

【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8月10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】	リスクコントロール世界資産分散ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

リスクコントロール世界資産分散ファンド

ただし、愛称として「マイスタート」という名称を用いる場合があります。

（以下「ファンド」または「当ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

契約型の追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口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。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

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

(5) 【申込手数料】

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%(税抜1.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(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。

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8月11日から2024年2月13日まで

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

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

(8) 【申込取扱場所】

当ファンドのお申込みにかかる取扱い等は販売会社が行います。

販売会社は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(9) 【払込期日】

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

(10) 【払込取扱場所】

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

払込取扱場所についてご不明な点は、以下の方法でご確認ください。

・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(11)【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権にかかる振替機関は以下の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

お申込みには、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

ただし、海外休業日にはお申込みの受付を行いません。

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

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

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

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】

当ファンドは、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

当ファンドの信託金限度額は、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 国内外の8資産に分散投資を行い、中長期的に安定的なリターンの獲得をめざします。

●主に国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券(リート)の8資産にマザーファンド*1を通じて投資します。*2*3

*1 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド

*2 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。

*3 有価証券指数等先物等、指数に連動する投資成果をめざす上場している投資信託証券(ETF)へ直接投資する場合があります。

また、DIAMマネーマザーファンドや短期金融資産等へ投資する場合があります。

2 基本資産配分によるポートフォリオの変動リスク*1を年率2%程度*2に抑えた安定的な運用をめざします。

●各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産の収益率のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度となるよう最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜、基本配分比率の見直しを行うことがあります。

●通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円での為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

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

*2 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれかを約束するものではありません。また、上記数値は長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。

3 基準価額の下落を一定水準(下値目安値*1)までに抑えることをめざします。

- 基本配分比率をもとに分散投資を行いつつ、基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率*2を機動的に変更します。

下値目安値は、過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

- *1 基準価額が下値目安値を下回らないことを委託会社が保証等するものではありません(相場急落の場合などには、基準価額が下値目安値を下回る場合があります。)
- *2 合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

4 年1回決算を行います。

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

運用プロセス

基本配分比率の決定

資産価格に影響を与える「変動要因」および各資産の「トレンド」を勘案し、基本配分比率を決定します。
基本配分比率は月次で見直します。
※基本配分比率の決定にあたっては、アセットマネジメントOne U.S.A.・インクの投資助言を活用します。



合計資産比率の機動的な変更

基準価額の下落を一定水準(下値目安値)までに抑えることを目標に機動的に合計資産比率を変更します。
下値目安値は毎営業日決定します。

リスクを抑えるための2つの運用手法により、安定的なリターンをめざします。



当ファンドでは、投資対象資産である国内外の8資産に対して、資産価格に影響を与える「変動要因」に着目した分散投資を行うことで、特定の要因で大きく基準価額が変動するリスクを回避し、変動を抑えて運用を行うことをめざします。

投資対象資産

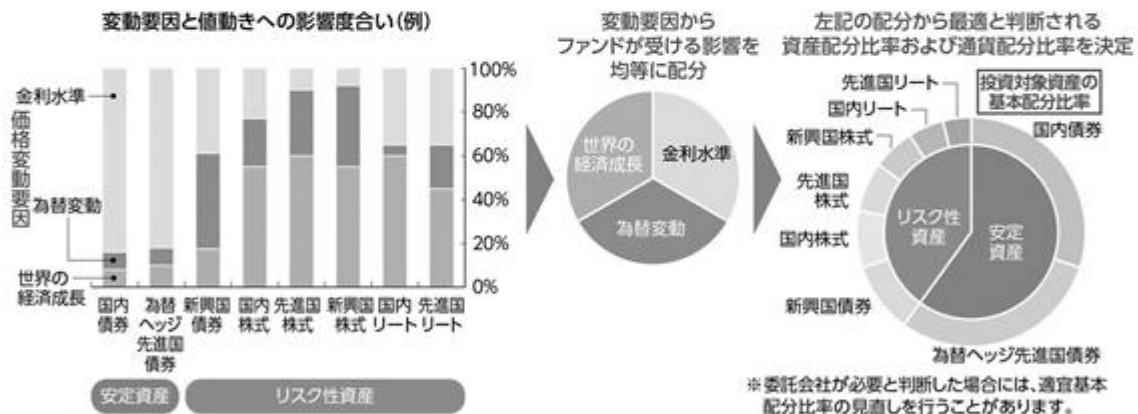
	安定資産			リスク性資産
	国内	先進国	新興国	
債券	国内債券	為替ヘッジ先進国債券	新興国債券	
株式	国内株式	先進国株式	新興国株式	
リート	国内リート	先進国リート		

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

当ファンドの基本配分比率決定のイメージ

資産価格に影響を与える変動要因を判定し、変動要因の偏りをなくすように資産配分比率および通貨配分比率を決定します。その後、各資産のトレンドを勘案した上で、基準価額の変動が小さくなるように最終的に基本配分比率を決定します。基本配分比率は、月次で決定し、原則月間を通じて維持します。

通貨配分比率の決定にあたっては、実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に対円で為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。



価格変動要因が変化した場合

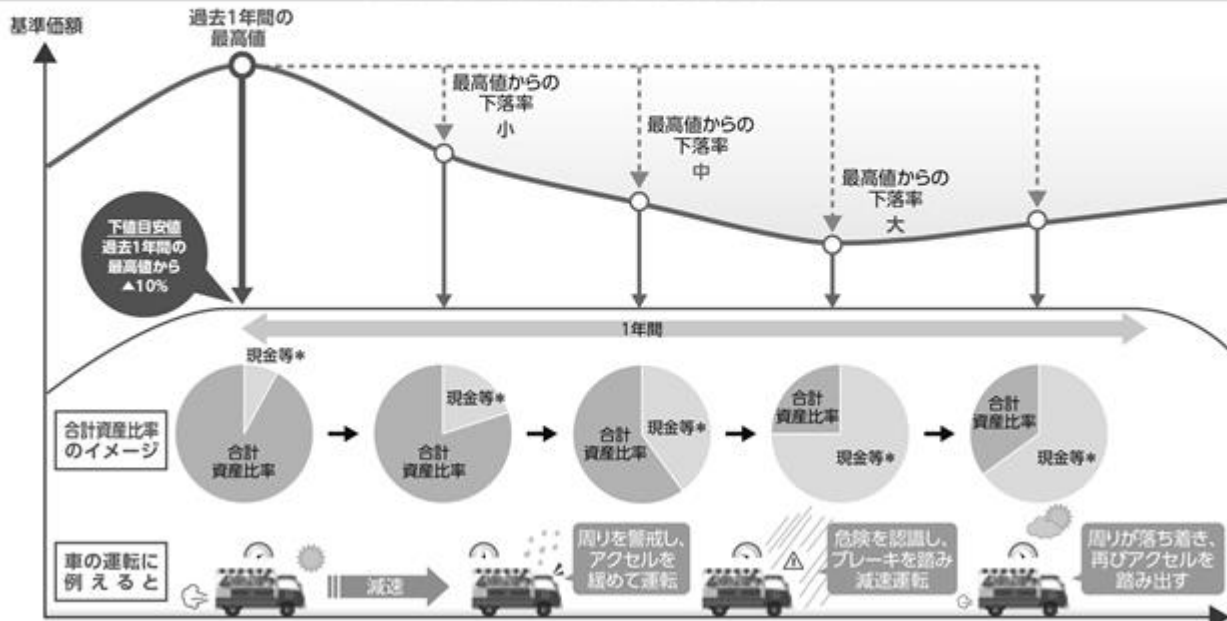


※上記はイメージ図であり、実際にはこれと異なる場合があります。また、変動要因のすべてを網羅したものではありません。



当ファンドでは、基準価額下落時や各資産の値動きが大きい時等には、現金等の比率を増やすことで基準価額の下落を一定水準（下値目安値）までに抑えることをめざします。

下値目安値と合計資産比率変更イメージ



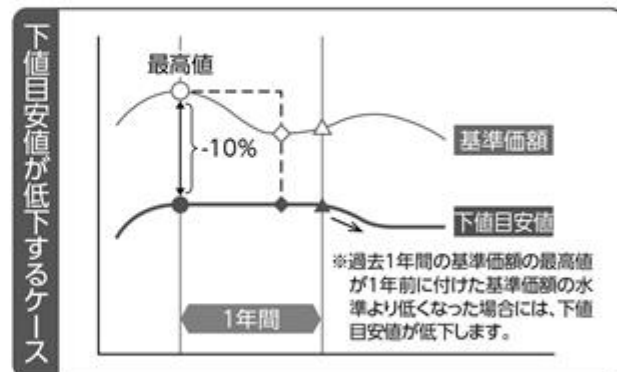
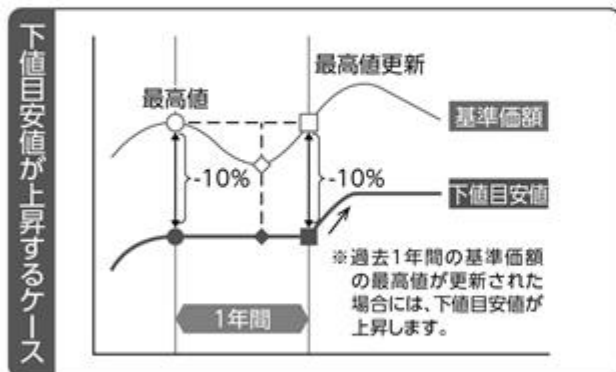
*現金等とは、短期国債およびコール・ローンなどの短期金融資産等をいい、当該資産への投資は、「DIAMマネーマザーファンド」を通じて、または直接投資を行います。

*合計資産比率とは、「DIAMマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびETF等への投資比率の合計をいいます。なお、合計資産比率の変更の際も、基本配分比率をもとに運用を行います。

下値目安値について

下値目安値は過去1年間の基準価額の最高値から-10%の水準となるよう毎営業日決定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

*設定後1年に満たない場合は、設定来の最高値をもとに下値目安値を決定します。



*下値目安値は、必ずしも上昇または低下するものではありません。基準価額の上昇局面でも基準価額が過去1年間の最高値を更新できない場合には、下値目安値は上昇せず同じ水準が継続します。基準価額の下落局面でも過去1年間の基準価額の最高値が維持されている場合には、下値目安値は低下せず同じ水準が継続します。

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

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

■ 分配方針

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

※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

< 商品分類 >

・ 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉となる資産)
単位型	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) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

・ 商品分類定義

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

< 属性区分 >

・属性区分表

投資対象資産 (実際の組入資産)	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (一部ヘッジ)
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)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア		
	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
不動産投信	その他 ()	アフリカ		
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))		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) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

・属性区分定義

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

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

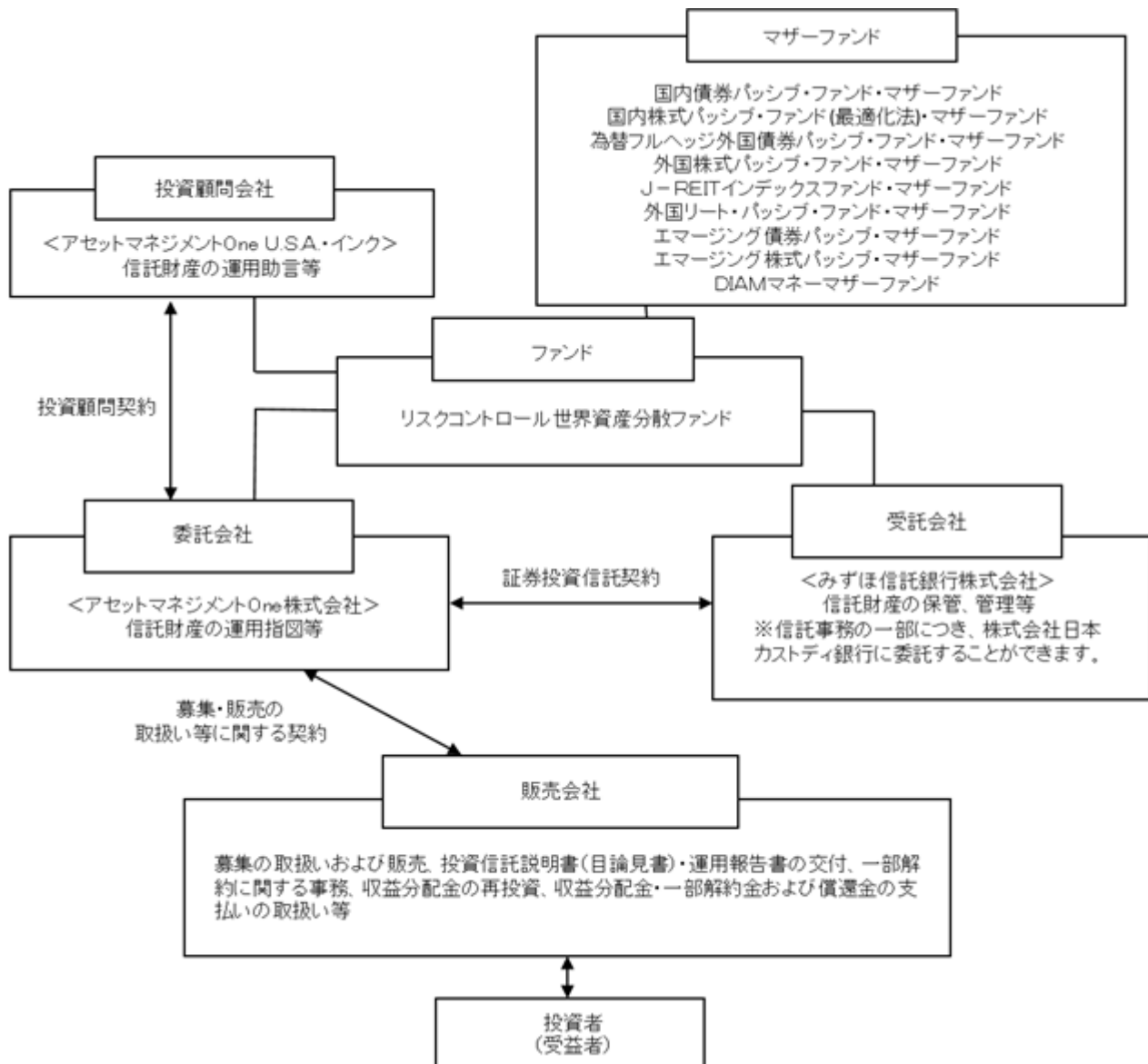
（注2）当ファンドが該当しない商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<https://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

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

（2）【ファンドの沿革】

2018年5月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



- ・「証券投資信託契約」の概要

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

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

- ・「募集・販売の取扱い等に関する契約」の概要

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

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

・「投資顧問契約」の概要

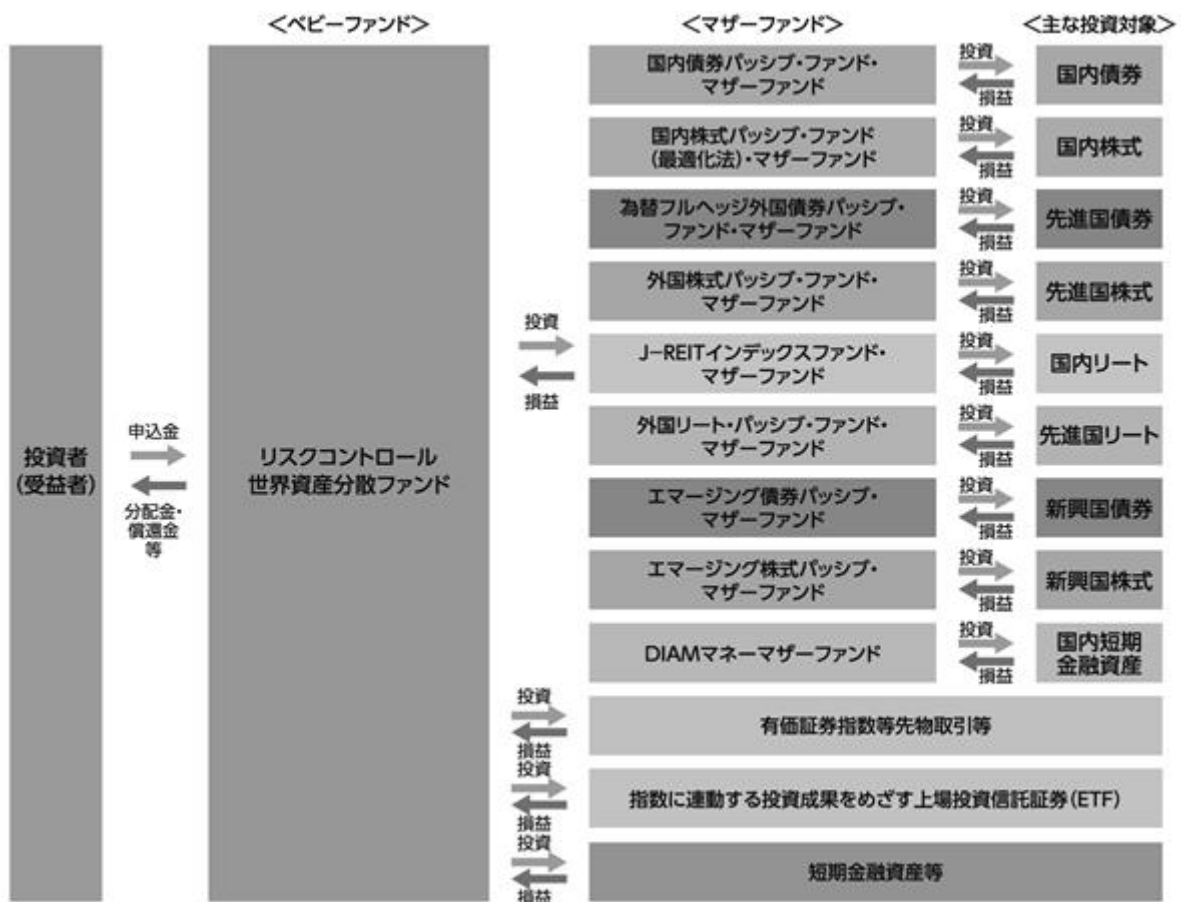
委託会社と投資顧問会社（アセットマネジメントOne U.S.A.・インク）との間においては、当ファンドの運用にかかる助言契約が締結されております。

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

ファミリーファンド方式とは

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用を行います。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、投資者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金の全部または一部をマザーファンド受益証券に投資して、その実質的な運用を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5月31日現在）

委託会社の沿革

1985年7月1日

会社設立

1998年3月31日

「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得

1998年12月1日	証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可
1999年10月1日	第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。
2008年1月1日	「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A M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	D I A M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株式会社に變更

大株主の状況

（2023年5月31日現在）

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

1：A種種類株式（15,510株）を含みます。

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

<基本方針>

この投資信託は、信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。

<投資対象>

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

<投資態度>

以下のマザーファンド受益証券、有価証券指数等先物取引、指数に連動する投資成果をめざす上場投資信託証券（E T F）等への投資を通じて、国内外の株式、債券、不動産投資信託証券（以下「各資産」ということがあります。）に実質的に分散投資を行います。

- ・国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド
- ・為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド
- ・外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド
- ・エマージング債券パッシブ・マザーファンド
- ・エマージング株式パッシブ・マザーファンド

（上記マザーファンドおよび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。）

上記のほか、D I A Mマネーマザーファンドや短期金融資産等に投資する場合があります。

一部のマザーファンドへの投資配分比率がゼロとなる場合があります。

各資産への基本配分比率は、統計的手法を用い、資産価格に影響を与える「変動要因」の偏りをなくすように資産配分比率、および通貨配分比率を決定します。その後各資産のトレンドを勘案し、ポートフォリオの変動リスクが2%程度¹となるよう最終的に基本配分比率を決定します²。基本配分比率は原則月次で見直しますが、経済環境、運用環境の大きな変化などにより委託会社が必要と判断した場合には、適宜見直しを行うことがあります。

- 1 上記数値は目標値であり、常にリスク水準が一定であること、あるいは目標値が達成されることのいずれを約束するものではありません。また、上記数値は基本資産配分に基づくポートフォリオの長期的なリスク水準の目標を表すものであり、年率2%程度の収益を目標とすることを意味するものではありません。上記数値が達成されるかどうかを問わず、実際の運用成績がマイナスとなる可能性があります。
- 2 実質組入外貨建資産は投資環境に応じて弾力的に為替ヘッジを行います。ただし、投資環境によっては、為替予約取引の売建を、実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があります。

基準価額の下落を一定水準（下値目安値^(*)）までに抑えることを目標に、基準価額の水準や市場環境等に応じて投資対象資産の合計資産比率^(**)を機動的に変更します。下値目安値は、毎営業日、委託会社の判断により過去1年間の基準価額の最高値から一定の水準に設定します。ただし、当該水準は委託会社の判断により今後変更する場合があります。

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

（**）合計資産比率とは、「D I A Mマネーマザーファンド」を除く8つのマザーファンドと有価証券指数等先物取引およびE T F等への投資比率の合計をいいます。

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24条、第25条および第26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債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド、為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド、J-REITインデックスファンド・マザーファンド、外国リート・パッシブ・ファンド・マザーファンド、エマージング債券パッシブ・マザーファンド、エマージング株式パッシブ・マザーファンド、DIAMマネーマザーファンド(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の各受益証券(以下総称して「マザーファンド受益証券」といいます。)を含む次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。 なお、社債券のうちで、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの、ならびに会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
8. 協同組織金融機関の優先出資に関する法律に規定する優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)

10. コマーシャル・ペーパー

11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1.～11.の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、15.で定めるものを除きます。）
 15. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 16. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
 18. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 20. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 21. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
 22. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 23. 外国の者に対する権利で22.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書、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）当ファンドが投資対象とするマザーファンドの概要

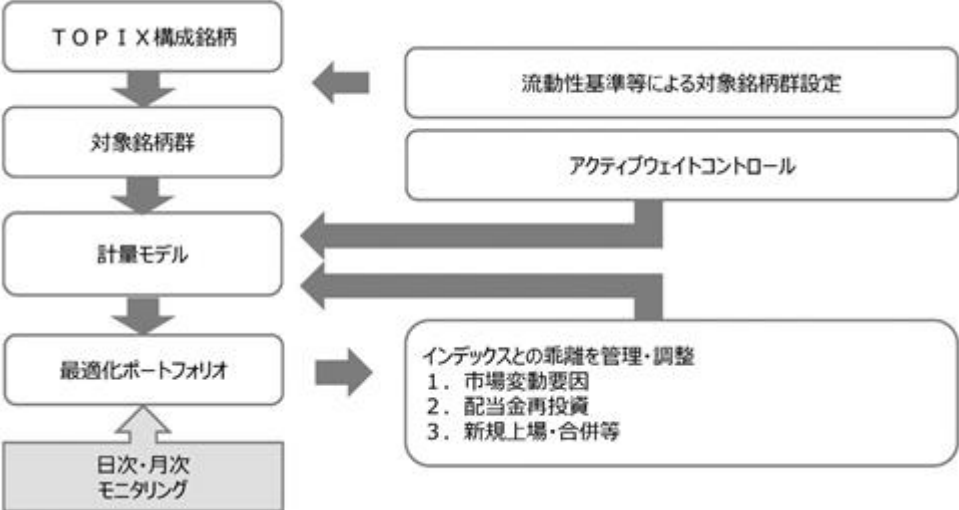
ファンド名	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<ol style="list-style-type: none">1.主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA - B P I 総合」 に連動する投資成果をめざして運用を行います。2.公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、市況動向・資金動向等により弾力的に変更を行う場合があります。3.公社債の組入比率の調整には、債券先物取引等を活用する場合があります。 <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 1) 債券種別・格付けから発生するベンチマーク乖離要因 2) 金利の期間構造、スプレッドの期間構造から発生するベンチマーク乖離要因 1)、2) が最小になると判断されるポートフォリオを構築します。</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、債券先物取引等を活用する場合があります。 インデックスとの乖離要因には以下のものがあります。 ・ 年限構成変化要因 ・ 指数構成銘柄変更 ・ リスク量の変更 ・ クーポン、償還再投資</p>
--------	---

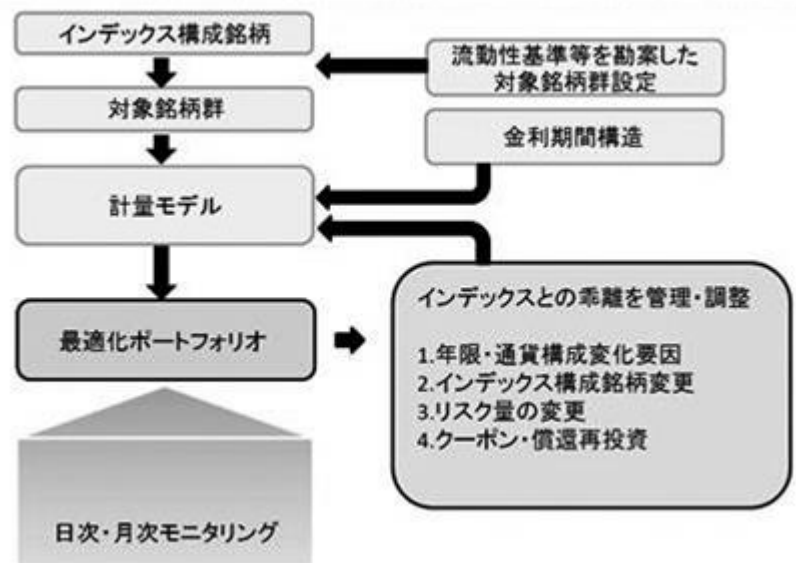
主な投資制限	<ol style="list-style-type: none"> 1. 株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 2. 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 3. 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 4. 同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 5. 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 6. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)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

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

投資態度	<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。 <div style="border: 1px solid black; padding: 10px; margin-top: 10px;"><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、言及をしないものとします。</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></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 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	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>
運用プロセス	<p>流動性基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日次・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] B --> C[計量モデル] C --> D[最適化ポートフォリオ] D --> E[日次・月次モニタリング] F[流動性基準等を勘案した 対象銘柄群設定] --> B G[金利期間構造] --> C H[インデックスとの乖離を管理・調整 1.年限・通貨構成変化要因 2.インデックス構成銘柄変更 3.リスク量の変更 4.クーポン・償還再投資] --> C H --> D </pre>

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

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

投資態度	<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限りなく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

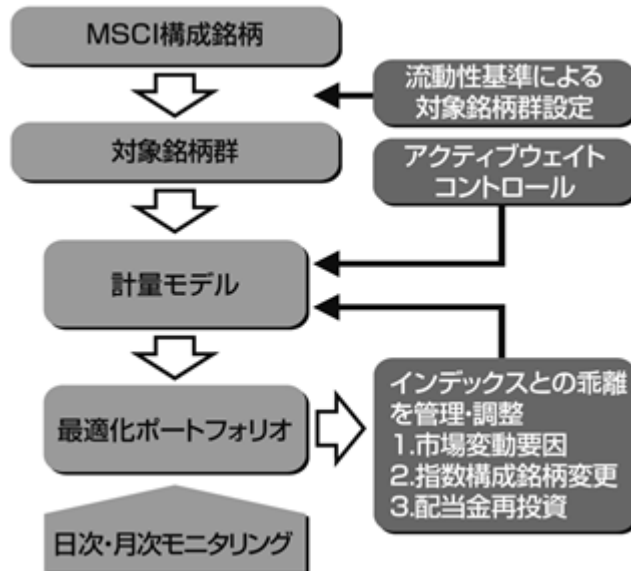
インデックスとポートフォリオにおける個別銘柄の構成比率との差(アクティブウェイト)を一定以内に抑えた上で、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。

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	J - R E I T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R E I T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R E I T指数に採用されている(または採用予定の)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。以下同じ。)を主要投資対象とします。

投資態度

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

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。

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。

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。

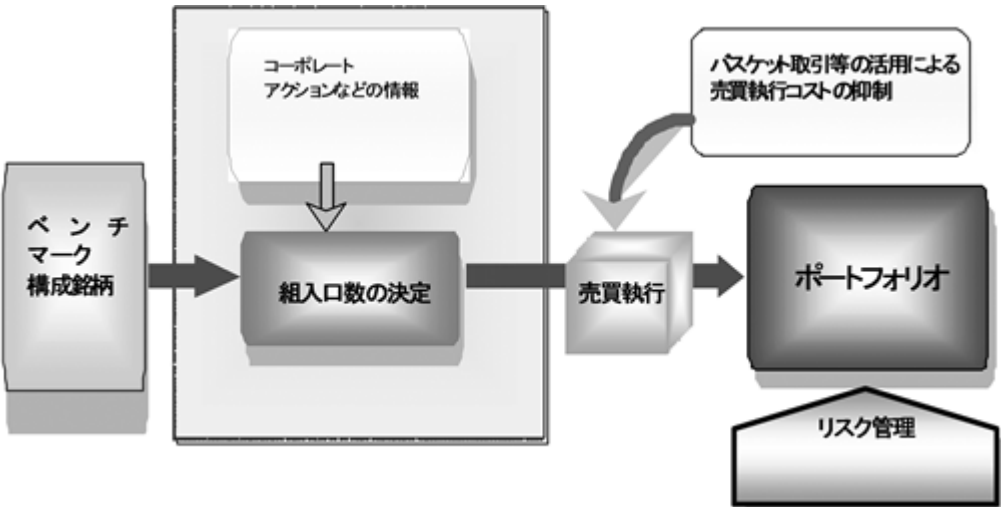
JPXは、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、JPXは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

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。

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。

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。

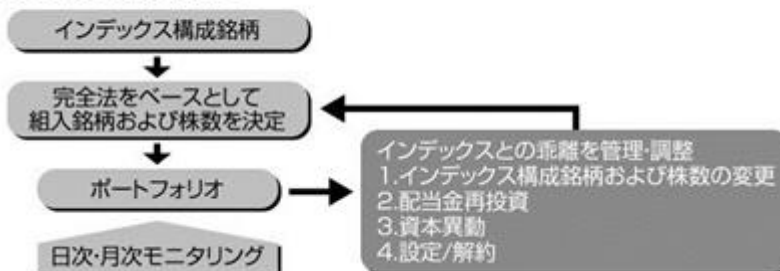
以上の項目に限らず、JPXは本件商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

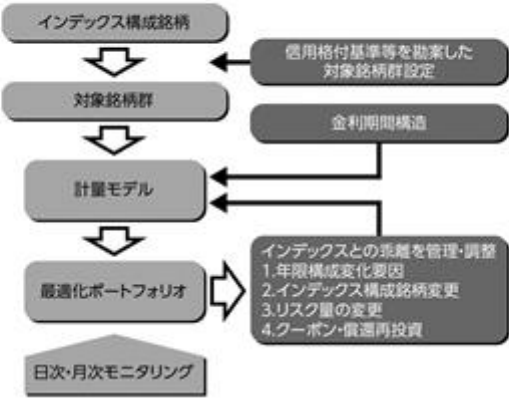
運用プロセス	<ul style="list-style-type: none"> ・原則としてベンチマーク構成全銘柄をその構成比率で保有します。ベンチマーク構成銘柄および採用予定銘柄を投資対象銘柄とします。 ・新規上場、公募増資、第三者割当等ベンチマーク構成の変更情報を事前に取得し、最適な執行方法によりリバランスを実施します。 ・配当金入金等によりキャッシュ比率が上昇した場合にもリバランスを実施します。 
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%を超えないものとします。ただし、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。</p> <p>株式への投資は行いません。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>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>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	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まず。)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

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

ファンド名	エマージング債券パッシブ・マザーファンド
基本方針	この投資信託は、主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	<p>1.主として新興国の債券に投資し、JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース・為替ヘッジなし）の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</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Moody'sの外貨建て長期格付がBB-格もしくはBa3格以上を取得している債券とします。但し、両社が格付を付与している場合には、どちらか低い方の格付を基準とします。また、当ファンドが保有する債券の格付が上記基準未満となった場合は、当該債券を速やかに売却するものとします。</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>JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。</p> </div>
運用プロセス	<p>信用格付基準等を勘案した投資対象銘柄群を設定し、計量モデルを用い、インデックスとの乖離を抑えます。日々・月次レベルでインデックスとの乖離を管理し、必要な場合には速やかに銘柄入替や組入比率の調整を行います。</p>  <pre> graph TD A[インデックス構成銘柄] --> B[対象銘柄群] C[信用格付基準等を勘案した対象銘柄群設定] --> B B --> D[計量モデル] E[金利期間構造] --> D D --> F[最適化ポートフォリオ] F --> G[インデックスとの乖離を管理・調整 1. 年次構成変化要因 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] G --> H[日々・月次モニタリング] </pre>

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

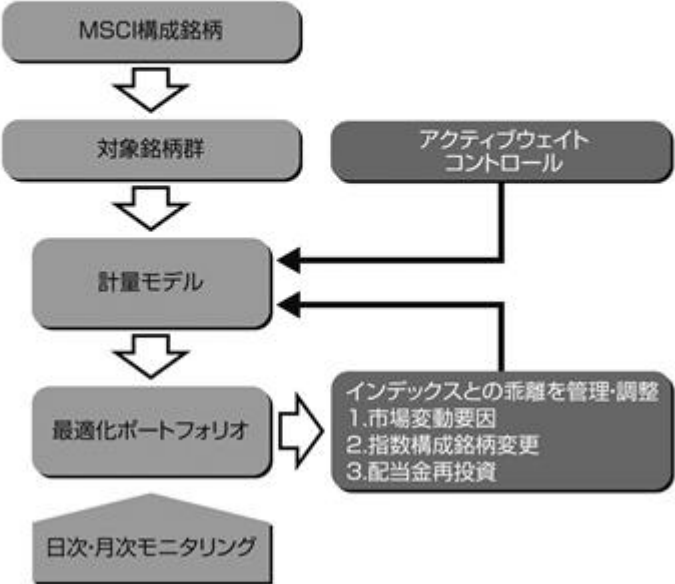
ファンド名	エマージング株式パッシブ・マザーファンド
基本方針	<p>この投資信託は、主として海外の証券取引所に上場している株式^(*)に投資し、MSCIEマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし)の動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行います。</p> <p>(*)DR(預託証券)もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</p>
主な投資対象	海外の証券取引所に上場している株式を主要投資対象とします。

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

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

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

投資態度	<p>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>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>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	<p>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)。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合は、純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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>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>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>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>外貨建て資産への投資は行いません。</p> <p>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>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。

定期的に関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5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

上記体制は、マザーファンドを通じた実質的な運用体制を記載しております。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

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

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

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る。

(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】

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

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)

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

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

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

スワップ取引の運用指図(約款第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、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26条)

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

産の時価総額の合計額」といいます。以下5)において同じ。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、ヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

デリバティブ取引等にかかる投資制限(約款第27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、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30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31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32条）

- 1) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、または為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- 2) 上記1)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額と、信託財産にかかる為替の売予約とマザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額との合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 3) 上記2)においてマザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の買予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる為替の売予約の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 4) 上記2)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

資金の借入れ（約款第38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 >

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

また、投資信託は預貯金と異なります。

資産配分リスク

資産配分比率が高い資産の価値が下落した場合や、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。当ファンドは、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。

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

株価変動リスク

投資する企業の株価の下落は、基準価額の下落要因となります。

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

金利変動リスク

金利の上昇は、基準価額の下落要因となる可能性があります。

金利の変動は、公社債等の価格に影響をおよぼします。金利変動は、公社債・株式・リート等の各資産への投資の相対的魅力度を変化させるため、金利変動により各資産の市場の間で資金移動が起こる場合があります。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。当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。当ファンドは実質組入外貨建資産について、弾力的に対円での為替ヘッジを行います。

為替ヘッジを行わない資産については、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、当ファンドは投資環境によっては、為替予約取引の売建を実質組入外貨建資産の額を超えて行う場合があるため、為替相場の影響を受けます。なお、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、その金利差相当程度のコストがかかることにご留意ください。

信用リスク

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

有価証券等の価格は、その発行体に債務不履行等が発生または予想される場合には、その影響を受け変動します。

当ファンドが実質的に投資する株式・債券の発行者が経営不安・倒産に陥った場合、当ファンドが実質的に投資するリートが収益性の悪化や資金繰り悪化等により清算される場合、またこうした状況に陥ると予想される場合等には、投資した資産の価格が下落したりその価値がなくなることがあり、基準価額が下落する要因となります。

流動性リスク

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

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

カントリーリスク

投資する国・地域の政治・経済の不安定化等は、基準価額の下落要因となります。

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

<その他の留意点>

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

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

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

収益分配金に関する留意点として、以下の事項にご留意ください。

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

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

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

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

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

当ファンドは過去1年間の基準価額の最高値をもとに下値目安値を毎営業日決定し、合計資産比率を調整します。そのため、基準価額は、長期的に10%以上下落する場合があります。また、相場急変時等においては、基準価額が下値目安値を下回る場合もあります。したがって、損失が常に一定範囲に限定されるわけではないことにご留意ください。

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

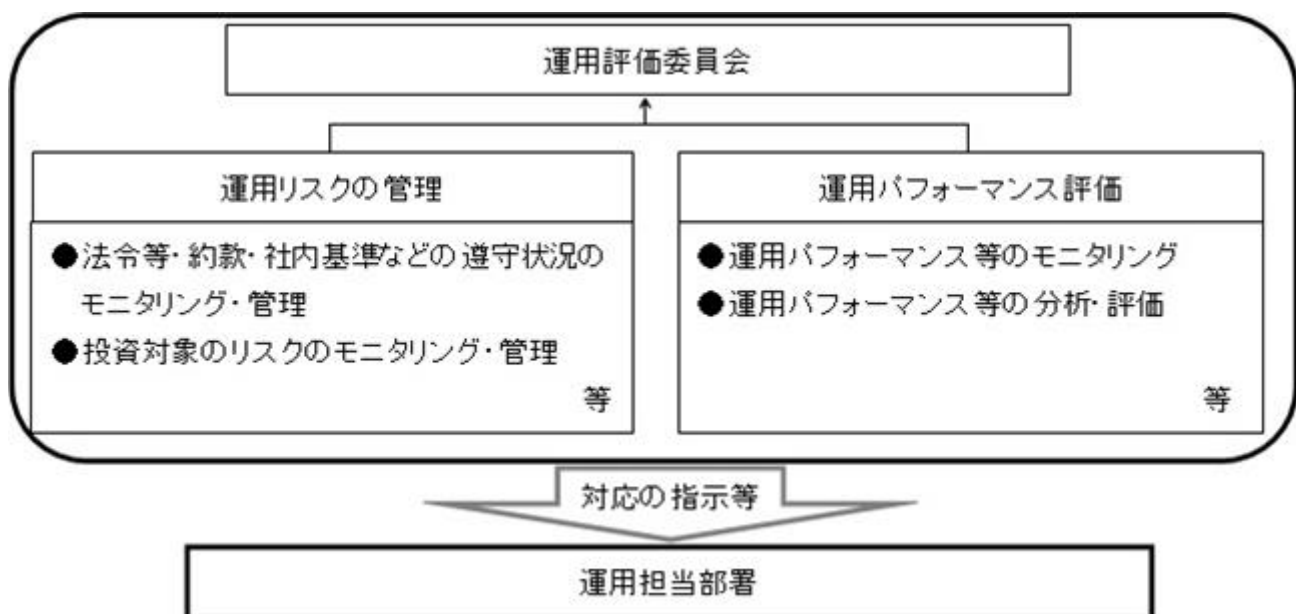
注意事項

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

<リスク管理体制>

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

- ・運用リスクの管理：運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。
- ・運用パフォーマンス評価：運用担当部署から独立したリスク管理担当部署が、ファンドの運用パフォーマンスについて定期的に分析を行い、結果の評価を行います。
- ・運用評価委員会：上記のとおり運用リスクの管理状況、運用パフォーマンス評価等の報告を受け、運用評価委員会は総合的な見地から運用状況全般の管理・評価を行います。

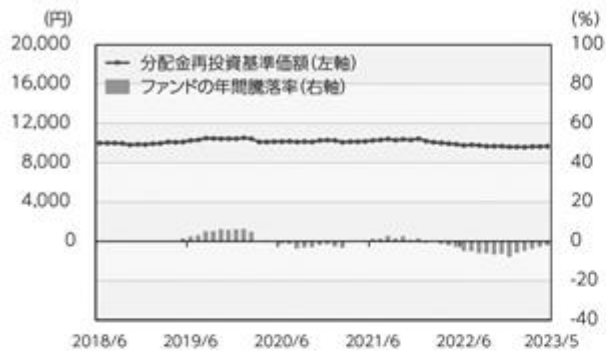


- ・流動性リスク管理：委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。運用評価委員会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

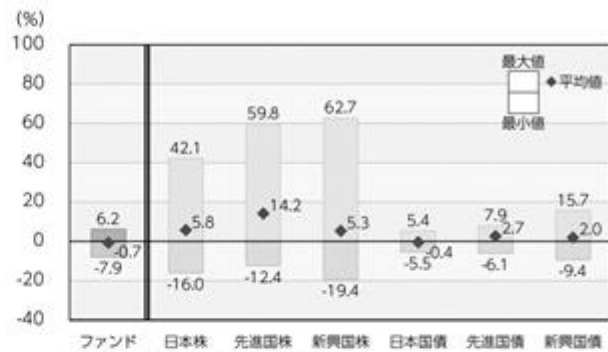
リスク管理体制は2023年5月31日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<参考情報>

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



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5月~2023年5月

代表的な資産クラス:2018年6月~2023年5月

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

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

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

*すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

(注) 海外の指数は為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

お申込時に、お申込日の翌営業日の基準価額に1.1%(税抜1.0%)を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

(2)【換金(解約)手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

ファンドの日々の純資産総額に対して年率1.089%(税抜0.99%)

支払先	内訳(税抜)	主な役務
委託会社	年率0.48%	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0.48%	購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	年率0.03%	運用財産の保管・管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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

委託会社の信託報酬には、当ファンドの投資顧問会社(アセットマネジメントOne U.S.A.・インク)に対する投資顧問報酬(当ファンドの信託財産の純資産総額に対して年率0.216%)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、間接的に当ファンドで負担することになります。

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

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

税法が改正された場合等は、上記内容が変更になることがあります。

(5) 【課税上の取扱い】

当ファンドは、課税上「株式投資信託」として取扱われます。

個人の受益者に対する課税

収益分配時

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

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

解約時および償還時

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

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

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

損益通算について

解約(換金)時および償還時の差損(譲渡損)については、確定申告を行うことにより上場株式等(上場株式、上場投資信託(ETF)、上場不動産投資信託(REIT)、公募株式投資信託および特定公社債等(公募公社債投資信託を含みます。))など。以下同じ。)の譲渡益ならびに上場

株式等の配当所得および利子所得の金額(配当所得については申告分離課税を選択したものに限り、)との損益通算ならびに3年間の繰越控除の対象とすることができます。また、特定口座(源泉徴収口座)をご利用の場合、その口座内において損益通算を行います(確定申告不要)。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

<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。

法人の受益者に対する課税

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

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

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

上記は、2023年5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。

…(参考情報)ファンドの総経費率…

総経費率(①+②)	運用管理費用の比率①	その他費用の比率②
1.11%	1.09%	0.02%

※対象期間:2021年11月12日~2022年11月11日

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税は含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)です。

※総経費率には、ファンドにより購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税以外にも計算に含まれない費用が存在する場合があります。

