ニュージーランド・ドル	13,041,500	-	13,056,233	14,733
ニュージーランド・ドル	4,142,600	-	4,143,235	635
ユーロ	4,142,600	-	4,143,235	635
ユーロ	11,692,088	-	11,692,560	472
香港・ドル	7,658,890	-	7,667,065	8,175
合計	176,921,143	-	177,042,251	121,108

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	2023年4月12日現在
1口当たり純資産額	1.6077円
(1万口当たり純資産額)	(16,077円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

たわらノーロード 最適化バランス（保守型）

2023年4月28日現在

資産総額	46,932,467円
負債総額	223,477円
純資産総額（ - ）	46,708,990円
発行済数量	48,055,236口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9720円

たわらノーロード 最適化バランス（安定型）

2023年4月28日現在

資産総額	103,838,833円
負債総額	1,753,685円
純資産総額（ - ）	102,085,148円
発行済数量	95,909,621口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0644円

たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）

2023年4月28日現在

資産総額	1,331,295,510円
負債総額	5,346,325円
純資産総額（ - ）	1,325,949,185円
発行済数量	1,177,922,725口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1257円

たわらノーロード 最適化バランス（成長型）

2023年4月28日現在

資産総額	117,470,323円
負債総額	91,701円
純資産総額（ - ）	117,378,622円
発行済数量	95,648,016口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2272円

たわらノーロード 最適化バランス（積極型）

2023年4月28日現在

資産総額	269,179,802円
負債総額	871,613円
純資産総額（ - ）	268,308,189円
発行済数量	203,693,281口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3172円

（参考）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	422,110,422,099円
負債総額	1,742,366,996円
純資産総額（ - ）	420,368,055,103円
発行済数量	118,620,314,817口
1口当たり純資産額（ / ）	3.5438円

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	486,554,954,069円
負債総額	4,875,219,000円
純資産総額（ - ）	481,679,735,069円
発行済数量	379,863,713,616口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2680円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	949,341,168,976円
負債総額	241,674,083円
純資産総額（ - ）	949,099,494,893円
発行済数量	149,676,164,468口
1口当たり純資産額（ / ）	6.3410円

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	214,603,308,026円
負債総額	1,673,086,000円
純資産総額（ - ）	212,930,222,026円
発行済数量	103,026,079,204口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0668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4月28日現在

資産総額	313,036,241,121円
負債総額	5,211,042,427円
純資産総額（ - ）	307,825,198,694円
発行済数量	255,966,787,109口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2026円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	90,074,303,862円
負債総額	28,831,577円
純資産総額（ - ）	90,045,472,285円
発行済数量	65,503,325,393口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3747円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	137,936,580,712円
負債総額	6,282,195,636円
純資産総額（ - ）	131,654,385,076円
発行済数量	64,772,039,648口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0326円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	208,875,799,222円
負債総額	2,084,101,782円
純資産総額(-)	206,791,697,440円
発行済数量	87,640,824,532口
1口当たり純資産額(/)	2.3595円

外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年4月28日現在

資産総額	78,693,715,716円
負債総額	177,891,412円
純資産総額(-)	78,515,824,304円
発行済数量	48,778,964,869口
1口当たり純資産額(/)	1.6096円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)受益証券の名義書換

該当事項はありません。

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

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

(2)受益者等名簿

該当事項はありません。

(3)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(4)受益権の譲渡制限

譲渡制限はありません。

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

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

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

(5)受益権の譲渡の対抗要件

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

(6)受益権の再分割

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

(7)質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額(2023年4月28日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2023年4月28日現在)

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

また、取締役会の決議によって、取締役社長を定めることができます。

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

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

投資運用の意思決定機構

1. 投資環境見直しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年4月28日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,395,036,939,532
追加型株式投資信託	794	14,529,802,864,852
単位型公社債投資信託	23	39,735,249,516
単位型株式投資信託	212	1,119,771,942,422
合計	1,055	17,084,346,996,322

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社であるアセットマネジメントOne株式会社（以下「委託会社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）により作成しております。
2. 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、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき第38期事業年度（自2022年4月1日至2023年3月31日）の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金	31,421	33,770
金銭の信託	30,332	29,184
未収委託者報酬	17,567	16,279
未収運用受託報酬	4,348	3,307
未収投資助言報酬	309	283
未収収益	5	15
前払費用	1,167	1,129
その他	2,673	2,377
流動資産計	87,826	86,346
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,109	1,001
器具備品	158	118
リース資産	-	7
無形固定資産		
ソフトウェア	3,107	3,367
ソフトウェア仮勘定	1,449	1,651
電話加入権	3	2
投資その他の資産		
投資有価証券	241	182
関係会社株式	5,349	5,810
長期差入保証金	1,102	775
繰延税金資産	3,092	2,895
その他	367	104
固定資産計	15,983	15,918
資産合計	103,810	102,265