※なお、当ファンドについては、入手し得る情報において計算に含まれていない費用はありません。

※費用の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	54,718,388,349	93.66
内 日本	54,718,388,349	93.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	3,702,720,546	6.34
純資産総額	58,421,108,895	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	506,060,076,750	84.99
内 日本	506,060,076,750	84.99
地方債証券	32,084,570,028	5.39
内 日本	32,084,570,028	5.39
特殊債券	30,070,195,149	5.05
内 日本	30,070,195,149	5.05
社債券	25,598,713,800	4.30
内 日本	25,004,138,800	4.20
内 フランス	594,575,000	0.10
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	1,644,081,868	0.28
純資産総額	595,457,637,595	100.00

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	422,732,527,860	97.27
内 日本	422,732,527,860	97.27
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	11,866,090,400	2.73
純資産総額	434,598,618,260	100.00

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	12,054,420,000	2.77
内 日本	12,054,420,000	2.77

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

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

国債証券		215,803,612,978	101.08
内 アメリカ		107,399,667,751	50.31
内 フランス		18,068,590,831	8.46
内 イタリア		16,480,119,774	7.72
内 ドイツ		14,088,651,502	6.60
内 中国		11,100,515,705	5.20
内 スペイン		11,035,901,069	5.17
内 イギリス		10,013,630,743	4.69
内 カナダ		4,397,245,738	2.06
内 ベルギー		4,065,580,733	1.90
内 オランダ		3,377,181,833	1.58
内 オーストラリア		3,344,870,127	1.57
内 オーストリア		2,693,517,979	1.26
内 メキシコ		2,010,876,132	0.94
内 アイルランド		1,269,035,020	0.59
内 マレーシア		1,093,227,717	0.51
内 フィンランド		1,061,919,499	0.50
内 ポーランド		957,998,303	0.45
内 シンガポール		921,380,770	0.43
内 デンマーク		639,467,252	0.30
内 イスラエル		575,333,766	0.27
内 ニュージーランド		482,046,909	0.23
内 スウェーデン		409,214,353	0.19
内 ノルウェー		317,639,472	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,314,527,032	1.08
純資産総額		213,489,085,946	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5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	937,377,321,315	95.96
内 アメリカ	660,361,870,876	67.60
内 イギリス	40,236,049,809	4.12
内 カナダ	33,268,393,651	3.41
内 フランス	32,451,102,785	3.32
内 スイス	32,373,881,219	3.31
内 ドイツ	24,266,000,980	2.48
内 オーストラリア	19,469,430,630	1.99
内 オランダ	18,738,070,120	1.92
内 アイルランド	17,718,322,455	1.81
内 デンマーク	8,868,326,913	0.91
内 スウェーデン	8,682,413,822	0.89
内 スペイン	7,468,811,606	0.76
内 香港	5,501,234,082	0.56
内 イタリア	5,222,536,704	0.53
内 ジャージー	3,302,265,109	0.34
内 フィンランド	3,257,394,655	0.33
内 シンガポール	3,098,112,933	0.32

内	ベルギー	2,156,308,946	0.22
内	イスラエル	1,817,269,758	0.19
内	ノルウェー	1,774,758,998	0.18
内	ケイマン諸島	1,645,078,437	0.17
内	バミューダ	1,471,937,905	0.15
内	オランダ領キュラソー	1,195,574,166	0.12
内	ニュージーランド	801,389,966	0.08
内	ルクセンブルグ	510,094,246	0.05
内	オーストリア	508,304,350	0.05
内	ポルトガル	467,123,730	0.05
内	リベリア	357,100,690	0.04
内	パナマ	210,419,762	0.02
内	マン島	177,742,012	0.02
投資信託受益証券		1,550,867,875	0.16
内	オーストラリア	1,114,910,402	0.11
内	シンガポール	435,957,473	0.04
投資証券		18,093,371,943	1.85
内	アメリカ	16,875,437,820	1.73
内	イギリス	434,390,452	0.04
内	フランス	336,075,236	0.03
内	香港	294,932,785	0.03
内	ベルギー	79,376,255	0.01
内	カナダ	73,159,395	0.01
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		19,791,014,703	2.03
純資産総額		976,812,575,836	100.00

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
株価指数先物取引（買建）	19,853,189,380	2.03	
内			
内	アメリカ	14,522,068,057	1.49
内	ドイツ	3,331,660,706	0.34
内	イギリス	888,948,893	0.09
内	カナダ	683,061,019	0.07
内	オーストラリア	427,450,705	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）	
投資証券	202,271,064,900	97.88	
内	日本	202,271,064,900	97.88
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,383,714,889	2.12	
純資産総額	206,654,779,789	100.00	

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

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

不動産投信指数先物取引(買建)	4,394,728,500	2.13
内 日本	4,394,728,500	2.13

(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5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	128,071,522,042	97.86
内 サウジアラビア	13,722,346,547	10.49
内 メキシコ	12,004,277,852	9.17
内 アラブ首長国連邦	10,870,984,233	8.31
内 カタール	10,166,613,919	7.77
内 チリ	8,384,468,363	6.41
内 ブラジル	8,121,229,598	6.21
内 コロンビア	7,887,389,665	6.03
内 ドミニカ共和国	7,707,264,945	5.89
内 パナマ	6,662,650,899	5.09
内 ハンガリー	6,316,776,486	4.83
内 インドネシア	5,812,845,857	4.44
内 ポーランド	5,570,178,332	4.26
内 ベルギー	5,198,767,684	3.97
内 南アフリカ	5,193,115,240	3.97
内 オマーン	4,907,675,382	3.75
内 フィリピン	3,733,661,556	2.85
内 ルーマニア	3,122,784,388	2.39
内 ウルグアイ	1,812,710,990	1.39
内 中国	875,780,106	0.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,797,391,080	2.14
純資産総額	130,868,913,122	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5月31日現在

資産の種類	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	85,231,532,902	93.83
内 ケイマン諸島	13,706,812,743	15.09
内 台湾	13,531,406,765	14.90
内 インド	12,258,030,967	13.49
内 韓国	11,014,826,301	12.13
内 中国	10,308,838,370	11.35
内 ブラジル	4,282,092,805	4.71
内 サウジアラビア	3,555,261,727	3.91
内 南アフリカ	2,552,231,147	2.81
内 メキシコ	1,809,354,835	1.99
内 タイ	1,754,404,123	1.93
内 インドネシア	1,722,444,630	1.90
内 マレーシア	1,195,547,253	1.32

内 アラブ首長国連邦	1,122,556,466	1.24
内 香港	907,712,593	1.00
内 カタール	792,222,612	0.87
内 クエート	723,785,880	0.80
内 ポーランド	622,332,647	0.69
内 フィリピン	598,759,235	0.66
内 トルコ	508,956,099	0.56
内 チリ	470,144,558	0.52
内 アメリカ	389,879,983	0.43
内 バミューダ	380,287,178	0.42
内 ギリシャ	378,619,423	0.42
内 ハンガリー	194,752,523	0.21
内 チェコ	141,085,613	0.16
内 コロンビア	82,281,949	0.09
内 ルクセンブルグ	75,675,459	0.08
内 オランダ	55,361,438	0.06
内 エジプト	54,503,214	0.06
内 シンガポール	24,672,006	0.03
内 ペルー	16,692,360	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	645,408,639	0.71
内 メキシコ	467,075,456	0.51
内 ブラジル	178,333,183	0.20
投資証券	85,319,685	0.09
内 メキシコ	58,710,074	0.06
内 南アフリカ	26,609,611	0.03
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	4,872,468,600	5.36
純資産総額	90,834,729,826	100.00

その他資産の投資状況

2023年5月31日現在

資産の種類	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引（買建）	4,993,590,744	5.50
内 アメリカ	4,993,590,744	5.50

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

（2）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

2023年5月31日現在

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

1	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	15,307,314,951	1.2070 18,476,427,445	1.1923 18,250,911,616	- -	31.24
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	13,919,729,467	1.2499 17,398,946,039	1.2668 17,633,513,288	- -	30.18
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	1,484,643,474	3.4107 5,063,674,526	3.6715 5,450,868,514	- -	9.33
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	695,249,413	6.1525 4,277,552,577	6.6369 4,614,300,829	- -	7.90
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	2,007,132,739	1.9904 3,995,159,006	2.0908 4,196,513,130	- -	7.18
6	エマージング株式パッシ ブ・マザーファンド 日本	親投資 信託受 益証券	2,564,457,161	1.3883 3,560,250,012	1.4340 3,677,431,568	- -	6.29
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	376,810,428	2.2979 865,901,234	2.3748 894,849,404	- -	1.53

(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5月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	93.66
合計	93.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	335回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	9,410,000,000	100.82 9,487,981,000	100.79 9,484,339,000	0.5 2024/9/20	1.59
2	137回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証 券	6,680,000,000	111.47 7,446,852,000	111.84 7,471,179,200	1.7 2032/6/20	1.25
3	341回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証 券	6,620,000,000	100.90 6,680,216,000	100.92 6,680,904,000	0.3 2025/12/20	1.12

4	339回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,480,000,000	100.99 6,544,740,000	100.96 6,542,532,000	0.4 2025/6/20	1.10
5	153回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	6,510,000,000	99.67 6,488,798,000	100.00 6,510,000,000	0.005 2027/6/20	1.09
6	338回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	6,230,000,000	100.90 6,286,098,000	100.85 6,283,328,800	0.4 2025/3/20	1.06
7	347回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,930,000,000	100.04 5,932,957,000	100.38 5,952,771,200	0.1 2027/6/20	1.00
8	361回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,920,000,000	97.99 5,801,232,000	98.70 5,843,336,000	0.1 2030/12/20	0.98
9	150回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,720,000,000	99.91 5,715,320,000	100.10 5,726,063,200	0.005 2026/12/20	0.96
10	350回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,560,000,000	99.60 5,537,945,000	100.11 5,566,616,400	0.1 2028/3/20	0.93
11	360回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,600,000,000	98.48 5,515,256,000	98.92 5,539,744,000	0.1 2030/9/20	0.93
12	146回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	100.34 5,518,995,000	100.40 5,522,495,000	0.1 2025/12/20	0.93
13	154回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,500,000,000	99.94 5,497,175,000	100.32 5,517,710,000	0.1 2027/9/20	0.93
14	365回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,630,000,000	97.21 5,473,457,000	97.96 5,515,373,200	0.1 2031/12/20	0.93
15	363回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,570,000,000	97.49 5,430,605,000	98.31 5,475,922,700	0.1 2031/6/20	0.92
16	358回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,350,000,000	98.74 5,282,647,000	99.32 5,314,101,500	0.1 2030/3/20	0.89
17	344回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,270,000,000	100.32 5,286,921,000	100.46 5,294,400,100	0.1 2026/9/20	0.89
18	354回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,200,000,000	99.28 5,162,979,000	99.79 5,189,496,000	0.1 2029/3/20	0.87
19	364回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	5,250,000,000	97.26 5,106,334,000	98.10 5,150,302,500	0.1 2031/9/20	0.86
20	149回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	5,010,000,000	100.06 5,013,073,000	100.14 5,017,414,800	0.005 2026/9/20	0.84

21	349回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,950,000,000	99.80 4,940,452,000	100.22 4,961,236,500	0.1 2027/12/20	0.83
22	366回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,980,000,000	98.17 4,889,030,000	98.67 4,914,114,600	0.2 2032/3/20	0.83
23	353回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,910,000,000	99.73 4,896,830,000	99.88 4,904,549,900	0.1 2028/12/20	0.82
24	138回 利付国庫債券 (20年) 日本	国債証券	4,420,000,000	109.92 4,858,750,000	110.09 4,865,978,000	1.5 2032/6/20	0.82
25	352回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,860,000,000	99.43 4,832,304,000	99.94 4,857,424,200	0.1 2028/9/20	0.82
26	359回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,870,000,000	98.40 4,792,236,000	99.13 4,827,728,400	0.1 2030/6/20	0.81
27	345回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,740,000,000	100.16 4,747,609,000	100.44 4,761,045,600	0.1 2026/12/20	0.80
28	351回 利付国庫債券 (10年) 日本	国債証券	4,680,000,000	99.52 4,657,573,000	100.02 4,681,170,000	0.1 2028/6/20	0.79
29	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	100.34 4,545,809,700	0.1 2025/6/20	0.76
30	151回 利付国庫債券 (5年) 日本	国債証券	4,500,000,000	99.90 4,495,850,000	100.05 4,502,565,000	0.005 2027/3/20	0.76

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	84.99
地方債証券	5.39
特殊債券	5.05
社債券	4.30
合計	99.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

2023年5月31日現在

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

1	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	7,617,700	1,894.35 14,430,615,371	1,908.50 14,538,380,450	- -	3.35
2	ソニーグループ 日本	株式 電気機器	981,400	12,034.32 11,810,488,319	13,160.00 12,915,224,000	- -	2.97
3	キーエンス 日本	株式 電気機器	138,800	61,137.19 8,485,842,259	67,800.00 9,410,640,000	- -	2.17
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ 日本	株式 銀行業	8,557,100	932.20 7,977,013,147	932.50 7,979,495,750	- -	1.84
5	日本電信電話 日本	株式 情報・通信業	1,782,900	3,868.89 6,897,859,721	3,955.00 7,051,369,500	- -	1.62
6	東京エレクトロン 日本	株式 電気機器	293,600	15,598.10 4,579,603,351	19,315.00 5,670,884,000	- -	1.30
7	三井住友フィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	998,500	5,622.33 5,613,899,415	5,678.00 5,669,483,000	- -	1.30
8	第一三共 日本	株式 医薬品	1,212,100	4,128.06 5,003,633,205	4,540.00 5,502,934,000	- -	1.27
9	日立製作所 日本	株式 電気機器	681,300	7,049.43 4,802,779,462	8,046.00 5,481,739,800	- -	1.26
10	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	1,231,400	4,197.10 5,168,316,907	4,421.00 5,444,019,400	- -	1.25
11	HOYA 日本	株式 精密機器	296,300	14,240.05 4,219,327,087	17,565.00 5,204,509,500	- -	1.20
12	任天堂 日本	株式 その他製品	875,900	5,594.72 4,900,417,000	5,936.00 5,199,342,400	- -	1.20
13	三菱商事 日本	株式 卸売業	907,900	4,614.21 4,189,244,994	5,586.00 5,071,529,400	- -	1.17
14	信越化学工業 日本	株式 化学	1,155,100	3,871.11 4,471,523,848	4,297.00 4,963,464,700	- -	1.14
15	KDDI 日本	株式 情報・通信業	1,075,200	3,977.72 4,276,850,788	4,291.00 4,613,683,200	- -	1.06
16	三井物産 日本	株式 卸売業	1,041,800	3,927.13 4,091,284,361	4,404.00 4,588,087,200	- -	1.06
17	リクルートホールディングス 日本	株式 サービス業	1,055,900	4,270.68 4,509,413,977	4,290.00 4,529,811,000	- -	1.04
18	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	1,127,700	3,293.88 3,714,514,601	4,005.00 4,516,438,500	- -	1.04
19	ダイキン工業 日本	株式 機械	167,200	22,984.52 3,843,012,750	26,560.00 4,440,832,000	- -	1.02
20	伊藤忠商事 日本	株式 卸売業	904,400	4,077.14 3,687,373,117	4,721.00 4,269,672,400	- -	0.98
21	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	1,350,600	2,718.84 3,672,075,040	3,144.00 4,246,286,400	- -	0.98

22	みずほフィナンシャルグループ 日本	株式 銀行業	1,976,100	2,066.62 4,083,856,338	2,053.00 4,056,933,300	- -	0.93
23	オリエンタルランド 日本	株式 サービス業	754,700	4,341.62 3,276,623,142	5,227.00 3,944,816,900	- -	0.91
24	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	686,400	6,161.17 4,229,031,740	5,475.00 3,758,040,000	- -	0.86
25	村田製作所 日本	株式 電気機器	420,800	7,720.02 3,248,585,164	8,199.00 3,450,139,200	- -	0.79
26	S M C 日本	株式 機械	45,400	67,968.26 3,085,759,188	75,080.00 3,408,632,000	- -	0.78
27	ソフトバンク 日本	株式 情報・通信業	2,235,300	1,529.28 3,418,403,130	1,485.50 3,320,538,150	- -	0.76
28	ファナック 日本	株式 電気機器	680,800	4,622.44 3,146,963,442	4,798.00 3,266,478,400	- -	0.75
29	セブン&アイ・ホールディングス 日本	株式 小売業	505,900	5,948.64 3,009,417,217	5,845.00 2,956,985,500	- -	0.68
30	アステラス製薬 日本	株式 医薬品	1,314,400	1,914.61 2,516,575,130	2,207.50 2,901,538,000	- -	0.67

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	97.27
合計	97.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

2023年5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
電気機器	国内	18.21
情報・通信業		8.09
輸送用機器		7.17
卸売業		6.11
化学		5.92
銀行業		5.85
医薬品		5.34
機械		5.33
サービス業		4.83
小売業		4.30
食料品		3.45
陸運業		2.94
精密機器		2.62
その他製品		2.29
保険業		2.21
建設業		1.96

不動産業	1.79
電気・ガス業	1.25
その他金融業	1.08
鉄鋼	0.81
ゴム製品	0.75
ガラス・土石製品	0.66
証券、商品先物取引業	0.66
非鉄金属	0.64
海運業	0.53
金属製品	0.51
空運業	0.48
繊維製品	0.42
石油・石炭製品	0.41
鉱業	0.28
パルプ・紙	0.17
倉庫・運輸関連業	0.14
水産・農林業	0.08
合計	97.27

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25 中国	国債証券	1,848,404,040	99.65 1,842,099,827	100.03 1,849,007,913	2.26 2025/2/24	0.87
2	CHINA GOVERNMENT BOND 2.64 01/15/28 中国	国債証券	1,734,110,400	99.77 1,730,220,810	100.66 1,745,699,286	2.64 2028/1/15	0.82
3	US T N/B 1.625 02/15/26 アメリカ	国債証券	1,803,033,000	93.42 1,684,460,797	93.51 1,686,117,578	1.625 2026/2/15	0.79
4	US T N/B 0.375 01/31/26 アメリカ	国債証券	1,817,010,000	90.23 1,639,551,019	90.48 1,644,145,628	0.375 2026/1/31	0.77
5	FRANCE OAT 5.75 10/25/32 フランス	国債証券	1,198,819,600	124.25 1,489,547,591	123.70 1,483,015,370	5.75 2032/10/25	0.69
6	US T N/B 1.125 01/15/25 アメリカ	国債証券	1,537,470,000	94.12 1,447,199,545	94.43 1,451,978,258	1.125 2025/1/15	0.68
7	US T N/B 1.125 02/15/31 アメリカ	国債証券	1,677,240,000	83.34 1,397,891,484	83.31 1,397,416,087	1.125 2031/2/15	0.65
8	US T N/B 0.875 11/15/30 アメリカ	国債証券	1,633,911,300	82.03 1,340,433,211	81.98 1,339,615,785	0.875 2030/11/15	0.63
9	US T N/B 1.75 12/31/24 アメリカ	国債証券	1,397,700,000	95.63 1,336,648,464	95.48 1,334,557,812	1.75 2024/12/31	0.63
10	US T N/B 2.875 05/15/32 アメリカ	国債証券	1,397,700,000	94.30 1,318,080,019	93.72 1,309,961,562	2.875 2032/5/15	0.61
11	FRANCE OAT 0.5 05/25/25 フランス	国債証券	1,350,360,000	94.83 1,280,625,909	95.41 1,288,450,045	0.5 2025/5/25	0.60

12	US T N/B 1.25 09/30/28 アメリカ	国債証券	1,414,472,400	86.71 1,226,619,563	87.60 1,239,210,429	1.25 2028/9/30	0.58
13	US T N/B 2.75 08/15/32 アメリカ	国債証券	1,325,019,600	91.42 1,211,374,066	92.63 1,227,454,683	2.75 2032/8/15	0.57
14	US T N/B 1.875 02/15/32 アメリカ	国債証券	1,397,700,000	86.95 1,215,377,023	86.55 1,209,720,266	1.875 2032/2/15	0.57
15	CHINA GOVERNMENT BOND 2.79 12/15/29 中国	国債証券	1,129,142,340	99.73 1,126,110,919	100.63 1,136,320,297	2.79 2029/12/15	0.53
16	ITALY BTPS 0.35 02/01/25 イタリア	国債証券	1,162,810,000	94.32 1,096,869,670	95.08 1,105,668,353	0.35 2025/2/1	0.52
17	US T N/B 4.125 11/15/32 アメリカ	国債証券	1,062,252,000	103.92 1,103,966,636	103.32 1,097,522,080	4.125 2032/11/15	0.51
18	US T N/B 2.25 12/31/24 アメリカ	国債証券	1,118,160,000	96.44 1,078,409,412	96.22 1,075,945,087	2.25 2024/12/31	0.50
19	FRANCE OAT 03/25/25 フランス	国債証券	1,129,801,200	94.16 1,063,877,299	94.89 1,072,107,901	- 2025/3/25	0.50
20	US T N/B 2.25 11/15/25 アメリカ	国債証券	1,118,160,000	95.54 1,068,323,259	95.33 1,066,008,324	2.25 2025/11/15	0.50
21	CHINA GOVERNMENT BOND 3.03 03/11/26 中国	国債証券	1,044,407,400	101.57 1,060,810,685	101.95 1,064,834,024	3.03 2026/3/11	0.50
22	US T N/B 1.5 02/15/25 アメリカ	国債証券	1,118,160,000	95.03 1,062,603,172	94.87 1,060,897,975	1.5 2025/2/15	0.50
23	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 11/15/32 中国	国債証券	1,034,554,500	99.30 1,027,388,209	100.32 1,037,902,214	2.8 2032/11/15	0.49
24	FRANCE OAT 5.5 04/25/29 フランス	国債証券	900,240,000	115.13 1,036,527,333	114.87 1,034,114,690	5.5 2029/4/25	0.48
25	US T N/B 1.625 11/30/26 アメリカ	国債証券	1,118,160,000	92.48 1,034,166,965	92.28 1,031,895,700	1.625 2026/11/30	0.48
26	US T N/B 2.625 02/15/29 アメリカ	国債証券	1,052,468,100	95.38 1,003,844,351	93.87 988,024,982	2.625 2029/2/15	0.46
27	US T N/B 3.5 02/15/33 アメリカ	国債証券	978,390,000	100.35 981,838,125	98.42 962,949,782	3.5 2033/2/15	0.45
28	US T N/B 5.375 02/15/31 アメリカ	国債証券	809,268,300	112.18 907,915,156	111.14 899,457,454	5.375 2031/2/15	0.42
29	US T N/B 2.875 06/15/25 アメリカ	国債証券	908,505,000	98.64 896,238,784	96.96 880,930,455	2.875 2025/6/15	0.41
30	US T N/B 4.625 02/28/25 アメリカ	国債証券	880,551,000	101.00 889,366,573	99.99 880,482,210	4.625 2025/2/28	0.41

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	101.08
合計	101.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

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5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類 業種	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	APPLE INC アメリカ	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	2,149,820	21,559.39 46,348,811,596	24,781.22 53,275,164,530	- -	5.45
2	MICROSOFT CORP アメリカ	株式 ソフト ウェア	956,655	38,116.24 36,464,098,649	46,293.22 44,286,642,005	- -	4.53
3	AMAZON.COM INC アメリカ	株式 大規模小 売り	1,240,262	13,939.18 17,288,241,865	17,004.41 21,089,933,725	- -	2.16
4	NVIDIA CORP アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	332,062	32,783.38 10,886,115,432	56,063.14 18,616,439,955	- -	1.91
5	ALPHABET INC-CL A アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	803,970	13,343.40 10,727,694,838	17,285.35 13,896,907,582	- -	1.42
6	ALPHABET INC-CL C アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	742,419	13,379.45 9,933,160,297	17,420.93 12,933,631,508	- -	1.32
7	META PLATFORMS INC アメリカ	株式 インタ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	303,449	25,534.92 7,748,546,668	36,692.42 11,134,278,277	- -	1.14
8	TESLA INC アメリカ	株式 自動車	362,277	29,002.21 10,506,836,805	28,116.13 10,185,828,387	- -	1.04

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 ア・サー ビス	126,297	68,835.17 8,693,676,043	67,068.63 8,470,567,331	- -	0.87
10	EXXON MOBIL CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	556,010	16,243.21 9,031,391,033	14,541.67 8,085,314,381	- -	0.83
11	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B アメリカ	株式 金融サー ビス	175,639	43,441.72 7,630,060,335	45,032.49 7,909,462,617	- -	0.81
12	JOHNSON & JOHNSON アメリカ	株式 医薬品	353,492	22,549.53 7,971,081,358	21,576.29 7,627,047,636	- -	0.78
13	JPMORGAN CHASE & CO アメリカ	株式 銀行	395,707	19,872.65 7,863,750,475	19,212.78 7,602,633,197	- -	0.78
14	VISA INC アメリカ	株式 金融サー ビス	219,836	32,020.64 7,039,290,171	30,978.62 6,810,216,521	- -	0.70
15	ELI LILLY & CO アメリカ	株式 医薬品	109,033	48,465.62 5,284,352,213	59,715.33 6,510,942,099	- -	0.67
16	PROCTER & GAMBLE CO アメリカ	株式 家庭用品	320,215	19,596.41 6,275,065,699	20,012.26 6,408,228,589	- -	0.66
17	BROADCOM INC アメリカ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	56,286	84,612.99 4,762,527,287	112,282.83 6,319,951,470	- -	0.65
18	NESTLE SA-REGISTERED スイス	株式 食品	371,943	17,159.54 6,382,373,295	16,717.94 6,218,122,765	- -	0.64
19	MASTERCARD INC アメリカ	株式 金融サー ビス	116,035	51,607.26 5,988,248,522	51,365.47 5,960,192,891	- -	0.61
20	HOME DEPOT INC アメリカ	株式 専門小売 り	137,588	44,120.96 6,070,515,344	40,868.74 5,623,049,299	- -	0.58
21	ASML HOLDING NV オランダ	株式 半導体・ 半導体製 造装置	54,297	92,875.78 5,042,876,685	102,492.32 5,565,025,716	- -	0.57
22	CHEVRON CORP アメリカ	株式 石油・ガス・消耗 燃料	248,161	24,007.87 5,957,818,284	21,401.58 5,311,038,089	- -	0.54
23	MERCK & CO. INC. アメリカ	株式 医薬品	342,191	15,200.69 5,201,539,665	15,258.69 5,221,386,697	- -	0.53
24	NOVO NORDISK A/S-B デンマーク	株式 医薬品	223,550	20,237.27 4,524,043,028	22,487.40 5,027,058,270	- -	0.51

25	PEPSICO INC アメリカ	株式 飲料	186,384	24,649.16 4,594,209,114	25,383.62 4,731,102,438	- -	0.48
26	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE フランス	株式 繊維・ア パレル・ 贅沢品	37,297	122,109.84 4,554,330,778	125,433.43 4,678,291,011	- -	0.48
27	COCA-COLA CO/THE アメリカ	株式 飲料	555,881	8,367.34 4,651,248,521	8,355.45 4,644,636,234	- -	0.48
28	ABBVIE INC アメリカ	株式 バイオテ クノロ ジー	238,853	21,437.46 5,120,402,931	19,070.21 4,554,978,971	- -	0.47
29	COSTCO WHOLESALE CORP アメリカ	株式 生活必需 品流通・ 小売り	59,677	70,150.06 4,186,345,694	71,007.35 4,237,505,810	- -	0.43
30	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN スイス	株式 医薬品	94,934	42,684.38 4,052,199,762	44,425.84 4,217,523,548	- -	0.43

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	95.96
投資信託受益証券	0.16
投資証券	1.85
合計	97.97

(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。

投資株式の業種別投資比率

2023年5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
ソフトウェア	外国	8.07
半導体・半導体製造装置		6.00
コンピュータ・周辺機器		5.67
医薬品		5.24
銀行		5.21
石油・ガス・消耗燃料		4.59
インタラクティブ・メディアおよびサービス		4.01
保険		3.02
金融サービス		3.01
資本市場		2.94
大規模小売り		2.58
ヘルスケア機器・用品		2.37
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		2.11
ホテル・レストラン・レジャー		2.06
化学		1.91
バイオテクノロジー		1.90
飲料		1.77

電力	1.75
生活必需品流通・小売り	1.73
機械	1.72
自動車	1.71
食品	1.66
航空宇宙・防衛	1.65
専門小売り	1.58
金属・鉱業	1.48
繊維・アパレル・贅沢品	1.36
ライフサイエンス・ツール/サービス	1.33
情報技術サービス	1.27
家庭用品	1.12
娯楽	1.11
専門サービス	1.04
各種電気通信サービス	1.02
陸上運輸	0.98
コングロマリット	0.92
電気設備	0.88
総合公益事業	0.76
メディア	0.72
通信機器	0.69
パーソナルケア用品	0.60
タバコ	0.60
航空貨物・物流サービス	0.56
建設関連製品	0.55
商業サービス・用品	0.53
電子装置・機器・部品	0.51
商社・流通業	0.39
消費者金融	0.37
建設・土木	0.30
不動産管理・開発	0.29
家庭用耐久財	0.29
建設資材	0.28
無線通信サービス	0.25
エネルギー設備・サービス	0.24
容器・包装	0.22
自動車用部品	0.17
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.14
ガス	0.12
運送インフラ	0.12
水道	0.10
販売	0.10
紙製品・林産品	0.09
海上運輸	0.06
旅客航空輸送	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.04
レジャー用品	0.02
各種消費者サービス	0.02
合計	95.96

(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。

J - R E I Tインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

順位	銘柄名 発行体の国/地域	種類	数量	簿価単価 簿価金額 (円)	評価単価 評価金額 (円)	利率 (%) 償還日	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 日本	投資証券	22,263	667,149.83 14,852,756,803	558,000.00 12,422,754,000	- -	6.01
2	ジャパンリアルエステイト 投資法人 日本	投資証券	19,569	613,557.82 12,006,713,010	530,000.00 10,371,570,000	- -	5.02
3	野村不動産マスターファン ド投資法人 日本	投資証券	61,713	165,010.89 10,183,317,532	163,900.00 10,114,760,700	- -	4.89
4	G L P 投資法人 日本	投資証券	64,340	160,472.74 10,324,816,576	147,800.00 9,509,452,000	- -	4.60
5	日本都市ファンド投資法人 日本	投資証券	96,289	105,016.83 10,111,966,042	98,600.00 9,494,095,400	- -	4.59
6	日本プロロジスリート投資 法人 日本	投資証券	32,168	329,662.74 10,604,591,137	292,200.00 9,399,489,600	- -	4.55
7	大和ハウスリート投資法人 日本	投資証券	28,766	305,656.82 8,792,524,252	292,500.00 8,414,055,000	- -	4.07
8	オリックス不動産投資法人 日本	投資証券	38,024	183,851.26 6,990,760,556	186,600.00 7,095,278,400	- -	3.43
9	アドバンス・レジデンス投 資法人 日本	投資証券	19,081	349,860.77 6,675,693,411	358,000.00 6,830,998,000	- -	3.31
10	ユナイテッド・アーバン投 資法人 日本	投資証券	42,689	147,539.09 6,298,296,532	148,000.00 6,317,972,000	- -	3.06
11	インヴィンシブル投資法人 日本	投資証券	83,996	45,466.83 3,819,031,864	59,300.00 4,980,962,800	- -	2.41
12	ジャパン・ホテル・リート 投資法人 日本	投資証券	61,542	70,784.16 4,356,199,100	79,100.00 4,867,972,200	- -	2.36
13	日本プライムリアルティ投 資法人 日本	投資証券	13,051	395,935.39 5,167,352,777	359,000.00 4,685,309,000	- -	2.27
14	産業ファンド投資法人 日本	投資証券	29,118	172,970.73 5,036,561,753	160,100.00 4,661,791,800	- -	2.26
15	積水ハウス・リート投資法 人 日本	投資証券	57,345	78,670.20 4,511,342,788	79,500.00 4,558,927,500	- -	2.21
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	6,590	651,073.16 4,290,572,140	678,000.00 4,468,020,000	- -	2.16
17	日本ロジスティクスファン ド投資法人 日本	投資証券	12,868	319,573.07 4,112,266,370	326,500.00 4,201,402,000	- -	2.03

18	アクティビア・プロパ ティーズ投資法人 日本	投資証 券	10,075	411,980.62 4,150,704,797	393,500.00 3,964,512,500	- -	1.92
19	ラサールロジポート投資法 人 日本	投資証 券	23,362	169,856.81 3,968,195,024	167,900.00 3,922,479,800	- -	1.90
20	三井不動産ロジスティクス パーク投資法人 日本	投資証 券	7,539	521,461.65 3,931,299,449	502,000.00 3,784,578,000	- -	1.83
21	イオンリート投資法人 日本	投資証 券	21,908	153,246.52 3,357,324,908	160,600.00 3,518,424,800	- -	1.70
22	ケネディクス・オフィス投 資法人 日本	投資証 券	11,104	328,426.50 3,646,847,966	316,000.00 3,508,864,000	- -	1.70
23	フロンティア不動産投資法 人 日本	投資証 券	7,081	518,973.56 3,674,851,840	493,000.00 3,490,933,000	- -	1.69
24	森ヒルズリート投資法人 日本	投資証 券	22,441	153,367.13 3,441,711,953	154,100.00 3,458,158,100	- -	1.67
25	大和証券リビング投資法人 日本	投資証 券	26,445	115,449.23 3,053,054,937	119,100.00 3,149,599,500	- -	1.52
26	コンフォリア・レジデン シャル投資法人 日本	投資証 券	9,126	327,087.74 2,985,002,787	338,500.00 3,089,151,000	- -	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	13,995	212,669.12 2,976,304,472	213,800.00 2,992,131,000	- -	1.45
28	三菱地所物流リート投資法 人 日本	投資証 券	6,556	444,756.85 2,915,825,955	434,500.00 2,848,582,000	- -	1.38
29	ヒューリックリート投資法 人 日本	投資証 券	17,855	161,652.19 2,886,299,996	158,700.00 2,833,588,500	- -	1.37
30	森トラストリート投資法人 日本	投資証 券	35,519	71,576.78 2,542,335,846	71,900.00 2,553,816,100	- -	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5月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	97.88
合計	97.88

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年5月31日現在

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

1	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29 サウジアラビア	国債証券	2,515,860,000	100.75 2,534,728,950	98.79 2,485,647,037	4.375 2029/4/16	1.90
2	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29 オマーン	国債証券	2,376,090,000	101.89 2,421,169,738	100.55 2,389,217,897	6 2029/8/1	1.83
3	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49 カタール	国債証券	2,376,090,000	98.40 2,338,151,949	94.84 2,253,512,269	4.817 2049/3/14	1.72
4	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29 ドミニカ共和国	国債証券	2,376,090,000	95.29 2,264,283,061	93.41 2,219,703,003	5.5 2029/2/22	1.70
5	PERU 2.783 01/23/31 ペルー	国債証券	2,236,320,000	85.72 1,917,108,689	85.22 1,906,003,437	2.783 2031/1/23	1.46
6	REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31 ウルグアイ	国債証券	1,817,010,000	100.01 1,817,266,670	99.76 1,812,710,990	4.375 2031/1/23	1.39
7	DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60 ドミニカ共和国	国債証券	2,376,090,000	76.77 1,824,318,989	74.80 1,777,529,833	5.875 2060/1/30	1.36
8	STATE OF QATAR 3.4 04/16/25 カタール	国債証券	1,817,010,000	98.00 1,780,669,800	97.72 1,775,582,172	3.4 2025/4/16	1.36
9	STATE OF QATAR 4.4 04/16/50 カタール	国債証券	1,956,780,000	93.74 1,834,285,572	89.47 1,750,731,066	4.4 2050/4/16	1.34
10	BRAZIL 3.875 06/12/30 ブラジル	国債証券	1,956,780,000	89.38 1,748,985,129	89.28 1,747,128,790	3.875 2030/6/12	1.34
11	BRAZIL 2.875 06/06/25 ブラジル	国債証券	1,817,010,000	95.89 1,742,493,558	95.77 1,740,214,417	2.875 2025/6/6	1.33
12	DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33 ドミニカ共和国	国債証券	1,844,964,000	92.54 1,707,356,220	91.62 1,690,515,955	6 2033/2/22	1.29
13	BRAZIL 4.75 01/14/50 ブラジル	国債証券	2,236,320,000	73.29 1,639,159,518	72.90 1,630,381,984	4.75 2050/1/14	1.25
14	ROMANIA 7.125 01/17/33 ルーマニア	国債証券	1,537,470,000	106.72 1,640,926,356	105.12 1,616,306,849	7.125 2033/1/17	1.24
15	PANAMA 6.4 02/14/35 パナマ	国債証券	1,537,470,000	104.14 1,601,140,180	105.02 1,614,714,783	6.4 2035/2/14	1.23
16	SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49 南アフリカ	国債証券	2,236,320,000	72.08 1,612,051,272	68.63 1,534,862,450	5.75 2049/9/30	1.17
17	REPUBLIC OF POLAND 4.875 10/04/33 ポーランド	国債証券	1,537,470,000	101.97 1,567,888,145	99.47 1,529,438,256	4.875 2033/10/4	1.17
18	STATE OF QATAR 4.0 03/14/29 カタール	国債証券	1,537,470,000	100.19 1,540,529,565	98.72 1,517,806,496	4 2029/3/14	1.16
19	STATE OF QATAR 3.75 04/16/30 カタール	国債証券	1,537,470,000	98.73 1,518,014,016	97.03 1,491,884,014	3.75 2030/4/16	1.14

20	SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25 サウジアラビア	国債証券	1,537,470,000	96.74 1,487,404,386	95.63 1,470,282,561	2.9 2025/10/22	1.12
21	SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29 南アフリカ	国債証券	1,677,240,000	89.63 1,503,457,809	86.67 1,453,747,770	4.85 2029/9/30	1.11
22	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.75 01/18/28 サウジアラビア	国債証券	1,397,700,000	102.07 1,426,667,332	100.62 1,406,365,740	4.75 2028/1/18	1.07
23	REPUBLIC OF POLAND 5.5 04/04/53 ポーランド	国債証券	1,397,700,000	103.63 1,448,456,077	100.51 1,404,828,270	5.5 2053/4/4	1.07
24	OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28 オマーン	国債証券	1,397,700,000	100.63 1,406,575,395	98.99 1,383,583,230	5.625 2028/1/17	1.06
25	PERU 3.0 01/15/34 ペルー	国債証券	1,677,240,000	81.93 1,374,218,220	81.65 1,369,573,400	3 2034/1/15	1.05
26	ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24 アラブ首長国連邦	国債証券	1,397,700,000	96.35 1,346,766,414	96.13 1,343,656,531	2.125 2024/9/30	1.03
27	ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25 アラブ首長国連邦	国債証券	1,397,700,000	96.56 1,349,619,120	96.01 1,341,931,770	2.5 2025/4/16	1.03
28	REPUBLIC OF POLAND 5.75 11/16/32 ポーランド	国債証券	1,257,930,000	108.93 1,370,279,921	106.02 1,333,683,802	5.75 2032/11/16	1.02
29	UNITED MEXICAN STATES 6.35 02/09/35 メキシコ	国債証券	1,257,930,000	105.75 1,330,302,910	105.36 1,325,452,009	6.35 2035/2/9	1.01
30	ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30 アラブ首長国連邦	国債証券	1,397,700,000	95.15 1,330,044,331	93.57 1,307,918,740	3.125 2030/4/16	1.00

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

投資有価証券の種類別投資比率

2023年5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.86
合計	97.86

（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5月31日現在

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

1	TAIWAN SEMICONDUCTOR 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	2,354,879	2,372.23 5,586,338,158	2,582.09 6,080,514,226	- -	6.69
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	457,121	6,934.85 3,170,070,138	7,678.25 3,509,893,889	- -	3.86
3	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	6,618.64 3,932,795,888	5,641.00 3,351,886,953	- -	3.69
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	1,417,668	1,701.93 2,412,780,205	1,405.79 1,992,946,333	- -	2.19
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD インド	株式 石油・ガ ス・消耗 燃料	291,511	4,024.66 1,173,234,118	4,283.91 1,248,808,345	- -	1.37
6	MEITUAN ケイマン諸島	株式 ホテル・ レストラ ン・レ ジャー	471,210	2,419.10 1,139,905,995	2,076.57 978,503,376	- -	1.08
7	CHINA CONSTRUCTION BANK 中国	株式 銀行	9,133,530	95.97 876,628,902	90.62 827,746,250	- -	0.91
8	ICICI BANK LTD インド	株式 銀行	495,554	1,532.20 759,292,794	1,614.91 800,277,587	- -	0.88
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP インド	株式 金融サー ビス	165,710	4,661.48 772,454,679	4,578.69 758,735,548	- -	0.84
10	INFOSYS LTD インド	株式 情報技術 サービス	321,610	2,139.10 687,959,167	2,250.54 723,797,777	- -	0.80
11	VALE SA ブラジル	株式 金属・鉱 業	365,789	2,159.75 790,014,840	1,782.83 652,140,155	- -	0.72
12	SK HYNIX INC 韓国	株式 半導体・ 半導体製 造装置	52,044	9,398.69 489,145,942	11,713.85 609,636,129	- -	0.67

13	HON HAI PRECISION INDUSTRY 台湾	株式 電子装 置・機 器・部品	1,201,773	474.44 570,178,796	488.13 586,626,261	- -	0.65
14	PING AN INSURANCE GROUP CO-H 中国	株式 保険	606,000	965.14 584,877,264	903.59 547,579,176	- -	0.60
15	SAMSUNG ELECTRONICS-PFD 韓国	株式 コン ピュー タ・周辺 機器	78,743	5,915.33 465,791,617	6,414.47 505,095,398	- -	0.56
16	MEDIATEK INC 台湾	株式 半導体・ 半導体製 造装置	144,975	3,234.45 468,915,548	3,480.80 504,629,849	- -	0.56
17	AL RAJHI BANK サウジアラビア	株式 銀行	186,714	2,855.74 533,207,571	2,672.82 499,054,407	- -	0.55
18	TATA CONSULTANCY SERVICES LTD インド	株式 情報技術 サービス	87,562	5,337.14 467,331,528	5,637.53 493,634,277	- -	0.54
19	JD.COM INC ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	206,385	2,665.29 550,077,114	2,319.20 478,648,092	- -	0.53
20	NETEASE INC ケイマン諸島	株式 娯楽	187,600	2,620.69 491,642,569	2,488.68 466,876,368	- -	0.51
21	BAIDU INC ケイマン諸島	株式 インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	210,550	2,337.04 492,063,772	2,206.80 464,643,424	- -	0.51
22	PDD HOLDINGS INC ADR ケイマン諸島	株式 大規模小 売り	48,284	9,637.14 465,319,740	9,452.64 456,411,516	- -	0.50
23	BANK CENTRAL ASIA TBK PT インドネシア	株式 銀行	5,248,300	84.83 445,239,530	86.95 456,339,685	- -	0.50
24	NASPERS LTD 南アフリカ	株式 大規模小 売り	20,843	23,824.10 496,565,749	21,672.64 451,722,858	- -	0.50
25	BANK OF CHINA LTD 中国	株式 銀行	7,526,200	56.19 422,942,335	55.66 418,914,312	- -	0.46
26	IND & COMM BK OF CHINA - H 中国	株式 銀行	5,430,235	77.06 418,501,695	75.46 409,782,909	- -	0.45
27	AMERICA MOVIL SAB DE CV メキシコ	株式 無線通信 サービス	2,640,678	155.41 410,396,439	153.51 405,381,412	- -	0.45

28	SAMSUNG SDI CO LTD 韓国	株式 電子装 置・機 器・部品	5,232	80,181.00 419,506,992	76,251.59 398,948,371	- -	0.44
29	THE SAUDI NATIONAL BANK サウジアラビア	株式 銀行	279,373	1,404.17 392,289,860	1,388.67 387,958,580	- -	0.43
30	HINDUSTAN UNILEVER LTD インド	株式 パーソ ナルケ ア用 品	78,339	4,338.14 339,845,941	4,516.13 353,789,499	- -	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5月31日現在

種類	投資比率(%)
株式	93.83
投資信託受益証券	0.71
投資証券	0.09
合計	94.64

(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

2023年5月31日現在

業種	国内/外国	投資比率(%)
銀行	外国	14.99
半導体・半導体製造装置		9.59
コンピュータ・周辺機器		5.63
インタラクティブ・メディアおよびサービス		5.02
石油・ガス・消耗燃料		4.75
大規模小売り		4.06
金属・鉱業		3.67
化学		3.04
電子装置・機器・部品		2.80
保険		2.65
自動車		2.60
ホテル・レストラン・レジャー		2.26
情報技術サービス		2.03
食品		1.74
無線通信サービス		1.61
金融サービス		1.57
不動産管理・開発		1.56
生活必需品流通・小売り		1.44
各種電気通信サービス		1.35
飲料		1.30
コングロマリット		1.24
医薬品		1.23
電気設備		1.15
娯楽		1.02
電力		1.01
繊維・アパレル・贅沢品		0.93
独立系発電事業者・エネルギー販売業者		0.90

資本市場	0.89
建設資材	0.84
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.81
専門小売り	0.77
パーソナルケア用品	0.75
運送インフラ	0.71
バイオテクノロジー	0.69
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.65
消費者金融	0.63
建設・土木	0.61
自動車用部品	0.55
機械	0.52
ガス	0.46
タバコ	0.37
家庭用耐久財	0.37
海上運輸	0.34
旅客航空輸送	0.30
陸上運輸	0.29
ソフトウェア	0.28
航空貨物・物流サービス	0.28
ヘルスケア機器・用品	0.22
通信機器	0.19
航空宇宙・防衛	0.19
紙製品・林産品	0.17
各種消費者サービス	0.15
商社・流通業	0.12
メディア	0.11
家庭用品	0.09
水道	0.09
商業サービス・用品	0.08
エネルギー設備・サービス	0.06
レジャー用品	0.03
容器・包装	0.03
総合公益事業	0.03
建設関連製品	0.03
合計	93.83

(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。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

(参考)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

該当事項はありません。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

該当事項はありません。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

J-REITインデックスファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング債券パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
該当事項はありません。

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX 先物 0506月	買建	567	11,820,678,110	12,054,420,000	2.77

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

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

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物 取引	シカゴ商品 取引所	S&P500 EMINI FUT Jun23	買建	493	14,363,546,164	14,522,068,057	1.49
	EUREX 取引所	DJ EURO STOXX 50 Jun23	買建	517	3,351,811,078	3,331,660,706	0.34
	ICE-E U	FTSE 100 INDEX FUTURE Jun23	買建	68	920,751,532	888,948,893	0.09
	モン トリ オール 取引 所	S&P/TSE 60 IX FUT Jun23	買建	28	709,834,356	683,061,019	0.07
	シド ニー 先 物 取引 所	SPI 200 FUTURES Jun23	買建	26	431,751,486	427,450,705	0.04

（注1）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

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

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	TREIT 先物 0506月	買建	2,337	4,213,377,300	4,394,728,500	2.13

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

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

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

該当事項はありません。

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年5月31日現在

種類	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価金額 (円)	評価金額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	ICE-US	MINI MSCI EMG MKT Jun23	買建	740	5,139,948,104	4,993,590,744	5.50

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

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

直近日(2023年5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11月12日)	16,055	16,055	0.9834	0.9834
第2計算期間末 (2019年11月11日)	63,143	63,143	1.0389	1.0389
第3計算期間末 (2020年11月11日)	116,766	116,766	1.0188	1.0188
第4計算期間末 (2021年11月11日)	83,658	83,658	1.0436	1.0436
第5計算期間末 (2022年11月11日)	63,428	63,428	0.9668	0.9668
2022年5月末日	70,098	-	0.9876	-
6月末日	68,310	-	0.9758	-
7月末日	67,792	-	0.9816	-
8月末日	66,757	-	0.9777	-
9月末日	65,196	-	0.9673	-
10月末日	63,698	-	0.9662	-
11月末日	62,892	-	0.9664	-
12月末日	61,552	-	0.9605	-
2023年1月末日	60,886	-	0.9608	-
2月末日	59,986	-	0.9594	-
3月末日	59,254	-	0.9633	-
4月末日	58,634	-	0.9649	-

5月末日	58,421	-	0.9677	-
------	--------	---	--------	---

【分配の推移】

	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11月12日～2023年5月11日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.7
第2計算期間	5.6
第3計算期間	1.9
第4計算期間	2.4
第5計算期間	7.4
2022年11月12日～2023年5月11日	0.0

(注) 収益率は期間騰落率です。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数
第1計算期間	17,241,080,294	914,894,367
第2計算期間	48,308,726,995	3,853,963,676
第3計算期間	84,183,367,871	30,357,847,700
第4計算期間	5,948,816,817	40,393,734,727
第5計算期間	3,490,938,507	18,046,893,924
2022年11月12日～ 2023年5月11日	1,277,469,254	6,149,190,391

(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5月31日

基準価額・純資産の推移 (2018年5月25日～2023年5月31日)



※基準価額は1万口当たり・信託報酬控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額とは異なります。
(設定日:2018年5月25日)

分配の推移(税引前)

2018年11月	0円
2019年11月	0円
2020年11月	0円
2021年11月	0円
2022年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たりです。

主要な資産の状況

■組入銘柄

※比率(%)は、純資産総額に対する当該資産の時価比率です。

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	31.24
2	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	30.18
3	国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	9.33
4	外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	7.90
5	エマージング債券パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	7.18
6	エマージング株式パッシブ・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	6.29
7	J-REITインデックスファンド・マザーファンド	親投資信託受益証券	日本	-	-	1.53

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

組入上位5銘柄

順位	銘柄名	種類	国/地域	利率(%)	償還日	比率(%)
1	335回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.5	2024/9/20	1.59
2	137回 利付国庫債券(20年)	国債証券	日本	1.7	2032/6/20	1.25
3	341回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.3	2025/12/20	1.12
4	339回 利付国庫債券(10年)	国債証券	日本	0.4	2025/6/20	1.10
5	153回 利付国庫債券(5年)	国債証券	日本	0.005	2027/6/20	1.09

○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5月31日

■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	3.35
2	ソニーグループ	株式	日本	電気機器	2.97
3	キーエンス	株式	日本	電気機器	2.17
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	株式	日本	銀行業	1.84
5	日本電信電話	株式	日本	情報・通信業	1.62

■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	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	国債証券	中国	2.26	2025/2/24	0.87
2	CHINA GOVERNMENT BOND 2.64 01/15/28	国債証券	中国	2.64	2028/1/15	0.82
3	US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	アメリカ	1.625	2026/2/15	0.79
4	US T N/B 0.375 01/31/26	国債証券	アメリカ	0.375	2026/1/31	0.77
5	FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	フランス	5.75	2032/10/25	0.69

■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	5.45
2	MICROSOFT CORP	株式	アメリカ	ソフトウェア	4.53
3	AMAZON.COM INC	株式	アメリカ	大規模小売り	2.16
4	NVIDIA CORP	株式	アメリカ	半導体・半導体製造装置	1.91
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	1.42

■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	6.01
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	投資証券	日本	5.02
3	野村不動産マスターファンド投資法人	投資証券	日本	4.89
4	GLP投資法人	投資証券	日本	4.60
5	日本都市ファンド投資法人	投資証券	日本	4.59

○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	SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	国債証券	サウジアラビア	4.375	2029/4/16	1.90
2	OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	国債証券	オマーン	6	2029/8/1	1.83
3	STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	国債証券	カタール	4.817	2049/3/14	1.72
4	DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	国債証券	ドミニカ共和国	5.5	2029/2/22	1.70
5	PERU 2.783 01/23/31	国債証券	ペルー	2.783	2031/1/23	1.46

■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	6.69
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	株式	韓国	コンピュータ・周辺機器	3.86
3	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	3.69
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	株式	ケイマン諸島	大規模小売り	2.19
5	RELIANCE INDUSTRIES LTD	株式	インド	石油・ガス・消耗燃料	1.37

年間収益率の推移(暦年ベース)



※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

お申込みに際しては、販売会社所定の方法でお申込みください。

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

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

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

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

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

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

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

・お申込価額

お申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

「基準価額」とは、純資産総額（ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額）を計算日の受益権総口数で除した価額をいいます。（ただし、便宜上1万口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。

当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・ 販売会社へのお問い合わせ

- ・ 委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

- ・ お申込手数料

お申込日の翌営業日の基準価額に、1.1%（税抜1.0%）を上限に各販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

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

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- ・ お申込単位

各販売会社が定める単位とします。

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

取扱コースおよびお申込単位は、販売会社にお問い合わせください。

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

当初元本は1口当たり1円です。

- ・ 払込期日

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

2【換金（解約）手続等】

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

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

海外休業日には、解約の受付を行いません。

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

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

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

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

・解約価額

解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

当ファンドの解約価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

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

・解約単位

各販売会社が定める単位とします。

解約単位は販売会社にお問い合わせください。

・解約代金の受渡日

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

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

<主な投資対象の時価評価方法の原則>

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

外国で取引されているものについては、計算時に知りうる直近の日

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

す。
当ファンドの基準価額は、以下の方法でご確認ください。

- ・販売会社へのお問い合わせ
- ・委託会社への照会

ホームページ URL <http://www.am-one.co.jp/>

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

信託期間は、2018年5月25日（設定日）から原則として2028年5月11日までです。

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

(4)【計算期間】

- a. 計算期間は、原則として毎年11月12日から翌年11月11日までとします。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上記a.の原則により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ.償還規定

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約を解約することが受益者のために有利であると認める場合、受益権口数が10億口を下回ることとなった場合、マザーファンドのベンチマークである対象インデックスが改廃された場合、またはやむを得ない事情が発生した場合は、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日および信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知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発送します。
- 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. 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. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益におよぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b. からe. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a. からf. の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、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。

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

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11月11日（休業日の場合は翌営業日とします。）および償還時に交付運用報告書を作成し、販売会社を通じて受益者に対して交付します。

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

（URL <http://www.am-one.co.jp/>）

4【受益者の権利等】

(1) 収益分配金請求権

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

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

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

(3)一部解約請求権

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

(4)帳簿書類の閲覧・謄写の請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期計算期間(2021年11月12日から2022年11月11日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 2021年11月11日現在	第5期 2022年11月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,535,739,376	29,917,956,186
国債証券	-	21,009,720,000
親投資信託受益証券	82,069,857,111	12,892,638,217
派生商品評価勘定	215,300,847	39,996,081
流動資産合計	84,820,897,334	63,860,310,484
資産合計		
	84,820,897,334	63,860,310,484
負債の部		
流動負債		
未払解約金	659,998,523	61,938,279
未払受託者報酬	15,191,359	11,172,378
未払委託者報酬	486,125,006	357,517,366
その他未払費用	1,098,672	860,218
流動負債合計	1,162,413,560	431,488,241
負債合計		
	1,162,413,560	431,488,241
純資産の部		
元本等		
元本	80,161,551,507	65,605,596,090
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,496,932,267	2,176,773,847
(分配準備積立金)	1,458,681,748	1,137,584,148
元本等合計	83,658,483,774	63,428,822,243
純資産合計	83,658,483,774	63,428,822,243
負債純資産合計	84,820,897,334	63,860,310,484

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期		第5期	
	自	2020年11月12日 至 2021年11月11日	自	2021年11月12日 至 2022年11月11日
営業収益				
受取利息		8,329		159,544
有価証券売買等損益		4,388,845,601		4,326,886,894
為替差損益		1,027,641,412		520,494,354
営業収益合計		3,361,212,518		4,847,221,704
営業費用				
支払利息		1,073,376		6,767,163
受託者報酬		32,828,085		23,744,823
委託者報酬		1,050,501,958		759,836,692
その他費用		3,270,580		3,635,311
営業費用合計		1,087,673,999		793,983,989
営業利益又は営業損失()		2,273,538,519		5,641,205,693
経常利益又は経常損失()		2,273,538,519		5,641,205,693
当期純利益又は当期純損失()		2,273,538,519		5,641,205,693
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()		319,178,588		741,440,575
期首剰余金又は期首欠損金()		2,159,756,637		3,496,932,267
剰余金増加額又は欠損金減少額		149,310,911		1,088,850
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		149,310,911		1,088,850
剰余金減少額又は欠損金増加額		766,495,212		775,029,846
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		766,495,212		775,029,846
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()		3,496,932,267		2,176,773,847

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	2021年11月11日現在	2022年11月11日現在
1. 期首元本額	114,606,469,417円	80,161,551,507円
期中追加設定元本額	5,948,816,817円	3,490,938,507円
期中一部解約元本額	40,393,734,727円	18,046,893,924円
2. 受益権の総数	80,161,551,507口	65,605,596,090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2,176,773,847円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自 2020年11月12日 至 2021年11月11日	自 2021年11月12日 至 2022年11月11日
1. 分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（958,689,797円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（2,038,250,519円）及び分配準備積立金（499,991,951円）より分配対象収益は3,496,932,267円（1万口当たり436.23円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（0円）、信託約款に規定される収益調整金（842,379,917円）及び分配準備積立金（1,137,584,148円）より分配対象収益は1,979,964,065円（1万口当たり301.79円）であります。分配を行っておりません。</p>

(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11月12日 至 2021年11月11日	自 2021年11月12日 至 2022年11月11日

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。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11月11日現在	第5期 2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	第4期 2021年11月11日現在	第5期 2022年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	-	7,668,000
親投資信託受益証券	2,639,083,492	513,643,969
合計	2,639,083,492	521,311,969

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第4期 2021年11月11日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	12,575,086,599	-	12,359,785,752	215,300,847
イギリス・ポンド	5,855,893,134	-	5,738,960,266	116,932,868
オーストラリア・ドル	2,526,070,250	-	2,461,480,000	64,590,250
カナダ・ドル	1,685,298,175	-	1,670,340,736	14,957,439

ユーロ	2,507,825,040	-	2,489,004,750	18,820,290
合計	12,575,086,599	-	12,359,785,752	215,300,847

種類	第5期 2022年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	1,732,188,345	-	1,692,192,264	39,996,081
イギリス・ポンド	718,483,696	-	697,007,694	21,476,002
オーストラリア・ドル	290,552,508	-	285,764,526	4,787,982
カナダ・ドル	144,761,323	-	141,039,584	3,721,739
ユーロ	578,390,818	-	568,380,460	10,010,358
合計	1,732,188,345	-	1,692,192,264	39,996,081

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

3. 換算において円未満の端数は切捨てております。

上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

	第4期 2021年11月11日現在	第5期 2022年11月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0436円 (10,436円)	0.9668円 (9,668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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1059回 国庫短期証券	15,000,000,000	15,005,400,000	

	1080回 国庫短期証券	6,000,000,000	6,004,320,000	
国債証券 合計		21,000,000,000	21,009,720,000	
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	88,414,162	297,027,377	
	国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,820,445,183	7,339,581,375	
	J-REITインデックスファ ンド・マザーファンド	224,059,883	546,952,580	
	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	47,895,318	298,474,042	
	外国リート・パッシブ・ファン ド・マザーファンド	169,200,023	289,636,599	
	為替フルヘッジ外国債券パッシ ブ・ファンド・マザーファンド	2,218,442,235	2,687,864,611	
	エマージング株式パッシブ・マ ザーファンド	343,511,203	457,728,677	
	エマージング債券パッシブ・マ ザーファンド	488,663,806	975,372,956	
親投資信託受益証券 合計		9,400,631,813	12,892,638,217	
合計			33,902,358,217	

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

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引等に関する注記）」にて記載しております。

（参考）

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,003,843,305
国債証券	677,101,432,750
地方債証券	34,259,207,370
特殊債証券	31,629,909,197
社債証券	27,814,299,380
未収利息	923,646,786
前払費用	191,842,113
流動資産合計	773,924,180,901
資産合計	773,924,180,901
負債の部	
流動負債	
未払解約金	717,805,000
流動負債合計	717,805,000
負債合計	717,805,000
純資産の部	
元本等	
元本	613,180,832,594
剰余金	
剰余金又は欠損金()	160,025,543,307
元本等合計	773,206,375,901
純資産合計	773,206,375,901
負債純資産合計	773,924,180,901

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	386,492,682,761円
同期中追加設定元本額	1,016,425,649,578円
同期中一部解約元本額	789,737,499,745円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	25,485,096,993円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	61,432,879円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	132,398,059円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	86,818,398円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	703,377,405円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	142,396,712円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	46,191,975円
たわらノーロード 国内債券	17,499,996,860円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,448,956,760円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,126,375,084円
たわらノーロード バランス(標準型)	1,968,885,662円
たわらノーロード バランス(積極型)	250,831,559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)	99,221,387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)	1,500,814,586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)	1,601,879,955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)	464,180,469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)	82,318,349円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	23,181,865円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	18,249,486円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	151,666,549円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	6,141,460円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	967,743円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金> Oneグローバルバランス	13,898,026,452円 13,250,056円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	9,581,344,338円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	13,419,659,263円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	5,666,339,687円
D I A M DC バランス30インデックスファンド	2,336,811,555円
D I A M DC バランス50インデックスファンド	2,429,128,250円
D I A M DC バランス70インデックスファンド	408,928,359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>	3,518,184,671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
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,559,819,892円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,915,127,849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	187,814,134,546円
クルーズコントロール	1,193,222,354円
投資のソムリエ<DC年金>	12,998,975,909円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,331,866,139円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,169,324,185円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	15,519,181,071円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	70,630,389,939円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	353,778,402円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	177,099,998円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	105,921,351円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,637,774,005円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,241,997,806円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	5,820,445,183円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,299,704,427円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	495,547,354円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	181,446,295円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	117,980,951円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,002,685,926円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	22,449,182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)	1,936,412,451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)	1,983,750,885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)	1,534,939,024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)	1,212,396,456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)	1,915,225,338円
インカム重視マルチアセット運用ファンド 2021-04(適格機関投資家限定)	4,956,308,630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)	1,912,948,779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)	1,727,724,857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)	1,968,944,827円
DIAM国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	9,127,429,359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)	4,861,516,897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)	584,037,946円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	265,452,445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)	3,284,048,841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)	102,570,764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)	185,998,680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)	158,193,329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)	102,185,167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)	23,174,353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)	96,778,708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)	32,497,715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)	326,885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)	27,081,860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)	108,229,468円
D I A M バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	3,238,226,803円
D I A M バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,194,293,080円
D I A M バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,283,760,394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)	64,279,569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)	154,922,143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)	1,913,233,941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)	159,562,268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)	523,838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)	2,028,313,339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)	44,723,242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)	297,704,048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)	457,531,011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)	858,489,695円
D I A M 世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	280,765,252円
D I A M 国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	96,664,950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 >	368,008,299円
コア資産形成ファンド	245,201,651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)	47,583,413,592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]	48,429,352,276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]	10,989,555,843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]	1,705,511,104円
計	613,180,832,594円
2. 受益権の総数	613,180,832,594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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）
国債証券	9,747,748,400
地方債証券	469,492,914
特殊債券	742,850,542
社債券	461,889,660
合計	11,421,981,516

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2022年11月11日現在
1口当たり純資産額	1.2610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11月11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	2,803,164,000	
	433回 利付国庫債券(2年)	3,400,000,000	3,403,706,000	
	434回 利付国庫債券(2年)	3,500,000,000	3,503,850,000	
	435回 利付国庫債券(2年)	3,720,000,000	3,724,092,000	
	436回 利付国庫債券(2年)	6,700,000,000	6,707,772,000	
	437回 利付国庫債券(2年)	3,850,000,000	3,854,466,000	
	438回 利付国庫債券(2年)	3,800,000,000	3,804,332,000	
	439回 利付国庫債券(2年)	3,100,000,000	3,103,689,000	
	440回 利付国庫債券(2年)	4,300,000,000	4,304,988,000	
	441回 利付国庫債券(2年)	2,700,000,000	2,704,050,000	
	138回 利付国庫債券(5年)	5,900,000,000	5,912,921,000	
	139回 利付国庫債券(5年)	9,350,000,000	9,371,972,500	
	140回 利付国庫債券(5年)	6,190,000,000	6,206,279,700	
	141回 利付国庫債券(5年)	6,410,000,000	6,428,973,600	
	142回 利付国庫債券(5年)	5,230,000,000	5,247,572,800	
	143回 利付国庫債券(5年)	3,100,000,000	3,111,625,000	
	144回 利付国庫債券(5年)	6,700,000,000	6,727,872,000	
	145回 利付国庫債券(5年)	7,050,000,000	7,082,148,000	
	146回 利付国庫債券(5年)	6,000,000,000	6,029,760,000	
	147回 利付国庫債券(5年)	7,580,000,000	7,596,448,600	

148回 利付国庫債券(5年)	6,790,000,000	6,803,444,200	
149回 利付国庫債券(5年)	6,950,000,000	6,959,313,000	
150回 利付国庫債券(5年)	6,940,000,000	6,944,233,400	
151回 利付国庫債券(5年)	5,140,000,000	5,140,000,000	
152回 利付国庫債券(5年)	3,430,000,000	3,444,131,600	
153回 利付国庫債券(5年)	7,200,000,000	7,193,376,000	
154回 利付国庫債券(5年)	3,300,000,000	3,308,778,000	
1回 利付国庫債券(40年)	110,000,000	136,448,400	
2回 利付国庫債券(40年)	630,000,000	750,096,900	
3回 利付国庫債券(40年)	540,000,000	643,885,200	
4回 利付国庫債券(40年)	720,000,000	854,215,200	
5回 利付国庫債券(40年)	1,010,000,000	1,152,824,100	
6回 利付国庫債券(40年)	1,720,000,000	1,909,251,600	
7回 利付国庫債券(40年)	1,690,000,000	1,792,633,700	
8回 利付国庫債券(40年)	1,850,000,000	1,821,602,500	
9回 利付国庫債券(40年)	2,830,000,000	2,036,213,300	
10回 利付国庫債券(40年)	2,530,000,000	2,142,201,600	
11回 利付国庫債券(40年)	1,820,000,000	1,482,899,600	
12回 利付国庫債券(40年)	1,910,000,000	1,385,762,300	
13回 利付国庫債券(40年)	2,680,000,000	1,929,921,600	
14回 利付国庫債券(40年)	2,770,000,000	2,131,930,500	
15回 利付国庫債券(40年)	1,600,000,000	1,348,656,000	
333回 利付国庫債券(10年)	6,330,000,000	6,387,476,400	
334回 利付国庫債券(10年)	6,520,000,000	6,589,307,600	
335回 利付国庫債券(10年)	7,910,000,000	7,991,947,600	
336回 利付国庫債券(10年)	3,000,000,000	3,035,280,000	
337回 利付国庫債券(10年)	4,800,000,000	4,836,288,000	
338回 利付国庫債券(10年)	4,630,000,000	4,680,004,000	
339回 利付国庫債券(10年)	5,580,000,000	5,646,736,800	
340回 利付国庫債券(10年)	7,540,000,000	7,638,924,800	

341回 利付国庫債券(10年)	6,720,000,000	6,795,062,400	
342回 利付国庫債券(10年)	7,880,000,000	7,922,236,800	
343回 利付国庫債券(10年)	7,850,000,000	7,892,390,000	
344回 利付国庫債券(10年)	7,830,000,000	7,869,150,000	
345回 利付国庫債券(10年)	5,990,000,000	6,017,014,900	
346回 利付国庫債券(10年)	7,570,000,000	7,601,188,400	
347回 利付国庫債券(10年)	7,110,000,000	7,136,093,700	
348回 利付国庫債券(10年)	6,590,000,000	6,607,529,400	
349回 利付国庫債券(10年)	6,230,000,000	6,244,204,400	
350回 利付国庫債券(10年)	8,660,000,000	8,676,107,600	
351回 利付国庫債券(10年)	7,400,000,000	7,412,358,000	
352回 利付国庫債券(10年)	6,990,000,000	6,998,108,400	
353回 利付国庫債券(10年)	7,240,000,000	7,244,344,000	
354回 利付国庫債券(10年)	6,760,000,000	6,760,000,000	
355回 利付国庫債券(10年)	6,910,000,000	6,905,439,400	
356回 利付国庫債券(10年)	6,840,000,000	6,830,697,600	
357回 利付国庫債券(10年)	7,410,000,000	7,389,103,800	
358回 利付国庫債券(10年)	6,250,000,000	6,222,750,000	
359回 利付国庫債券(10年)	8,300,000,000	8,250,200,000	
360回 利付国庫債券(10年)	8,340,000,000	8,281,870,200	
361回 利付国庫債券(10年)	6,500,000,000	6,448,195,000	
362回 利付国庫債券(10年)	7,840,000,000	7,772,419,200	
363回 利付国庫債券(10年)	7,500,000,000	7,430,325,000	
364回 利付国庫債券(10年)	7,600,000,000	7,524,076,000	
365回 利付国庫債券(10年)	6,340,000,000	6,280,530,800	

366回 利付国庫債券(10年)	6,300,000,000	6,308,631,000	
367回 利付国庫債券(10年)	6,790,000,000	6,770,852,200	
368回 利付国庫債券(10年)	1,400,000,000	1,395,282,000	
1回 利付国庫債券(30年)	110,000,000	130,114,600	
2回 利付国庫債券(30年)	100,000,000	116,219,000	
4回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	242,988,000	
6回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	238,968,000	
8回 利付国庫債券(30年)	200,000,000	229,970,000	
11回 利付国庫債券(30年)	250,000,000	285,360,000	
12回 利付国庫債券(30年)	230,000,000	272,354,500	
13回 利付国庫債券(30年)	150,000,000	176,158,500	
14回 利付国庫債券(30年)	340,000,000	414,470,200	
15回 利付国庫債券(30年)	260,000,000	320,335,600	
16回 利付国庫債券(30年)	240,000,000	296,011,200	
17回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	330,409,800	
18回 利付国庫債券(30年)	400,000,000	485,128,000	
19回 利付国庫債券(30年)	280,000,000	339,928,400	
20回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	409,437,600	
21回 利付国庫債券(30年)	310,000,000	377,204,900	
22回 利付国庫債券(30年)	290,000,000	360,528,000	
23回 利付国庫債券(30年)	350,000,000	435,515,500	
24回 利付国庫債券(30年)	270,000,000	336,239,100	
25回 利付国庫債券(30年)	330,000,000	402,398,700	
26回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	764,373,200	
27回 利付国庫債券(30年)	620,000,000	773,753,800	
28回 利付国庫債券(30年)	770,000,000	961,383,500	
29回 利付国庫債券(30年)	860,000,000	1,061,007,800	
30回 利付国庫債券(30年)	880,000,000	1,071,576,000	

31回 利付国庫債券(30年)	720,000,000	865,166,400	
32回 利付国庫債券(30年)	970,000,000	1,180,819,800	
33回 利付国庫債券(30年)	1,180,000,000	1,377,496,600	
34回 利付国庫債券(30年)	1,200,000,000	1,441,080,000	
35回 利付国庫債券(30年)	1,460,000,000	1,705,061,000	
36回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	2,068,634,400	
37回 利付国庫債券(30年)	2,660,000,000	3,061,553,600	
38回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	2,094,884,500	
39回 利付国庫債券(30年)	1,980,000,000	2,278,504,800	
40回 利付国庫債券(30年)	1,620,000,000	1,832,511,600	
41回 利付国庫債券(30年)	1,880,000,000	2,089,244,000	
42回 利付国庫債券(30年)	1,960,000,000	2,176,442,800	
43回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,908,408,800	
44回 利付国庫債券(30年)	1,850,000,000	2,050,947,000	
45回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,645,120,400	
46回 利付国庫債券(30年)	2,690,000,000	2,870,122,400	
47回 利付国庫債券(30年)	1,760,000,000	1,910,620,800	
48回 利付国庫債券(30年)	2,340,000,000	2,443,638,600	
49回 利付国庫債券(30年)	1,810,000,000	1,887,413,700	
50回 利付国庫債券(30年)	2,260,000,000	2,076,194,200	
51回 利付国庫債券(30年)	1,950,000,000	1,586,403,000	
52回 利付国庫債券(30年)	2,110,000,000	1,796,158,600	
53回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	1,623,833,200	
54回 利付国庫債券(30年)	2,050,000,000	1,860,436,500	
55回 利付国庫債券(30年)	1,720,000,000	1,555,361,600	

56回 利付国庫債券(30年)	1,680,000,000	1,513,696,800	
57回 利付国庫債券(30年)	2,070,000,000	1,858,301,100	
58回 利付国庫債券(30年)	2,370,000,000	2,121,837,300	
59回 利付国庫債券(30年)	1,870,000,000	1,626,376,400	
60回 利付国庫債券(30年)	1,470,000,000	1,338,111,600	
61回 利付国庫債券(30年)	1,540,000,000	1,328,850,600	
62回 利付国庫債券(30年)	1,770,000,000	1,441,204,800	
63回 利付国庫債券(30年)	1,810,000,000	1,426,044,700	
64回 利付国庫債券(30年)	1,670,000,000	1,310,849,800	
65回 利付国庫債券(30年)	1,250,000,000	981,287,500	
66回 利付国庫債券(30年)	1,630,000,000	1,277,349,500	
67回 利付国庫債券(30年)	2,250,000,000	1,845,742,500	
68回 利付国庫債券(30年)	2,210,000,000	1,805,105,900	
69回 利付国庫債券(30年)	1,970,000,000	1,651,923,800	
70回 利付国庫債券(30年)	2,290,000,000	1,914,211,000	
71回 利付国庫債券(30年)	2,240,000,000	1,868,272,000	
72回 利付国庫債券(30年)	2,300,000,000	1,914,083,000	
73回 利付国庫債券(30年)	2,250,000,000	1,872,090,000	
74回 利付国庫債券(30年)	2,180,000,000	1,965,902,200	
75回 利付国庫債券(30年)	2,150,000,000	2,089,692,500	
76回 利付国庫債券(30年)	900,000,000	893,412,000	
67回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,329,500	
70回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	51,970,500	
71回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,448,400	
72回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	478,390,800	

73回 利付国庫債券(20年)	380,000,000	396,446,400	
74回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,815,200	
75回 利付国庫債券(20年)	180,000,000	189,129,600	
76回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	73,222,100	
77回 利付国庫債券(20年)	40,000,000	41,934,800	
78回 利付国庫債券(20年)	250,000,000	262,745,000	
79回 利付国庫債券(20年)	50,000,000	52,679,000	
80回 利付国庫債券(20年)	90,000,000	95,056,200	
81回 利付国庫債券(20年)	400,000,000	423,516,000	
82回 利付国庫債券(20年)	140,000,000	148,631,000	
83回 利付国庫債券(20年)	70,000,000	74,693,500	
84回 利付国庫債券(20年)	170,000,000	180,871,500	
85回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	632,609,800	
86回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	129,492,000	
87回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	129,090,000	
88回 利付国庫債券(20年)	590,000,000	639,849,100	
89回 利付国庫債券(20年)	10,000,000	10,808,800	
90回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	510,387,100	
91回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	119,876,900	
92回 利付国庫債券(20年)	1,160,000,000	1,260,351,600	
93回 利付国庫債券(20年)	370,000,000	402,064,200	
94回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	730,976,700	
95回 利付国庫債券(20年)	550,000,000	607,453,000	
96回 利付国庫債券(20年)	120,000,000	131,433,600	
97回 利付国庫債券(20年)	660,000,000	728,818,200	

98回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	175,908,800	
99回 利付国庫債券(20年)	750,000,000	827,977,500	
100回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	924,636,600	
101回 利付国庫債券(20年)	230,000,000	258,674,100	
102回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	565,110,000	
103回 利付国庫債券(20年)	160,000,000	179,942,400	
104回 利付国庫債券(20年)	110,000,000	122,483,900	
105回 利付国庫債券(20年)	640,000,000	715,475,200	
106回 利付国庫債券(20年)	500,000,000	561,875,000	
107回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	673,350,000	
108回 利付国庫債券(20年)	690,000,000	765,975,900	
109回 利付国庫債券(20年)	350,000,000	389,844,000	
110回 利付国庫債券(20年)	440,000,000	495,638,000	
111回 利付国庫債券(20年)	460,000,000	523,139,600	
112回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	836,718,000	
113回 利付国庫債券(20年)	1,170,000,000	1,328,277,600	
114回 利付国庫債券(20年)	820,000,000	933,619,200	
115回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	412,412,400	
116回 利付国庫債券(20年)	530,000,000	608,932,900	
117回 利付国庫債券(20年)	1,070,000,000	1,221,586,900	
118回 利付国庫債券(20年)	555,000,000	631,173,750	
119回 利付国庫債券(20年)	470,000,000	527,457,500	
120回 利付国庫債券(20年)	670,000,000	741,857,500	
121回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	895,164,800	
122回 利付国庫債券(20年)	570,000,000	641,466,600	

123回 利付国庫債券(20年)	1,050,000,000	1,210,429,500	
124回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	686,892,000	
125回 利付国庫債券(20年)	600,000,000	699,072,000	
126回 利付国庫債券(20年)	510,000,000	585,831,900	
127回 利付国庫債券(20年)	540,000,000	615,853,800	
128回 利付国庫債券(20年)	1,370,000,000	1,567,499,200	
129回 利付国庫債券(20年)	760,000,000	863,139,600	
130回 利付国庫債券(20年)	910,000,000	1,036,599,200	
131回 利付国庫債券(20年)	790,000,000	893,039,700	
132回 利付国庫債券(20年)	830,000,000	940,829,900	
133回 利付国庫債券(20年)	1,030,000,000	1,176,733,800	
134回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	1,030,203,000	
135回 利付国庫債券(20年)	740,000,000	840,284,800	
136回 利付国庫債券(20年)	360,000,000	405,489,600	
137回 利付国庫債券(20年)	880,000,000	1,001,466,400	
138回 利付国庫債券(20年)	920,000,000	1,029,710,000	
139回 利付国庫債券(20年)	1,000,000,000	1,128,640,000	
140回 利付国庫債券(20年)	2,790,000,000	3,178,870,200	
141回 利付国庫債券(20年)	2,780,000,000	3,169,227,800	
142回 利付国庫債券(20年)	1,710,000,000	1,966,226,400	
143回 利付国庫債券(20年)	3,220,000,000	3,639,984,600	
144回 利付国庫債券(20年)	1,750,000,000	1,960,700,000	
145回 利付国庫債券(20年)	3,550,000,000	4,052,112,000	
146回 利付国庫債券(20年)	3,980,000,000	4,543,966,000	
147回 利付国庫債券(20年)	4,090,000,000	4,626,280,800	

148回 利付国庫債券(20年)	3,900,000,000	4,365,543,000	
149回 利付国庫債券(20年)	3,460,000,000	3,871,082,600	
150回 利付国庫債券(20年)	4,250,000,000	4,704,155,000	
151回 利付国庫債券(20年)	3,360,000,000	3,638,678,400	
152回 利付国庫債券(20年)	3,540,000,000	3,828,120,600	
153回 利付国庫債券(20年)	4,220,000,000	4,609,126,200	
154回 利付国庫債券(20年)	3,990,000,000	4,306,407,000	
155回 利付国庫債券(20年)	4,060,000,000	4,275,383,000	
156回 利付国庫債券(20年)	3,700,000,000	3,604,096,000	
157回 利付国庫債券(20年)	3,230,000,000	3,052,220,800	
158回 利付国庫債券(20年)	3,490,000,000	3,423,480,600	
159回 利付国庫債券(20年)	3,480,000,000	3,448,610,400	
160回 利付国庫債券(20年)	3,100,000,000	3,104,030,000	
161回 利付国庫債券(20年)	3,190,000,000	3,141,480,100	
162回 利付国庫債券(20年)	3,230,000,000	3,169,469,800	
163回 利付国庫債券(20年)	2,970,000,000	2,903,650,200	
164回 利付国庫債券(20年)	3,930,000,000	3,771,424,500	
165回 利付国庫債券(20年)	3,190,000,000	3,048,810,600	
166回 利付国庫債券(20年)	2,940,000,000	2,886,462,600	
167回 利付国庫債券(20年)	3,470,000,000	3,288,692,500	
168回 利付国庫債券(20年)	3,070,000,000	2,851,262,500	
169回 利付国庫債券(20年)	2,700,000,000	2,455,407,000	
170回 利付国庫債券(20年)	2,520,000,000	2,280,423,600	
171回 利付国庫債券(20年)	2,340,000,000	2,108,503,800	
172回 利付国庫債券(20年)	2,460,000,000	2,246,791,800	

	173回 利付国庫債券(20年)	3,620,000,000	3,292,498,600	
	174回 利付国庫債券(20年)	3,490,000,000	3,160,858,100	
	175回 利付国庫債券(20年)	2,930,000,000	2,693,080,200	
	176回 利付国庫債券(20年)	3,280,000,000	3,004,808,000	
	177回 利付国庫債券(20年)	3,330,000,000	2,986,244,100	
	178回 利付国庫債券(20年)	3,400,000,000	3,096,006,000	
	179回 利付国庫債券(20年)	3,460,000,000	3,144,724,800	
	180回 利付国庫債券(20年)	3,300,000,000	3,164,799,000	
	181回 利付国庫債券(20年)	2,900,000,000	2,826,978,000	
	182回 利付国庫債券(20年)	900,000,000	907,389,000	
	国債証券 合計	674,885,000,000	677,101,432,750	
地方債証券	726回 東京都公募公債	400,000,000	403,112,000	
	760回 東京都公募公債	100,000,000	99,827,000	
	783回 東京都公募公債	110,000,000	110,152,900	
	796回 東京都公募公債	200,000,000	197,174,000	
	802回 東京都公募公債	400,000,000	395,408,000	
	813回 東京都公募公債	300,000,000	296,181,000	
	1回 東京都公募公債 30年	200,000,000	235,158,000	
	14回 東京都公募公債 30年	100,000,000	115,856,000	
	5回 東京都公募公債 20年	100,000,000	104,812,000	
	7回 東京都公募公債 20年	100,000,000	105,981,000	
	9回 東京都公募公債 20年	200,000,000	217,030,000	
	10回 東京都公募公債 20年	300,000,000	325,791,000	
	18回 東京都公募公債 20年	100,000,000	112,473,000	
	21回 東京都公募公債 20年	100,000,000	113,415,000	
	31回 東京都公募公債 20年	200,000,000	214,386,000	
	28年度6回 北海道公募公債	100,000,000	99,886,000	
	30年度8回 北海道公募公債	400,000,000	400,896,000	
	30年度14回 北海道公募公債	400,000,000	399,288,000	
	令和2年度19回 北海道公募公債	100,000,000	98,425,000	
	36回2号 宮城県公募公債 10年	250,000,000	246,182,500	
	208回 神奈川県公募公債	300,000,000	302,367,000	
	213回 神奈川県公募公債	100,000,000	101,112,000	

237回 神奈川県公募公債	200,000,000	198,978,000	
251回 神奈川県公募公債 10年	200,000,000	197,624,000	
258回 神奈川県公募公債 10年	300,000,000	295,719,000	
3回 神奈川県公募公債 30 年	100,000,000	124,162,000	
11回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	112,095,000	
16回 神奈川県公募公債 2 0年	300,000,000	341,964,000	
19回 神奈川県公募公債 2 0年	100,000,000	112,710,000	
413回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	99,649,000	
419回 大阪府公募公債 1 0年	100,000,000	100,213,000	
464回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	195,714,000	
467回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	197,100,000	
469回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	196,442,000	
472回 大阪府公募公債 1 0年	200,000,000	195,430,000	
474回 大阪府公募公債 1 0年	300,000,000	293,049,000	
10回 大阪府公募公債 20 年	200,000,000	223,910,000	
13回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	106,138,000	
14回 大阪府公募公債 20 年	100,000,000	96,870,000	
190回 大阪府公募公債 5 年	300,000,000	298,476,000	
26年度11回 京都府公募公 債	350,000,000	353,059,000	
29年度13回 京都府公募公 債	109,330,000	109,416,370	
令和2年度1回 京都府公募公 債	400,000,000	395,372,000	
令和2年度14回 京都府公募 公債	200,000,000	197,872,000	
26年度17回 兵庫県公募公 債	200,000,000	201,830,000	
令和元年度16回 兵庫県公募 公債	200,000,000	197,208,000	
令和3年度2回 兵庫県公募公 債	100,000,000	98,601,000	
2回 兵庫県公募公債 30年	100,000,000	120,505,000	
1回 兵庫県公募公債 15年	200,000,000	211,694,000	

1回 兵庫県公募公債(12年)	300,000,000	305,058,000	
5回 兵庫県公募公債 15年	300,000,000	318,291,000	
9回 兵庫県公募公債 15年	100,000,000	105,076,000	
5回 兵庫県公募公債 12年	100,000,000	102,480,000	
令和元年度 9回 静岡県公募公債	200,000,000	197,310,000	
令和2年度 10回 静岡県公募公債	100,000,000	98,587,000	
令和2年度 14回 静岡県公募公債	200,000,000	196,666,000	
2回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	105,759,000	
4回 静岡県公募公債 15年	100,000,000	106,343,000	
8回 静岡県公募公債 15年	200,000,000	207,658,000	
1回 静岡県公募公債 20年	100,000,000	106,023,000	
7回 静岡県公募公債 20年	300,000,000	336,819,000	
22年度14回 愛知県公募公債	300,000,000	341,466,000	
24年度12回 愛知県公募公債 30年	100,000,000	116,891,000	
26年度4回 愛知県公募公債 20年	200,000,000	221,360,000	
27年度8回 愛知県公募公債 30年	150,000,000	158,871,000	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	100,000,000	101,250,000	
30年度19回 愛知県公募公債	200,000,000	198,608,000	
令和元年度7回 愛知県公募公債	300,000,000	227,814,000	
30年度3回 広島県公募公債	100,000,000	100,286,000	
令和2年 7回 広島県公募公債	200,000,000	197,868,000	
27年度 2回 広島県公募公債 30年	100,000,000	87,912,000	
令和2年 2回 広島県公募公債	100,000,000	90,109,000	
25年度8回 埼玉県公募公債	100,000,000	100,758,000	
26年度5回 埼玉県公募公債	400,000,000	403,736,000	
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	200,000,000	197,986,000	
6回 埼玉県公募公債 30年	200,000,000	184,098,000	
12回 埼玉県公募公債 30年	300,000,000	233,766,000	
9回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	113,652,000	
13回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	111,381,000	
14回 埼玉県公募公債 20年	300,000,000	332,298,000	
15回 埼玉県公募公債 20年	100,000,000	106,171,000	

25年度11回 福岡県公募公債	200,000,000	201,688,000	
28年度8回 福岡県公募公債	100,000,000	100,506,000	
30年度6回 福岡県公募公債	200,000,000	199,762,000	
令和元年度1回 福岡県公募公債	200,000,000	197,248,000	
令和2年5回 福岡県公募公債	100,000,000	98,479,000	
24年度1回 福岡県公募公債 15年	100,000,000	105,773,000	
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	200,000,000	154,590,000	
20回2号 福岡県公募公債	100,000,000	111,019,000	
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	100,000,000	113,930,000	
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	300,000,000	333,387,000	
27年度4回 千葉県公募公債	200,000,000	202,920,000	
27年度9回 千葉県公募公債	100,000,000	100,120,000	
令和3年5回 千葉県公募公債	200,000,000	195,776,000	
14回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	106,639,000	
18回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	105,737,000	
21回 千葉県公募公債 20年	100,000,000	95,410,000	
25年度2回 新潟県公募公債	100,000,000	100,817,000	
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	200,000,000	197,456,000	
5回 群馬県公募公債 20年	100,000,000	110,495,000	
132回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,833,000	
142回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	503,075,000	
144回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	403,876,000	
146回 共同発行市場公募地方債	600,000,000	607,464,000	
148回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	506,640,000	
150回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,861,000	
153回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,277,000	
157回 共同発行市場公募地方債	120,000,000	120,063,600	
159回 共同発行市場公募地方債	200,000,000	199,964,000	
160回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	499,445,000	