(単位:百万円)

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	1,445	1,481
リース債務	-	1
未払金	7,616	7,246
未払収益分配金	0	0
未払償還金	9	-
未払手数料	7,430	7,005
その他未払金	175	240
未払費用	8,501	7,716
未払法人税等	2,683	1,958
未払消費税等	1,330	277
賞与引当金	1,933	1,730
役員賞与引当金	69	48
流動負債計	23,581	20,460
固定負債		
リース債務	-	6
退職給付引当金	2,507	2,654
時効後支払損引当金	147	108
固定負債計	2,655	2,769
負債合計	26,236	23,230
(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	56,020	57,481
利益準備金	123	123
その他利益剰余金	55,896	57,358
別途積立金	31,680	31,680
繰越利益剰余金	24,216	25,678
株主資本計	77,573	79,034
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	77,573	79,034
負債・純資産合計	103,810	102,265

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)		第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	
	営業収益			
委託者報酬	108,563		95,739	
運用受託報酬	16,716		16,150	
投資助言報酬	1,587		2,048	
その他営業収益	12		23	
営業収益計		126,879		113,962
営業費用				
支払手数料	45,172		41,073	
広告宣伝費	391		216	
公告費	0		0	
調査費	36,488		33,177	
調査費	10,963		12,294	
委託調査費	25,525		20,882	
委託計算費	557		548	
営業雑経費	842		733	
通信費	35		36	
印刷費	606		504	
協会費	66		69	
諸会費	26		29	
支払販売手数料	106		92	
営業費用計		83,453		75,749
一般管理費				
給料	10,377		10,484	
役員報酬	168		168	
給料・手当	8,995		9,199	
賞与	1,213		1,115	
交際費	6		17	
寄付金	15		11	
旅費交通費	40		128	
租税公課	367		330	
不動産賃借料	1,674		1,006	
退職給付費用	495		437	
固定資産減価償却費	1,389		1,388	
福利厚生費	42		47	
修繕費	0		1	
賞与引当金繰入額	1,933		1,730	
役員賞与引当金繰入額	69		48	
機器リース料	0		0	
事務委託費	3,901		4,074	
事務用消耗品費	45		37	
器具備品費	0		1	
諸経費	217		334	
一般管理費計		20,578		20,078
営業利益		22,848		18,135

（単位：百万円）

	第37期 （自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）		第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	
営業外収益				
受取利息		13		10
受取配当金	1	559	1	2,400
時効成立分配金・償還金		0		0
為替差益		7		-
雑収入		19		10
時効後支払損引当金戻入額		10		24
営業外収益計		610		2,446
営業外費用				
為替差損		-		3
金銭の信託運用損		743		1,003
早期割増退職金		20		24
雑損失		-		47
営業外費用計		764		1,079
経常利益		22,694		19,502
特別利益				
固定資産売却益		0		-
投資有価証券売却益		-		4
特別利益計		0		4
特別損失				
固定資産除却損		5		12
投資有価証券売却損		6		9
ゴルフ会員権売却損		3		-
オフィス再編費用	2	509		-
関係会社株式評価損		-		584
特別損失計		525		606
税引前当期純利益		22,169		18,900
法人税、住民税及び事業税		6,085		4,881
法人税等調整額		584		197
法人税等合計		6,669		5,078
当期純利益		15,499		13,821

（３）【株主資本等変動計算書】

第37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	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		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	24,216	56,020	77,573
当期変動額									
剰余金の配当							12,360	12,360	12,360
当期純利益							13,821	13,821	13,821
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,461	1,461	1,461
当期末残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	25,678	57,481	79,034

	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	77,573
当期変動額			
剰余金の配当			12,360
当期純利益			13,821
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	1,461
当期末残高	0	0	79,034

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p>
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 ... 8～18年 器具備品 ... 2～20年</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価格を零とする定額法を採用しております。</p>
4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準	外貨建金銭債権債務は、期末日の直物等為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。
5. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(2) 役員賞与引当金 役員に対して支給する賞与の支出に充てるため、将来の支給見込額に基づき当事業年度に見合う分を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金制度について、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 過去勤務費用については、その発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を費用処理しております。 数理計算上の差異については、各事業年度の発生時の従業員の平均残存勤務期間内の一定の年数(5年または10年)による定額法により按分した額を、それぞれ発生翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>

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

（会計方針の変更）

「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。）を当事業年度の期首から適用し、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、当事業年度の財務諸表への影響はありません。

また、（金融商品会計）注記の金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項における投資信託に関する注記事項においては、時価算定会計基準適用指針第27 - 3項に従って、前事業年度に係るものについては記載しておりません。

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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
建物	415	523
器具備品	966	934
リース資産	-	1

（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37期 (自 2021年4月 1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月 1日 至 2023年3月31日)
受取配当金	543	2,393