166回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,295,000	
169回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,585,000	
173回 共同発行市場公募地方債	400,000,000	401,044,000	
174回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,879,000	
178回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,258,000	
179回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,440,000	
189回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,942,000	
194回 共同発行市場公募地方債	300,000,000	297,573,000	
196回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	493,895,000	
203回 共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,638,000	
227回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	492,905,000	
228回 共同発行市場公募地方債	500,000,000	490,505,000	
30年度3回 堺市公募公債	100,000,000	99,820,000	
26年度1回 長崎県公募公債	100,000,000	100,920,000	
令和元年度1回 島根県公募公債	200,000,000	187,400,000	
令和2年度1回 福島県公募公債	200,000,000	196,886,000	
26年度1回 静岡市公募公債	100,000,000	100,916,000	
26年度1回 浜松市公募公債	100,000,000	100,604,000	
29年度4回 大阪市公募公債	200,000,000	199,806,000	
令和2年 2回 大阪市公募公債	300,000,000	296,175,000	
6回 大阪市公募公債 20年	200,000,000	223,966,000	
488回 名古屋市公募公債 10年	450,000,000	454,446,000	
511回 名古屋市公募公債 10年	200,000,000	196,906,000	
16回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	110,441,000	
17回 名古屋市公募公債 20年	100,000,000	106,426,000	
5回 京都市公募公債 30年 定時償還	200,000,000	184,320,000	
4回 京都市公募公債 20年	100,000,000	109,288,000	
9回 京都市公募公債 20年	200,000,000	228,558,000	
24年度12回 神戸市公募公債	200,000,000	224,558,000	
26年度4回 神戸市公募公債	100,000,000	100,910,000	

30年度7回 神戸市公募公債 30年	300,000,000	300,852,000	
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	200,000,000	162,846,000	
令和元年度3回 横浜市公募公債	400,000,000	394,428,000	
2回 横浜市公募公債 30年	100,000,000	121,637,000	
17回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	111,140,000	
29回 横浜市公募公債 20年	100,000,000	110,495,000	
23年度7回 札幌市公募公債 30年	100,000,000	116,240,000	
26年度4回 札幌市公募公債 10年	100,000,000	100,771,000	
29年度5回 札幌市公募公債 20年	300,000,000	289,446,000	
第91回 川崎市公募公債	200,000,000	199,770,000	
6回 川崎市公募公債 20年	200,000,000	225,382,000	
5回 川崎市公募公債 30年	100,000,000	116,523,000	
6回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	110,865,000	
11回 北九州市公募公債 20年	300,000,000	342,693,000	
17回 北九州市公募公債 20年	100,000,000	110,384,000	
22年度8回 福岡市公募公債	100,000,000	119,155,000	
30年度7回 福岡市公募公債	200,000,000	192,874,000	
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	100,000,000	89,020,000	
26年度3回 広島市公募公債	100,000,000	100,843,000	
29年度2回 広島市公募公債	200,000,000	193,756,000	
29年度6回 広島市公募公債	300,000,000	300,708,000	
30年度2回 仙台市公募公債 20年	100,000,000	96,823,000	
令和3年度3回 仙台市公募公債 5年	300,000,000	298,530,000	
17回 さいたま市公募公債	200,000,000	197,774,000	
令和2年度1回 高知県公募公債	200,000,000	196,886,000	
26年度1回 相模原市公募公債	100,000,000	100,860,000	
26年度1回 三重県公募公債	100,000,000	100,838,000	
30年度3回 岡山県公募公債 10年	200,000,000	199,048,000	
地方債証券 合計	33,739,330,000	34,259,207,370	
特殊債券			
9回 新関西国際空港社債	200,000,000	210,278,000	
12回 新関西国際空港社債	200,000,000	208,830,000	
78回 日本政策投資銀行債券	300,000,000	300,543,000	
125回 日本政策投資銀行債券	500,000,000	443,420,000	

127回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	99,869,000	
131回 日本政策投資銀行債券	100,000,000	80,055,000	
156回 日本政策投資銀行債券	400,000,000	394,280,000	
33回 政保日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,006,000	
1回 高速道路機構債	300,000,000	390,615,000	
19回 高速道路機構債	150,000,000	188,227,500	
26回 高速道路機構債	200,000,000	247,354,000	
36回 高速道路機構債	300,000,000	381,585,000	
50回 高速道路機構債	300,000,000	276,636,000	
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,125,000	
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	110,155,000	
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,760,000	
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	106,905,000	
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,312,000	
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	104,762,000	
169回 高速道路機構債	100,000,000	95,841,000	
172回 高速道路機構債	200,000,000	186,992,000	
210回 高速道路機構債	100,000,000	95,539,000	
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,225,000	
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	111,962,000	
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	559,720,000	
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	113,129,000	
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	109,826,000	
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,857,000	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,993,000	
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	202,032,000	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	319,620,000	
241回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	500,000,000	505,120,000	
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	107,788,000	

254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	101,157,000	
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	205,412,000	
第262回 政保道路債	500,000,000	527,335,000	
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,304,000	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	300,000,000	300,006,000	
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	189,356,000	
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	100,156,000	
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	800,000,000	801,496,000	
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	195,670,000	
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	100,000,000	96,578,000	
398回 政保道路債	300,000,000	233,217,000	
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	150,872,000	
418回 高速道路機構債	200,000,000	161,024,000	
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	200,000,000	163,282,000	
28回 日本道路・機構承継債	500,000,000	618,270,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	221,546,000	
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	338,601,000	
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	339,231,000	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	113,887,000	
79回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	316,191,000	
19回 地方公共団体金融機構債券	200,000,000	225,074,000	
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	111,491,000	
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	223,302,000	
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	340,275,000	
56回 政保地方公共団体金融機構債券	542,000,000	546,899,680	
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	110,541,000	

64回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	302,832,000	
39回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	544,580,000	
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	311,712,000	
71回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,909,000	
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	200,000,000	214,042,000	
288回 政保地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,816,000	
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	400,000,000	399,936,000	
91回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,061,000	
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	100,000,000	97,460,000	
96回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	500,535,000	
98回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,209,000	
103回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,101,000	
113回 政保地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,325,000	
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	300,000,000	260,700,000	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	300,000,000	229,878,000	
F538回 地方公共団体金融機構債券	500,000,000	498,930,000	
15回 日本政策金融公庫債券	200,000,000	223,430,000	
40回 政保日本政策金融公庫債券	103,000,000	103,018,540	
23回 国際協力銀行債券	100,000,000	106,160,000	
93回 都市再生債券	100,000,000	105,082,000	
109回 都市再生機構債券	200,000,000	207,950,000	
165回 都市再生機構債券	200,000,000	160,442,000	
11回 独立行政法人福祉医療機構	100,000,000	108,275,000	
21回 政保中部国際空港債券	100,000,000	101,007,000	
39回 住宅金融支援機構債券	200,000,000	224,538,000	
61回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,356,000	
75回 住宅金融支援機構債券	350,000,000	398,160,000	
80回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,591,000	
115回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	112,716,000	
124回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,044,000	

148回 住宅金融支援機構債券	250,000,000	280,255,000	
159回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,907,000	
172回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,210,000	
187回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,950,000	
222回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	299,628,000	
230回 住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,156,000	
233回 住宅金融支援機構債券	100,000,000	94,809,000	
321回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,700,000	
325回 住宅金融支援機構債券	500,000,000	497,700,000	
2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	30,306,000	30,524,809	
40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,180,000	47,086,051	
43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,329,000	10,406,777	
44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,670,000	50,051,961	
51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,457,000	29,641,989	
4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	10,067,000	10,133,140	
27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	16,661,000	17,494,883	
29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,850,000	110,064,384	
36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,568,000	165,375,494	
38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,045,000	23,077,808	
49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,925,000	19,794,414	
52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	22,212,000	23,157,564	
53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	23,289,000	24,283,207	
60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,898,000	30,098,422	
64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	70,500,000	73,071,135	
76回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,067,000	33,290,676	

8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,171,000	39,303,915	
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,621,000	39,790,830	
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,442,000	43,694,463	
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,211,000	45,222,547	
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,607,000	49,902,657	
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,832,000	56,571,215	
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,845,000	58,983,389	
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	216,789,000	213,480,799	
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,576,000	72,893,214	
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,375,000	72,771,123	
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,384,000	72,718,407	
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,212,000	226,174,941	
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	229,515,000	226,327,036	
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	155,682,000	153,451,076	
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,544,000	229,709,207	
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	233,466,000	229,639,492	
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	402,315,000	397,278,015	
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,559,000	79,469,842	
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,873,000	80,921,340	
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	265,509,000	258,234,053	
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	354,496,000	345,956,191	
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	272,841,000	266,429,236	
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	279,948,000	273,783,545	
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	849,681,000	827,759,230	
6 回 沖縄振興開発金融公庫債券	400,000,000	420,328,000	

	21回 沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,393,000	
	い第828号 利付商工債	100,000,000	100,047,000	
	い第843号 利付商工債	100,000,000	99,956,000	
	い第851号 利付商工債	300,000,000	299,436,000	
	い第854号 利付商工債	300,000,000	299,115,000	
	い第855号 利付商工債	200,000,000	199,322,000	
	369回 利附信金中金債(5年)	400,000,000	399,320,000	
	377回 利附信金中金債(5年)	300,000,000	299,127,000	
	7回 広島県・広島市折半保証 広島高速道路債券	100,000,000	100,730,000	
	15回 国際協力機構債	100,000,000	111,906,000	
	72回 東日本高速道路社債	200,000,000	198,592,000	
	77回 東日本高速道路社債	300,000,000	297,135,000	
	85回 中日本高速道路債券	300,000,000	299,205,000	
	87回 中日本高速道路債券	400,000,000	398,612,000	
	71回 鉄道建設運輸施設債	100,000,000	100,887,000	
	78回 鉄道建設・運輸施設整備 支援機構債券	100,000,000	103,124,000	
	90回 鉄道建設・運輸施設整備 支援機構債券	200,000,000	196,286,000	
	特殊債券 合計	31,000,518,000	31,629,909,197	
社債券	25回 フランス相互信用連合 銀行(BFCM)円貨社債(2017)	300,000,000	295,413,000	
	2回 BPCE SA円貨社債 (ソーシャルボンド)	100,000,000	99,673,000	
	6回 クレディ・アグリコ ル・エス・エー円貨社債	200,000,000	201,108,000	
	11回 クレディ・アグリ コル・エス・エー円貨社債(2016)	100,000,000	98,708,000	
	25回 首都高速道路社債	100,000,000	99,833,000	
	27回 首都高速道路社債	400,000,000	398,652,000	
	16回 成田国際空港社債	100,000,000	100,811,000	
	37回 成田国際空港社債	100,000,000	87,524,000	
	57回 東日本高速道路社債	100,000,000	99,731,000	
	67回 東日本高速道路社債	200,000,000	197,654,000	
	79回 東日本高速道路社債	300,000,000	298,551,000	
	83回 東日本高速道路社債	200,000,000	199,034,000	
	56回 中日本高速道路社債	100,000,000	100,755,000	
	90回 中日本高速道路債券	200,000,000	198,968,000	
	91回 中日本高速道路債券	500,000,000	496,850,000	
	25回 西日本高速道路社債	200,000,000	201,676,000	
	26回 西日本高速道路社債	100,000,000	101,217,000	
	33回 西日本高速道路債券	300,000,000	300,423,000	
	34回 西日本高速道路債券	200,000,000	200,744,000	
	61回 西日本高速道路債券	500,000,000	497,405,000	
62回 西日本高速道路債券	500,000,000	496,845,000		

24回 大和ハウス工業社債	200,000,000	199,430,000	
10回 キリンホールディングス社債	100,000,000	101,029,000	
3回 ダイドグループHD社債	300,000,000	296,910,000	
9回 野村不動産ホールディングス社債	100,000,000	97,633,000	
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	100,000,000	101,462,000	
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	200,000,000	199,762,000	
30回 東レ社債	300,000,000	300,138,000	
42回 王子ホールディングス社債	200,000,000	199,652,000	
49回 住友化学社債	100,000,000	101,128,000	
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	200,000,000	195,634,000	
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	100,000,000	99,574,000	
17回 ダイセル社債	300,000,000	297,918,000	
16回 武田薬品工業社債	500,000,000	484,885,000	
4回 住友三井オートサービス社債	100,000,000	99,666,000	
4回 ENEOSホールディングス社債	300,000,000	299,433,000	
14回 プリヂストーン社債	300,000,000	299,793,000	
35回 三菱マテリアル社債	300,000,000	298,617,000	
17回 パナソニック社債	100,000,000	100,729,000	
19回 パナソニック社債	100,000,000	98,894,000	
23回 パナソニック社債	200,000,000	196,832,000	
29回 三菱重工業社債	100,000,000	100,861,000	
58回 川崎重工業社債	300,000,000	293,352,000	
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	100,000,000	99,289,000	
16回 トヨタ自動車社債	200,000,000	201,510,000	
26回 トヨタ自動車社債	200,000,000	199,604,000	
26回 豊田通商社債	100,000,000	96,082,000	
73回 三井物産社債	400,000,000	395,856,000	
12回 新生銀行社債	400,000,000	398,780,000	
13回 新生銀行社債	200,000,000	199,294,000	
88回 三菱東京UFJ銀行社債	100,000,000	108,726,000	
12回 りそな銀行劣後社債	100,000,000	107,355,000	
20回 三井住友信託銀行社債	300,000,000	297,699,000	
10回 三井住友信託銀行社債	200,000,000	201,306,000	
11回 セブン銀行社債	200,000,000	201,432,000	
28回 芙蓉総合リース社債	300,000,000	297,339,000	
17回 NTTファイナンス社債	300,000,000	299,370,000	
18回 NTTファイナンス社債	400,000,000	397,252,000	

69回	ホンダファイナンス社債	300,000,000	298,869,000	
81回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,830,000	
96回	トヨタファイナンス社債	100,000,000	99,831,000	
80回	日立キャピタル社債	200,000,000	195,700,000	
86回	日立キャピタル社債	300,000,000	293,448,000	
23回	三井住友ファイナンス&リース社債	100,000,000	98,821,000	
27回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	198,584,000	
29回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	199,350,000	
31回	三井住友ファイナンス&リース社債	200,000,000	196,088,000	
56回	三菱UFJリース社債	300,000,000	299,451,000	
3回	野村ホールディングス社債	300,000,000	296,490,000	
72回	三菱地所社債	100,000,000	103,942,000	
106回	住友不動産社債	100,000,000	100,558,000	
108回	住友不動産社債	200,000,000	200,442,000	
80回	東京急行電鉄社債	100,000,000	104,601,000	
43回	京浜急行電鉄社債	100,000,000	93,111,000	
39回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	314,262,000	
42回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	210,746,000	
65回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	111,888,000	
71回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	110,928,000	
73回	東日本旅客鉄道普通社債	200,000,000	225,300,000	
107回	東日本旅客鉄道普通社債	100,000,000	100,743,000	
125回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	93,046,000	
127回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	95,408,000	
147回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	98,461,000	
160回	東日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,204,000	
163回	東日本旅客鉄道社債	300,000,000	298,071,000	
165回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	179,270,000	
171回	東日本旅客鉄道社債	200,000,000	162,404,000	
21回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	111,537,000	
60回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	196,674,000	
70回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	83,157,000	
71回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	75,958,000	
74回	西日本旅客鉄道社債	100,000,000	97,694,000	
75回	西日本旅客鉄道社債	200,000,000	178,846,000	
13回	東海旅客鉄道社債	200,000,000	204,084,000	
14回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	102,707,000	
32回	東海旅客鉄道社債	100,000,000	109,316,000	
4回	東京地下鉄社債	120,000,000	129,009,600	
47回	東京地下鉄社債	100,000,000	76,062,000	

7回	ニッコンHD社債	300,000,000	294,249,000	
6回	横浜高速鉄道社債	200,000,000	196,498,000	
12回	ソフトバンク社債	400,000,000	392,560,000	
30回	光通信社債	200,000,000	190,002,000	
527回	中部電力社債	100,000,000	94,673,000	
532回	中部電力社債	200,000,000	194,100,000	
497回	関西電力社債	100,000,000	101,657,000	
508回	関西電力社債	300,000,000	298,917,000	
530回	関西電力社債	400,000,000	390,212,000	
531回	関西電力社債	200,000,000	178,272,000	
541回	関西電力社債	300,000,000	285,930,000	
396回	中国電力社債	200,000,000	193,528,000	
425回	中国電力社債	100,000,000	96,993,000	
307回	北陸電力社債	100,000,000	102,409,000	
311回	北陸電力社債	100,000,000	101,529,000	
471回	東北電力社債	400,000,000	404,392,000	
488回	東北電力社債	100,000,000	99,379,000	
521回	東北電力社債	400,000,000	390,096,000	
525回	東北電力社債	200,000,000	196,678,000	
536回	東北電力社債	300,000,000	285,333,000	
320回	四国電力社債	300,000,000	288,402,000	
426回	九州電力社債	400,000,000	404,348,000	
428回	九州電力社債	100,000,000	101,154,000	
463回	九州電力社債	100,000,000	92,505,000	
466回	九州電力社債	100,000,000	91,194,000	
491回	九州電力社債	300,000,000	287,160,000	
492回	九州電力社債	100,000,000	86,046,000	
493回	九州電力社債	200,000,000	197,910,000	
507回	九州電力社債	200,000,000	193,592,000	
321回	北海道電力社債	261,000,000	264,387,780	
340回	北海道電力社債	300,000,000	299,700,000	
350回	北海道電力社債	200,000,000	185,232,000	
13回	電源開発社債	200,000,000	209,066,000	
38回	電源開発社債	300,000,000	302,700,000	
54回	電源開発社債	100,000,000	99,112,000	
75回	電源開発社債	200,000,000	192,548,000	
41回	東京瓦斯社債	200,000,000	191,304,000	
52回	東京瓦斯社債	100,000,000	90,707,000	
55回	東京瓦斯社債	100,000,000	87,076,000	
57回	東京瓦斯社債	300,000,000	215,616,000	
7回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	200,438,000	
8回	ファーストリテイリング社債	200,000,000	191,002,000	
社債券 合計		28,281,000,000	27,814,299,380	
合計			770,804,848,697	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2022年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	9,742,539,968
株式	369,641,938,680
派生商品評価勘定	279,002,160
未収配当金	3,732,089,883
差入委託証拠金	315,090,000
流動資産合計	383,710,660,691
資産合計	383,710,660,691
負債の部	
流動負債	
前受金	89,745,000
未払金	5,975,785,629
未払解約金	237,892,000
流動負債合計	6,303,422,629
負債合計	6,303,422,629
純資産の部	
元本等	
元本	112,340,543,501
剰余金	
剰余金又は欠損金()	265,066,694,561
元本等合計	377,407,238,062
純資産合計	377,407,238,062
負債純資産合計	383,710,660,691

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	141,707,381,255円
同期中追加設定元本額	163,439,412,971円
同期中一部解約元本額	192,806,250,725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	2,644,249,719円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	4,104,798,560円
One DC 国内株式インデックスファンド	23,557,449,042円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,855,529,092円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,314,816円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	19,054,777円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	52,565,399円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	26,211,925円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	20,313,275円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	28,002,126円
たわらノーロード TOPIX	1,598,035,347円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,374,586,071円
たわらノーロード バランス(堅実型)	48,303,590円
たわらノーロード バランス(標準型)	320,087,690円
たわらノーロード バランス(積極型)	506,308,448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)	4,145,066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)	188,774,622円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	457,531,588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)	319,672,524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)	451,904,286円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	659,285円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,858,895円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	45,945,183円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,667,114円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	16,378,587円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,740,650,941円
Oneグローバルバランス	5,321,865円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,080,110,534円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,630,732,823円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,989,964,000円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	346,614,178円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,096,155,174円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,143,931,943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>	1,143,748,865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)	312,476,258円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	358,247,282円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	579,138,973円
投資のソムリエ	5,853,893,573円
クルーズコントロール	472,830,786円
投資のソムリエ<DC年金>	404,634,141円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	362,738,228円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	815,799,590円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	375,780,818円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,710,910,524円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	37,364,785円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	18,676,534円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,538,037円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	68,085,245円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	477,755,844円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	88,414,162円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	268,097,187円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	36,490,417円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	19,205,151円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	12,432,660円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	309,174,567円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,351,519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)	23,255,514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)	23,957,057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)	12,773,022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)	14,627,936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)	23,070,411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)	52,598,309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)	139,550,798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)	20,856,849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)	93,420,529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)	500,696,767円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	151,442,697円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	5,355,744円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	31,042,700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)	49,054,999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)	39,640,070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)	3,195,139円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	4,488,456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)	50,671,328円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	98,264,863円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,816,106円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	24,799,446円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	4,995,143円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	94,241円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	6,939,768円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	27,735,068円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	466,643,569円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	562,273,673円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,646,815,092円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	16,469,736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)	23,798,158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)	245,409,288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)	61,347,605円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	67,381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)	292,359,203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)	17,193,749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)	57,203,815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)	131,906,920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)	197,952,397円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	32,971,593円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	15,927,213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)	177,619,994円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	922,255,638円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,220,307,862円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	48,743,066円
動的パッケージファンド<DC年金>	20,491,294円
コア資産形成ファンド	13,745,203円
MHAMトピックスファンド	770,540,564円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	54,485,328円

MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	2,696,898,556円
MHAM日本株式パッシブファンド [適格機関投資家限定]	1,542,332,531円
計	112,340,543,501円
2. 受益権の総数	112,340,543,501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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的として行っており、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11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	11,061,730,931	
合計	11,061,730,931	

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち		時価(円)
		1年超		
市場取引 先物取引 買建	8,602,450,000	-		8,881,600,000
合計	8,602,450,000	-		8,881,600,000

(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11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.3595円 (33,595円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

2022年11月11日現在

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
極洋	6,900	3,660.00	25,254,000	
日本水産	181,400	503.00	91,244,200	
マルハニチロ	28,100	2,384.00	66,990,400	
雪国まいたけ	15,500	1,050.00	16,275,000	
カネコ種苗	6,000	1,433.00	8,598,000	
サカタのタネ	23,000	4,760.00	109,480,000	
ホクト	16,300	1,897.00	30,921,100	
ホクリヨウ	2,600	633.00	1,645,800	
ショーボンドホールディングス	24,700	6,020.00	148,694,000	
ミライト・ワン	62,900	1,461.00	91,896,900	

タマホーム	12,800	2,404.00	30,771,200
サンヨーホームズ	2,200	696.00	1,531,200
日本アクア	7,600	796.00	6,049,600
ファーストコーポレーション	4,800	722.00	3,465,600
ベステラ	4,000	996.00	3,984,000
Robot Home	30,900	185.00	5,716,500
キャンディル	2,800	493.00	1,380,400
住石ホールディングス	28,300	206.00	5,829,800
日鉄鉱業	7,200	3,100.00	22,320,000
三井松島ホールディングス	8,100	2,709.00	21,942,900
I N P E X	671,100	1,569.00	1,052,955,900
石油資源開発	21,000	4,120.00	86,520,000
K & O エナジーグループ	8,200	2,116.00	17,351,200
ダイセキ環境ソリューション	3,800	802.00	3,047,600
第一カッター興業	4,700	1,194.00	5,611,800
明豊ファシリティワークス	6,700	709.00	4,750,300
安藤・間	105,100	872.00	91,647,200
東急建設	51,700	645.00	33,346,500
コムシスホールディングス	61,400	2,449.00	150,368,600
ピーアールホールディングス	28,900	347.00	10,028,300
高松コンストラクショングループ	11,800	1,949.00	22,998,200
東建コーポレーション	5,900	7,910.00	46,669,000
ソネック	2,000	922.00	1,844,000
ヤマウラ	9,400	985.00	9,259,000
オリエンタル白石	65,400	269.00	17,592,600
大成建設	126,300	4,025.00	508,357,500
大林組	453,900	994.00	451,176,600
清水建設	381,700	727.00	277,495,900
飛島建設	14,000	1,037.00	14,518,000
長谷工コーポレーション	131,000	1,512.00	198,072,000
松井建設	11,900	565.00	6,723,500
銭高組	1,500	2,803.00	4,204,500
鹿島建設	281,500	1,521.00	428,161,500
不動テトラ	8,700	1,494.00	12,997,800
大末建設	4,700	1,194.00	5,611,800
鉄建建設	9,300	1,755.00	16,321,500
西松建設	21,600	3,695.00	79,812,000
三井住友建設	102,400	407.00	41,676,800
大豊建設	5,300	4,180.00	22,154,000
佐田建設	8,200	437.00	3,583,400
ナカノフドー建設	9,300	309.00	2,873,700
奥村組	20,500	2,830.00	58,015,000
東鉄工業	17,500	2,434.00	42,595,000
イチケン	2,800	1,768.00	4,950,400
富士ピー・エス	6,000	439.00	2,634,000
浅沼組	10,200	2,819.00	28,753,800
戸田建設	156,200	707.00	110,433,400
熊谷組	22,000	2,496.00	54,912,000
北野建設	2,300	2,364.00	5,437,200
植木組	3,700	1,223.00	4,525,100

矢作建設工業	17,400	727.00	12,649,800
ピーエス三菱	16,200	588.00	9,525,600
日本ハウスホールディングス	25,100	424.00	10,642,400
大東建託	46,700	14,830.00	692,561,000
新日本建設	17,900	739.00	13,228,100
東亜道路工業	2,300	5,980.00	13,754,000
日本道路	2,500	6,230.00	15,575,000
東亜建設工業	10,900	2,228.00	24,285,200
日本国土開発	38,100	581.00	22,136,100
若築建設	5,700	2,526.00	14,398,200
東洋建設	41,200	851.00	35,061,200
五洋建設	180,000	633.00	113,940,000
世紀東急工業	16,900	785.00	13,266,500
福田組	4,400	4,805.00	21,142,000
日本ドライケミカル	3,300	1,524.00	5,029,200
住友林業	97,300	2,344.00	228,071,200
日本基礎技術	8,000	416.00	3,328,000
巴コーポレーション	14,200	376.00	5,339,200
大和ハウス工業	354,700	3,163.00	1,121,916,100
ライト工業	24,200	2,030.00	49,126,000
積水ハウス	397,600	2,501.00	994,397,600
日特建設	12,200	899.00	10,967,800
北陸電気工事	8,700	671.00	5,837,700
ユアテック	28,100	705.00	19,810,500
日本リーテック	8,300	744.00	6,175,200
四電工	5,400	1,711.00	9,239,400
中電工	19,700	2,057.00	40,522,900
関電工	69,700	849.00	59,175,300
きんでん	89,500	1,452.00	129,954,000
東京エネシス	12,600	943.00	11,881,800
トーエネック	4,300	3,405.00	14,641,500
住友電設	12,100	2,526.00	30,564,600
日本電設工業	20,900	1,610.00	33,649,000
エクシオグループ	62,200	2,133.00	132,672,600
新日本空調	7,000	1,933.00	13,531,000
日本工営	9,600	3,420.00	32,832,000
九電工	30,900	3,335.00	103,051,500
三機工業	28,300	1,574.00	44,544,200
日揮ホールディングス	125,600	1,855.00	232,988,000
中外炉工業	4,200	1,559.00	6,547,800
ヤマト	10,700	679.00	7,265,300
太平電業	7,800	3,155.00	24,609,000
高砂熱学工業	30,600	1,828.00	55,936,800
三晃金属工業	1,500	2,930.00	4,395,000
NEC ネットズエスアイ	43,300	1,682.00	72,830,600
朝日工業社	5,300	1,920.00	10,176,000
明星工業	22,000	733.00	16,126,000
大気社	15,400	3,520.00	54,208,000
ダイダン	8,300	2,112.00	17,529,600
日比谷総合設備	11,000	1,881.00	20,691,000

ニッポン	34,500	1,574.00	54,303,000
日清製粉グループ本社	117,800	1,577.00	185,770,600
日東富士製粉	2,200	4,295.00	9,449,000
昭和産業	11,200	2,524.00	28,268,800
鳥越製粉	10,300	622.00	6,406,600
中部飼料	17,700	1,048.00	18,549,600
フィード・ワン	18,600	692.00	12,871,200
東洋精糖	1,600	882.00	1,411,200
日本甜菜製糖	7,500	1,632.00	12,240,000
D M三井製糖ホールディングス	12,700	1,925.00	24,447,500
塩水港精糖	15,800	196.00	3,096,800
日新製糖	6,600	1,691.00	11,160,600
L I F U L L	45,400	244.00	11,077,600
M I X I	30,300	2,344.00	71,023,200
ジェイエイシーリクルートメント	12,000	2,534.00	30,408,000
日本M&Aセンターホールディングス	228,200	1,790.00	408,478,000
メンバーズ	4,000	2,021.00	8,084,000
中広	1,000	365.00	365,000
U Tグループ	19,500	2,644.00	51,558,000
アイティメディア	5,100	1,748.00	8,914,800
E・Jホールディングス	8,500	1,289.00	10,956,500
夢真ビーネックスグループ	48,600	1,963.00	95,401,800
コシダカホールディングス	39,900	1,099.00	43,850,100
アルトナー	3,300	1,000.00	3,300,000
パソナグループ	16,200	2,013.00	32,610,600
C D S	3,400	1,936.00	6,582,400
リンクアンドモチベーション	38,200	880.00	33,616,000
エス・エム・エス	50,600	3,575.00	180,895,000
サニーサイドアップグループ	4,700	562.00	2,641,400
パーソルホールディングス	148,900	3,230.00	480,947,000
リニカル	7,500	735.00	5,512,500
クックパッド	36,500	199.00	7,263,500
エスクリ	5,400	363.00	1,960,200
アイ・ケイ・ケイホールディングス	6,600	622.00	4,105,200
森永製菓	26,200	3,630.00	95,106,000
中村屋	2,800	3,085.00	8,638,000
江崎グリコ	36,500	3,515.00	128,297,500
名糖産業	5,100	1,566.00	7,986,600
井村屋グループ	7,000	2,234.00	15,638,000
不二家	8,700	2,611.00	22,715,700
山崎製パン	85,300	1,521.00	129,741,300
第一屋製パン	2,500	407.00	1,017,500
モロゾフ	4,200	3,595.00	15,099,000
亀田製菓	8,100	4,245.00	34,384,500
寿スピリッツ	13,500	7,290.00	98,415,000
カルビー	58,400	2,842.00	165,972,800
森永乳業	23,200	4,420.00	102,544,000
六甲バター	9,500	1,355.00	12,872,500
ヤクルト本社	91,000	7,940.00	722,540,000
明治ホールディングス	79,000	6,460.00	510,340,000

雪印メグミルク	30,800	1,731.00	53,314,800
プリマハム	17,200	1,972.00	33,918,400
日本ハム	49,800	3,630.00	180,774,000
林兼産業	3,800	465.00	1,767,000
丸大食品	12,900	1,407.00	18,150,300
S Foods	14,000	2,810.00	39,340,000
柿安本店	5,000	2,172.00	10,860,000
伊藤ハム米久ホールディングス	99,200	680.00	67,456,000
学情	6,000	1,496.00	8,976,000
スタジオアリス	6,700	2,089.00	13,996,300
クロスキャット	7,400	1,357.00	10,041,800
シミックホールディングス	7,300	1,580.00	11,534,000
エプコ	2,800	669.00	1,873,200
システナ	218,300	439.00	95,833,700
N J S	2,600	2,036.00	5,293,600
デジタルアーツ	8,100	6,110.00	49,491,000
日鉄ソリューションズ	22,200	3,505.00	77,811,000
総合警備保障	49,300	3,680.00	181,424,000
キューブシステム	7,700	1,000.00	7,700,000
いちご	146,700	324.00	47,530,800
日本駐車場開発	151,800	252.00	38,253,600
コア	5,800	1,465.00	8,497,000
カカクコム	99,300	2,350.00	233,355,000
アイロムグループ	4,800	2,262.00	10,857,600
セントケア・ホールディング	8,400	817.00	6,862,800
サイネックス	2,200	532.00	1,170,400
ルネサンス	9,400	923.00	8,676,200
ディップ	23,300	4,140.00	96,462,000
S B Sホールディングス	11,600	2,929.00	33,976,400
デジタルホールディングス	10,400	1,193.00	12,407,200
新日本科学	14,000	2,623.00	36,722,000
キャリアデザインセンター	2,700	1,617.00	4,365,900
ベネフィット・ワン	61,600	2,193.00	135,088,800
エムスリー	262,800	4,567.00	1,200,207,600
ツカダ・グローバルホールディング	8,600	385.00	3,311,000
プラス	1,700	902.00	1,533,400
アウトソーシング	79,200	1,282.00	101,534,400
ウェルネット	11,900	605.00	7,199,500
ワールドホールディングス	6,000	2,852.00	17,112,000
ディー・エヌ・エー	56,700	1,841.00	104,384,700
博報堂D Yホールディングス	169,700	1,365.00	231,640,500
ぐるなび	24,400	392.00	9,564,800
タカミヤ	18,100	382.00	6,914,200
ジャパンベストレスキューシステム	8,200	839.00	6,879,800
ファンコミュニケーションズ	26,100	434.00	11,327,400
ライク	5,000	2,097.00	10,485,000
ビジネス・ブレークスルー	5,100	392.00	1,999,200
エスプール	38,200	934.00	35,678,800
W D Bホールディングス	6,800	2,583.00	17,564,400
手間いらず	2,100	5,080.00	10,668,000

ティア	8,000	434.00	3,472,000
C D G	1,500	1,188.00	1,782,000
アドウェイズ	18,300	600.00	10,980,000
バリューコマース	10,100	2,227.00	22,492,700
インフォマート	138,100	467.00	64,492,700
サッポロホールディングス	42,000	3,535.00	148,470,000
アサヒグループホールディングス	294,400	4,335.00	1,276,224,000
麒麟ホールディングス	575,000	2,175.50	1,250,912,500
宝ホールディングス	87,000	1,043.00	90,741,000
オエノンホールディングス	38,100	270.00	10,287,000
養命酒製造	4,300	1,799.00	7,735,700
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	99,800	1,453.00	145,009,400
サントリー食品インターナショナル	89,700	5,110.00	458,367,000
ダイドーグループホールディングス	7,200	4,575.00	32,940,000
伊藤園	47,500	5,360.00	254,600,000
キーコーヒー	14,200	2,074.00	29,450,800
ユニカフェ	4,400	953.00	4,193,200
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	18,000	3,310.00	59,580,000
不二製油グループ本社	29,700	2,057.00	61,092,900
かどや製油	1,200	3,480.00	4,176,000
J - オイルミルズ	13,000	1,529.00	19,877,000
ローソン	34,000	4,795.00	163,030,000
サンエー	10,500	4,240.00	44,520,000
カワチ薬品	10,700	2,102.00	22,491,400
エービーシー・マート	19,900	6,920.00	137,708,000
ハードオフコーポレーション	5,500	1,257.00	6,913,500
高千穂交易	4,900	2,138.00	10,476,200
アスクル	33,000	1,588.00	52,404,000
ゲオホールディングス	14,300	1,973.00	28,213,900
アダストリア	16,600	2,034.00	33,764,400
ジーフット	7,100	292.00	2,073,200
シー・ヴィ・エス・バイエリア	1,900	405.00	769,500
オルパヘルスケアホールディングス	2,200	1,431.00	3,148,200
伊藤忠食品	2,700	5,110.00	13,797,000
くら寿司	16,100	3,425.00	55,142,500
キャンドウ	4,900	2,150.00	10,535,000
エレマテック	12,300	1,516.00	18,646,800
アイケイ	4,500	415.00	1,867,500
パルグループホールディングス	13,400	2,216.00	29,694,400
エディオン	54,200	1,208.00	65,473,600
あらた	10,500	3,880.00	40,740,000
サーラコーポレーション	28,800	758.00	21,830,400
ワッツ	6,700	660.00	4,422,000
トーメンデバイス	1,900	5,520.00	10,488,000
ハローズ	6,200	2,929.00	18,159,800
J Pホールディングス	38,200	285.00	10,887,000
フジオフードグループ本社	11,500	1,367.00	15,720,500
あみやき亭	3,400	2,898.00	9,853,200

東京エレクトロン デバイス	5,100	7,020.00	35,802,000	
ひらまつ	29,300	192.00	5,625,600	
円谷フィールズホールディングス	11,800	1,997.00	23,564,600	
双日	145,400	2,442.00	355,066,800	
アルフレッサ ホールディングス	137,400	1,607.00	220,801,800	
大黒天物産	4,900	4,660.00	22,834,000	
ハニーズホールディングス	12,200	1,214.00	14,810,800	
ファーマライズホールディングス	3,100	640.00	1,984,000	
キッコーマン	84,400	7,860.00	663,384,000	
味の素	311,900	4,134.00	1,289,394,600	
ブルドックソース	5,100	1,679.00	8,562,900	
キューピー	68,500	2,413.00	165,290,500	
ハウス食品グループ本社	39,000	2,685.00	104,715,000	
カゴメ	59,400	2,944.00	174,873,600	
焼津水産化学工業	5,800	803.00	4,657,400	
アリアケジャパン	11,100	4,905.00	54,445,500	
ピエトロ	1,700	1,797.00	3,054,900	
エバラ食品工業	3,300	3,085.00	10,180,500	
やまみ	1,100	1,307.00	1,437,700	
ニチレイ	58,500	2,619.00	153,211,500	
横浜冷凍	37,400	927.00	34,669,800	
東洋水産	64,500	5,550.00	357,975,000	
イートアンドホールディングス	5,400	2,215.00	11,961,000	
大冷	1,600	1,883.00	3,012,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	8,000	506.00	4,048,000	
日清食品ホールディングス	45,400	10,150.00	460,810,000	
永谷園ホールディングス	6,300	2,006.00	12,637,800	
一正蒲鉾	5,500	750.00	4,125,000	
フジッコ	13,100	1,915.00	25,086,500	
ロック・フィールド	15,700	1,459.00	22,906,300	
日本たばこ産業	839,000	2,780.50	2,332,839,500	
ケンコーマヨネーズ	8,700	1,620.00	14,094,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,500	1,802.00	17,119,000	
なとり	8,000	2,040.00	16,320,000	
イフジ産業	2,200	904.00	1,988,800	
ファーマフーズ	19,600	1,304.00	25,558,400	
北の達人コーポレーション	54,600	278.00	15,178,800	
ユーグレナ	82,000	883.00	72,406,000	
紀文食品	10,000	918.00	9,180,000	
ピクルスホールディングス	7,400	1,074.00	7,947,600	
スター・マイカ・ホールディングス	5,800	1,414.00	8,201,200	
S R Eホールディングス	6,200	4,355.00	27,001,000	
A Dワークスグループ	31,800	165.00	5,247,000	
片倉工業	11,900	1,893.00	22,526,700	
ゲンゼ	9,800	3,820.00	37,436,000	
ヒューリック	297,300	1,116.00	331,786,800	
神栄	1,800	798.00	1,436,400	
ラサ商事	6,300	1,022.00	6,438,600	
アルペン	11,300	1,991.00	22,498,300	
ハブ	4,500	614.00	2,763,000	

ラクーンホールディングス	12,900	1,253.00	16,163,700
クオールホールディングス	18,800	1,145.00	21,526,000
アルコニックス	18,000	1,304.00	23,472,000
神戸物産	105,900	3,485.00	369,061,500
ソリトンシステムズ	6,700	1,180.00	7,906,000
ジーンズホールディングス	8,100	3,925.00	31,792,500
ピックカメラ	91,000	1,143.00	104,013,000
DCMホールディングス	83,600	1,176.00	98,313,600
ペッパーフードサービス	28,600	220.00	6,292,000
ハイパー	2,200	464.00	1,020,800
Monotaro	194,100	2,386.00	463,122,600
東京一番フーズ	3,300	583.00	1,923,900
DDホールディングス	8,700	609.00	5,298,300
あいホールディングス	22,000	2,245.00	49,390,000
ディーブイエックス	3,900	970.00	3,783,000
きちりホールディングス	3,800	309.00	1,174,200
アークランドサービスホールディングス	11,300	2,163.00	24,441,900
J.フロントリテイリング	170,300	1,143.00	194,652,900
ドトール・日レスホールディングス	24,300	1,652.00	40,143,600
マツキヨココカラ&カンパニー	83,100	5,130.00	426,303,000
ブロンコビリー	7,300	2,478.00	18,089,400
ZOZO	90,500	3,290.00	297,745,000
トレジャー・ファクトリー	4,100	2,168.00	8,888,800
物語コーポレーション	7,600	7,240.00	55,024,000
三越伊勢丹ホールディングス	230,500	1,229.00	283,284,500
東洋紡	55,900	1,013.00	56,626,700
ユニチカ	39,100	248.00	9,696,800
富士紡ホールディングス	5,100	3,315.00	16,906,500
日清紡ホールディングス	106,300	1,018.00	108,213,400
倉敷紡績	9,800	2,031.00	19,903,800
ダイワボウホールディングス	55,900	2,115.00	118,228,500
シキボウ	7,200	861.00	6,199,200
日東紡績	15,500	2,123.00	32,906,500
トヨタ紡織	54,500	1,935.00	105,457,500
マクニカホールディングス	33,600	3,500.00	117,600,000
Hamee	5,500	866.00	4,763,000
マーケットエンタープライズ	1,300	1,089.00	1,415,700
ラクト・ジャパン	5,300	2,047.00	10,849,100
ウエルシアホールディングス	71,100	3,025.00	215,077,500
クリエイトSDホールディングス	22,700	3,195.00	72,526,500
グリムス	5,700	1,755.00	10,003,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	19,900	760.00	15,124,000
八洲電機	11,100	1,015.00	11,266,500
メディアスホールディングス	8,700	706.00	6,142,200
レスターホールディングス	13,100	2,151.00	28,178,100
ジューテックホールディングス	2,700	1,130.00	3,051,000
丸善CHIホールディングス	16,400	325.00	5,330,000
大光	6,000	688.00	4,128,000