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

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					

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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
2022年6月16日 定時株主総会	普通株式	12,360	309,000	2022年3月31日	2022年6月17日
	A種種類株式				

(2) 基準日が当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

2023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
2023年6月16日 定時株主総会	普通株式	利益 剰余金	11,040	276,000	2023年3月31日	2023年6月19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

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。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023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	29,184	29,184	-
(2) 投資有価証券 其他有価証券	1	1	-
資産計	29,186	29,186	-

(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37期（2022年3月31日現在）

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

第38期（2023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	33,770	-	-	-
(2) 金銭の信託	29,184	-	-	-
(3) 未収委託者報酬	16,279	-	-	-
(4) 未収運用受託報酬	3,307	-	-	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券(投資信託)	-	1	-	-
合計	82,540	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

第37期（2022年3月31日現在）

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	-	-	-	-
其他有価証券	-	-	-	-
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。

第38期（2023年3月31日現在）

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	-	29,184	-	29,184
(2) 投資有価証券	-	-	-	-
其他有価証券	-	1	-	1
資産計	-	29,186	-	29,186

（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。

投資有価証券

投資有価証券は市場における取引価格が存在しない投資信託であり、基準価額を時価としております。

（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37期 （2022年3月31日現在）	第38期 （2023年3月31日現在）
投資有価証券（其他有価証券）		
非上場株式	239	180
関係会社株式		
非上場株式	5,349	5,810

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（第37期の貸借対照表計上額5,349百万円、第38期の貸借対照表計上額5,810百万円）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 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 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。

第38期（2023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 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 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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

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

第38期（自 2022年4月1日 至 2023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	54	4	9

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、有価証券について584百万円（関係会社株式584百万円）減損処理を行っております。

(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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,479	2,576
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の発生額	14	31
退職給付の支払額	185	191
退職給付債務の期末残高	2,576	2,698

(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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
非積立型制度の退職給付債務	2,576	2,698
未積立退職給付債務	2,576	2,698
未認識数理計算上の差異	35	44
未認識過去勤務費用	33	0
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654
退職給付引当金	2,507	2,654
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,507	2,654

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(百万円)

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
勤務費用	295	279
利息費用	2	2
数理計算上の差異の費用処理額	34	22
過去勤務費用の費用処理額	69	34
その他	3	4
確定給付制度に係る退職給付費用	398	334

(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20百万円、当事業年度において24百万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37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023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% ~ 3.56%

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97百万円、当事業年度103百万円であります。

（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37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
	(百万円)	(百万円)
繰延税金資産		
未払事業税	156	121
未払事業所税	10	9
賞与引当金	592	529
未払法定福利費	92	94
運用受託報酬	845	390
資産除去債務	13	15
減価償却超過額（一括償却資産）	12	21
減価償却超過額	58	198
繰延資産償却超過額（税法上）	292	297
退職給付引当金	767	812
時効後支払損引当金	45	33
ゴルフ会員権評価損	7	7
関係会社株式評価損	166	345
投資有価証券評価損	28	4
その他	2	13
その他有価証券評価差額金	0	0
繰延税金資産合計	3,092	2,895
繰延税金負債		
繰延税金負債合計	-	-
繰延税金資産の純額	3,092	2,895

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

	第37期	第38期
	(2022年3月31日現在)	(2023年3月31日現在)
法定実効税率	-	30.62 %
（調整）		
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	3.69 %
その他	-	0.06 %
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	26.87 %

（注）前事業年度は、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が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(企業結合等関係)

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

1. 結合当事企業

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

2. 企業結合日

2016年10月1日

3. 企業結合の方法

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

4. 結合後企業の名称

アセットマネジメントOne株式会社

5. 企業結合の主な目的

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

6. 合併比率

「3. 企業結合の方法」の吸収合併における合併比率は以下の通りであります。

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

(*) 普通株式と種類株式を合算して算定しております。

7. 交付した株式数

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

8. 経済的持分比率(議決権比率)

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

MHFGが企業結合日に追加取得した当社に対する経済的持分比率 20.00%

MHFGの追加取得後の当社に対する経済的持分比率 70.00%

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

9. 取得企業を決定するに至った主な根拠

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

10. 会計処理

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

11. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合に関する事項

(1) 被取得企業の取得原価及びその内訳

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

(2) 発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

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

(3) 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

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

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

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

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

12. 被取得企業に対してパーチェス法を適用した場合の差額

(1) 貸借対照表項目

	第37期 (2022年3月31日現在)	第38期 (2023年3月31日現在)
流動資産	- 百万円	- 百万円
固定資産	76,763百万円	68,921百万円
資産合計	76,763百万円	68,921百万円
流動負債	- 百万円	- 百万円
固定負債	4,740百万円	3,643百万円
負債合計	4,740百万円	3,643百万円
純資産	72,022百万円	65,278百万円