OCHIホールディングス	3,300	1,231.00	4,062,300	
TOKAIホールディングス	67,600	875.00	59,150,000	
黒谷	3,900	568.00	2,215,200	
ミサワ	2,400	589.00	1,413,600	
ティーライフ	1,700	1,278.00	2,172,600	
Cominix	2,400	727.00	1,744,800	
エー・ピーホールディングス	1,900	443.00	841,700	
三洋貿易	14,000	1,135.00	15,890,000	
チムニー	4,300	1,087.00	4,674,100	
シュッピン	10,200	1,360.00	13,872,000	
ビューティガレージ	2,400	2,748.00	6,595,200	
オイシックス・ラ・大地	18,400	1,859.00	34,205,600	
ウイン・パートナーズ	10,100	979.00	9,887,900	
ネクステージ	31,200	2,778.00	86,673,600	
ジョイフル本田	44,000	1,835.00	80,740,000	
鳥貴族ホールディングス	5,100	2,133.00	10,878,300	
ホットランド	10,500	1,390.00	14,595,000	
すかいらーくホールディングス	187,200	1,549.00	289,972,800	
SFPホールディングス	7,500	1,610.00	12,075,000	
綿半ホールディングス	10,700	1,351.00	14,455,700	
日本毛織	37,600	1,005.00	37,788,000	
ダイトウボウ	21,600	84.00	1,814,400	
トーア紡コーポレーション	4,100	355.00	1,455,500	
ダイドーリミテッド	19,800	173.00	3,425,400	
ヨシックスホールディングス	2,600	2,102.00	5,465,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	44,700	1,059.00	47,337,300	
三栄建築設計	6,200	1,448.00	8,977,600	
野村不動産ホールディングス	79,600	3,230.00	257,108,000	
三重交通グループホールディングス	27,300	496.00	13,540,800	
サムティ	20,200	2,346.00	47,389,200	
ディア・ライフ	19,200	606.00	11,635,200	
コーセーアールイー	4,200	671.00	2,818,200	
地主	9,800	2,048.00	20,070,400	
プレサンスコーポレーション	16,800	1,486.00	24,964,800	
フィル・カンパニー	2,200	1,086.00	2,389,200	
THEグローバル社	7,500	220.00	1,650,000	
ハウスコム	2,000	970.00	1,940,000	
JPMC	6,500	1,019.00	6,623,500	
サンセイランディック	3,900	857.00	3,342,300	
エストラスト	1,500	563.00	844,500	
フージャースホールディングス	19,600	746.00	14,621,600	
オープンハウスグループ	46,700	5,610.00	261,987,000	
東急不動産ホールディングス	383,200	746.00	285,867,200	
飯田グループホールディングス	111,600	2,202.00	245,743,200	
イーランド	1,900	1,544.00	2,933,600	
ムゲンエステート	8,500	471.00	4,003,500	
帝国繊維	14,500	1,580.00	22,910,000	
日本コークス工業	117,100	84.00	9,836,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,200	1,398.00	8,667,600	

ミタチ産業	3,600	992.00	3,571,200
B E E N O S	7,700	2,968.00	22,853,600
あさひ	11,500	1,298.00	14,927,000
日本調剤	9,400	1,198.00	11,261,200
コスモス薬品	15,600	14,390.00	224,484,000
シップヘルスケアホールディングス	49,200	2,887.00	142,040,400
トーエル	6,100	701.00	4,276,100
ソフトクリエイイトホールディングス	5,400	3,470.00	18,738,000
セブン&アイ・ホールディングス	471,900	5,669.00	2,675,201,100
クリエイイト・レストランツ・ホールディングス	103,000	922.00	94,966,000
明治電機工業	5,100	1,026.00	5,232,600
ツルハホールディングス	33,600	8,700.00	292,320,000
デリカフーズホールディングス	5,600	510.00	2,856,000
スターティアホールディングス	2,600	1,203.00	3,127,800
サンマルクホールディングス	11,100	1,590.00	17,649,000
フェリシモ	3,200	989.00	3,164,800
トリドールホールディングス	34,100	2,611.00	89,035,100
帝人	124,500	1,241.00	154,504,500
東レ	868,500	723.50	628,359,750
クラレ	206,200	1,047.00	215,891,400
旭化成	809,600	980.00	793,408,000
T O K Y O B A S E	14,000	343.00	4,802,000
稲葉製作所	7,800	1,370.00	10,686,000
宮地エンジニアリンググループ	3,800	3,310.00	12,578,000
トーカロ	36,700	1,237.00	45,397,900
アルファ	5,000	931.00	4,655,000
S U M C O	254,200	2,078.00	528,227,600
川田テクノロジーズ	3,300	3,560.00	11,748,000
R S T e c h n o l o g i e s	4,400	9,410.00	41,404,000
ジェイテックコーポレーション	1,700	1,548.00	2,631,600
信和	7,300	800.00	5,840,000
ビーロット	8,600	561.00	4,824,600
ファーストブラザーズ	2,500	865.00	2,162,500
A n d D o ホールディングス	7,500	840.00	6,300,000
シーアールイー	5,800	1,498.00	8,688,400
プロパティエージェント	1,500	1,317.00	1,975,500
ケイアイスター不動産	6,100	4,760.00	29,036,000
アグレ都市デザイン	2,200	1,459.00	3,209,800
グッドコムアセット	11,800	682.00	8,047,600
ジェイ・エス・ビー	3,200	4,155.00	13,296,000
ロードスターキャピタル	5,500	1,615.00	8,882,500
テンポイノベーション	4,000	937.00	3,748,000
グローバル・リンク・マネジメント	2,400	1,069.00	2,565,600
フェイスネットワーク	1,700	1,345.00	2,286,500
住江織物	2,300	1,795.00	4,128,500
日本フェルト	7,300	397.00	2,898,100
イチカワ	1,500	1,300.00	1,950,000
エコナックホールディングス	23,100	90.00	2,079,000
日東製網	1,500	1,333.00	1,999,500

芦森工業	2,300	1,104.00	2,539,200	
アツギ	7,400	365.00	2,701,000	
ウイルプラスホールディングス	2,500	978.00	2,445,000	
J Mホールディングス	11,600	1,700.00	19,720,000	
コメダホールディングス	33,600	2,420.00	81,312,000	
サツドラホールディングス	6,200	680.00	4,216,000	
アレンザホールディングス	10,300	969.00	9,980,700	
串カツ田中ホールディングス	3,700	1,810.00	6,697,000	
パロックジャパンリミテッド	8,900	782.00	6,959,800	
クスリのアオキホールディングス	13,700	7,270.00	99,599,000	
ダイニック	3,400	605.00	2,057,000	
共和レザー	7,500	500.00	3,750,000	
ピーバンドットコム	1,700	514.00	873,800	
力の源ホールディングス	7,500	762.00	5,715,000	
FOOD & LIFE COMPANIES	78,600	2,795.00	219,687,000	
アセンテック	4,600	521.00	2,396,600	
セーレン	25,000	2,488.00	62,200,000	
ソトー	4,200	781.00	3,280,200	
東海染工	1,300	1,132.00	1,471,600	
小松マテーレ	18,800	797.00	14,983,600	
ワコールホールディングス	24,900	2,436.00	60,656,400	
ホギメディカル	17,400	3,360.00	58,464,000	
クラウドシアホールディングス	3,100	293.00	908,300	
T S Iホールディングス	46,400	453.00	21,019,200	
マツオカコーポレーション	3,600	980.00	3,528,000	
ワールド	16,700	1,313.00	21,927,100	
T I S	145,900	4,195.00	612,050,500	
J N Sホールディングス	5,800	344.00	1,995,200	
グリー	69,600	797.00	55,471,200	
G M Oペパボ	1,800	2,119.00	3,814,200	
コーエーテクモホールディングス	81,300	2,355.00	191,461,500	
三菱総合研究所	6,400	4,950.00	31,680,000	
ボルテージ	3,800	321.00	1,219,800	
電算	800	1,610.00	1,288,000	
A G S	5,500	626.00	3,443,000	
ファインデックス	10,400	581.00	6,042,400	
ブレインパッド	12,900	904.00	11,661,600	
K L a b	25,500	498.00	12,699,000	
ポールトゥウィンホールディングス	22,200	934.00	20,734,800	
ネクソン	335,400	2,560.00	858,624,000	
アイスタイル	41,500	529.00	21,953,500	
エムアップホールディングス	16,000	1,407.00	22,512,000	
エイチーム	9,700	773.00	7,498,100	
エニグモ	16,500	569.00	9,388,500	
テクノスジャパン	10,700	477.00	5,103,900	
e n i s h	9,800	496.00	4,860,800	
コロプラ	50,400	698.00	35,179,200	
オルトプラス	9,900	268.00	2,653,200	
ブロードリーフ	75,800	506.00	38,354,800	

クロス・マーケティンググループ	5,200	899.00	4,674,800
デジタルハーツホールディングス	8,000	2,006.00	16,048,000
システム情報	11,500	996.00	11,454,000
メディアドゥ	5,300	2,024.00	10,727,200
じげん	37,700	370.00	13,949,000
ブイキューブ	15,600	859.00	13,400,400
エンカレッジ・テクノロジー	3,200	511.00	1,635,200
サイバーリンクス	4,200	1,365.00	5,733,000
ディー・エル・イー	9,400	340.00	3,196,000
フィックスターズ	14,600	1,154.00	16,848,400
CARTA HOLDINGS	6,200	1,742.00	10,800,400
オブティム	10,700	974.00	10,421,800
セレス	5,200	976.00	5,075,200
SHIFT	9,600	26,510.00	254,496,000
特種東海製紙	6,500	3,010.00	19,565,000
ティーガイア	13,500	1,650.00	22,275,000
セック	1,700	2,275.00	3,867,500
テクマトリックス	23,700	1,714.00	40,621,800
プロシップ	5,700	1,560.00	8,892,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	39,800	2,228.00	88,674,400
GMOペイメントゲートウェイ	29,700	11,820.00	351,054,000
ザッパラス	4,900	365.00	1,788,500
システムリサーチ	4,100	2,040.00	8,364,000
インターネットイニシアティブ	72,400	2,462.00	178,248,800
さくらインターネット	14,500	533.00	7,728,500
ヴィンクス	3,900	1,433.00	5,588,700
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4,000	4,695.00	18,780,000
SRAホールディングス	6,600	3,305.00	21,813,000
システムインテグレータ	4,000	460.00	1,840,000
朝日ネット	13,900	591.00	8,214,900
eBASE	18,200	592.00	10,774,400
アバントグループ	16,400	1,503.00	24,649,200
アドソル日進	5,500	1,433.00	7,881,500
ODKソリューションズ	2,800	608.00	1,702,400
フリービット	7,900	1,107.00	8,745,300
コムチュア	17,200	2,569.00	44,186,800
サイバーコム	2,000	1,419.00	2,838,000
アステリア	10,200	844.00	8,608,800
アイル	7,200	1,875.00	13,500,000
王子ホールディングス	540,100	536.00	289,493,600
日本製紙	67,400	936.00	63,086,400
三菱製紙	15,700	280.00	4,396,000
北越コーポレーション	81,900	846.00	69,287,400
中越パルプ工業	5,200	934.00	4,856,800
巴川製紙所	4,100	796.00	3,263,600
大王製紙	57,300	1,112.00	63,717,600
阿波製紙	3,300	303.00	999,900
マークライnz	7,000	2,630.00	18,410,000

メディカル・データ・ビジョン	19,300	1,074.00	20,728,200	
gumi	21,200	820.00	17,384,000	
ショーケース	3,200	363.00	1,161,600	
モバイルファクトリー	2,600	987.00	2,566,200	
テラスカイ	5,600	2,440.00	13,664,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	6,700	1,750.00	11,725,000	
PCIホールディングス	5,400	1,074.00	5,799,600	
アイピーシー	1,900	475.00	902,500	
ネオジャパン	4,400	1,033.00	4,545,200	
PR TIMES	3,400	2,407.00	8,183,800	
ラクス	61,300	1,867.00	114,447,100	
ランドコンピュータ	3,300	844.00	2,785,200	
ダブルスタンダード	5,300	2,662.00	14,108,600	
オーブンドア	9,200	1,769.00	16,274,800	
マイネット	4,200	461.00	1,936,200	
アカツキ	6,100	2,258.00	13,773,800	
ベネフィットジャパン	800	1,340.00	1,072,000	
Ubicomホールディングス	4,100	2,120.00	8,692,000	
カナミックネットワーク	18,700	675.00	12,622,500	
ノムラシステムコーポレーション	12,400	124.00	1,537,600	
レンゴー	118,000	871.00	102,778,000	
トーモク	7,500	1,611.00	12,082,500	
ザ・パック	9,700	2,487.00	24,123,900	
チェンジ	31,700	1,990.00	63,083,000	
シンクロ・フード	8,100	481.00	3,896,100	
オークネット	6,700	1,863.00	12,482,100	
キャピタル・アセット・プランニング	2,500	570.00	1,425,000	
セグエグループ	3,600	872.00	3,139,200	
エイトレッド	1,900	1,472.00	2,796,800	
マクロミル	29,400	1,110.00	32,634,000	
ビーグリー	2,100	1,410.00	2,961,000	
オロ	4,000	1,671.00	6,684,000	
ユーザーローカル	4,700	1,620.00	7,614,000	
テモナ	2,500	258.00	645,000	
ニーズウェル	4,100	672.00	2,755,200	
マネーフォワード	31,200	5,030.00	156,936,000	
サインポスト	5,000	736.00	3,680,000	
昭和電工	125,300	2,189.00	274,281,700	
住友化学	961,700	480.00	461,616,000	
住友精化	5,400	3,720.00	20,088,000	
日産化学	61,500	6,690.00	411,435,000	
ラサ工業	5,000	2,361.00	11,805,000	
クレハ	11,100	10,040.00	111,444,000	
多木化学	5,100	5,190.00	26,469,000	
テイカ	8,600	1,311.00	11,274,600	
石原産業	23,500	1,076.00	25,286,000	
片倉コープアグリ	2,600	1,238.00	3,218,800	
日本曹達	13,900	4,230.00	58,797,000	
東ソー	173,000	1,565.00	270,745,000	

トクヤマ	41,900	1,799.00	75,378,100
セントラル硝子	20,800	3,805.00	79,144,000
東亜合成	66,600	1,164.00	77,522,400
大阪ソーダ	7,700	3,920.00	30,184,000
関東電化工業	25,000	996.00	24,900,000
デンカ	47,200	3,390.00	160,008,000
イビデン	75,000	5,710.00	428,250,000
信越化学工業	221,700	17,045.00	3,778,876,500
日本カーバイド工業	5,000	1,262.00	6,310,000
電算システムホールディングス	6,300	2,367.00	14,912,100
堺化学工業	9,900	1,864.00	18,453,600
第一稀元素化学工業	11,800	1,301.00	15,351,800
エア・ウォーター	122,300	1,592.00	194,701,600
日本酸素ホールディングス	125,800	2,239.00	281,666,200
日本化学工業	4,400	1,812.00	7,972,800
東邦アセチレン	2,700	1,103.00	2,978,100
日本パーカライジング	64,300	978.00	62,885,400
高圧ガス工業	18,900	657.00	12,417,300
チタン工業	1,500	1,684.00	2,526,000
四国化成工業	15,500	1,323.00	20,506,500
戸田工業	2,800	3,165.00	8,862,000
ステラ ケミファ	7,600	2,593.00	19,706,800
保土谷化学工業	3,700	3,080.00	11,396,000
日本触媒	19,700	5,380.00	105,986,000
大日精化工業	9,000	1,729.00	15,561,000
カネカ	29,600	3,365.00	99,604,000
協和キリン	156,900	3,165.00	496,588,500
三菱瓦斯化学	96,800	1,920.00	185,856,000
三井化学	109,000	3,060.00	333,540,000
J S R	121,000	2,799.00	338,679,000
東京応化工業	22,700	6,560.00	148,912,000
大阪有機化学工業	9,800	2,116.00	20,736,800
三菱ケミカルグループ	874,700	722.10	631,620,870
K Hネオケム	21,600	2,739.00	59,162,400
ダイセル	190,500	970.00	184,785,000
住友ベークライト	19,200	4,240.00	81,408,000
積水化学工業	269,200	1,925.00	518,210,000
日本ゼオン	77,800	1,367.00	106,352,600
アイカ工業	32,700	3,245.00	106,111,500
U B E	66,800	1,942.00	129,725,600
積水樹脂	18,900	1,729.00	32,678,100
タキロンシーアイ	28,500	511.00	14,563,500
旭有機材	8,500	2,644.00	22,474,000
ニチバン	8,000	1,753.00	14,024,000
リケンテクノス	28,000	497.00	13,916,000
大倉工業	6,000	1,886.00	11,316,000
積水化成品工業	18,200	386.00	7,025,200
群栄化学工業	2,700	2,421.00	6,536,700
タイガースポリマー	6,100	393.00	2,397,300
ミライアル	4,000	1,675.00	6,700,000

ダイキアクシス	4,800	714.00	3,427,200
ダイキョーニシカワ	28,600	630.00	18,018,000
竹本容器	4,500	725.00	3,262,500
森六ホールディングス	6,600	1,769.00	11,675,400
恵和	4,300	3,695.00	15,888,500
日本化薬	99,000	1,196.00	118,404,000
カーリットホールディングス	11,700	672.00	7,862,400
ソルクシーズ	10,600	370.00	3,922,000
CLホールディングス	3,800	862.00	3,275,600
プレステージ・インターナショナル	55,900	735.00	41,086,500
フェイス	3,800	545.00	2,071,000
プロトコレーション	16,300	1,185.00	19,315,500
ハイマックス	4,100	1,518.00	6,223,800
アミューズ	7,200	1,753.00	12,621,600
野村総合研究所	266,300	3,335.00	888,110,500
ドリームインキュベータ	4,100	2,629.00	10,778,900
サイバネットシステム	10,900	1,009.00	10,998,100
クイック	10,200	2,043.00	20,838,600
TAC	6,700	204.00	1,366,800
CEホールディングス	6,700	496.00	3,323,200
日本システム技術	5,400	1,664.00	8,985,600
電通グループ	139,600	4,610.00	643,556,000
インテージホールディングス	17,600	1,486.00	26,153,600
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,538.00	7,074,800
東邦システムサイエンス	3,800	1,013.00	3,849,400
ぴあ	4,500	3,310.00	14,895,000
イオンファンタジー	5,800	2,707.00	15,700,600
ソースネクスト	66,000	302.00	19,932,000
シーティーエス	14,800	843.00	12,476,400
ネクシィーズグループ	4,200	701.00	2,944,200
インフォコム	16,800	2,073.00	34,826,400
メディカルシステムネットワーク	11,900	409.00	4,867,100
日本精化	7,300	2,204.00	16,089,200
扶桑化学工業	12,000	3,460.00	41,520,000
トリケミカル研究所	17,300	2,392.00	41,381,600
シンプレクス・ホールディングス	21,800	2,271.00	49,507,800
HEROZ	4,400	1,120.00	4,928,000
ラクスル	18,300	3,095.00	56,638,500
メルカリ	58,400	3,020.00	176,368,000
IPS	4,300	3,130.00	13,459,000
FIG	15,000	395.00	5,925,000
システムサポート	5,600	1,483.00	8,304,800
ADEKA	45,200	2,202.00	99,530,400
日油	40,200	5,460.00	219,492,000
ミヨシ油脂	4,600	987.00	4,540,200
新日本理化	17,900	267.00	4,779,300
ハリマ化成グループ	9,200	821.00	7,553,200
イーソル	8,200	652.00	5,346,400
アルテリア・ネットワークス	12,100	1,232.00	14,907,200
東海ソフト	2,100	904.00	1,898,400

ウイングアーク1st	13,300	2,314.00	30,776,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,600	1,693.00	6,094,800	
サーバーワークス	2,500	2,620.00	6,550,000	
東名	900	1,497.00	1,347,300	
ヴィッツ	1,200	954.00	1,144,800	
トピラシステムズ	3,300	1,046.00	3,451,800	
Sansan	48,400	1,720.00	83,248,000	
Link-U	2,400	843.00	2,023,200	
ギフトィ	13,900	2,297.00	31,928,300	
花王	315,700	5,430.00	1,714,251,000	
第一工業製薬	4,700	1,922.00	9,033,400	
石原ケミカル	5,900	1,232.00	7,268,800	
日華化学	5,300	876.00	4,642,800	
ニイタカ	2,500	2,088.00	5,220,000	
三洋化成工業	7,900	4,305.00	34,009,500	
ベース	4,500	4,115.00	18,517,500	
JMDC	21,400	5,280.00	112,992,000	
武田薬品工業	1,148,600	3,868.00	4,442,784,800	
アステラス製薬	1,243,900	2,076.00	2,582,336,400	
住友ファーマ	96,300	1,028.00	98,996,400	
塩野義製薬	165,900	6,679.00	1,108,046,100	
わかもと製薬	12,100	224.00	2,710,400	
日本新薬	30,600	8,330.00	254,898,000	
中外製薬	406,400	3,436.00	1,396,390,400	
科研製薬	22,300	3,810.00	84,963,000	
エーザイ	157,900	8,387.00	1,324,307,300	
理研ビタミン	11,100	1,837.00	20,390,700	
ロート製薬	62,900	4,155.00	261,349,500	
小野薬品工業	250,400	3,368.00	843,347,200	
久光製薬	28,900	3,600.00	104,040,000	
有機合成薬品工業	9,800	300.00	2,940,000	
持田製薬	15,600	3,170.00	49,452,000	
参天製薬	252,100	1,035.00	260,923,500	
扶桑薬品工業	4,200	2,032.00	8,534,400	
日本ケミファ	1,300	1,680.00	2,184,000	
ツムラ	40,900	2,966.00	121,309,400	
日医工	37,900	362.00	13,719,800	
テルモ	404,300	4,059.00	1,641,053,700	
H.U.グループホールディングス	38,900	2,824.00	109,853,600	
キッセイ薬品工業	20,000	2,444.00	48,880,000	
生化学工業	24,700	917.00	22,649,900	
栄研化学	21,100	1,895.00	39,984,500	
鳥居薬品	6,900	2,912.00	20,092,800	
JCRファーマ	43,900	1,896.00	83,234,400	
東和薬品	19,900	2,221.00	44,197,900	
富士製薬工業	8,300	1,038.00	8,615,400	
ゼリア新薬工業	18,000	2,198.00	39,564,000	
第一三共	1,130,700	4,656.00	5,264,539,200	
キョーリン製薬ホールディングス	28,200	1,771.00	49,942,200	

大幸薬品	23,500	531.00	12,478,500
ダイト	9,800	2,548.00	24,970,400
大塚ホールディングス	297,000	4,582.00	1,360,854,000
大正製薬ホールディングス	28,900	5,320.00	153,748,000
ペプチドリーム	62,900	1,815.00	114,163,500
大日本塗料	16,000	761.00	12,176,000
日本ペイントホールディングス	573,600	1,016.00	582,777,600
関西ペイント	118,700	1,844.00	218,882,800
神東塗料	11,500	131.00	1,506,500
中国塗料	24,000	1,029.00	24,696,000
日本特殊塗料	8,200	864.00	7,084,800
藤倉化成	17,600	398.00	7,004,800
太陽ホールディングス	19,700	2,558.00	50,392,600
D I C	50,700	2,544.00	128,980,800
サカタインクス	28,900	1,051.00	30,373,900
東洋インキS Cホールディングス	25,400	1,922.00	48,818,800
T & K T O K A	11,500	899.00	10,338,500
アルプス技研	11,600	2,127.00	24,673,200
サニックス	21,400	229.00	4,900,600
日本空調サービス	14,300	708.00	10,124,400
オリエンタルランド	140,800	19,655.00	2,767,424,000
フォーカスシステムズ	9,600	1,025.00	9,840,000
ダスキン	29,600	2,931.00	86,757,600
パーク24	99,300	1,942.00	192,840,600
明光ネットワークジャパン	17,500	613.00	10,727,500
ファルコホールディングス	6,000	1,783.00	10,698,000
クレスコ	10,100	1,732.00	17,493,200
フジ・メディア・ホールディングス	124,600	1,027.00	127,964,200
秀英予備校	3,100	430.00	1,333,000
田谷	1,600	538.00	860,800
ラウンドワン	111,200	617.00	68,610,400
リゾートトラスト	52,600	2,266.00	119,191,600
オービック	43,300	22,070.00	955,631,000
ジャストシステム	18,600	3,300.00	61,380,000
T D C ソフト	11,000	1,304.00	14,344,000
Zホールディングス	1,847,100	365.10	674,376,210
ビー・エム・エル	16,500	3,365.00	55,522,500
トレンドマイクロ	75,000	7,190.00	539,250,000
りらいあコミュニケーションズ	22,000	1,044.00	22,968,000
I Dホールディングス	8,700	926.00	8,056,200
リソー教育	60,500	325.00	19,662,500
日本オラクル	24,800	8,120.00	201,376,000
早稲田アカデミー	7,400	1,109.00	8,206,600
アルファシステムズ	4,200	4,325.00	18,165,000
フューチャー	32,200	1,659.00	53,419,800
C A C Holdings	8,000	1,484.00	11,872,000
S Bテクノロジー	5,500	2,094.00	11,517,000
トーセ	3,500	773.00	2,705,500
ユー・エス・エス	136,800	2,162.00	295,761,600
オービックビジネスコンサルタント	25,500	4,325.00	110,287,500

伊藤忠テクノソリューションズ	69,700	3,335.00	232,449,500	
アイティフォー	17,100	785.00	13,423,500	
東京個別指導学院	15,900	530.00	8,427,000	
東計電算	1,600	5,860.00	9,376,000	
サイバーエージェント	318,300	1,184.00	376,867,200	
楽天グループ	615,200	696.00	428,179,200	
エックスネット	1,800	998.00	1,796,400	
クリーク・アンド・リバー社	7,700	2,107.00	16,223,900	
モーニングスター	21,800	456.00	9,940,800	
テー・オー・ダブリュー	28,600	305.00	8,723,000	
大塚商会	73,500	4,535.00	333,322,500	
サイボウズ	17,900	2,142.00	38,341,800	
山田コンサルティンググループ	6,700	1,145.00	7,671,500	
セントラルスポーツ	5,100	2,386.00	12,168,600	
パラカ	4,600	1,813.00	8,339,800	
電通国際情報サービス	15,900	4,785.00	76,081,500	
A C C E S S	15,500	802.00	12,431,000	
デジタルガレージ	23,100	3,830.00	88,473,000	
イーエムシステムズ	21,700	971.00	21,070,700	
ウェザーニューズ	4,600	7,860.00	36,156,000	
C I J	11,900	825.00	9,817,500	
ビジネスエンジニアリング	2,700	2,140.00	5,778,000	
日本エンタープライズ	13,700	140.00	1,918,000	
WOWOW	7,300	1,223.00	8,927,900	
スカラ	12,800	746.00	9,548,800	
インテリジェント ウェイブ	6,900	739.00	5,099,100	
フルキャストホールディングス	12,700	2,968.00	37,693,600	
エン・ジャパン	24,100	2,463.00	59,358,300	
あすか製薬ホールディングス	13,300	1,121.00	14,909,300	
サワイグループホールディングス	29,700	4,115.00	122,215,500	
富士フイルムホールディングス	249,100	7,525.00	1,874,477,500	
コニカミノルタ	291,900	536.00	156,458,400	
資生堂	271,000	5,638.00	1,527,898,000	
ライオン	155,800	1,443.00	224,819,400	
高砂香料工業	8,700	2,826.00	24,586,200	
マンダム	28,100	1,357.00	38,131,700	
ミルボン	19,200	6,220.00	119,424,000	
ファンケル	56,800	2,582.00	146,657,600	
コーセー	26,300	15,550.00	408,965,000	
コタ	10,900	1,661.00	18,104,900	
シーボン	1,500	1,584.00	2,376,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	66,500	1,675.00	111,387,500	
ノエビアホールディングス	11,600	5,630.00	65,308,000	
アジュバンホールディングス	3,300	917.00	3,026,100	
新日本製薬	7,400	1,565.00	11,581,000	
エステー	10,100	1,511.00	15,261,100	
アグロ カネショウ	4,800	1,348.00	6,470,400	
コニシ	21,800	1,809.00	39,436,200	
長谷川香料	26,900	3,230.00	86,887,000	
星光PMC	6,600	536.00	3,537,600	

小林製薬	39,800	8,190.00	325,962,000	
荒川化学工業	11,100	942.00	10,456,200	
メック	10,700	2,435.00	26,054,500	
日本高純度化学	3,500	2,329.00	8,151,500	
タカラバイオ	35,000	1,807.00	63,245,000	
J C U	14,600	3,345.00	48,837,000	
新田ゼラチン	7,900	954.00	7,536,600	
O A T アグリオ	5,300	1,593.00	8,442,900	
デクセリアルズ	37,400	3,240.00	121,176,000	
アース製薬	11,800	5,300.00	62,540,000	
北興化学工業	13,000	914.00	11,882,000	
大成ラミック	4,200	3,020.00	12,684,000	
クミアイ化学工業	51,600	937.00	48,349,200	
日本農薬	23,800	741.00	17,635,800	
富士興産	3,200	1,178.00	3,769,600	
ニチレキ	15,500	1,262.00	19,561,000	
ユシロ化学工業	6,700	804.00	5,386,800	
ビーピー・カストロール	5,100	924.00	4,712,400	
富士石油	26,400	274.00	7,233,600	
M O R E S C O	4,300	1,051.00	4,519,300	
出光興産	144,100	3,195.00	460,399,500	
E N E O S ホールディングス	2,344,900	490.60	1,150,407,940	
コスモエネルギーホールディングス	49,200	4,000.00	196,800,000	
テスホールディングス	13,600	1,039.00	14,130,400	
インフロニア・ホールディングス	133,000	1,011.00	134,463,000	
横浜ゴム	73,800	2,261.00	166,861,800	
T O Y O T I R E	74,600	1,675.00	124,955,000	
ブリヂストン	414,500	5,398.00	2,237,471,000	
住友ゴム工業	127,400	1,123.00	143,070,200	
藤倉コンポジット	9,300	842.00	7,830,600	
オカモト	7,200	3,785.00	27,252,000	
W O W W O R L D G R O U P	2,200	1,048.00	2,305,600	
アキレス	8,400	1,374.00	11,541,600	
フコク	6,800	1,026.00	6,976,800	
ニッタ	13,200	2,911.00	38,425,200	
クリエートメディック	4,400	871.00	3,832,400	
住友理工	25,200	612.00	15,422,400	
三ツ星ベルト	18,900	3,305.00	62,464,500	
バンドー化学	20,500	1,011.00	20,725,500	
A G C	132,100	4,500.00	594,450,000	
日本板硝子	66,100	558.00	36,883,800	
石塚硝子	2,000	1,472.00	2,944,000	
有沢製作所	21,200	1,242.00	26,330,400	
日本山村硝子	4,900	585.00	2,866,500	
日本電気硝子	53,000	2,518.00	133,454,000	
オハラ	6,200	1,244.00	7,712,800	
住友大阪セメント	18,300	3,115.00	57,004,500	
太平洋セメント	82,700	2,009.00	166,144,300	
リソルホールディングス	1,200	4,515.00	5,418,000	
日本ヒューム	11,600	631.00	7,319,600	

日本コンクリート工業	25,400	242.00	6,146,800
三谷セキサン	5,500	3,960.00	21,780,000
アジアパイルホールディングス	20,400	515.00	10,506,000
東海カーボン	108,800	1,070.00	116,416,000
日本カーボン	7,400	4,300.00	31,820,000
東洋炭素	8,100	3,855.00	31,225,500
ノリタケカンパニーリミテド	6,500	3,995.00	25,967,500
TOTO	85,600	4,475.00	383,060,000
日本碍子	153,600	1,768.00	271,564,800
日本特殊陶業	98,800	2,635.00	260,338,000
ダントーホールディングス	9,300	257.00	2,390,100
MARUWA	4,800	18,430.00	88,464,000
品川リフラクトリーズ	3,700	4,010.00	14,837,000
黒崎播磨	2,600	4,905.00	12,753,000
ヨータイ	8,600	1,419.00	12,203,400
東京窯業	11,900	270.00	3,213,000
ニッカトー	5,800	467.00	2,708,600
フジインコーポレーテッド	10,400	6,510.00	67,704,000
クニミネ工業	3,900	802.00	3,127,800
エーアンドエーマテリアル	2,400	855.00	2,052,000
ニチアス	32,800	2,418.00	79,310,400
日本製鉄	597,900	2,188.50	1,308,504,150
神戸製鋼所	268,500	606.00	162,711,000
中山製鋼所	27,600	691.00	19,071,600
合同製鐵	6,600	1,872.00	12,355,200
JFEホールディングス	356,900	1,496.00	533,922,400
東京製鐵	37,500	1,362.00	51,075,000
共英製鋼	15,300	1,318.00	20,165,400
大和工業	22,100	4,780.00	105,638,000
東京鐵鋼	6,400	1,396.00	8,934,400
大阪製鐵	6,200	1,127.00	6,987,400
淀川製鋼所	15,300	2,510.00	38,403,000
丸一鋼管	40,700	2,825.00	114,977,500
モリ工業	3,200	2,764.00	8,844,800
大同特殊鋼	16,900	4,290.00	72,501,000
日本高周波鋼業	4,100	321.00	1,316,100
日本冶金工業	9,800	3,790.00	37,142,000
山陽特殊製鋼	13,200	2,210.00	29,172,000
愛知製鋼	7,700	2,366.00	18,218,200
日本金属	2,800	955.00	2,674,000
大平洋金属	9,600	1,917.00	18,403,200
新日本電工	85,400	406.00	34,672,400
栗本鐵工所	6,400	1,782.00	11,404,800
虹技	1,600	881.00	1,409,600
日本鑄鉄管	1,400	951.00	1,331,400
日本製鋼所	36,000	3,130.00	112,680,000
三菱製鋼	8,300	980.00	8,134,000
日亜鋼業	13,900	235.00	3,266,500
日本精線	1,800	4,190.00	7,542,000
エンビプロ・ホールディングス	9,300	702.00	6,528,600

大紀アルミニウム工業所	19,000	1,289.00	24,491,000
日本軽金属ホールディングス	36,100	1,514.00	54,655,400
三井金属鉱業	38,900	3,135.00	121,951,500
東邦亜鉛	7,800	2,199.00	17,152,200
三菱マテリアル	89,200	2,099.00	187,230,800
住友金属鉱山	154,800	4,536.00	702,172,800
DOWAホールディングス	30,000	4,925.00	147,750,000
古河機械金属	19,600	1,328.00	26,028,800
エス・サイエンス	80,900	28.00	2,265,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,500	4,370.00	85,215,000
東邦チタニウム	24,200	3,050.00	73,810,000
UACJ	18,700	2,099.00	39,251,300
CKサンエツ	2,600	4,170.00	10,842,000
古河電気工業	44,500	2,500.00	111,250,000
住友電気工業	461,100	1,606.50	740,757,150
フジクラ	143,100	1,110.00	158,841,000
昭和電線ホールディングス	14,900	1,648.00	24,555,200
東京特殊電線	1,700	5,640.00	9,588,000
タツタ電線	27,300	437.00	11,930,100
カナレ電気	2,100	1,473.00	3,093,300
平河ヒューテック	7,700	1,128.00	8,685,600
いよぎんホールディングス	151,800	661.00	100,339,800
しずおかフィナンシャルグループ	288,100	928.00	267,356,800
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	107,400	881.00	94,619,400
リョービ	14,100	1,195.00	16,849,500
アーレスティ	14,600	375.00	5,475,000
アサヒホールディングス	54,000	1,959.00	105,786,000
東洋製罐グループホールディングス	88,300	1,558.00	137,571,400
ホッカンホールディングス	7,200	1,311.00	9,439,200
コロナ	7,600	850.00	6,460,000
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,872.00	33,134,400
駒井ハルテック	2,100	1,542.00	3,238,200
高田機工	600	2,368.00	1,420,800
三和ホールディングス	123,000	1,280.00	157,440,000
文化シャッター	38,500	1,121.00	43,158,500
三協立山	18,300	569.00	10,412,700
アルインコ	10,300	988.00	10,176,400
東洋シャッター	2,200	495.00	1,089,000
LIXIL	194,500	2,100.00	408,450,000
日本フィルコン	8,900	461.00	4,102,900
ノーリツ	19,600	1,490.00	29,204,000
長府製作所	13,400	1,961.00	26,277,400
リンナイ	24,200	10,150.00	245,630,000
ユニプレス	23,200	870.00	20,184,000
ダイニチ工業	6,600	669.00	4,415,400
日東精工	19,300	510.00	9,843,000
三洋工業	1,500	1,709.00	2,563,500
岡部	21,600	712.00	15,379,200
ジーテクト	14,900	1,461.00	21,768,900
東プレ	23,500	1,216.00	28,576,000

高周波熱錬	21,900	683.00	14,957,700
東京製綱	7,800	889.00	6,934,200
サンコール	11,900	672.00	7,996,800
モリテックスチール	10,000	275.00	2,750,000
パイオラックス	18,400	1,714.00	31,537,600
エイチワン	13,700	627.00	8,589,900
日本発条	118,100	895.00	105,699,500
中央発條	7,400	704.00	5,209,600
アドパネクス	1,600	1,061.00	1,697,600
三浦工業	54,500	3,210.00	174,945,000
タクマ	40,300	1,262.00	50,858,600
テクノプロ・ホールディングス	89,200	3,900.00	347,880,000
アトラグループ	3,200	191.00	611,200
インターワークス	3,600	372.00	1,339,200
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	2,231.00	15,393,900
KeepPer 技研	9,700	3,845.00	37,296,500
ファーストロジック	2,000	787.00	1,574,000
三機サービス	2,300	885.00	2,035,500
Gunosy	8,100	676.00	5,475,600
デザインワン・ジャパン	3,700	206.00	762,200
イー・ガーディアン	5,100	2,899.00	14,784,900
リブセンス	6,100	296.00	1,805,600
ジャパンマテリアル	40,800	2,340.00	95,472,000
ベクトル	20,900	1,108.00	23,157,200
ウチヤマホールディングス	5,800	283.00	1,641,400
チャーム・ケア・コーポレーション	11,100	1,094.00	12,143,400
キャリアリンク	4,900	2,768.00	13,563,200
I B J	8,100	981.00	7,946,100
アサンテ	6,600	1,595.00	10,527,000
バリューHR	11,600	1,576.00	18,281,600
M&Aキャピタルパートナーズ	12,300	4,400.00	54,120,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	4,800	1,069.00	5,131,200
E R Iホールディングス	3,800	1,070.00	4,066,000
アビスト	2,000	2,898.00	5,796,000
シグマクシス・ホールディングス	20,100	1,327.00	26,672,700
ウィルグループ	11,100	1,343.00	14,907,300
エスクロー・エージェント・ジャパン	14,200	148.00	2,101,600
メドピア	10,500	1,468.00	15,414,000
レアジョブ	2,400	983.00	2,359,200
リクルートホールディングス	985,100	4,853.00	4,780,690,300
エラン	17,600	1,042.00	18,339,200
ツガミ	29,000	1,120.00	32,480,000
オークマ	13,000	5,010.00	65,130,000
芝浦機械	14,400	2,708.00	38,995,200
アマダ	208,500	1,105.00	230,392,500
アイダエンジニアリング	26,900	793.00	21,331,700
TAKISAWA	3,600	1,120.00	4,032,000
F U J I	56,800	2,109.00	119,791,200

牧野フライス製作所	14,400	4,520.00	65,088,000
オーエスジー	62,400	1,976.00	123,302,400
ダイジェット工業	1,300	801.00	1,041,300
旭ダイヤモンド工業	37,700	681.00	25,673,700
D M G 森精機	79,200	1,770.00	140,184,000
ソディック	36,000	787.00	28,332,000
ディスコ	21,000	40,000.00	840,000,000
日東工器	6,400	1,530.00	9,792,000
日進工具	11,000	1,124.00	12,364,000
パンチ工業	11,000	410.00	4,510,000
富士ダイス	6,200	571.00	3,540,200
土木管理総合試験所	5,700	305.00	1,738,500
日本郵政	1,743,600	999.30	1,742,379,480
ベルシステム24ホールディングス	17,900	1,329.00	23,789,100
鎌倉新書	15,100	790.00	11,929,000
S M N	3,200	451.00	1,443,200
一蔵	1,600	456.00	729,600
グローバルキッズCOMPANY	1,900	574.00	1,090,600
エアトリ	8,500	2,510.00	21,335,000
アトラエ	10,500	1,694.00	17,787,000
ストライク	6,500	4,430.00	28,795,000
ソラスト	36,600	869.00	31,805,400
セラク	4,800	1,177.00	5,649,600
インソース	16,600	3,425.00	56,855,000
豊田自動織機	94,700	7,760.00	734,872,000
豊和工業	7,100	866.00	6,148,600
ニデックオーケーケー	5,300	899.00	4,764,700
石川製作所	3,400	1,415.00	4,811,000
東洋機械金属	9,000	526.00	4,734,000
津田駒工業	2,400	599.00	1,437,600
エンシュウ	2,700	745.00	2,011,500
島精機製作所	20,800	2,030.00	42,224,000
オプトラ	19,300	2,667.00	51,473,100
N C ホールディングス	2,600	1,940.00	5,044,000
イワキ	8,600	1,419.00	12,203,400
フリー	13,600	1,169.00	15,898,400
ヤマシンフィルタ	31,100	498.00	15,487,800
日阪製作所	12,700	839.00	10,655,300
やまびこ	21,500	1,168.00	25,112,000
野村マイクロ・サイエンス	4,500	3,965.00	17,842,500
平田機工	6,200	4,540.00	28,148,000
ペガサスミシン製造	14,300	952.00	13,613,600
マルマエ	6,300	1,866.00	11,755,800
タツモ	7,100	1,685.00	11,963,500
ナブテスコ	82,000	3,250.00	266,500,000
三井海洋開発	16,500	1,658.00	27,357,000
レオン自動機	13,700	1,198.00	16,412,600
S M C	42,400	66,660.00	2,826,384,000
ホソカワミクロン	10,100	2,740.00	27,674,000
ユニオンツール	5,800	3,765.00	21,837,000

オイレス工業	18,300	1,477.00	27,029,100
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,930.00	23,187,000
サトーホールディングス	18,600	1,911.00	35,544,600
技研製作所	13,600	3,315.00	45,084,000
日本エアテック	6,600	1,131.00	7,464,600
カワタ	3,800	841.00	3,195,800
日精樹脂工業	9,800	978.00	9,584,400
オカダアイヨン	4,100	1,488.00	6,100,800
ワイエイシイホールディングス	5,500	1,396.00	7,678,000
小松製作所	612,400	3,074.00	1,882,517,600
住友重機械工業	77,300	2,938.00	227,107,400
日立建機	52,100	3,075.00	160,207,500
日工	19,400	615.00	11,931,000
巴工業	5,600	2,421.00	13,557,600
井関農機	12,200	1,244.00	15,176,800
TOWA	13,300	2,025.00	26,932,500
丸山製作所	2,200	1,480.00	3,256,000
北川鉄工所	5,200	1,278.00	6,645,600
シンニッタン	14,400	222.00	3,196,800
ローツェ	6,800	8,300.00	56,440,000
タカキタ	3,800	456.00	1,732,800
クボタ	691,700	2,008.00	1,388,933,600
荏原実業	6,500	2,252.00	14,638,000
東洋エンジニアリング	16,900	584.00	9,869,600
三菱化工機	4,300	2,124.00	9,133,200
月島機械	17,700	996.00	17,629,200
帝国電機製作所	10,000	2,065.00	20,650,000
東京機械製作所	3,100	641.00	1,987,100
新東工業	26,400	669.00	17,661,600
澁谷工業	12,300	2,608.00	32,078,400
アイチコーポレーション	18,500	800.00	14,800,000
小森コーポレーション	30,300	821.00	24,876,300
鶴見製作所	10,100	2,086.00	21,068,600
住友精密工業	1,800	2,592.00	4,665,600
日本ギア工業	4,400	326.00	1,434,400
酒井重工業	2,000	3,155.00	6,310,000
荏原製作所	53,500	5,330.00	285,155,000
石井鐵工所	1,000	2,469.00	2,469,000
西島製作所	11,300	1,440.00	16,272,000
北越工業	13,100	1,174.00	15,379,400
ダイキン工業	156,000	23,255.00	3,627,780,000
オルガノ	18,000	2,778.00	50,004,000
トーヨーカネツ	5,000	2,468.00	12,340,000
栗田工業	73,100	6,000.00	438,600,000
椿本チエイン	18,500	3,135.00	57,997,500
大同工業	5,300	757.00	4,012,100
日機装	32,300	1,024.00	33,075,200
木村化工機	10,000	682.00	6,820,000
レイズネクスト	18,400	1,272.00	23,404,800
アネスト岩田	22,300	923.00	20,582,900

ダイフク	67,400	7,410.00	499,434,000
サムコ	4,300	3,410.00	14,663,000
加藤製作所	6,100	748.00	4,562,800
油研工業	1,600	1,790.00	2,864,000
タダノ	68,900	928.00	63,939,200
フジテック	47,900	2,967.00	142,119,300
CKD	36,100	1,926.00	69,528,600
平和	43,400	2,410.00	104,594,000
理想科学工業	11,600	2,288.00	26,540,800
SANKYO	25,600	4,720.00	120,832,000
日本金銭機械	14,300	788.00	11,268,400
マースグループホールディングス	7,600	2,007.00	15,253,200
フクシマガリレイ	9,700	4,145.00	40,206,500
オーイズミ	5,100	405.00	2,065,500
ダイコク電機	7,100	1,525.00	10,827,500
竹内製作所	23,700	2,967.00	70,317,900
アマノ	37,100	2,529.00	93,825,900
JUKI	20,200	668.00	13,493,600
サンデン	19,400	211.00	4,093,400
ジャノメ	13,200	642.00	8,474,400
ブラザー工業	174,700	2,244.00	392,026,800
マックス	16,200	2,038.00	33,015,600
モリタホールディングス	22,800	1,230.00	28,044,000
グローリー	34,000	2,038.00	69,292,000
新晃工業	13,100	1,571.00	20,580,100
大和冷機工業	20,000	1,278.00	25,560,000
セガサミーホールディングス	105,100	1,830.00	192,333,000
日本ピストンリング	4,500	1,189.00	5,350,500
リケン	5,200	2,233.00	11,611,600
TPR	15,400	1,241.00	19,111,400
ツバキ・ナカシマ	32,100	1,208.00	38,776,800
ホシザキ	84,100	4,515.00	379,711,500
大豊工業	11,300	693.00	7,830,900
日本精工	240,100	773.00	185,597,300
NTN	257,600	295.00	75,992,000
ジェイテクト	116,300	1,008.00	117,230,400
不二越	9,700	3,990.00	38,703,000
ミネベアミツミ	227,300	2,280.00	518,244,000
日本トムソン	31,900	546.00	17,417,400
THK	75,400	2,665.00	200,941,000
ユーシン精機	10,500	680.00	7,140,000
前澤給装工業	9,300	926.00	8,611,800
イーグル工業	14,400	1,129.00	16,257,600
前澤工業	8,400	615.00	5,166,000
日本ピラー工業	12,100	2,735.00	33,093,500
キッツ	48,100	838.00	40,307,800
日立製作所	656,300	7,286.00	4,781,801,800
東芝	251,600	4,950.00	1,245,420,000
三菱電機	1,350,900	1,358.00	1,834,522,200
富士電機	79,400	6,080.00	482,752,000

東洋電機製造	4,700	848.00	3,985,600
安川電機	154,800	4,565.00	706,662,000
シンフォニアテクノロジー	14,300	1,424.00	20,363,200
明電舎	19,800	2,050.00	40,590,000
オリジン	2,800	1,314.00	3,679,200
山洋電気	5,700	6,170.00	35,169,000
デンヨー	10,000	1,365.00	13,650,000
PHCホールディングス	18,200	1,702.00	30,976,400
ベイカレント・コンサルティング	105,300	4,600.00	484,380,000
Orchestra Holdings	2,800	2,655.00	7,434,000
アイモバイル	6,900	1,234.00	8,514,600
キャリアインデックス	4,700	399.00	1,875,300
MS - Japan	4,400	1,001.00	4,404,400
船場	1,500	774.00	1,161,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	47,300	1,714.00	81,072,200
フルテック	1,700	1,086.00	1,846,200
グリーンズ	5,100	998.00	5,089,800
ツナググループ・ホールディングス	3,800	489.00	1,858,200
GAMEWITH	4,100	376.00	1,541,600
MS&Consulting	1,500	608.00	912,000
ウェルビー	9,800	923.00	9,045,400
エル・ティー・エス	1,600	3,030.00	4,848,000
ミダックホールディングス	8,000	3,735.00	29,880,000
日総工産	10,000	610.00	6,100,000
キュービーネットホールディングス	6,900	1,295.00	8,935,500
RPAホールディングス	18,000	287.00	5,166,000
三櫻工業	19,700	681.00	13,415,700
マキタ	162,600	2,913.00	473,653,800
東芝テック	19,500	3,860.00	75,270,000
芝浦メカトロニクス	2,400	11,460.00	27,504,000
マブチモーター	32,400	4,115.00	133,326,000
日本電産	317,500	8,669.00	2,752,407,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,700	499.00	4,840,300
トレックス・セミコンダクター	6,100	3,190.00	19,459,000
東光高岳	7,800	1,800.00	14,040,000
ダブル・スコープ	42,700	1,835.00	78,354,500
宮越ホールディングス	5,800	882.00	5,115,600
ダイヘン	11,800	3,980.00	46,964,000
ヤーマン	25,400	1,111.00	28,219,400
JVCケンウッド	119,100	333.00	39,660,300
ミマキエンジニアリング	12,400	645.00	7,998,000
I - P E X	7,200	1,310.00	9,432,000
日新電機	31,300	1,392.00	43,569,600
大崎電気工業	31,000	512.00	15,872,000
オムロン	119,800	7,377.00	883,764,600
日東工業	17,600	2,213.00	38,948,800
I D E C	19,300	3,080.00	59,444,000
正興電機製作所	5,000	1,015.00	5,075,000

不二電機工業	2,600	1,088.00	2,828,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	42,900	2,195.00	94,165,500
サクサホールディングス	2,700	1,300.00	3,510,000
メルコホールディングス	3,600	3,095.00	11,142,000
テクノメディカ	3,300	1,658.00	5,471,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4,000	1,229.00	4,916,000
日本電気	184,800	4,855.00	897,204,000
富士通	130,200	18,015.00	2,345,553,000
沖電気工業	59,100	751.00	44,384,100
岩崎通信機	5,800	796.00	4,616,800
電気興業	6,100	2,409.00	14,694,900
サンケン電気	12,100	6,330.00	76,593,000
ナカヨ	2,100	1,080.00	2,268,000
アイホン	7,900	1,807.00	14,275,300
ルネサスエレクトロニクス	852,500	1,384.00	1,179,860,000
セイコーエプソン	174,100	2,033.00	353,945,300
ワコム	103,600	648.00	67,132,800
アルバック	31,000	6,200.00	192,200,000
アクセル	4,900	1,420.00	6,958,000
E I Z O	9,700	3,820.00	37,054,000
ジャパンディスプレイ	502,200	48.00	24,105,600
日本信号	29,800	994.00	29,621,200
京三製作所	27,500	406.00	11,165,000
能美防災	17,700	1,557.00	27,558,900
ホーチキ	9,900	1,340.00	13,266,000
星和電機	5,300	444.00	2,353,200
エレコム	31,200	1,524.00	47,548,800
パナソニック ホールディングス	1,544,000	1,221.50	1,885,996,000
シャープ	157,500	966.00	152,145,000
アンリツ	92,100	1,490.00	137,229,000
富士通ゼネラル	37,000	3,250.00	120,250,000
ソニーグループ	915,500	11,630.00	10,647,265,000
T D K	207,000	5,100.00	1,055,700,000
帝国通信工業	5,900	1,423.00	8,395,700
タムラ製作所	56,000	718.00	40,208,000
アルプスアルパイン	116,700	1,270.00	148,209,000
池上通信機	4,200	528.00	2,217,600
日本電波工業	15,700	1,664.00	26,124,800
鈴木	7,600	887.00	6,741,200
メイコー	14,200	3,200.00	45,440,000
日本トリム	2,800	2,412.00	6,753,600
ローランド ディー・ジー	7,300	3,005.00	21,936,500
フォスター電機	12,100	847.00	10,248,700
S M K	3,200	2,618.00	8,377,600
ヨコオ	10,400	2,412.00	25,084,800
ティアック	20,200	114.00	2,302,800
ホシデン	31,300	1,547.00	48,421,100
ヒロセ電機	21,700	18,440.00	400,148,000
日本航空電子工業	26,800	2,316.00	62,068,800

TOA	15,100	760.00	11,476,000
マクセル	28,400	1,322.00	37,544,800
古野電気	17,000	1,018.00	17,306,000
スミダコーポレーション	12,000	1,285.00	15,420,000
アイコム	5,100	2,545.00	12,979,500
リオン	5,400	1,955.00	10,557,000
横河電機	142,900	2,594.00	370,682,600
新電元工業	5,000	3,335.00	16,675,000
アズビル	90,400	4,170.00	376,968,000
東亜ディーケーケー	6,100	852.00	5,197,200
日本光電工業	59,800	3,370.00	201,526,000
チノー	5,400	1,810.00	9,774,000
共和電業	12,300	340.00	4,182,000
日本電子材料	8,500	1,574.00	13,379,000
堀場製作所	28,900	6,290.00	181,781,000
アドバンテスト	102,000	8,910.00	908,820,000
小野測器	5,000	378.00	1,890,000
エスベック	10,400	1,948.00	20,259,200
キーエンス	129,500	60,710.00	7,861,945,000
日置電機	6,800	6,950.00	47,260,000
シスメックス	111,600	8,526.00	951,501,600
日本マイクロニクス	21,400	1,531.00	32,763,400
メガチップス	10,700	2,686.00	28,740,200
OBARA GROUP	6,100	3,400.00	20,740,000
IMAGICA GROUP	10,900	761.00	8,294,900
澤藤電機	1,500	1,156.00	1,734,000
デンソー	266,900	7,588.00	2,025,237,200
原田工業	5,800	777.00	4,506,600
コーセル	17,300	859.00	14,860,700
イリソ電子工業	11,900	5,090.00	60,571,000
オブテックスグループ	23,700	1,959.00	46,428,300
千代田インテグレ	5,300	2,327.00	12,333,100
レーザーテック	63,900	27,210.00	1,738,719,000
スタンレー電気	92,100	2,698.00	248,485,800
岩崎電気	4,200	2,403.00	10,092,600
ウシオ電機	67,600	1,716.00	116,001,600
岡谷電機産業	10,100	279.00	2,817,900
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	496.00	5,902,400
エノモト	3,400	1,769.00	6,014,600
日本セラミック	13,100	2,598.00	34,033,800
遠藤照明	5,800	746.00	4,326,800
古河電池	9,600	1,033.00	9,916,800
双信電機	5,300	415.00	2,199,500
山一電機	11,300	1,985.00	22,430,500
図研	11,300	3,110.00	35,143,000
日本電子	32,300	5,860.00	189,278,000
カシオ計算機	96,400	1,340.00	129,176,000
ファナック	127,000	20,765.00	2,637,155,000
日本シイエムケイ	27,600	592.00	16,339,200
エンプラス	3,800	4,220.00	16,036,000

大真空	15,800	987.00	15,594,600
ローム	59,800	11,350.00	678,730,000
浜松ホトニクス	103,900	6,880.00	714,832,000
三井ハイテック	13,300	8,050.00	107,065,000
新光電気工業	45,900	4,145.00	190,255,500
京セラ	201,000	6,857.00	1,378,257,000
協栄産業	1,200	1,742.00	2,090,400
太陽誘電	63,000	4,525.00	285,075,000
村田製作所	392,400	7,762.00	3,045,808,800
双葉電子工業	24,600	609.00	14,981,400
日東電工	94,200	8,580.00	808,236,000
北陸電気工業	4,900	1,165.00	5,708,500
東海理化電機製作所	36,500	1,553.00	56,684,500
ニチコン	26,300	1,387.00	36,478,100
日本ケミコン	12,800	1,820.00	23,296,000
K O A	19,500	2,192.00	42,744,000
三井E & Sホールディングス	59,100	445.00	26,299,500
日立造船	107,200	912.00	97,766,400
三菱重工業	228,600	5,216.00	1,192,377,600
川崎重工業	97,500	2,861.00	278,947,500
I H I	82,400	3,560.00	293,344,000
名村造船所	33,200	578.00	19,189,600
サノヤホールディングス	17,700	125.00	2,212,500
スプリックス	4,600	1,036.00	4,765,600
マネジメントソリューションズ	7,300	3,350.00	24,455,000
プロレド・パートナーズ	3,300	529.00	1,745,700
and factory	3,900	386.00	1,505,400
テノ・ホールディングス	1,600	533.00	852,800
フロンティア・マネジメント	4,500	1,293.00	5,818,500
ピアラ	2,000	685.00	1,370,000
コプロ・ホールディングス	2,100	923.00	1,938,300
ギークス	1,800	920.00	1,656,000
カーブスホールディングス	40,900	906.00	37,055,400
フォーラムエンジニアリング	7,700	835.00	6,429,500
FAST FITNESS JAPAN	4,600	1,547.00	7,116,200
日本車輛製造	5,000	1,970.00	9,850,000
三菱ロジスネクスト	20,600	846.00	17,427,600
近畿車輛	1,500	979.00	1,468,500
一家ホールディングス	3,100	635.00	1,968,500
フルサト・マルカホールディングス	13,600	3,545.00	48,212,000
ヤマエグループホールディングス	7,700	1,410.00	10,857,000
ジャパクラフトホールディングス	4,400	640.00	2,816,000
F P G	51,700	1,045.00	54,026,500
島根銀行	4,300	424.00	1,823,200
じもとホールディングス	8,400	405.00	3,402,000
全国保証	33,300	4,960.00	165,168,000
めぶきフィナンシャルグループ	632,400	289.00	182,763,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	10,500	1,270.00	13,335,000

東京きらぼしフィナンシャルグループ	16,400	2,171.00	35,604,400	
九州フィナンシャルグループ	224,200	385.00	86,317,000	
かんぼ生命保険	154,700	2,138.00	330,748,600	
ゆうちょ銀行	363,000	999.00	362,637,000	
あんしん保証	5,500	256.00	1,408,000	
富山第一銀行	31,700	409.00	12,965,300	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	702,600	450.00	316,170,000	
ジェイリース	4,300	2,970.00	12,771,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	80,700	806.00	65,044,200	
イントラスト	4,900	717.00	3,513,300	
日本モーゲージサービス	7,100	853.00	6,056,300	
CASA	4,900	866.00	4,243,400	
アルヒ	26,100	1,419.00	37,035,900	
プレミアグループ	21,500	1,819.00	39,108,500	
日産自動車	1,838,300	499.50	918,230,850	
いすゞ自動車	376,300	1,760.00	662,288,000	
トヨタ自動車	7,106,300	2,001.00	14,219,706,300	
日野自動車	166,800	626.00	104,416,800	
三菱自動車工業	504,800	612.00	308,937,600	
エフテック	8,900	521.00	4,636,900	
レシップホールディングス	5,200	475.00	2,470,000	
GMB	2,500	744.00	1,860,000	
ファルテック	2,100	611.00	1,283,100	
武蔵精密工業	31,600	1,743.00	55,078,800	
日産車体	22,900	826.00	18,915,400	
新明和工業	40,700	1,026.00	41,758,200	
極東開発工業	22,800	1,363.00	31,076,400	
トビー工業	10,500	1,697.00	17,818,500	
ティラド	3,300	2,452.00	8,091,600	
曙ブレーキ工業	79,100	162.00	12,814,200	
タチエス	20,400	1,093.00	22,297,200	
NOK	50,200	1,308.00	65,661,600	
フタバ産業	34,700	375.00	13,012,500	
KYB	12,400	3,460.00	42,904,000	
市光工業	18,600	416.00	7,737,600	
大同メタル工業	25,300	489.00	12,371,700	
プレス工業	57,700	415.00	23,945,500	
ミクニ	14,900	305.00	4,544,500	
太平洋工業	29,700	1,065.00	31,630,500	
河西工業	17,100	191.00	3,266,100	
アイシン	99,800	3,810.00	380,238,000	
マツダ	428,000	1,091.00	466,948,000	
今仙電機製作所	8,200	542.00	4,444,400	
本田技研工業	1,052,100	3,335.00	3,508,753,500	
スズキ	237,700	5,184.00	1,232,236,800	
SUBARU	409,500	2,400.00	982,800,000	
安永	5,700	732.00	4,172,400	
ヤマハ発動機	203,300	3,465.00	704,434,500	

小糸製作所	155,600	2,248.00	349,788,800
T B K	12,900	271.00	3,495,900
エクセディ	21,200	1,664.00	35,276,800
ミツバ	24,200	479.00	11,591,800
豊田合成	37,700	2,351.00	88,632,700
愛三工業	21,500	702.00	15,093,000
盟和産業	1,500	922.00	1,383,000
日本プラスト	10,200	442.00	4,508,400
ヨロズ	12,100	810.00	9,801,000
エフ・シー・シー	23,000	1,418.00	32,614,000
新家工業	2,800	2,217.00	6,207,600
シマノ	53,000	24,125.00	1,278,625,000
テイ・エス テック	59,300	1,564.00	92,745,200
三十三フィナンシャルグループ	11,400	1,444.00	16,461,600
第四北越フィナンシャルグループ	19,900	2,578.00	51,302,200
ひろぎんホールディングス	166,300	626.00	104,103,800
マーキュリアホールディングス	7,500	619.00	4,642,500
おきなわフィナンシャルグループ	12,100	2,038.00	24,659,800
ダイレクトマーケティングミックス	15,300	1,692.00	25,887,600
ポピンズ	1,900	1,618.00	3,074,200
L I T A L I C O	10,400	2,545.00	26,468,000
十六フィナンシャルグループ	16,600	2,449.00	40,653,400
北國フィナンシャルホールディングス	10,800	4,280.00	46,224,000
ネットプロテクションズホールディングス	42,100	493.00	20,755,300
プロクレアホールディングス	15,700	2,103.00	33,017,100
あいちフィナンシャルグループ	17,800	2,148.00	38,234,400
ジャムコ	7,000	1,532.00	10,724,000
小野建	12,600	1,480.00	18,648,000
はるやまホールディングス	5,700	435.00	2,479,500
南陽	2,600	1,812.00	4,711,200
ノジマ	44,700	1,320.00	59,004,000
佐島電機	8,500	1,308.00	11,118,000
カップ・クリエイト	21,600	1,363.00	29,440,800
エコートレーディング	2,500	553.00	1,382,500
伯東	7,800	3,480.00	27,144,000
コンドーテック	10,600	973.00	10,313,800
中山福	7,200	318.00	2,289,600
ライトオン	10,400	624.00	6,489,600
ナガイレーベン	17,300	2,045.00	35,378,500
三菱食品	12,600	3,190.00	40,194,000
良品計画	176,700	1,417.00	250,383,900
パリミキホールディングス	17,300	262.00	4,532,600
松田産業	10,500	2,270.00	23,835,000
第一興商	26,400	4,075.00	107,580,000
メディパルホールディングス	142,000	1,785.00	253,470,000
アドヴァングループ	13,000	882.00	11,466,000
S P K	6,100	1,395.00	8,509,500
萩原電気ホールディングス	5,300	2,447.00	12,969,100
アルピス	4,600	2,293.00	10,547,800

アズワン	20,000	6,220.00	124,400,000
スズデン	4,800	2,407.00	11,553,600
尾家産業	3,400	838.00	2,849,200
シモジマ	9,500	989.00	9,395,500
ドウシシャ	14,400	1,565.00	22,536,000
小津産業	3,200	1,478.00	4,729,600
コナカ	14,900	328.00	4,887,200
高速	7,100	1,700.00	12,070,000
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,606.00	2,569,600
G-7ホールディングス	17,100	1,502.00	25,684,200
たけびし	5,300	1,531.00	8,114,300
イオン北海道	20,200	1,172.00	23,674,400
コジマ	26,300	607.00	15,964,100
ヒマラヤ	4,400	911.00	4,008,400
コーナン商事	18,500	3,275.00	60,587,500
ネットワンシステムズ	48,300	3,460.00	167,118,000
エコス	5,100	1,832.00	9,343,200
ワタミ	16,600	958.00	15,902,800
マルシェ	4,700	401.00	1,884,700
リックス	2,700	2,073.00	5,597,100
システムソフト	45,100	103.00	4,645,300
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	307,000	2,337.00	717,459,000
丸文	12,200	893.00	10,894,600
西松屋チェーン	30,300	1,372.00	41,571,600
ゼンショーホールディングス	75,000	3,270.00	245,250,000
ハビネット	11,600	1,976.00	22,921,600
幸楽苑ホールディングス	8,900	1,063.00	9,460,700
ハークスレイ	4,900	559.00	2,739,100
橋本総業ホールディングス	5,500	997.00	5,483,500
日本ライフライン	40,200	971.00	39,034,200
サイゼリヤ	22,800	2,802.00	63,885,600
タカショー	11,900	690.00	8,211,000
VTホールディングス	52,100	503.00	26,206,300
アルゴグラフィックス	11,900	3,730.00	44,387,000
魚力	4,300	2,104.00	9,047,200
IDOM	41,400	723.00	29,932,200
日本エム・ディ・エム	7,600	1,104.00	8,390,400
ポブラ	3,300	148.00	488,400
フジ・コーポレーション	7,700	1,241.00	9,555,700
ユナイテッドアローズ	14,500	1,849.00	26,810,500
進和	9,200	1,954.00	17,976,800
エスケイジャパン	3,400	503.00	1,710,200
ダイترون	5,400	2,393.00	12,922,200
ハイデイ日高	20,200	1,860.00	37,572,000
シークス	19,400	1,173.00	22,756,200
YU-WA CREATION HOLDINGS	8,100	211.00	1,709,100
コロワイド	63,100	1,723.00	108,721,300
ピーシーデポコーポレーション	15,300	293.00	4,482,900

田中商事	4,100	540.00	2,214,000
オーハシテクニカ	6,800	1,437.00	9,771,600
壱番屋	10,900	4,570.00	49,813,000
白銅	5,000	2,492.00	12,460,000
トップカルチャー	4,600	202.00	929,200
P L A N T	3,300	631.00	2,082,300
スギホールディングス	27,700	5,910.00	163,707,000
ダイコー通産	1,500	1,055.00	1,582,500
薬王堂ホールディングス	7,600	2,659.00	20,208,400
島津製作所	157,700	4,235.00	667,859,500
J M S	12,000	514.00	6,168,000
クボテック	3,200	221.00	707,200
長野計器	9,500	1,088.00	10,336,000
ブイ・テクノロジ	6,300	2,615.00	16,474,500
スター精密	24,600	1,649.00	40,565,400
東京計器	10,000	1,252.00	12,520,000
愛知時計電機	5,100	1,385.00	7,063,500
インターアクション	7,700	1,462.00	11,257,400
オーバル	11,400	444.00	5,061,600
東京精密	28,400	4,365.00	123,966,000
マニー	56,900	2,176.00	123,814,400
ニコン	201,200	1,350.00	271,620,000
トプコン	68,100	1,652.00	112,501,200
オリンパス	809,100	3,093.00	2,502,546,300
理研計器	7,900	4,515.00	35,668,500
S C R E E Nホールディングス	22,200	8,940.00	198,468,000
キャノン電子	14,300	1,573.00	22,493,900
タムロン	9,800	3,235.00	31,703,000
H O Y A	279,600	14,740.00	4,121,304,000
シード	6,600	504.00	3,326,400
ノーリツ鋼機	12,300	2,667.00	32,804,100
A & Dホロンホールディングス	18,800	1,030.00	19,364,000
朝日インテック	170,900	2,517.00	430,155,300
キャノン	710,000	3,166.00	2,247,860,000
リコー	339,400	1,032.00	350,260,800
シチズン時計	142,200	606.00	86,173,200
リズム	4,100	1,667.00	6,834,700
大研医器	9,900	462.00	4,573,800
メニコン	44,400	2,393.00	106,249,200
シンシア	1,200	509.00	610,800
K Y O R I T S U	19,300	120.00	2,316,000
中本パックス	4,000	1,516.00	6,064,000
スノーピーク	22,200	2,003.00	44,466,600
パラマウントベッドホールディングス	29,900	2,620.00	78,338,000
トランザクション	10,000	1,177.00	11,770,000
粧美堂	3,700	373.00	1,380,100
ニホンフラッシュ	12,200	981.00	11,968,200
前田工織	14,000	3,035.00	42,490,000
永大産業	14,000	218.00	3,052,000
アートネイチャー	13,300	770.00	10,241,000

バンダイナムコホールディングス	118,100	8,978.00	1,060,301,800	
アイフィスジャパン	3,800	610.00	2,318,000	
SHOEI	13,600	5,600.00	76,160,000	
フランスベッドホールディングス	16,100	915.00	14,731,500	
マーベラス	21,100	689.00	14,537,900	
パイロットコーポレーション	20,200	4,835.00	97,667,000	
萩原工業	8,500	1,023.00	8,695,500	
エイベックス	22,100	1,581.00	34,940,100	
フジシルインターナショナル	26,100	1,795.00	46,849,500	
タカラトミー	59,800	1,212.00	72,477,600	
広済堂ホールディングス	8,600	1,742.00	14,981,200	
エステールホールディングス	3,200	613.00	1,961,600	
レック	18,500	845.00	15,632,500	
タカノ	4,900	651.00	3,189,900	
三光合成	17,800	460.00	8,188,000	
プロネクサス	10,800	953.00	10,292,400	
ホクシン	10,000	144.00	1,440,000	
ウッドワン	4,400	913.00	4,017,200	
大建工業	7,800	2,094.00	16,333,200	
きもと	19,200	232.00	4,454,400	
凸版印刷	169,300	2,163.00	366,195,900	
大日本印刷	153,500	2,903.00	445,610,500	
共同印刷	3,700	2,917.00	10,792,900	
NISSHA	24,600	1,691.00	41,598,600	
光村印刷	600	1,165.00	699,000	
藤森工業	10,300	3,175.00	32,702,500	
ヴィア・ホールディングス	18,500	128.00	2,368,000	
TAKARA & COMPANY	8,900	2,121.00	18,876,900	
前澤化成工業	8,300	1,384.00	11,487,200	
未来工業	4,800	1,492.00	7,161,600	
アシックス	119,500	2,502.00	298,989,000	
ツツミ	2,800	1,973.00	5,524,400	
ウェーブロックホールディングス	4,000	593.00	2,372,000	
JSP	9,200	1,454.00	13,376,800	
ニチハ	16,300	2,869.00	46,764,700	
ローランド	9,600	4,010.00	38,496,000	
エフピコ	24,500	3,765.00	92,242,500	
小松ウオール工業	4,800	1,851.00	8,884,800	
ヤマハ	81,600	5,440.00	443,904,000	
河合楽器製作所	3,600	2,690.00	9,684,000	
クリナップ	14,500	628.00	9,106,000	
ピジョン	82,500	1,961.00	161,782,500	
天馬	11,100	2,073.00	23,010,300	
兼松サステック	600	1,538.00	922,800	
キングジム	11,600	899.00	10,428,400	
象印マホービン	38,700	1,603.00	62,036,100	
リンテック	25,900	2,240.00	58,016,000	
信越ポリマー	24,000	1,257.00	30,168,000	
東リ	29,500	204.00	6,018,000	
イトーキ	26,500	434.00	11,501,000	

任天堂	817,100	5,759.00	4,705,678,900
三菱鉛筆	18,400	1,399.00	25,741,600
松風	5,900	2,389.00	14,095,100
タカスタンダード	25,100	1,269.00	31,851,900
コクヨ	62,300	1,855.00	115,566,500
ナカバヤシ	14,000	517.00	7,238,000
ニフコ	46,900	3,535.00	165,791,500
立川ブラインド工業	6,100	1,110.00	6,771,000
グローブライド	10,500	2,602.00	27,321,000
オカムラ	39,000	1,449.00	56,511,000
バルカー	10,900	2,695.00	29,375,500
MUTOHホールディングス	1,000	1,912.00	1,912,000
伊藤忠商事	843,700	4,267.00	3,600,067,900
丸紅	1,081,000	1,466.50	1,585,286,500
スクロール	20,200	713.00	14,402,600
高島	2,100	2,656.00	5,577,600
ヨンドシーホールディングス	11,800	1,713.00	20,213,400
三陽商会	5,000	1,124.00	5,620,000
長瀬産業	64,400	1,995.00	128,478,000
ナイガイ	4,100	265.00	1,086,500
蝶理	7,300	1,967.00	14,359,100
豊田通商	119,900	5,220.00	625,878,000
オンワードホールディングス	84,000	299.00	25,116,000
三共生興	19,700	474.00	9,337,800
兼松	53,200	1,504.00	80,012,800
美津濃	12,800	2,795.00	35,776,000
ツカモトコーポレーション	1,900	1,149.00	2,183,100
ルックホールディングス	3,800	2,357.00	8,956,600
三井物産	1,001,800	3,863.00	3,869,953,400
日本紙パルプ商事	7,200	4,980.00	35,856,000
東京エレクトロン	91,300	44,370.00	4,050,981,000
カメイ	14,500	1,174.00	17,023,000
東都水産	600	4,875.00	2,925,000
OUGホールディングス	2,000	2,409.00	4,818,000
スターゼン	10,500	2,032.00	21,336,000
セイコーグループ	20,000	3,035.00	60,700,000
山善	36,900	989.00	36,494,100
椿本興業	2,100	3,795.00	7,969,500
住友商事	847,900	2,179.00	1,847,574,100
BIPROGY	47,800	3,200.00	152,960,000
内田洋行	6,000	4,710.00	28,260,000
三菱商事	856,100	4,340.00	3,715,474,000
第一実業	4,900	4,235.00	20,751,500
キヤノンマーケティングジャパン	31,700	3,155.00	100,013,500
西華産業	5,400	1,579.00	8,526,600
佐藤商事	9,600	1,174.00	11,270,400
菱洋エレクトロ	11,700	2,338.00	27,354,600
東京産業	12,600	770.00	9,702,000
ユアサ商事	12,300	3,720.00	45,756,000
神鋼商事	3,500	4,210.00	14,735,000

トルク	7,400	215.00	1,591,000
阪和興業	24,600	3,710.00	91,266,000
正栄食品工業	9,200	4,170.00	38,364,000
カナデン	11,100	1,095.00	12,154,500
菱電商事	11,100	1,702.00	18,892,200
ニプロ	107,900	1,031.00	111,244,900
岩谷産業	31,100	5,630.00	175,093,000
ナイス	3,800	1,402.00	5,327,600
ニチモウ	1,500	2,517.00	3,775,500
極東貿易	8,100	1,324.00	10,724,400
アステナホールディングス	23,700	418.00	9,906,600
兼松エレクトロニクス	8,300	4,570.00	37,931,000
三愛オブリ	37,700	1,209.00	45,579,300
稲畑産業	28,000	2,434.00	68,152,000
G S Iクレオス	7,900	1,427.00	11,273,300
明和産業	18,200	728.00	13,249,600
クワザワホールディングス	4,600	403.00	1,853,800
キムラタン	76,000	22.00	1,672,000
ゴールドウイン	23,000	8,280.00	190,440,000
ユニ・チャーム	270,400	5,035.00	1,361,464,000
デザート	22,400	3,360.00	75,264,000
キング	5,700	494.00	2,815,800
ワキタ	25,200	1,202.00	30,290,400
ヤマトインターナショナル	10,300	238.00	2,451,400
東邦ホールディングス	34,100	1,944.00	66,290,400
サンゲツ	34,400	1,987.00	68,352,800
ミツウロコグループホールディングス	17,600	1,000.00	17,600,000
シナネンホールディングス	4,500	3,820.00	17,190,000
伊藤忠エネクス	34,100	1,013.00	34,543,300
サンリオ	38,800	4,275.00	165,870,000
サンワテクノス	7,000	1,507.00	10,549,000
リョーサン	14,400	2,844.00	40,953,600
新光商事	18,400	1,071.00	19,706,400
トーヨー	5,900	1,699.00	10,024,100
三信電気	5,500	2,148.00	11,814,000
東陽テクニカ	15,100	1,340.00	20,234,000
モスフードサービス	20,100	3,115.00	62,611,500
加賀電子	11,100	4,300.00	47,730,000
三益半導体工業	12,000	2,531.00	30,372,000
都築電気	6,800	1,350.00	9,180,000
ソーダニッカ	10,100	615.00	6,211,500
立花エレテック	10,100	1,716.00	17,331,600
木曽路	20,600	2,099.00	43,239,400
S R Sホールディングス	22,700	837.00	18,999,900
千趣会	25,300	399.00	10,094,700
タカキュー	9,800	80.00	784,000
リテールパートナーズ	20,200	1,232.00	24,886,400
ケーヨー	22,200	902.00	20,024,400
上新電機	12,200	1,883.00	22,972,600
日本瓦斯	73,300	2,173.00	159,280,900

ロイヤルホールディングス	26,300	2,226.00	58,543,800
東天紅	600	805.00	483,000
いなげや	13,300	1,157.00	15,388,100
チヨダ	13,100	729.00	9,549,900
ライフコーポレーション	12,000	2,362.00	28,344,000
リンガーハット	17,700	2,194.00	38,833,800
MrMaxHD	19,200	664.00	12,748,800
テナアライド	14,500	247.00	3,581,500
AOKIホールディングス	25,400	693.00	17,602,200
オークワ	22,000	903.00	19,866,000
コメリ	21,100	2,633.00	55,556,300
青山商事	29,300	975.00	28,567,500
しまむら	16,100	12,120.00	195,132,000
はせがわ	6,500	348.00	2,262,000
高島屋	103,200	1,709.00	176,368,800
松屋	23,200	963.00	22,341,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	66,600	1,205.00	80,253,000
近鉄百貨店	4,500	2,398.00	10,791,000
丸井グループ	101,000	2,312.00	233,512,000
クレディセゾン	80,800	1,639.00	132,431,200
アクシアル リテイリング	9,400	3,345.00	31,443,000
井筒屋	6,600	364.00	2,402,400
イオン	464,100	2,702.50	1,254,230,250
イズミ	20,800	2,962.00	61,609,600
フォーバル	5,400	893.00	4,822,200
平和堂	22,900	1,930.00	44,197,000
フジ	21,000	1,870.00	39,270,000
ヤオコー	15,600	6,520.00	101,712,000
ゼビオホールディングス	18,500	976.00	18,056,000
ケーズホールディングス	108,900	1,106.00	120,443,400
PALTAC	21,600	4,200.00	90,720,000
三谷産業	24,100	299.00	7,205,900
Olympicグループ	5,200	503.00	2,615,600
日産東京販売ホールディングス	17,600	285.00	5,016,000
新生銀行	37,600	2,210.00	83,096,000
あおぞら銀行	80,100	2,591.00	207,539,100
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,356,500	710.80	5,939,800,200
りそなホールディングス	1,626,900	568.20	924,404,580
三井住友トラスト・ホールディングス	236,200	4,339.00	1,024,871,800
三井住友フィナンシャルグループ	931,400	4,347.00	4,048,795,800
千葉銀行	355,200	800.00	284,160,000
群馬銀行	247,400	413.00	102,176,200
武蔵野銀行	16,400	1,727.00	28,322,800
千葉興業銀行	29,700	318.00	9,444,600
筑波銀行	55,800	188.00	10,490,400
七十七銀行	40,900	1,729.00	70,716,100
秋田銀行	8,500	1,559.00	13,251,500
山形銀行	14,100	1,037.00	14,621,700
岩手銀行	8,600	1,800.00	15,480,000
東邦銀行	101,000	205.00	20,705,000

東北銀行	6,300	952.00	5,997,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	101,800	2,472.00	251,649,600	
スルガ銀行	112,300	403.00	45,256,900	
八十二銀行	261,400	474.00	123,903,600	
山梨中央銀行	13,100	1,006.00	13,178,600	
大垣共立銀行	24,300	1,731.00	42,063,300	
福井銀行	11,400	1,399.00	15,948,600	
清水銀行	5,100	1,411.00	7,196,100	
富山銀行	1,900	1,634.00	3,104,600	
滋賀銀行	21,200	2,435.00	51,622,000	
南都銀行	19,100	2,104.00	40,186,400	
百五銀行	120,000	327.00	39,240,000	
京都銀行	40,400	5,380.00	217,352,000	
紀陽銀行	45,600	1,446.00	65,937,600	
ほくほくフィナンシャルグループ	81,000	879.00	71,199,000	
山陰合同銀行	79,700	709.00	56,507,300	
鳥取銀行	4,200	1,068.00	4,485,600	
百十四銀行	11,600	1,685.00	19,546,000	
四国銀行	20,200	853.00	17,230,600	
阿波銀行	18,800	1,838.00	34,554,400	
大分銀行	7,600	1,796.00	13,649,600	
宮崎銀行	8,200	2,236.00	18,335,200	
佐賀銀行	7,400	1,514.00	11,203,600	
琉球銀行	29,200	777.00	22,688,400	
セブン銀行	456,700	251.00	114,631,700	
みずほフィナンシャルグループ	1,843,400	1,630.00	3,004,742,000	
高知銀行	4,400	624.00	2,745,600	
山口フィナンシャルグループ	140,800	780.00	109,824,000	
芙蓉総合リース	11,700	8,540.00	99,918,000	
みずほリース	18,900	3,305.00	62,464,500	
東京センチュリー	23,800	4,980.00	118,524,000	
SBIホールディングス	184,400	2,685.00	495,114,000	
日本証券金融	51,100	954.00	48,749,400	
アイフル	211,100	419.00	88,450,900	
日本アジア投資	10,200	255.00	2,601,000	
長野銀行	4,000	1,153.00	4,612,000	
名古屋銀行	8,300	2,980.00	24,734,000	
北洋銀行	193,100	233.00	44,992,300	
大光銀行	3,900	1,132.00	4,414,800	
愛媛銀行	17,200	837.00	14,396,400	
トマト銀行	4,300	979.00	4,209,700	
京葉銀行	59,100	507.00	29,963,700	
栃木銀行	58,400	280.00	16,352,000	
北日本銀行	4,500	1,869.00	8,410,500	
東和銀行	23,300	522.00	12,162,600	
福島銀行	13,300	206.00	2,739,800	
大東銀行	5,000	613.00	3,065,000	
リコーリース	12,100	3,640.00	44,044,000	
イオンフィナンシャルサービス	73,200	1,429.00	104,602,800	
アコム	227,500	315.00	71,662,500	

ジャックス	13,500	3,705.00	50,017,500
オリエントコーポレーション	33,300	1,205.00	40,126,500
オリックス	852,500	2,149.00	1,832,022,500
三菱HCキャピタル	496,900	629.00	312,550,100
ジャフコグループ	42,500	2,266.00	96,305,000
九州リースサービス	6,000	629.00	3,774,000
トモニホールディングス	103,000	318.00	32,754,000
大和証券グループ本社	911,200	601.00	547,631,200
野村ホールディングス	2,347,400	494.50	1,160,789,300
岡三証券グループ	112,000	367.00	41,104,000
丸三証券	42,400	408.00	17,299,200
東洋証券	42,300	249.00	10,532,700
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	138,700	353.00	48,961,100
光世証券	2,700	365.00	985,500
水戸証券	34,400	220.00	7,568,000
いちよし証券	23,500	604.00	14,194,000
松井証券	75,400	795.00	59,943,000
SOMPOホールディングス	218,800	6,277.00	1,373,407,600
日本取引所グループ	358,200	2,021.50	724,101,300
マネックスグループ	142,300	464.00	66,027,200
極東証券	16,000	606.00	9,696,000
岩井コスモホールディングス	14,500	1,254.00	18,183,000
アイザワ証券グループ	18,400	659.00	12,125,600
フィデアホールディングス	13,100	1,300.00	17,030,000
池田泉州ホールディングス	162,900	213.00	34,697,700
アニコムホールディングス	43,200	673.00	29,073,600
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	287,400	4,070.00	1,169,718,000
マネーパートナーズグループ	13,200	275.00	3,630,000
スパークス・グループ	14,100	1,645.00	23,194,500
小林洋行	2,800	220.00	616,000
第一生命ホールディングス	648,900	2,424.00	1,572,933,600
東京海上ホールディングス	1,283,400	2,817.50	3,615,979,500
アドバンテッジリスクマネジメント	6,000	424.00	2,544,000
イー・ギャランティ	20,500	2,448.00	50,184,000
アサックス	5,900	602.00	3,551,800
NECキャピタルソリューション	6,300	2,090.00	13,167,000
T&Dホールディングス	342,100	1,523.00	521,018,300
アドバンスクリエイト	7,400	1,047.00	7,747,800
三井不動産	554,000	2,683.00	1,486,382,000
三菱地所	808,200	1,976.50	1,597,407,300
平和不動産	20,600	3,860.00	79,516,000
東京建物	121,500	1,893.00	229,999,500
京阪神ビルディング	16,500	1,356.00	22,374,000
住友不動産	230,400	3,621.00	834,278,400
太平洋興発	4,800	740.00	3,552,000
テーオーシー	23,100	741.00	17,117,100
東京楽天地	1,900	4,255.00	8,084,500
レオパレス21	143,500	312.00	44,772,000

スターツコーポレーション	18,300	2,835.00	51,880,500
フジ住宅	17,900	620.00	11,098,000
空港施設	15,600	537.00	8,377,200
明和地所	6,500	615.00	3,997,500
ゴールドクレスト	12,100	1,714.00	20,739,400
リログループ	74,100	2,214.00	164,057,400
エスリード	6,000	1,868.00	11,208,000
日神グループホールディングス	20,400	426.00	8,690,400
日本エスコン	28,700	812.00	23,304,400
MIRARTHホールディングス	64,400	385.00	24,794,000
AVANTIA	6,400	774.00	4,953,600
イオンモール	66,100	1,618.00	106,949,800
毎日コムネット	4,800	678.00	3,254,400
ファースト住建	5,200	1,011.00	5,257,200
ランド	767,600	9.00	6,908,400
カチタス	34,300	3,400.00	116,620,000
東祥	9,400	1,195.00	11,233,000
トーセイ	21,200	1,408.00	29,849,600
穴吹興産	3,100	1,960.00	6,076,000
サンフロンティア不動産	21,200	1,110.00	23,532,000
FJネクストホールディングス	13,400	980.00	13,132,000
インテリックス	3,200	547.00	1,750,400
ランドビジネス	4,800	228.00	1,094,400
サンネクスタグループ	4,300	925.00	3,977,500
グランディハウス	10,800	546.00	5,896,800
東武鉄道	142,100	3,170.00	450,457,000
相鉄ホールディングス	42,700	2,067.00	88,260,900
東急	362,900	1,607.00	583,180,300
京浜急行電鉄	146,800	1,399.00	205,373,200
小田急電鉄	196,100	1,675.00	328,467,500
京王電鉄	68,500	4,870.00	333,595,000
京成電鉄	83,500	3,685.00	307,697,500
富士急行	16,000	4,810.00	76,960,000
東日本旅客鉄道	219,500	7,668.00	1,683,126,000
西日本旅客鉄道	165,300	5,571.00	920,886,300
東海旅客鉄道	99,700	16,210.00	1,616,137,000
西武ホールディングス	156,500	1,285.00	201,102,500
鴻池運輸	22,100	1,562.00	34,520,200
西日本鉄道	34,600	2,798.00	96,810,800
ハマキョウレックス	10,200	3,355.00	34,221,000
サカイ引越センター	6,100	4,685.00	28,578,500
近鉄グループホールディングス	129,200	4,695.00	606,594,000
阪急阪神ホールディングス	172,300	4,125.00	710,737,500
南海電気鉄道	61,700	2,831.00	174,672,700
京阪ホールディングス	53,400	3,505.00	187,167,000
神戸電鉄	3,600	3,210.00	11,556,000
名古屋鉄道	142,700	2,136.00	304,807,200
山陽電気鉄道	9,800	2,216.00	21,716,800
アルプス物流	10,400	1,137.00	11,824,800
トランコム	3,800	7,680.00	29,184,000