(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	55,263百万円	51,451百万円
顧客関連資産	25,175百万円	20,947百万円

(2) 損益計算書項目

	第37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
営業収益	- 百万円	- 百万円
営業利益	8,429百万円	8,039百万円
経常利益	8,429百万円	8,039百万円
税引前当期純利益	8,429百万円	8,039百万円
当期純利益	7,015百万円	6,744百万円
1株当たり当期純利益	175,380円68銭	168,617円97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	4,618百万円	4,228百万円

（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

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）	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
委託者報酬	108,259百万円	95,739百万円
運用受託報酬	14,425百万円	14,651百万円
投資助言報酬	1,587百万円	2,048百万円
成功報酬（注）	2,594百万円	1,499百万円
その他営業収益	12百万円	23百万円
合計	126,879百万円	113,962百万円

（注）成功報酬は、前事業年度においては損益計算書の委託者報酬及び運用受託報酬、当事業年度においては損益計算書の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37期（自 2021年4月1日 至 2022年3月31日）及び第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（1）サービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

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

（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。

(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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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37期(自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)

該当はありません。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当はありません。

(3) 兄弟会社等

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。

第38期(自 2022年4月1日 至 2023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	7,474	未払 手数料	1,579
	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	13,932	未払 手数料	2,404

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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
1株当たり純資産額	1,939,327円79銭	1,975,862円96銭
1株当たり当期純利益金額	387,499円36銭	345,535円19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37期 (自 2021年4月1日 至 2022年3月31日)	第38期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
当期純利益金額	15,499百万円	13,821百万円
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	15,499百万円	13,821百万円
普通株式及び普通株式と同等の株式の期中平均株式数	40,000株	40,000株
(うち普通株式)	(24,490株)	(24,490株)
(うちA種種類株式)	(15,510株)	(15,510株)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の実行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
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958	日本において銀行業務を営んでおります。
auカブコム証券株式会社	7,196	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
株式会社SBI証券	48,323	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
楽天証券株式会社	(1) 17,495	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
東武証券株式会社(2)	420	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
SMB C日興証券株式会社	10,000	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
マネックス証券株式会社	12,200	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。
松井証券株式会社	11,945	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでおります。

(注) 資本金の額は2022年3月末日現在

(1) 2021年12月31日現在

(2) 「保守型」以外の取扱いはありません。

(3) 投資顧問会社

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

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、以下の業務を行います。

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

3【資本関係】

該当事項はありません。

持株比率5%以上を記載します。

第3【その他】

(1)目論見書の表紙等にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格を記載する場合があります。また、以下の内容を記載することがあります。

- ・金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
- ・委託会社の金融商品取引業者登録番号
- ・詳細情報の入手方法
委託会社のホームページアドレス、電話番号および受付時間など
請求目論見書の入手方法およびファンドの投資信託約款の全文が請求目論見書に掲載されている旨
- ・目論見書の使用開始日
- ・届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
- ・ファンドの内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
- ・投資信託の財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください」との趣旨を示す記載

(2)有価証券届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」に記載の内容について、投資家の理解を助けるため、その内容を説明した図表等を付加して目論見書のその内容に関する箇所に記載することがあります。また、第二部「ファンド情報」第1「ファンドの状況」5「運用状況」について、有価証券届出書提出後の随時入手可能な直近の情報および同情報についての表での表示に加えて、グラフで表示した情報を目論見書に記載することがあります。

(3)投資信託説明書（請求目論見書）に約款の全文を掲載します。

(4)目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

(5)目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。

(6)投信評価機関、投信評価会社などによる評価を取得・使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2023年5月25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

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2023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、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

利害関係

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

以上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月9日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（保守型）の2021年10月13日から2022年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（保守型）の2022年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月9日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（安定型）の2021年10月13日から2022年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（安定型）の2022年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月9日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）の2021年10月13日から2022年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）の2022年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月9日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（成長型）の2021年10月13日から2022年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（成長型）の2022年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) XBR Lデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2022年12月9日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（積極型）の2021年10月13日から2022年10月12日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（積極型）の2022年10月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年6月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（保守型）の2022年10月13日から2023年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（保守型）の2023年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年10月13日から2023年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年6月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（安定型）の2022年10月13日から2023年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（安定型）の2023年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年10月13日から2023年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年6月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）の2022年10月13日から2023年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）の2023年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年10月13日から2023年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年6月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（成長型）の2022年10月13日から2023年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（成長型）の2023年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年10月13日から2023年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2023年6月16日

アセットマネジメントOne株式会社

取締役会 御中

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているたわらノーロード 最適化バランス（積極型）の2022年10月13日から2023年4月12日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、たわらノーロード 最適化バランス（積極型）の2023年4月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年10月13日から2023年4月12日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。