ヤマトホールディングス	165,400	2,308.00	381,743,200
山九	32,900	4,885.00	160,716,500
日新	9,900	2,005.00	19,849,500
丸運	6,400	212.00	1,356,800
丸全昭和運輸	7,900	3,090.00	24,411,000
センコーグループホールディングス	68,500	994.00	68,089,000
トナミホールディングス	2,500	3,640.00	9,100,000
ニッコンホールディングス	41,400	2,398.00	99,277,200
日本石油輸送	800	2,189.00	1,751,200
福山通運	10,800	3,390.00	36,612,000
セイノーホールディングス	80,500	1,159.00	93,299,500
エスライン	3,900	805.00	3,139,500
神奈川中央交通	3,800	3,335.00	12,673,000
日立物流	28,600	8,900.00	254,540,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	31,200	1,530.00	47,736,000
C & F ロジホールディングス	12,400	1,215.00	15,066,000
日本郵船	345,700	2,728.50	943,242,450
商船三井	227,800	3,120.00	710,736,000
川崎汽船	110,100	2,590.00	285,159,000
N S ユナイテッド海運	6,900	3,690.00	25,461,000
明治海運	12,500	730.00	9,125,000
飯野海運	47,500	870.00	41,325,000
共栄タンカー	2,300	941.00	2,164,300
九州旅客鉄道	91,300	2,842.00	259,474,600
S Gホールディングス	248,000	2,027.00	502,696,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	48,200	7,630.00	367,766,000
日本航空	317,400	2,692.00	854,440,800
A N Aホールディングス	351,600	2,841.00	998,895,600
ビーウィズ	4,100	1,220.00	5,002,000
パスコ	2,500	1,297.00	3,242,500
T R Eホールディングス	28,100	1,553.00	43,639,300
人・夢・技術グループ	5,900	2,681.00	15,817,900
西本W i s m e t t a cホールディングス	3,600	4,085.00	14,706,000
シルバーライフ	3,200	1,498.00	4,793,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,200	1,529.00	1,834,800
Genky Drug Stores	6,700	3,760.00	25,192,000
コア商事ホールディングス	9,700	592.00	5,742,400
K P Pグループホールディングス	31,800	870.00	27,666,000
ナルミヤ・インターナショナル	2,100	821.00	1,724,100
ブックオフグループホールディングス	8,000	1,256.00	10,048,000
ギフトホールディングス	2,800	3,600.00	10,080,000
三菱倉庫	27,800	3,355.00	93,269,000
三井倉庫ホールディングス	12,100	3,520.00	42,592,000
住友倉庫	35,500	2,028.00	71,994,000
澁澤倉庫	5,200	2,082.00	10,826,400
ヤマタネ	6,100	1,659.00	10,119,900
東陽倉庫	17,400	252.00	4,384,800
乾汽船	16,500	1,926.00	31,779,000

日本トランスシティ	26,000	495.00	12,870,000
ケイヒン	2,300	1,528.00	3,514,400
中央倉庫	6,300	928.00	5,846,400
川西倉庫	2,200	996.00	2,191,200
安田倉庫	9,000	929.00	8,361,000
ファイズホールディングス	2,300	985.00	2,265,500
東洋埠頭	3,800	1,259.00	4,784,200
上組	64,300	2,842.00	182,740,600
サンリツ	3,100	696.00	2,157,600
キムラユニティー	6,200	800.00	4,960,000
キューソー流通システム	7,700	1,057.00	8,138,900
東海運	7,700	273.00	2,102,100
エーアイテイー	8,000	1,433.00	11,464,000
内外トランスライン	4,700	2,076.00	9,757,200
ショーエイコーポレーション	3,900	570.00	2,223,000
日本コンセプト	4,100	1,879.00	7,703,900
TBSホールディングス	66,400	1,490.00	98,936,000
日本テレビホールディングス	114,800	1,050.00	120,540,000
朝日放送グループホールディングス	12,200	625.00	7,625,000
テレビ朝日ホールディングス	31,400	1,329.00	41,730,600
スカパーJ S A Tホールディングス	115,200	497.00	57,254,400
テレビ東京ホールディングス	9,400	1,829.00	17,192,600
日本BS放送	4,700	915.00	4,300,500
ビジョン	17,100	1,353.00	23,136,300
スマートバリュー	3,300	468.00	1,544,400
USEN-NEXT HOLDINGS	11,600	2,389.00	27,712,400
ワイヤレスゲート	5,700	290.00	1,653,000
コネクシオ	8,600	1,122.00	9,649,200
日本通信	119,700	254.00	30,403,800
クロップス	2,100	1,045.00	2,194,500
日本電信電話	1,663,200	3,874.00	6,443,236,800
KDDI	1,003,000	4,271.00	4,283,813,000
ソフトバンク	2,085,100	1,486.00	3,098,458,600
光通信	15,400	18,590.00	286,286,000
エムティーアイ	11,900	510.00	6,069,000
GMOインターネットグループ	48,200	2,628.00	126,669,600
ファイバーゲート	6,900	975.00	6,727,500
アйдママーケティングコミュニケーション	3,100	281.00	871,100
KADOKAWA	68,600	2,486.00	170,539,600
学研ホールディングス	21,700	962.00	20,875,400
ゼンリン	22,200	854.00	18,958,800
昭文社ホールディングス	5,600	295.00	1,652,000
インプレスホールディングス	11,400	208.00	2,371,200
東京電力ホールディングス	1,166,500	465.00	542,422,500
中部電力	476,900	1,245.00	593,740,500
関西電力	499,700	1,152.00	575,654,400
中国電力	206,100	722.00	148,804,200
北陸電力	122,100	494.00	60,317,400

東北電力	316,400	627.00	198,382,800
四国電力	110,500	738.00	81,549,000
九州電力	298,300	734.00	218,952,200
北海道電力	124,900	445.00	55,580,500
沖縄電力	30,300	1,015.00	30,754,500
電源開発	97,400	2,130.00	207,462,000
エフオン	9,500	647.00	6,146,500
イーレックス	23,000	2,460.00	56,580,000
レノバ	34,500	2,794.00	96,393,000
東京瓦斯	273,600	2,483.00	679,348,800
大阪瓦斯	262,100	2,056.00	538,877,600
東邦瓦斯	50,900	2,624.00	133,561,600
北海道瓦斯	7,700	1,649.00	12,697,300
広島ガス	27,500	341.00	9,377,500
西部ガスホールディングス	12,100	1,633.00	19,759,300
静岡ガス	29,500	974.00	28,733,000
メタウォーター	16,300	1,884.00	30,709,200
アイネット	7,800	1,320.00	10,296,000
松竹	7,400	11,700.00	86,580,000
東宝	81,200	5,050.00	410,060,000
エイチ・アイ・エス	34,800	2,002.00	69,669,600
東映	3,700	17,670.00	65,379,000
ラックランド	4,200	2,895.00	12,159,000
エヌ・ティ・ティ・データ	407,300	2,027.00	825,597,100
共立メンテナンス	22,800	5,690.00	129,732,000
イチネンホールディングス	14,100	1,238.00	17,455,800
建設技術研究所	6,800	3,025.00	20,570,000
スペース	9,800	885.00	8,673,000
アインホールディングス	18,800	6,370.00	119,756,000
燦ホールディングス	5,900	1,720.00	10,148,000
ピー・シー・エー	7,800	1,186.00	9,250,800
スバル興業	600	8,800.00	5,280,000
東京テアトル	5,000	1,114.00	5,570,000
タナベコンサルティンググループ	5,300	631.00	3,344,300
ビジネスブレイン太田昭和	5,600	1,812.00	10,147,200
ナガワ	3,600	7,080.00	25,488,000
東京都競馬	11,200	4,045.00	45,304,000
常磐興産	4,700	1,142.00	5,367,400
カナモト	24,400	2,274.00	55,485,600
D T S	28,600	3,590.00	102,674,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	65,300	6,660.00	434,898,000
シーイーシー	18,200	1,534.00	27,918,800
カブコン	129,000	4,415.00	569,535,000
西尾レントオール	12,400	2,946.00	36,530,400
アイ・エス・ピー	6,600	1,329.00	8,771,400
アゴーラ ホスピタリティグループ	75,500	23.00	1,736,500
日本空港ビルデング	45,100	5,960.00	268,796,000
トランス・コスモス	16,600	3,170.00	52,622,000

乃村工藝社	58,100	1,060.00	61,586,000
ジャステック	7,900	1,270.00	10,033,000
S C S K	105,900	2,183.00	231,179,700
藤田観光	5,900	2,903.00	17,127,700
K N T - C Tホールディングス	7,900	1,650.00	13,035,000
日本管財	13,900	2,526.00	35,111,400
トーカイ	11,800	1,899.00	22,408,200
白洋舎	1,200	1,547.00	1,856,400
セコム	135,500	8,234.00	1,115,707,000
N S W	5,100	2,173.00	11,082,300
セントラル警備保障	7,100	2,537.00	18,012,700
アイネス	9,200	1,457.00	13,404,400
丹青社	25,700	798.00	20,508,600
メイテック	53,100	2,572.00	136,573,200
T K C	23,300	3,800.00	88,540,000
富士ソフト	14,600	8,290.00	121,034,000
応用地質	12,900	2,202.00	28,405,800
船井総研ホールディングス	28,000	2,767.00	77,476,000
N S D	46,400	2,642.00	122,588,800
進学会ホールディングス	4,500	301.00	1,354,500
丸紅建材リース	800	1,734.00	1,387,200
オオバ	8,300	681.00	5,652,300
コナミグループ	55,500	6,540.00	362,970,000
いであ	3,100	1,672.00	5,183,200
学究社	5,300	1,730.00	9,169,000
ベネッセホールディングス	49,600	1,951.00	96,769,600
イオンディライト	14,600	2,963.00	43,259,800
ナック	6,100	933.00	5,691,300
福井コンピュータホールディングス	9,000	3,370.00	30,330,000
ダイセキ	27,200	4,665.00	126,888,000
ステップ	5,500	1,888.00	10,384,000
日鉄物産	9,500	5,200.00	49,400,000
泉州電業	6,800	2,690.00	18,292,000
元気寿司	4,400	3,140.00	13,816,000
トラスコ中山	28,800	1,994.00	57,427,200
ヤマダホールディングス	561,500	463.00	259,974,500
オートバックスセブン	47,600	1,415.00	67,354,000
モリト	9,900	746.00	7,385,400
アークランズ	20,000	1,501.00	30,020,000
ニトリホールディングス	55,300	15,490.00	856,597,000
グルメ杵屋	11,200	1,001.00	11,211,200
愛眼	7,400	175.00	1,295,000
ケーユーホールディングス	8,000	1,247.00	9,976,000
吉野家ホールディングス	53,600	2,292.00	122,851,200
加藤産業	16,700	3,540.00	59,118,000
北恵	3,200	755.00	2,416,000
イノテック	8,600	1,271.00	10,930,600
イエローハット	24,200	1,694.00	40,994,800
松屋フーズホールディングス	6,500	3,960.00	25,740,000
J B C Cホールディングス	9,600	1,841.00	17,673,600

JKホールディングス	10,800	1,036.00	11,188,800	
サガミホールディングス	22,100	1,221.00	26,984,100	
日伝	8,000	1,708.00	13,664,000	
関西フードマーケット	12,400	1,392.00	17,260,800	
ミロク情報サービス	11,800	1,428.00	16,850,400	
北沢産業	7,000	193.00	1,351,000	
杉本商事	6,100	2,040.00	12,444,000	
因幡電機産業	35,500	2,714.00	96,347,000	
王将フードサービス	9,000	5,950.00	53,550,000	
プレナス	15,100	2,635.00	39,788,500	
ミニストップ	10,100	1,410.00	14,241,000	
アークス	25,100	2,034.00	51,053,400	
パローホールディングス	26,000	1,766.00	45,916,000	
東テク	4,600	3,495.00	16,077,000	
ミスミグループ本社	206,600	3,315.00	684,879,000	
アルテック	7,700	301.00	2,317,700	
ベルク	6,800	5,510.00	37,468,000	
大 庄	7,400	1,055.00	7,807,000	
タキヒヨー	3,400	761.00	2,587,400	
ファーストリテイリング	20,500	82,190.00	1,684,895,000	
ソフトバンクグループ	750,500	6,953.00	5,218,226,500	
蔵王産業	2,200	1,727.00	3,799,400	
スズケン	49,900	3,250.00	162,175,000	
サンドラッグ	52,000	3,385.00	176,020,000	
サックスパー ホールディングス	13,000	734.00	9,542,000	
ジェコス	9,000	810.00	7,290,000	
ヤマザワ	2,500	1,150.00	2,875,000	
やまや	2,800	2,448.00	6,854,400	
グローセル	15,000	421.00	6,315,000	
ベルーナ	32,900	693.00	22,799,700	
合計	152,321,200		369,641,938,680	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

為替フルヘッジ外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド
貸借対照表

(単位：円)

2022年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	550,199,839
コール・ローン	1,630,665,983
国債証券	209,954,814,561
派生商品評価勘定	6,938,469,203
未収入金	23,304,147
未収利息	980,405,076
前払費用	470,606,941
流動資産合計	220,548,465,750
資産合計	
220,548,465,750	
負債の部	
流動負債	
未払金	3,165
未払解約金	3,449,000
流動負債合計	3,452,165
負債合計	
3,452,165	
純資産の部	
元本等	
元本	182,027,030,485
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	38,517,983,100
元本等合計	220,545,013,585
純資産合計	220,545,013,585
負債純資産合計	220,548,465,750

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11月12日 至 2022年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	369,051,653,049円
同期中追加設定元本額	750,171,772,765円
同期中一部解約元本額	937,196,395,329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>	8,862,848,786円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,102,583,150円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,896,079,006円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,393,607,973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)	51,321,017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)	1,483,960,420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)	1,723,160,689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)	459,849,497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)	56,774,887円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	6,461,152円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	20,249,956円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	192,265,122円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	11,132,921円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,149,282円
投資のソムリエ	74,499,770,064円
投資のソムリエ<DC年金>	5,150,063,330円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	5,916,390,451円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	26,948,281,616円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,150,626,128円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	1,015,970,007円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	440,579,377円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	220,553,422円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	40,046,185円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	977,333,692円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,218,442,235円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,574,701,696円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	459,688,772円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	225,968,100円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	146,933,952円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	27,959,761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)	19,876,196,159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)	7,251,652,232円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	1,927,455,784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)	40,672,950円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	70,885,548円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	530,588,474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)	46,814,570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)	311,608,986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)	598,683,855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)	898,600,858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)	478,550,143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	182,027,030,485円
2. 受益権の総数	182,027,030,485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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短時間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	4,171,020,535
合計	4,171,020,535

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年11月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	216,311,770,569	-	209,373,301,366	6,938,469,203
アメリカ・ドル	111,358,798,240	-	106,404,575,275	4,954,222,965
イギリス・ポンド	9,973,475,592	-	9,653,984,112	319,491,480
イスラエル・シェケル	835,847,428	-	806,650,868	29,196,560
オーストラリア・ドル	3,337,250,671	-	3,288,550,136	48,700,535
オフショア・人民元	7,472,652,373	-	7,297,961,986	174,690,387
カナダ・ドル	4,565,563,222	-	4,459,440,719	106,122,503

シンガポール・ドル	996,736,231	-	974,066,967	22,669,264
スウェーデン・クローナ	562,924,249	-	558,756,886	4,167,363
デンマーク・クローネ	793,701,394	-	781,024,272	12,677,122
ニュージーランド・ドル	443,642,963	-	436,429,633	7,213,330
ノルウェー・クローネ	456,373,963	-	447,683,899	8,690,064
ポーランド・ズロチ	865,926,428	-	859,523,776	6,402,652
マレーシア・リンギット	1,134,771,204	-	1,109,552,934	25,218,270
メキシコ・ペソ	1,850,131,066	-	1,819,200,345	30,930,721
ユーロ	71,663,975,545	-	70,475,899,558	1,188,075,987
合計	216,311,770,569	-	209,373,301,366	6,938,469,203

(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11月11日現在
1口当たり純資産額	1.2116円
(1万口当たり純資産額)	(12,116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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	US T N/B 0.125 02/15/24	4,870,000.000	4,608,998.430	
		US T N/B 0.25 05/15/24	550,000.000	516,033.190	
		US T N/B 0.25 05/31/25	4,000,000.000	3,617,500.000	
		US T N/B 0.25 06/30/25	5,000,000.000	4,516,796.850	
		US T N/B 0.25 08/31/25	9,020,000.000	8,091,926.510	
		US T N/B 0.25 10/31/25	2,810,000.000	2,505,729.680	
		US T N/B 0.375 01/31/26	4,000,000.000	3,547,343.720	
		US T N/B 0.375 04/15/24	7,740,000.000	7,300,392.140	
		US T N/B 0.375 04/30/25	6,870,000.000	6,258,677.300	

US T N/B 0.375 07/31/27	3,000,000.000	2,541,562.500	
US T N/B 0.375 08/15/24	18,000,000.000	16,766,718.660	
US T N/B 0.375 09/15/24	60,000.000	55,785.930	
US T N/B 0.375 11/30/25	3,020,000.000	2,694,170.290	
US T N/B 0.375 12/31/25	3,400,000.000	3,027,328.100	
US T N/B 0.5 02/28/26	5,000,000.000	4,442,187.500	
US T N/B 0.5 03/31/25	6,790,000.000	6,224,785.520	
US T N/B 0.5 05/31/27	3,830,000.000	3,278,839.060	
US T N/B 0.5 06/30/27	3,170,000.000	2,707,378.120	
US T N/B 0.5 08/31/27	2,520,000.000	2,139,145.290	
US T N/B 0.5 10/31/27	3,000,000.000	2,533,828.110	
US T N/B 0.5 11/30/23	2,000,000.000	1,916,875.000	
US T N/B 0.625 03/31/27	2,630,000.000	2,276,645.110	
US T N/B 0.625 05/15/30	5,150,000.000	4,084,493.170	
US T N/B 0.625 07/31/26	3,000,000.000	2,641,875.000	
US T N/B 0.625 08/15/30	9,110,000.000	7,172,345.620	
US T N/B 0.625 10/15/24	17,340,000.000	16,156,003.120	
US T N/B 0.625 12/31/27	3,160,000.000	2,675,446.100	
US T N/B 0.75 01/31/28	3,270,000.000	2,777,967.180	
US T N/B 0.75 03/31/26	5,140,000.000	4,595,682.010	
US T N/B 0.75 04/30/26	900,000.000	802,687.500	
US T N/B 0.75 05/31/26	3,000,000.000	2,668,828.110	
US T N/B 0.75 08/31/26	5,000,000.000	4,413,281.250	
US T N/B 0.75 11/15/24	4,040,000.000	3,760,987.500	
US T N/B 0.75 12/31/23	4,940,000.000	4,735,646.080	
US T N/B 0.875 01/31/24	6,000,000.000	5,738,906.220	
US T N/B 0.875 06/30/26	3,250,000.000	2,897,324.200	
US T N/B 0.875 09/30/26	11,680,000.000	10,338,168.660	
US T N/B 0.875 11/15/30	5,190,000.000	4,156,865.620	
US T N/B 1.0 07/31/28	3,670,000.000	3,116,919.510	
US T N/B 1.0 12/15/24	16,260,000.000	15,185,315.620	
US T N/B 1.125 02/15/31	7,230,000.000	5,886,236.680	
US T N/B 1.125 02/28/25	4,820,000.000	4,489,754.660	
US T N/B 1.125 02/29/28	5,380,000.000	4,654,120.280	
US T N/B 1.125 05/15/40	1,930,000.000	1,188,156.250	
US T N/B 1.125 08/15/40	3,760,000.000	2,289,781.230	
US T N/B 1.125 08/31/28	4,370,000.000	3,730,375.370	
US T N/B 1.125 10/31/26	4,000,000.000	3,569,375.000	
US T N/B 1.25 03/31/28	3,880,000.000	3,370,446.850	
US T N/B 1.25 04/30/28	4,000,000.000	3,467,343.720	
US T N/B 1.25 05/15/50	4,370,000.000	2,315,587.870	
US T N/B 1.25 05/31/28	3,850,000.000	3,330,550.760	
US T N/B 1.25 06/30/28	5,000,000.000	4,319,140.600	
US T N/B 1.25 08/15/31	6,680,000.000	5,412,104.670	
US T N/B 1.25 08/31/24	5,400,000.000	5,103,421.840	
US T N/B 1.25 09/30/28	7,120,000.000	6,110,684.320	
US T N/B 1.25 11/30/26	4,000,000.000	3,582,187.480	
US T N/B 1.25 12/31/26	10,960,000.000	9,800,637.500	
US T N/B 1.375 08/15/50	6,850,000.000	3,735,390.620	

US T N/B 1.375 08/31/26	2,750,000.000	2,487,890.620	
US T N/B 1.375 10/31/28	4,000,000.000	3,452,031.240	
US T N/B 1.375 11/15/31	13,320,000.000	10,839,150.000	
US T N/B 1.375 11/15/40	4,330,000.000	2,757,668.750	
US T N/B 1.375 12/31/28	3,900,000.000	3,360,093.750	
US T N/B 1.5 01/31/27	5,290,000.000	4,772,158.560	
US T N/B 1.5 02/15/25	5,580,000.000	5,241,276.530	
US T N/B 1.5 02/15/30	4,730,000.000	4,035,281.250	
US T N/B 1.5 02/29/24	20,000.000	19,215.620	
US T N/B 1.5 08/15/26	4,990,000.000	4,539,730.440	
US T N/B 1.5 11/30/28	4,000,000.000	3,472,187.480	
US T N/B 1.625 02/15/26	3,900,000.000	3,598,054.660	
US T N/B 1.625 05/15/26	2,000,000.000	1,837,656.240	
US T N/B 1.625 05/15/31	5,460,000.000	4,596,637.500	
US T N/B 1.625 08/15/29	4,400,000.000	3,813,906.220	
US T N/B 1.625 09/30/26	3,820,000.000	3,489,629.660	
US T N/B 1.625 11/15/50	7,310,000.000	4,278,634.370	
US T N/B 1.75 01/31/29	4,000,000.000	3,513,281.240	
US T N/B 1.75 03/15/25	6,100,000.000	5,754,968.750	
US T N/B 1.75 06/30/24	6,760,000.000	6,466,362.500	
US T N/B 1.75 08/15/41	5,140,000.000	3,440,587.500	
US T N/B 1.75 11/15/29	2,900,000.000	2,534,214.820	
US T N/B 1.875 02/15/32	6,010,000.000	5,092,535.930	
US T N/B 1.875 02/15/41	5,330,000.000	3,709,346.870	
US T N/B 1.875 02/15/51	6,700,000.000	4,195,875.000	
US T N/B 1.875 02/28/27	4,690,000.000	4,295,014.060	
US T N/B 1.875 02/28/29	6,000,000.000	5,306,718.720	
US T N/B 1.875 06/30/26	2,920,000.000	2,701,000.000	
US T N/B 1.875 11/15/51	5,690,000.000	3,545,581.250	
US T N/B 2.0 02/15/50	2,610,000.000	1,698,946.870	
US T N/B 2.0 04/30/24	6,860,000.000	6,613,468.750	
US T N/B 2.0 05/31/24	6,440,000.000	6,192,462.490	
US T N/B 2.0 08/15/25	2,190,000.000	2,063,219.520	
US T N/B 2.0 08/15/51	6,310,000.000	4,062,062.500	
US T N/B 2.0 11/15/26	4,140,000.000	3,824,325.000	
US T N/B 2.0 11/15/41	6,490,000.000	4,532,859.370	
US T N/B 2.125 02/29/24	5,000,000.000	4,845,312.500	
US T N/B 2.125 03/31/24	4,600,000.000	4,451,937.500	
US T N/B 2.125 05/15/25	2,500,000.000	2,373,437.500	
US T N/B 2.125 05/31/26	50,000.000	46,695.310	
US T N/B 2.125 07/31/24	6,170,000.000	5,931,153.490	
US T N/B 2.125 09/30/24	2,400,000.000	2,301,750.000	
US T N/B 2.25 01/31/24	6,160,000.000	5,991,081.210	
US T N/B 2.25 02/15/27	500,000.000	465,136.710	
US T N/B 2.25 02/15/52	6,020,000.000	4,123,700.000	
US T N/B 2.25 03/31/24	8,510,000.000	8,250,378.450	
US T N/B 2.25 03/31/26	7,000,000.000	6,592,304.670	
US T N/B 2.25 04/30/24	5,000,000.000	4,841,015.600	
US T N/B 2.25 05/15/41	3,220,000.000	2,380,787.500	

US T N/B 2.25 08/15/27	3,640,000.000	3,366,857.780	
US T N/B 2.25 08/15/46	1,080,000.000	748,026.550	
US T N/B 2.25 08/15/49	3,030,000.000	2,103,956.250	
US T N/B 2.25 11/15/24	16,780,000.000	16,112,732.720	
US T N/B 2.25 11/15/25	1,820,000.000	1,720,610.920	
US T N/B 2.25 11/15/27	3,340,000.000	3,079,062.500	
US T N/B 2.375 02/15/42	5,560,000.000	4,154,796.840	
US T N/B 2.375 02/29/24	5,800,000.000	5,642,312.500	
US T N/B 2.375 03/31/29	4,000,000.000	3,643,281.240	
US T N/B 2.375 04/30/26	4,280,000.000	4,041,256.250	
US T N/B 2.375 05/15/27	5,000,000.000	4,666,796.850	
US T N/B 2.375 05/15/29	3,450,000.000	3,138,421.870	
US T N/B 2.375 05/15/51	5,210,000.000	3,687,703.120	
US T N/B 2.375 08/15/24	4,000,000.000	3,857,187.480	
US T N/B 2.375 11/15/49	5,000,000.000	3,568,750.000	
US T N/B 2.5 01/31/25	6,000,000.000	5,771,718.720	
US T N/B 2.5 02/15/45	1,210,000.000	892,185.930	
US T N/B 2.5 02/15/46	3,130,000.000	2,291,257.810	
US T N/B 2.5 02/28/26	3,520,000.000	3,343,724.980	
US T N/B 2.5 03/31/27	9,760,000.000	9,167,156.220	
US T N/B 2.5 04/30/24	7,100,000.000	6,894,210.900	
US T N/B 2.5 05/15/46	2,360,000.000	1,729,160.930	
US T N/B 2.625 01/31/26	1,280,000.000	1,220,949.990	
US T N/B 2.625 02/15/29	4,530,000.000	4,192,904.250	
US T N/B 2.625 04/15/25	2,280,000.000	2,192,451.550	
US T N/B 2.625 05/31/27	3,000,000.000	2,831,484.360	
US T N/B 2.625 07/31/29	1,500,000.000	1,384,218.750	
US T N/B 2.625 12/31/25	2,000,000.000	1,909,687.500	
US T N/B 2.75 02/15/24	3,470,000.000	3,393,822.630	
US T N/B 2.75 02/15/28	3,000,000.000	2,824,804.680	
US T N/B 2.75 02/28/25	10,000.000	9,664.060	
US T N/B 2.75 04/30/27	2,740,000.000	2,598,718.750	
US T N/B 2.75 05/15/25	6,500,000.000	6,264,882.780	
US T N/B 2.75 05/31/29	3,000,000.000	2,792,226.540	
US T N/B 2.75 06/30/25	70,000.000	67,446.090	
US T N/B 2.75 07/31/27	2,000,000.000	1,894,296.860	
US T N/B 2.75 08/15/32	8,980,000.000	8,179,166.380	
US T N/B 2.75 08/15/42	50,000.000	39,656.250	
US T N/B 2.75 08/15/47	1,450,000.000	1,111,458.970	
US T N/B 2.75 08/31/25	3,000,000.000	2,883,515.610	
US T N/B 2.75 11/15/23	700,000.000	687,640.620	
US T N/B 2.75 11/15/42	1,030,000.000	812,975.770	
US T N/B 2.75 11/15/47	2,160,000.000	1,655,859.360	
US T N/B 2.875 04/30/25	3,920,000.000	3,793,825.000	
US T N/B 2.875 05/15/28	9,140,000.000	8,645,154.640	
US T N/B 2.875 05/15/32	3,840,000.000	3,542,099.980	
US T N/B 2.875 05/15/43	1,790,000.000	1,436,475.000	
US T N/B 2.875 05/15/49	3,050,000.000	2,421,175.760	
US T N/B 2.875 05/15/52	1,000,000.000	790,312.500	

US T N/B 2.875 05/31/25	4,550,000.000	4,398,570.310	
US T N/B 2.875 06/15/25	4,000,000.000	3,867,500.000	
US T N/B 2.875 07/31/25	3,270,000.000	3,157,338.260	
US T N/B 2.875 08/15/28	3,860,000.000	3,639,256.250	
US T N/B 2.875 08/15/45	2,400,000.000	1,890,000.000	
US T N/B 2.875 11/15/46	1,020,000.000	802,612.500	
US T N/B 2.875 11/30/23	2,070,000.000	2,032,481.250	
US T N/B 2.875 11/30/25	1,140,000.000	1,097,606.250	
US T N/B 3.0 02/15/47	5,020,000.000	4,034,825.000	
US T N/B 3.0 02/15/48	3,080,000.000	2,480,242.160	
US T N/B 3.0 02/15/49	3,030,000.000	2,464,478.890	
US T N/B 3.0 05/15/42	1,000,000.000	830,390.620	
US T N/B 3.0 05/15/45	1,930,000.000	1,557,871.870	
US T N/B 3.0 05/15/47	1,210,000.000	972,915.620	
US T N/B 3.0 07/15/25	5,000,000.000	4,844,726.550	
US T N/B 3.0 08/15/48	5,880,000.000	4,758,206.240	
US T N/B 3.0 08/15/52	4,340,000.000	3,533,031.250	
US T N/B 3.0 09/30/25	2,000,000.000	1,935,000.000	
US T N/B 3.0 10/31/25	40,000.000	38,671.870	
US T N/B 3.0 11/15/44	1,320,000.000	1,069,200.000	
US T N/B 3.0 11/15/45	870,000.000	701,165.620	
US T N/B 3.125 02/15/42	1,310,000.000	1,115,853.890	
US T N/B 3.125 02/15/43	2,760,000.000	2,314,734.360	
US T N/B 3.125 05/15/48	2,360,000.000	1,949,950.000	
US T N/B 3.125 08/15/44	1,650,000.000	1,367,953.120	
US T N/B 3.125 08/31/27	8,450,000.000	8,145,667.920	
US T N/B 3.125 11/15/28	5,380,000.000	5,134,537.500	
US T N/B 3.125 11/15/41	80,000.000	68,081.240	
US T N/B 3.25 05/15/42	4,950,000.000	4,277,109.370	
US T N/B 3.25 06/30/27	3,000,000.000	2,905,781.250	
US T N/B 3.25 06/30/29	4,860,000.000	4,661,992.950	
US T N/B 3.375 05/15/44	900,000.000	779,343.750	
US T N/B 3.375 08/15/42	3,480,000.000	3,068,381.250	
US T N/B 3.375 11/15/48	2,840,000.000	2,472,131.250	
US T N/B 3.5 02/15/39	890,000.000	830,203.120	
US T N/B 3.625 02/15/44	2,160,000.000	1,950,075.000	
US T N/B 3.625 08/15/43	1,000,000.000	907,812.500	
US T N/B 3.75 08/15/41	1,000,000.000	937,812.500	
US T N/B 3.75 11/15/43	1,000,000.000	924,375.000	
US T N/B 3.875 08/15/40	2,580,000.000	2,485,668.750	
US T N/B 4.25 05/15/39	2,000,000.000	2,043,125.000	
US T N/B 4.25 11/15/40	1,000,000.000	1,010,234.370	
US T N/B 4.375 02/15/38	750,000.000	782,343.750	
US T N/B 4.375 05/15/40	2,220,000.000	2,290,762.500	
US T N/B 4.375 05/15/41	870,000.000	892,021.870	
US T N/B 4.375 11/15/39	1,200,000.000	1,241,625.000	
US T N/B 4.5 02/15/36	1,410,000.000	1,502,531.250	
US T N/B 4.5 08/15/39	30,000.000	31,593.750	
US T N/B 4.75 02/15/41	20,000.000	21,531.250	

	US T N/B 5.0 05/15/37	750,000.000	834,843.750	
	US T N/B 5.25 11/15/28	1,700,000.000	1,809,437.500	
	US T N/B 5.375 02/15/31	2,290,000.000	2,530,271.080	
	US T N/B 6.0 02/15/26	1,810,000.000	1,909,691.380	
	US T N/B 6.125 11/15/27	8,320,000.000	9,107,149.950	
	US T N/B 6.25 05/15/30	2,000,000.000	2,301,093.700	
アメリカ・ドル	小計	853,800,000.000 (121,128,606,000)	752,481,263.970 (106,754,516,920)	
イギリス・ポンド	UK TREASURY 0.125 01/30/26	900,000.000	818,190.000	
	UK TREASURY 0.125 01/31/24	1,120,000.000	1,080,296.440	
	UK TREASURY 0.25 01/31/25	2,240,000.000	2,095,578.240	
	UK TREASURY 0.25 07/31/31	3,350,000.000	2,579,165.000	
	UK TREASURY 0.375 10/22/26	1,270,000.000	1,135,266.710	
	UK TREASURY 0.375 10/22/30	2,240,000.000	1,787,099.770	
	UK TREASURY 0.5 01/31/29	1,000,000.000	839,240.000	
	UK TREASURY 0.5 10/22/61	1,610,000.000	688,258.900	
	UK TREASURY 0.625 06/07/25	1,410,000.000	1,324,483.500	
	UK TREASURY 0.625 07/31/35	1,420,000.000	1,001,100.000	
	UK TREASURY 0.625 10/22/50	1,120,000.000	565,442.300	
	UK TREASURY 0.875 01/31/46	650,000.000	381,030.000	
	UK TREASURY 0.875 07/31/33	1,060,000.000	819,581.400	
	UK TREASURY 0.875 10/22/29	90,000.000	76,680.000	
	UK TREASURY 1.0 01/31/32	3,350,000.000	2,727,927.770	
	UK TREASURY 1.0 04/22/24	1,990,000.000	1,931,495.590	
	UK TREASURY 1.125 01/31/39	1,770,000.000	1,235,267.420	
	UK TREASURY 1.125 10/22/73	710,000.000	379,935.200	
	UK TREASURY 1.25 07/22/27	690,000.000	629,073.000	
	UK TREASURY 1.25 07/31/51	1,270,000.000	773,049.000	
UK TREASURY 1.25 10/22/41	2,370,000.000	1,616,848.120		
UK TREASURY 1.5 07/22/26	1,040,000.000	978,605.880		
UK TREASURY 1.5 07/22/47	1,720,000.000	1,156,032.640		
UK TREASURY 1.5 07/31/53	70,000.000	45,203.360		

UK TREASURY 1.625 10/22/28	1,320,000.000	1,202,881.680	
UK TREASURY 1.625 10/22/54	880,000.000	588,843.200	
UK TREASURY 1.625 10/22/71	670,000.000	443,519.900	
UK TREASURY 1.75 01/22/49	510,000.000	361,763.400	
UK TREASURY 1.75 07/22/57	1,510,000.000	1,059,805.580	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	1,760,000.000	1,389,759.360	
UK TREASURY 2.0 09/07/25	910,000.000	883,658.230	
UK TREASURY 2.5 07/22/65	950,000.000	818,900.000	
UK TREASURY 2.75 09/07/24	1,050,000.000	1,042,048.350	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	1,210,000.000	1,151,755.190	
UK TREASURY 3.5 01/22/45	1,630,000.000	1,614,603.020	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	1,310,000.000	1,437,070.000	
UK TREASURY 3.75 07/22/52	770,000.000	819,959.440	
UK TREASURY 4.0 01/22/60	1,390,000.000	1,638,879.500	
UK TREASURY 4.25 03/07/36	1,120,000.000	1,206,376.640	
UK TREASURY 4.25 06/07/32	850,000.000	916,697.800	
UK TREASURY 4.25 09/07/39	1,020,000.000	1,097,985.120	
UK TREASURY 4.25 12/07/27	2,550,000.000	2,651,051.400	
UK TREASURY 4.25 12/07/40	200,000.000	216,426.000	
UK TREASURY 4.25 12/07/46	2,110,000.000	2,346,868.600	
UK TREASURY 4.25 12/07/49	450,000.000	509,513.400	
UK TREASURY 4.25 12/07/55	1,650,000.000	1,954,326.000	
UK TREASURY 4.5 12/07/42	800,000.000	903,958.880	
UK TREASURY 4.75 12/07/30	860,000.000	952,329.600	
UK TREASURY 4.75 12/07/38	1,760,000.000	2,004,416.120	
UK TREASURY 5.0 03/07/25	1,580,000.000	1,644,656.440	
UK TREASURY 6.0 12/07/28	1,450,000.000	1,652,765.370	
イギリス・ボンド 小計	66,730,000.000 (11,045,149,600)	59,175,668.460 (9,794,756,643)	
イスラエル・ シュケル	ISRAEL FIXED BOND 0.4 10/31/24	2,390,000.000	2,263,729.130

	ISRAEL FIXED BOND 0.5 02/27/26	1,770,000.000	1,616,533.920	
	ISRAEL FIXED BOND 0.5 04/30/25	1,180,000.000	1,102,943.640	
	ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	2,810,000.000	2,387,997.010	
	ISRAEL FIXED BOND 1.3 04/30/32	90,000.000	75,609.720	
	ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	1,970,000.000	1,554,207.860	
	ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	1,630,000.000	1,564,542.460	
	ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	2,350,000.000	2,225,736.700	
	ISRAEL FIXED BOND 2.25 09/28/28	1,160,000.000	1,093,030.880	
	ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	1,920,000.000	2,010,428.160	
	ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	930,000.000	1,192,384.620	
	ISRAEL FIXED BOND 6.25 10/30/26	2,100,000.000	2,329,223.400	
	イスラエル・シュケル 小計	20,300,000.000 (827,641,150)	19,416,367.500 (791,615,011)	
オーストラリア・ドル	AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	1,970,000.000	1,858,272.410	
	AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	3,490,000.000	3,190,189.760	
	AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	760,000.000	682,518.160	
	AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	1,470,000.000	1,168,410.740	
	AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	1,710,000.000	1,394,321.440	
	AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	230,000.000	185,081.450	
	AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	3,520,000.000	2,959,102.530	
	AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	1,580,000.000	967,592.000	
	AUSTRALIAN 1.75 11/21/32	3,430,000.000	2,869,290.590	
	AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	2,340,000.000	2,171,100.710	
	AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	470,000.000	385,288.370	
	AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	160,000.000	142,101.420	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	2,440,000.000	2,379,366.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	950,000.000	911,929.000	
	AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	2,060,000.000	1,970,596.000	
	AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	880,000.000	725,267.940	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	500,000.000	500,636.950	
	AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	3,500,000.000	3,445,643.590	
	AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	670,000.000	602,819.800	
	AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	680,000.000	662,728.160	
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	780,000.000	804,148.330		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	3,290,000.000	3,511,195.250		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	1,490,000.000	1,574,173.660		
	オーストラリア・ドル 小計	38,370,000.000 (3,590,664,600)	35,061,774.260 (3,281,080,835)	

オフショア・人民元	CHINA GOVERNMENT BOND 1.99 09/15/24	15,000,000.000	14,963,400.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 06/25/24	5,300,000.000	5,307,459.750	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.18 08/25/25	24,600,000.000	24,525,093.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.26 02/24/25	2,000,000.000	2,001,946.400	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.28 03/17/24	25,000,000.000	25,090,750.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.37 01/20/27	5,000,000.000	4,979,480.300	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.44 10/15/27	12,000,000.000	11,970,240.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.47 09/02/24	34,000,000.000	34,233,746.600	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.48 04/15/27	22,000,000.000	21,991,064.040	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.5 07/25/27	15,000,000.000	15,002,325.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.6 09/01/32	10,000,000.000	9,913,100.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.62 09/25/29	14,000,000.000	13,922,510.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.68 05/21/30	23,500,000.000	23,407,005.330	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/12/26	27,310,000.000	27,578,137.770	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.69 08/15/32	9,400,000.000	9,371,544.790	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.75 02/17/32	15,000,000.000	14,973,825.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.76 05/15/32	10,000,000.000	10,011,450.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.8 03/24/29	6,000,000.000	6,043,290.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 2.91 10/14/28	5,500,000.000	5,592,866.950	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.01 05/13/28	12,000,000.000	12,274,116.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.02 05/27/31	9,500,000.000	9,712,352.550	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.28 12/03/27	17,500,000.000	18,177,285.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.32 04/15/52	19,400,000.000	20,054,847.000	
	CHINA GOVERNMENT BOND 3.53 10/18/51	7,700,000.000	8,224,254.500	
CHINA GOVERNMENT BOND 3.72 04/12/51	7,950,000.000	8,737,761.520		

オフショア・人民元 小計		354,660,000.000 (7,020,565,632)	358,059,851.500 (7,087,866,372)	
カナダ・ドル	CANADA 0.25 03/01/26	260,000.000	233,501.580	
	CANADA 0.25 04/01/24	600,000.000	571,135.800	
	CANADA 0.5 09/01/25	4,390,000.000	4,016,850.000	
	CANADA 0.5 12/01/30	3,500,000.000	2,846,567.500	
	CANADA 0.75 10/01/24	410,000.000	387,542.250	
	CANADA 1.0 06/01/27	100,000.000	90,495.800	
	CANADA 1.0 09/01/26	1,860,000.000	1,698,202.320	
	CANADA 1.25 03/01/25	1,400,000.000	1,323,107.800	
	CANADA 1.25 03/01/27	760,000.000	695,765.560	
	CANADA 1.25 06/01/30	3,090,000.000	2,700,833.040	
	CANADA 1.5 04/01/25	2,080,000.000	1,973,123.360	
	CANADA 1.5 05/01/24	1,620,000.000	1,565,169.480	
	CANADA 1.5 06/01/31	4,500,000.000	3,946,500.000	
	CANADA 1.75 12/01/53	1,350,000.000	951,932.250	
	CANADA 2.0 06/01/32	3,000,000.000	2,718,240.000	
	CANADA 2.0 12/01/51	4,260,000.000	3,238,528.680	
	CANADA 2.25 03/01/24	1,550,000.000	1,517,752.250	
	CANADA 2.25 06/01/25	1,260,000.000	1,216,896.660	
	CANADA 2.25 06/01/29	1,910,000.000	1,810,878.640	
	CANADA 2.25 12/01/29	1,300,000.000	1,229,183.800	
	CANADA 2.75 08/01/24	1,260,000.000	1,237,134.780	
	CANADA 2.75 09/01/27	2,160,000.000	2,106,876.960	
	CANADA 2.75 12/01/48	170,000.000	153,572.050	
	CANADA 2.75 12/01/64	580,000.000	511,636.560	
CANADA 3.0 11/01/24	1,160,000.000	1,142,065.240		
CANADA 3.5 12/01/45	790,000.000	809,528.010		
CANADA 4.0 06/01/41	110,000.000	119,582.430		
CANADA 5.0 06/01/37	80,000.000	95,105.440		
CANADA 5.75 06/01/33	720,000.000	881,253.360		
カナダ・ドル 小計		46,230,000.000 (4,915,635,900)	41,788,961.600 (4,443,420,287)	
シンガポール・ドル	SINGAPORE 0.5 11/01/25	240,000.000	222,096.000	
	SINGAPORE 1.25 11/01/26	630,000.000	583,884.000	
	SINGAPORE 1.625 07/01/31	400,000.000	345,561.400	
	SINGAPORE 1.875 03/01/50	380,000.000	287,280.000	
	SINGAPORE 1.875 10/01/51	400,000.000	304,050.000	
	SINGAPORE 2.0 02/01/24	290,000.000	285,331.000	
	SINGAPORE 2.125 06/01/26	1,030,000.000	993,229.000	
	SINGAPORE 2.25 08/01/36	280,000.000	242,390.400	
	SINGAPORE 2.375 06/01/25	740,000.000	726,680.000	
	SINGAPORE 2.375 07/01/39	40,000.000	34,380.000	
	SINGAPORE 2.625 05/01/28	140,000.000	134,736.000	
	SINGAPORE 2.75 03/01/46	720,000.000	660,240.000	
	SINGAPORE 2.75 04/01/42	580,000.000	529,107.900	
	SINGAPORE 2.875 07/01/29	290,000.000	279,995.000	
SINGAPORE 2.875 09/01/27	920,000.000	902,821.400		

	SINGAPORE 2.875 09/01/30	1,200,000.000	1,151,400.000	
	SINGAPORE 3.0 08/01/72	130,000.000	125,722.830	
	SINGAPORE 3.0 09/01/24	400,000.000	398,840.000	
	SINGAPORE 3.375 09/01/33	780,000.000	772,590.000	
	SINGAPORE 3.5 03/01/27	440,000.000	443,608.000	
シンガポール・ドル 小計		10,030,000.000 (1,028,576,500)	9,423,942.930 (966,425,347)	
スウェーデン・ クローナ	SWEDEN 0.125 05/12/31	50,000.000	42,654.310	
	SWEDEN 0.75 05/12/28	10,680,000.000	9,935,245.540	
	SWEDEN 0.75 11/12/29	8,310,000.000	7,596,751.030	
	SWEDEN 1.0 11/12/26	4,900,000.000	4,680,701.420	
	SWEDEN 2.5 05/12/25	14,520,000.000	14,585,501.170	
	SWEDEN 3.5 03/30/39	4,090,000.000	4,993,831.510	
スウェーデン・クローナ 小計		42,550,000.000 (568,042,500)	41,834,684.980 (558,493,044)	
デンマーク・ク ローネ	DENMARK 0.0 11/15/24	3,170,000.000	3,041,773.500	
	DENMARK 0.0 11/15/31	8,860,000.000	7,251,138.180	
	DENMARK 0.25 11/15/52	4,200,000.000	2,466,165.780	
	DENMARK 0.5 11/15/27	5,390,000.000	4,982,665.830	
	DENMARK 0.5 11/15/29	14,900,000.000	13,277,269.300	
	DENMARK 1.75 11/15/25	3,250,000.000	3,217,223.750	
	DENMARK 4.5 11/15/39	4,600,000.000	5,961,876.000	
デンマーク・クローネ 小計		44,370,000.000 (861,221,700)	40,198,112.340 (780,245,361)	
ニュージーラン ド・ドル	NEW ZEALAND 1.75 05/15/41	500,000.000	316,899.500	
	NEW ZEALAND 2.0 05/15/32	1,000,000.000	815,635.350	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/25	1,000,000.000	960,771.230	
	NEW ZEALAND 2.75 04/15/37	500,000.000	402,473.230	
	NEW ZEALAND 2.75 05/15/51	380,000.000	264,347.010	
	NEW ZEALAND 3.0 04/20/29	1,000,000.000	923,750.500	
	NEW ZEALAND 4.5 04/15/27	1,000,000.000	1,003,518.200	
ニュージーランド・ドル 小計		5,380,000.000 (458,053,200)	4,687,395.020 (399,084,812)	
ノルウェー・ク ローネ	NORWAY 1.25 09/17/31	4,140,000.000	3,504,924.000	
	NORWAY 1.375 08/19/30	3,730,000.000	3,252,970.300	
	NORWAY 1.5 02/19/26	2,220,000.000	2,094,589.980	
	NORWAY 1.75 02/17/27	4,840,000.000	4,542,461.000	
	NORWAY 1.75 03/13/25	6,240,000.000	6,011,784.480	
	NORWAY 1.75 09/06/29	2,870,000.000	2,605,317.120	
	NORWAY 2.0 04/26/28	6,860,000.000	6,368,824.000	
	NORWAY 2.125 05/18/32	260,000.000	236,500.940	
NORWAY 3.0 03/14/24	2,980,000.000	2,963,449.370		
ノルウェー・クローネ 小計		34,140,000.000	31,580,821.190	

		(478,301,400)	(442,447,305)	
ポーランド・ズロチ	POLAND 0.25 10/25/26	1,100,000.000	846,285.000	
	POLAND 0.75 04/25/25	1,700,000.000	1,474,495.000	
	POLAND 07/25/24	220,000.000	194,964.000	
	POLAND 1.25 10/25/30	3,640,000.000	2,343,796.000	
	POLAND 1.75 04/25/32	4,300,000.000	2,734,585.000	
	POLAND 2.25 10/25/24	7,510,000.000	6,866,393.000	
	POLAND 2.5 07/25/26	8,400,000.000	7,119,000.000	
	POLAND 2.5 07/25/27	3,090,000.000	2,511,552.000	
	POLAND 2.75 04/25/28	2,310,000.000	1,844,650.500	
	POLAND 2.75 10/25/29	1,160,000.000	884,442.000	
	POLAND 3.25 07/25/25	2,240,000.000	2,026,640.000	
ポーランド・ズロチ 小計		35,670,000.000 (1,100,801,169)	28,846,802.500 (890,232,518)	
マレーシア・リングgit	MALAYSIA 2.632 04/15/31	1,290,000.000	1,121,722.770	
	MALAYSIA 3.478 06/14/24	1,830,000.000	1,830,185.740	
	MALAYSIA 3.502 05/31/27	200,000.000	193,874.450	
	MALAYSIA 3.582 07/15/32	2,000,000.000	1,858,648.720	
	MALAYSIA 3.733 06/15/28	2,000,000.000	1,935,485.280	
	MALAYSIA 3.757 05/22/40	1,750,000.000	1,505,995.870	
	MALAYSIA 3.828 07/05/34	1,410,000.000	1,299,321.660	
	MALAYSIA 3.844 04/15/33	2,010,000.000	1,870,267.490	
	MALAYSIA 3.882 03/14/25	1,000,000.000	998,670.590	
	MALAYSIA 3.885 08/15/29	2,410,000.000	2,321,659.970	
	MALAYSIA 3.892 03/15/27	1,370,000.000	1,351,505.150	
	MALAYSIA 3.899 11/16/27	1,300,000.000	1,277,277.950	
	MALAYSIA 3.9 11/30/26	2,090,000.000	2,066,808.350	
	MALAYSIA 3.906 07/15/26	870,000.000	862,552.250	
	MALAYSIA 3.955 09/15/25	1,240,000.000	1,239,162.090	
	MALAYSIA 4.059 09/30/24	420,000.000	423,320.770	
	MALAYSIA 4.065 06/15/50	2,070,000.000	1,775,003.650	
	MALAYSIA 4.181 07/15/24	670,000.000	677,209.660	
	MALAYSIA 4.232 06/30/31	1,000,000.000	973,133.570	
	MALAYSIA 4.254 05/31/35	200,000.000	191,066.150	
	MALAYSIA 4.392 04/15/26	1,030,000.000	1,039,319.950	
	MALAYSIA 4.498 04/15/30	1,050,000.000	1,049,620.060	
	MALAYSIA 4.642 11/07/33	2,000,000.000	1,989,692.420	
	MALAYSIA 4.696 10/15/42	1,910,000.000	1,858,349.560	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	780,000.000	753,442.540		
MALAYSIA 4.762 04/07/37	380,000.000	382,428.580		
MALAYSIA 4.893 06/08/38	1,030,000.000	1,030,823.690		
MALAYSIA 4.921 07/06/48	500,000.000	493,380.490		
MALAYSIA 4.935 09/30/43	580,000.000	578,480.450		
マレーシア・リングgit 小計		36,390,000.000 (1,111,801,836)	34,948,409.870 (1,067,757,798)	
メキシコ・ペソ	MEXICAN BONDS 03/04/27	20,000,000.000	17,244,049.000	
	MEXICAN BONDS 03/06/25	14,710,000.000	13,201,886.960	

	MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	5,000,000.000	5,192,922.900	
	MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	24,390,000.000	24,396,374.320	
	MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	41,894,000.000	37,462,695.660	
	MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	9,585,000.000	8,927,510.680	
	MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	30,300,000.000	27,497,213.910	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	13,528,000.000	11,330,304.830	
	MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	4,011,000.000	3,540,174.090	
	MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	30,040,000.000	29,042,672.000	
	MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	19,346,000.000	16,355,815.680	
	MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	27,501,000.000	26,305,924.770	
	MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	28,443,000.000	25,960,612.140	
	メキシコ・ペソ 小計	268,748,000.000 (1,975,163,426)	246,458,156.940 (1,811,344,224)	
ユーロ	AUSTRIA 0.0 02/20/30	660,000.000	552,469.500	
	AUSTRIA 0.0 02/20/31	1,000,000.000	811,236.000	
	AUSTRIA 0.25 10/20/36	1,250,000.000	886,750.000	
	AUSTRIA 0.5 02/20/29	440,000.000	391,505.400	
	AUSTRIA 0.5 04/20/27	2,010,000.000	1,860,486.150	
	AUSTRIA 0.7 04/20/71	100,000.000	49,482.600	
	AUSTRIA 0.75 02/20/28	1,770,000.000	1,632,784.290	
	AUSTRIA 0.75 03/20/51	180,000.000	111,763.440	
	AUSTRIA 0.75 10/20/26	1,330,000.000	1,257,420.570	
	AUSTRIA 0.85 06/30/20	110,000.000	53,767.180	
	AUSTRIA 0.9 02/20/32	1,100,000.000	944,631.600	
	AUSTRIA 07/15/24	490,000.000	473,734.450	
	AUSTRIA 1.2 10/20/25	200,000.000	194,548.450	
	AUSTRIA 1.5 02/20/47	1,110,000.000	868,561.680	
	AUSTRIA 1.5 11/02/86	80,000.000	52,160.000	
	AUSTRIA 1.65 10/21/24	1,530,000.000	1,517,977.910	
	AUSTRIA 2.1 09/20/17	570,000.000	461,369.400	
	AUSTRIA 2.4 05/23/34	1,660,000.000	1,609,217.280	
	AUSTRIA 3.15 06/20/44	520,000.000	553,937.800	
	AUSTRIA 3.8 01/26/62	160,000.000	197,356.160	
	AUSTRIA 4.15 03/15/37	1,650,000.000	1,914,990.000	
	AUSTRIA 4.85 03/15/26	440,000.000	478,498.240	
	BELGIUM 0.0 10/22/27	640,000.000	574,152.960	
	BELGIUM 0.0 10/22/31	1,290,000.000	1,038,099.120	
	BELGIUM 0.1 06/22/30	800,000.000	677,040.000	

BELGIUM 0.5 10/22/24	2,620,000.000	2,545,356.200	
BELGIUM 0.65 06/22/71	2,090,000.000	981,909.170	
BELGIUM 0.8 06/22/25	2,290,000.000	2,218,155.830	
BELGIUM 0.8 06/22/27	1,030,000.000	967,901.300	
BELGIUM 0.9 06/22/29	1,330,000.000	1,214,835.300	
BELGIUM 1.0 06/22/26	1,000,000.000	962,551.000	
BELGIUM 1.0 06/22/31	1,110,000.000	991,471.980	
BELGIUM 1.25 04/22/33	2,400,000.000	2,120,570.400	
BELGIUM 1.4 06/22/53	510,000.000	355,245.090	
BELGIUM 1.45 06/22/37	280,000.000	232,636.600	
BELGIUM 1.6 06/22/47	1,330,000.000	1,020,852.140	
BELGIUM 1.7 06/22/50	280,000.000	215,087.040	
BELGIUM 1.9 06/22/38	80,000.000	70,188.240	
BELGIUM 2.15 06/22/66	90,000.000	74,097.000	
BELGIUM 2.25 06/22/57	1,090,000.000	953,829.570	
BELGIUM 2.6 06/22/24	60,000.000	60,529.950	
BELGIUM 3.0 06/22/34	1,540,000.000	1,579,494.840	
BELGIUM 4.0 03/28/32	1,250,000.000	1,401,203.750	
BELGIUM 4.25 03/28/41	550,000.000	649,488.400	
BELGIUM 4.5 03/28/26	1,300,000.000	1,403,087.400	
BELGIUM 5.0 03/28/35	2,630,000.000	3,233,879.560	
BELGIUM 5.5 03/28/28	1,500,000.000	1,753,099.500	
BUNDESOBL 0.0 04/10/26	3,100,000.000	2,912,605.000	
BUNDESOBL 0.0 04/11/25	1,670,000.000	1,595,067.100	
BUNDESOBL 0.0 10/09/26	1,710,000.000	1,588,094.100	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	1,050,000.000	994,360.500	
BUNDESOBL 0.0 10/10/25	240,000.000	227,757.600	
BUNDESOBL 04/05/24	2,280,000.000	2,217,311.400	
BUNDESOBL 10/18/24	1,040,000.000	1,001,575.120	
BUNDESSCHAT 0.0 03/15/24	1,450,000.000	1,412,111.500	
BUNDESSCHAT 0.0 12/15/23	580,000.000	567,292.200	
BUNDESSCHAT 0.4 09/13/24	3,970,000.000	3,860,745.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	2,490,000.000	2,167,893.600	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	2,100,000.000	1,791,888.000	
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/32	2,650,000.000	2,210,184.800	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	2,670,000.000	2,048,343.900	
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/36	2,010,000.000	1,511,258.700	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	1,700,000.000	1,465,978.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	820,000.000	707,430.400	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	2,320,000.000	1,960,748.000	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/31	1,000,000.000	845,765.910	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	2,500,000.000	1,454,007.500	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	470,000.000	273,906.600	
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/52	1,660,000.000	934,995.000	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	1,060,000.000	966,730.600	
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/28	3,000,000.000	2,680,767.000	
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	7,440,000.000	6,961,459.200	

DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	3,540,000.000	3,198,382.920	
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	3,640,000.000	3,314,584.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	1,300,000.000	1,259,557.000	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	3,490,000.000	3,341,779.700	
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	660,000.000	614,044.200	
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	1,600,000.000	1,502,763.200	
DEUTSCHLAND 08/15/26	2,180,000.000	2,033,792.300	
DEUTSCHLAND 08/15/29	3,930,000.000	3,456,631.500	
DEUTSCHLAND 1.0 05/15/38	1,000,000.000	846,240.000	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	2,020,000.000	1,987,720.400	
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	2,220,000.000	2,166,831.000	
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	2,370,000.000	2,010,620.310	
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	1,270,000.000	1,261,211.600	
DEUTSCHLAND 1.7 08/15/32	1,950,000.000	1,897,564.500	
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	1,980,000.000	1,973,042.280	
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	2,930,000.000	3,141,077.200	
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	2,300,000.000	2,490,308.900	
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	1,520,000.000	1,789,541.600	
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	1,630,000.000	1,998,438.680	
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	1,220,000.000	1,566,650.800	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	2,390,000.000	3,052,245.100	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	1,090,000.000	1,496,493.700	
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	1,640,000.000	2,072,861.600	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	1,180,000.000	1,235,943.800	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	400,000.000	514,064.000	
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	1,670,000.000	2,002,730.800	
FINLAND 0.0 09/15/24	660,000.000	637,004.940	
FINLAND 0.0 09/15/26	1,140,000.000	1,046,577.000	
FINLAND 0.0 09/15/30	880,000.000	725,913.760	
FINLAND 0.125 04/15/52	40,000.000	20,297.480	
FINLAND 0.125 09/15/31	180,000.000	146,198.160	
FINLAND 0.25 09/15/40	100,000.000	64,541.600	
FINLAND 0.5 04/15/26	600,000.000	567,886.200	
FINLAND 0.5 04/15/43	190,000.000	123,527.070	
FINLAND 0.5 09/15/27	860,000.000	787,971.900	
FINLAND 0.5 09/15/28	90,000.000	80,777.770	
FINLAND 0.5 09/15/29	560,000.000	490,472.640	
FINLAND 0.75 04/15/31	980,000.000	851,401.460	
FINLAND 1.125 04/15/34	570,000.000	480,790.890	

FINLAND 1.375 04/15/47	450,000.000	350,607.150	
FINLAND 2.625 07/04/42	870,000.000	847,316.490	
FINLAND 2.75 07/04/28	200,000.000	203,802.200	
FRANCE OAT 0.0 02/25/24	2,000,000.000	1,946,078.000	
FRANCE OAT 0.0 02/25/25	1,500,000.000	1,427,413.500	
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	2,550,000.000	2,377,737.300	
FRANCE OAT 0.0 02/25/27	4,500,000.000	4,104,760.500	
FRANCE OAT 0.0 05/25/32	3,820,000.000	3,037,282.000	
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	2,760,000.000	2,360,655.600	
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	3,680,000.000	3,064,453.760	
FRANCE OAT 0.0 11/25/31	3,070,000.000	2,484,489.600	
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	3,590,000.000	3,328,087.960	
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	1,680,000.000	1,612,666.150	
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	3,220,000.000	3,039,831.340	
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	10,600,000.000	9,503,271.000	
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	1,100,000.000	749,373.900	
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	510,000.000	223,436.100	
FRANCE OAT 0.5 06/25/44	650,000.000	410,855.900	
FRANCE OAT 0.75 02/25/28	2,000,000.000	1,852,800.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	4,690,000.000	4,334,029.000	
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	1,720,000.000	1,026,263.800	
FRANCE OAT 0.75 05/25/53	1,980,000.000	1,157,931.720	
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	4,800,000.000	4,403,798.400	
FRANCE OAT 03/25/24	2,000,000.000	1,943,036.000	
FRANCE OAT 03/25/25	2,810,000.000	2,670,695.650	
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	3,000,000.000	2,850,186.000	
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	1,230,000.000	1,189,686.750	
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	4,010,000.000	3,451,872.160	
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	1,430,000.000	1,189,617.000	
FRANCE OAT 1.25 05/25/38	100,000.000	80,340.000	
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	3,910,000.000	3,677,851.570	
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	3,220,000.000	2,419,025.000	
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	910,000.000	686,560.590	
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	2,690,000.000	2,335,592.500	
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	3,490,000.000	3,463,919.230	
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	1,750,000.000	1,482,430.250	
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	1,880,000.000	1,882,409.590	
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	3,620,000.000	3,689,065.980	
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	4,590,000.000	4,716,758.350	
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	2,960,000.000	3,151,689.600	
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	5,430,000.000	5,676,522.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	1,640,000.000	2,023,268.000	
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	1,600,000.000	2,000,681.440	
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	1,900,000.000	2,179,645.800	
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	3,780,000.000	4,663,661.940	
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	1,410,000.000	1,706,407.380	
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	1,000,000.000	1,191,046.000	
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	5,690,000.000	7,322,165.120	
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	4,000,000.000	4,440,244.000	

IRISH 0.0 10/18/31	930,000.000	752,000.320	
IRISH 0.2 10/18/30	1,160,000.000	982,356.440	
IRISH 0.4 05/15/35	100,000.000	76,012.600	
IRISH 0.55 04/22/41	1,330,000.000	889,973.490	
IRISH 0.9 05/15/28	60,000.000	55,583.220	
IRISH 1.0 05/15/26	1,310,000.000	1,262,426.040	
IRISH 1.1 05/15/29	420,000.000	390,029.640	
IRISH 1.3 05/15/33	1,180,000.000	1,043,775.490	
IRISH 1.35 03/18/31	820,000.000	762,613.120	
IRISH 1.5 05/15/50	20,000.000	15,059.420	
IRISH 1.7 05/15/37	80,000.000	69,622.360	
IRISH 2.0 02/18/45	760,000.000	655,661.120	
IRISH 2.4 05/15/30	910,000.000	916,273.540	
IRISH 5.4 03/13/25	1,460,000.000	1,567,847.280	
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	1,850,000.000	1,797,071.500	
ITALY BTPS 0.0 01/30/24	2,300,000.000	2,231,943.000	
ITALY BTPS 0.0 04/01/26	1,920,000.000	1,733,760.000	
ITALY BTPS 0.0 04/15/24	2,730,000.000	2,636,634.000	
ITALY BTPS 0.0 08/01/26	2,000,000.000	1,785,400.000	
ITALY BTPS 0.0 08/15/24	1,000,000.000	956,350.000	
ITALY BTPS 0.0 12/15/24	2,000,000.000	1,897,500.000	
ITALY BTPS 0.25 03/15/28	2,610,000.000	2,212,236.000	
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	2,810,000.000	2,671,982.150	
ITALY BTPS 0.45 02/15/29	3,000,000.000	2,488,650.000	
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	1,600,000.000	1,477,988.800	
ITALY BTPS 0.5 07/15/28	1,500,000.000	1,277,250.000	
ITALY BTPS 0.6 08/01/31	2,000,000.000	1,529,163.600	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	30,000.000	27,370.500	
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	2,000,000.000	1,592,214.000	
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	3,440,000.000	2,303,768.000	
ITALY BTPS 0.95 06/01/32	80,000.000	61,656.000	
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	1,750,000.000	1,429,050.000	
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	2,000,000.000	1,798,600.000	
ITALY BTPS 0.95 12/01/31	1,350,000.000	1,054,485.000	
ITALY BTPS 1.1 04/01/27	1,000,000.000	915,100.000	
ITALY BTPS 1.2 08/15/25	2,070,000.000	1,977,057.000	
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	110,000.000	102,452.460	
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	2,000,000.000	1,706,638.000	
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	510,000.000	375,054.000	
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	330,000.000	319,514.250	
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	2,000,000.000	1,960,139.820	
ITALY BTPS 1.5 04/30/45	1,630,000.000	1,013,860.000	
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	30,000.000	29,051.250	
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	1,140,000.000	1,086,876.000	
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	1,640,000.000	1,363,926.710	
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	2,660,000.000	2,281,710.760	
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	300,000.000	184,389.900	
ITALY BTPS 1.75 05/30/24	2,000,000.000	1,975,780.000	
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	1,000,000.000	987,747.000	

ITALY BTPS 1.8 03/01/41	1,570,000.000	1,096,645.000	
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	1,400,000.000	1,387,260.000	
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	90,000.000	87,741.000	
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	1,200,000.000	1,124,700.000	
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	110,000.000	107,148.800	
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	6,440,000.000	6,115,913.440	
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	1,000,000.000	967,730.170	
ITALY BTPS 2.15 03/01/72	1,380,000.000	852,012.000	
ITALY BTPS 2.15 09/01/52	1,180,000.000	787,178.000	
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	2,060,000.000	1,977,806.000	
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	340,000.000	274,720.000	
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	140,000.000	120,411.270	
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	1,770,000.000	1,289,091.000	
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	1,500,000.000	1,484,313.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	2,000,000.000	1,996,858.000	
ITALY BTPS 2.5 12/01/32	720,000.000	633,434.400	
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	550,000.000	433,840.000	
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	1,230,000.000	905,280.000	
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	3,660,000.000	3,542,001.600	
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	2,850,000.000	2,364,075.000	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	2,890,000.000	2,800,979.330	
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	1,940,000.000	1,687,551.680	
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	1,270,000.000	1,138,676.920	
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	2,360,000.000	2,351,123.370	
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	1,200,000.000	1,225,339.200	
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	1,800,000.000	1,712,653.200	
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	1,280,000.000	1,266,048.000	
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	3,070,000.000	3,146,083.810	
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	1,720,000.000	1,804,108.000	
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	790,000.000	850,314.280	
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	1,620,000.000	1,703,587.140	
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	3,470,000.000	3,760,786.000	
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	1,360,000.000	1,484,576.000	
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	1,450,000.000	1,585,575.000	
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	1,940,000.000	2,154,370.000	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	1,390,000.000	1,594,330.000	
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	2,300,000.000	2,683,870.000	
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	770,000.000	887,425.000	
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	1,900,000.000	1,746,664.300	
NETHERLANDS 0.0 01/15/29	2,040,000.000	1,787,478.600	
NETHERLANDS 0.0 01/15/38	1,260,000.000	877,983.120	
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	1,860,000.000	994,688.940	
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	1,140,000.000	969,125.400	
NETHERLANDS 0.0 07/15/31	980,000.000	814,801.400	
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	6,200,000.000	5,924,189.030	
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	510,000.000	450,521.760	
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	1,670,000.000	1,230,111.980	

NETHERLANDS 0.5 07/15/26	210,000.000	198,975.000	
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	2,130,000.000	2,008,758.270	
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	200,000.000	185,822.000	
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	70,000.000	70,044.380	
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	1,620,000.000	1,650,809.160	
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	1,170,000.000	1,271,775.960	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	1,850,000.000	2,233,269.300	
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	70,000.000	83,377.000	
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	760,000.000	874,304.000	
SPAIN 0.0 01/31/25	1,750,000.000	1,667,837.500	
SPAIN 0.0 01/31/26	1,690,000.000	1,568,786.440	
SPAIN 0.0 01/31/27	2,000,000.000	1,805,500.000	
SPAIN 0.0 05/31/24	2,740,000.000	2,648,374.400	
SPAIN 0.0 05/31/25	2,000,000.000	1,887,070.000	
SPAIN 0.1 04/30/31	890,000.000	709,775.000	
SPAIN 0.25 07/30/24	1,230,000.000	1,190,949.960	
SPAIN 0.5 04/30/30	1,540,000.000	1,312,836.140	
SPAIN 0.5 10/31/31	390,000.000	317,649.150	
SPAIN 0.6 10/31/29	1,530,000.000	1,332,792.180	
SPAIN 0.7 04/30/32	370,000.000	302,956.000	
SPAIN 0.8 07/30/27	1,500,000.000	1,373,625.000	
SPAIN 0.8 07/30/29	1,000,000.000	871,800.000	
SPAIN 0.85 07/30/37	1,810,000.000	1,292,202.440	
SPAIN 1.0 07/30/42	1,180,000.000	792,252.000	
SPAIN 1.0 10/31/50	1,100,000.000	631,789.400	
SPAIN 1.2 10/31/40	2,780,000.000	1,974,325.420	
SPAIN 1.25 10/31/30	2,970,000.000	2,653,992.000	
SPAIN 1.3 10/31/26	1,540,000.000	1,480,377.360	
SPAIN 1.4 07/30/28	1,510,000.000	1,416,380.000	
SPAIN 1.45 04/30/29	2,930,000.000	2,727,613.180	
SPAIN 1.45 10/31/27	3,000,000.000	2,854,224.000	
SPAIN 1.45 10/31/71	250,000.000	131,936.250	
SPAIN 1.5 04/30/27	1,840,000.000	1,770,356.000	
SPAIN 1.85 07/30/35	2,230,000.000	1,929,384.850	
SPAIN 1.9 10/31/52	380,000.000	268,811.620	
SPAIN 1.95 04/30/26	1,770,000.000	1,748,115.720	
SPAIN 1.95 07/30/30	1,660,000.000	1,569,144.880	
SPAIN 2.35 07/30/33	1,260,000.000	1,185,030.000	
SPAIN 2.55 10/31/32	1,910,000.000	1,833,844.480	
SPAIN 2.7 10/31/48	1,530,000.000	1,348,769.970	
SPAIN 2.75 10/31/24	1,900,000.000	1,921,057.700	
SPAIN 2.9 10/31/46	270,000.000	251,064.900	
SPAIN 3.45 07/30/66	1,330,000.000	1,317,057.770	
SPAIN 3.8 04/30/24	410,000.000	418,978.380	
SPAIN 4.2 01/31/37	2,330,000.000	2,597,183.430	

	SPAIN 4.65 07/30/25	6,570,000.000	6,990,992.460	
	SPAIN 4.7 07/30/41	1,940,000.000	2,322,956.000	
	SPAIN 4.9 07/30/40	2,120,000.000	2,585,340.000	
	SPAIN 5.15 10/31/28	5,360,000.000	6,036,432.000	
	SPAIN 5.75 07/30/32	2,010,000.000	2,503,406.760	
	SPAIN 5.9 07/30/26	1,600,000.000	1,805,779.200	
	SPAIN 6.0 01/31/29	1,140,000.000	1,366,917.680	
	ユーロ 小計	522,030,000.000 (75,386,352,300)	490,863,015.610 (70,885,528,084)	
国債証券 合計		231,496,576,913 (231,496,576,913)	209,954,814,561 (209,954,814,561)	
合計			209,954,814,561 (209,954,814,561)	

(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 211銘柄	48.40	50.85
イギリス・ポンド	国債証券 51銘柄	4.44	4.67
イスラエル・シケル	国債証券 12銘柄	0.36	0.38
オーストラリア・ドル	国債証券 23銘柄	1.49	1.56
オフショア・人民元	国債証券 25銘柄	3.21	3.38
カナダ・ドル	国債証券 29銘柄	2.01	2.12
シンガポール・ドル	国債証券 20銘柄	0.44	0.46
スウェーデン・クローナ	国債証券 6銘柄	0.25	0.27
デンマーク・クローネ	国債証券 7銘柄	0.35	0.37
ニュージーランド・ドル	国債証券 7銘柄	0.18	0.19
ノルウェー・クローネ	国債証券 9銘柄	0.20	0.21
ポーランド・ズロチ	国債証券 11銘柄	0.40	0.42
マレーシア・リングgit	国債証券 29銘柄	0.48	0.51
メキシコ・ペソ	国債証券 13銘柄	0.82	0.86
ユーロ	国債証券 308銘柄	32.14	33.76

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2022年11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,997,605,198
コール・ローン	6,222,713,846
株式	767,654,557,203
投資信託受益証券	1,305,524,222
投資証券	16,950,844,450
派生商品評価勘定	1,255,534,226
未収入金	496,488
未収配当金	743,407,077
差入委託証拠金	4,676,606,921
流動資産合計	808,807,289,631
資産合計	
808,807,289,631	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	157,365,511
未払解約金	81,131,000
流動負債合計	238,496,511
負債合計	
238,496,511	
純資産の部	
元本等	
元本	129,749,605,564
剰余金	
剰余金又は欠損金()	678,819,187,556
元本等合計	808,568,793,120
純資産合計	808,568,793,120
負債純資産合計	808,807,289,631

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11月12日 至 2022年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	115,916,372,811円
同期中追加設定元本額	82,161,830,217円
同期中一部解約元本額	68,328,597,464円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM外国株式パッシブ・ファンド	3,390,660,316円
MITO ラップ型ファンド（安定型）	1,939,686円
MITO ラップ型ファンド（中立型）	12,531,838円
MITO ラップ型ファンド（積極型）	42,353,868円

グローバル8資産ラップファンド(安定型)	22,097,897円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	13,515,675円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,634,563円
たわらノーロード 先進国株式	39,128,547,551円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	427,272,850円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,692,826,414円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	740,084,447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)	669,258,758円
たわらノーロード バランス(積極型)	832,597,549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)	140,575,143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)	417,995,473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)	341,312,527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)	503,554,203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)	1,182,266円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	25,577,850円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,743,358円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,930,302円
たわらノーロード 全世界株式	475,998,595円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	54,600,691,624円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,651,112,905円
Oneグローバルバランス	2,872,387円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	151,576,425円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	780,081,625円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,019,151,977円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	92,510,967円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	251,439,120円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	243,542,869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>	621,612,619円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	123,721,570円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	167,056,250円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	191,366,860円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	309,355,040円
投資のソムリエ	4,735,886,429円
クルーズコントロール	129,770,636円
投資のソムリエ<DC年金>	327,778,655円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	194,026,459円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	208,203,308円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	129,086,685円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	587,555,135円
ワールドアセットバランス(基本コース)	140,743,631円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	72,776,027円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	14,300,058円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,148,287円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	873,277円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	23,076,309円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	127,589,859円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	47,895,318円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	144,069,700円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	12,811,979円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	7,349,559円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,758,058円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	83,058,670円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	900,462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
M S C I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)	450,014,163円
D I A M外国株式インデックスファンドV A(適格機関投資家専用)	40,531,629円
D I A M外国株式パッシブ私募ファンド(適格機関投資家向け)	1,110,172,319円
D I A M先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,440,106円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,061,006,881円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	122,631,365円
A M 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)	1,748,825円
D I A Mワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	6,874,916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(F O F s用)(適格機関投資家専用)	2,586,389円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	1,543,325円
D I A Mグローバル・バランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	26,211,424円
D I A Mグローバル・バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	50,829,922円
D I A M国際分散バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	1,974,100円
D I A M国際分散バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	19,245,392円
D I A M国内重視バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	1,291,107円
D I A M国内重視バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	32,693円
D I A M世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	3,589,761円
D I A M世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	21,520,408円
D I A Mバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	160,865,870円
D I A Mバランスファンド37.5V A(適格機関投資家限定)	254,478,015円
D I A Mバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	851,855,651円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A(適格機関投資家限定)	42,544,519円
D I A Mグローバル・アセット・バランスV A 2(適格機関投資家限定)	37,506,497円
D I A M アクサ グローバル バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	254,551,780円
D I A M世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	10,545,373円
D I A M世界バランスファンド55V A(適格機関投資家限定)	159,891円
D I A M世界アセットバランスファンド2V A(適格機関投資家限定)	100,804,498円
D I A M世界アセットバランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	8,893,863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）	29,588,668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）	45,483,012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）	102,386,587円
動的パッケージファンド<DC年金>	8,359,934円
コア資産形成ファンド	5,545,575円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,770,995,002円
MHAM外国株式インデックスファンド	140,867,863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）	8,854,656円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	1,100,924,377円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,468,567,681円
計	129,749,605,564円
2. 受益権の総数	129,749,605,564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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<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11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額（円）	
株式	66,688,236,303	
投資信託受益証券	175,165,781	
投資証券	2,510,257,779	
合計	69,373,659,863	

（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11月11日まで）に対応する金額であります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

通貨関連

種類	2022年11月11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	23,114,608	-	22,828,078	286,530	
オーストラリア・ドル	23,114,608	-	22,828,078	286,530	
買建	6,532,318,010	-	6,375,699,024	156,618,986	
アメリカ・ドル	4,897,085,880	-	4,760,402,663	136,683,217	
イギリス・ポンド	294,793,515	-	293,061,962	1,731,553	
オーストラリア・ドル	130,693,739	-	129,951,548	742,191	
カナダ・ドル	243,848,409	-	240,016,475	3,831,934	
ユーロ	965,896,467	-	952,266,376	13,630,091	
合計	6,555,432,618	-	6,398,527,102	156,332,456	

（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11月11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	21,767,929,272	-		23,022,430,443	1,254,501,171
合計	21,767,929,272	-		23,022,430,443	1,254,501,171

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引

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

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

2022年11月11日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	6.2318円 (62,318円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	AMAZON.COM INC	1,064,890	96.630	102,900,320.700	
	ABBOTT LABORATORIES	203,718	104.230	21,233,527.140	
	AES CORP	79,505	28.220	2,243,631.100	
	ABIOMED INC	5,283	372.780	1,969,396.740	
	INTL BUSINESS MACHINES CORP	104,412	141.230	14,746,106.760	
	ADVANCED MICRO DEVICES	189,936	68.470	13,004,917.920	
	ADOBE INC	55,212	329.950	18,217,199.400	
	CHUBB LTD	49,523	211.910	10,494,418.930	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,039	289.590	7,540,634.010	

ALLSTATE CORP	31,078	130.190	4,046,044.820	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78,829	214.800	16,932,469.200	
AMGEN INC	62,119	291.010	18,077,250.190	
HESS CORP	33,470	139.840	4,680,444.800	
AMERICAN EXPRESS CO	74,329	154.750	11,502,412.750	
AMERICAN ELECTRIC POWER	59,558	91.800	5,467,424.400	
AFLAC INC	68,561	69.970	4,797,213.170	
AMERICAN INTL GROUP	93,843	60.590	5,685,947.370	
AMERCO	980	52.020	50,979.600	
ANALOG DEVICES	60,232	160.370	9,659,405.840	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	79,236	66.660	5,281,871.760	
VALERO ENERGY CORP	48,490	132.450	6,422,500.500	
ANSYS INC	9,857	249.190	2,456,265.830	
APPLE INC	1,881,449	146.870	276,328,414.630	
APPLIED MATERIALS INC	102,343	104.790	10,724,522.970	
ALBEMARLE CORP	13,133	320.770	4,212,672.410	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	66,469	94.280	6,266,697.320	
AMEREN CORP	31,621	85.300	2,697,271.300	
ARROW ELECTRONICS INC	9,936	108.980	1,082,825.280	
AUTODESK INC	24,822	222.960	5,534,313.120	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	48,690	254.880	12,410,107.200	
AUTOZONE INC	2,313	2,467.660	5,707,697.580	
AVERY DENNISON CORP	9,514	182.670	1,737,922.380	
BALL CORP	36,411	53.500	1,947,988.500	
BERKSHIRE HATHAWAY INC- CL B	149,168	303.200	45,227,737.600	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	90,954	44.070	4,008,342.780	
BAXTER INTERNATIONAL INC	57,988	53.730	3,115,695.240	
BECTON DICKINSON & CO	32,349	229.280	7,416,978.720	
AMETEK INC	27,428	140.680	3,858,571.040	
VERIZON COMM INC	489,273	38.520	18,846,795.960	
WR BERKLEY CORP	24,066	73.290	1,763,797.140	
BEST BUY CO INC	25,405	72.030	1,829,922.150	
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	2,459	427.580	1,051,419.220	
YUM! BRANDS INC	32,015	124.130	3,974,021.950	
FIRSTENERGY CORP	61,472	38.990	2,396,793.280	
BOEING CO	64,353	177.580	11,427,805.740	
ROBERT HALF INTL INC	11,897	79.590	946,882.230	
BORGWARNER INC	27,800	40.970	1,138,966.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	163,516	43.760	7,155,460.160	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14,494	93.930	1,361,421.420	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	19,529	98.570	1,924,973.530	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,582	1,449.150	3,741,705.300	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	248,136	79.380	19,697,035.680	
ONEOK INC	52,652	63.400	3,338,136.800	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7,891	148.660	1,173,076.060	
UNITED RENTALS INC	8,287	344.910	2,858,269.170	
SEMPRA ENERGY	36,952	155.830	5,758,230.160	
FEDEX CORP	28,131	166.000	4,669,746.000	
VERISIGN INC	10,834	191.120	2,070,594.080	
AMPHENOL CORP	67,929	79.060	5,370,466.740	
BROWN-FORMAN CORP	35,058	69.840	2,448,450.720	
QUANTA SERVICES INC	17,560	147.060	2,582,373.600	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	101,765	6.410	652,313.650	
CSX CORP	254,377	31.220	7,941,649.940	
COTERRA ENERGY INC	91,495	27.530	2,518,857.350	
CAMPBELL SOUP CO	26,978	50.550	1,363,737.900	
CONSTELLATION BRANDS INC	18,254	244.030	4,454,523.620	
CARDINAL HEALTH INC	31,857	77.930	2,482,616.010	
CARLISLE COS INC	6,119	242.640	1,484,714.160	
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	132,291	9.780	1,293,805.980	
CATERPILLAR INC	62,161	232.450	14,449,324.450	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	10,845	130.730	1,417,766.850	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	97,073	6.450	626,120.850	
JPMORGAN CHASE & CO	341,549	135.080	46,136,438.920	
CHURCH & DWIGHT CO INC	27,423	74.940	2,055,079.620	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,259	107.550	1,856,205.450	
CINTAS CORP	10,530	444.510	4,680,690.300	
CISCO SYSTEMS INC	482,556	45.660	22,033,506.960	
CLEVELAND-CLIFFS INC	56,364	13.960	786,841.440	
CLOROX COMPANY	14,322	143.980	2,062,081.560	
COCA-COLA CO/THE	477,562	60.880	29,073,974.560	
COPART INC	49,880	60.460	3,015,744.800	
COGNEX CORP	20,432	49.810	1,017,717.920	
COLGATE-PALMOLIVE CO	93,331	74.970	6,997,025.070	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31,293	157.980	4,943,668.140	
MOLINA HEALTHCARE INC	6,695	329.690	2,207,274.550	
NRG ENERGY, INC.	28,364	45.090	1,278,932.760	
COMCAST CORP-CL A	521,756	32.770	17,097,944.120	
CONAGRA BRANDS INC	55,843	35.190	1,965,115.170	
CONSOLIDATED EDISON INC	41,423	90.950	3,767,421.850	
CMS ENERGY CORP	32,591	59.200	1,929,387.200	
COOPER COS INC	5,638	302.030	1,702,845.140	

MOLSON COORS BEVERAGE CO	21,281	51.450	1,094,907.450	
CORNING INC	95,758	33.900	3,246,196.200	
SEALED AIR CORP	17,610	49.470	871,166.700	
HEICO CORP-CL A	7,767	127.730	992,078.910	
CUMMINS INC	15,824	242.130	3,831,465.120	
DR HORTON INC	38,221	83.920	3,207,506.320	
DANAHER CORP	80,519	267.870	21,568,624.530	
MOODY'S CORP	19,566	294.260	5,757,491.160	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	58,780	57.290	3,367,506.200	
TARGET CORP	54,443	164.380	8,949,340.340	
DEERE & CO	33,838	407.610	13,792,707.180	
MORGAN STANLEY	152,253	88.800	13,520,066.400	
REPUBLIC SERVICES INC	24,966	134.850	3,366,665.100	
COSTAR GROUP INC	47,398	84.160	3,989,015.680	
THE WALT DISNEY CO	212,234	90.460	19,198,687.640	
DOLLAR TREE INC	25,247	163.120	4,118,290.640	
DOVER CORP	16,217	137.350	2,227,404.950	
OMNICOM GROUP	23,275	75.110	1,748,185.250	
DTE ENERGY CO	23,792	115.540	2,748,927.680	
DUKE ENERGY CORP	87,541	97.100	8,500,231.100	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,939	145.330	2,025,754.870	
EBAY INC	67,667	44.660	3,022,008.220	
BANK OF AMERICA CORP	844,230	38.130	32,190,489.900	
CITIGROUP INC	226,525	48.420	10,968,340.500	
EASTMAN CHEMICAL CO	14,111	85.130	1,201,269.430	
EATON CORP PLC	45,226	162.130	7,332,491.380	
CADENCE DESIGN SYS INC	31,336	162.020	5,077,058.720	
DISH NETWORK CORP	24,416	16.060	392,120.960	
ECOLAB INC	28,945	151.630	4,388,930.350	
PERKINELMER INC	15,649	136.380	2,134,210.620	
ELECTRONIC ARTS INC	33,011	130.300	4,301,333.300	
SALESFORCE INC	116,028	156.300	18,135,176.400	
ERIE INDEMNITY CO	3,372	271.370	915,059.640	
EMERSON ELECTRIC CO	69,296	94.000	6,513,824.000	
ATMOS ENERGY CORP	17,567	111.800	1,963,990.600	
ENTERGY CORP	23,769	111.040	2,639,309.760	
EOG RESOURCES INC	68,935	142.310	9,810,139.850	
EQUIFAX INC	13,970	187.810	2,623,705.700	
EQT CORP	36,492	42.900	1,565,506.800	
ESTEE LAUDER COS INC/THE	27,378	218.890	5,992,770.420	
EXPEDITORS INTERNATIONAL	19,974	108.690	2,170,974.060	
EXXON MOBIL CORP	490,461	110.500	54,195,940.500	
FMC CORP	15,534	126.450	1,964,274.300	
NEXTERA ENERGY INC	228,563	83.200	19,016,441.600	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4,716	436.280	2,057,496.480	
FAIR ISAAC CORP	2,962	581.780	1,723,232.360	
ASSURANT INC	5,823	126.660	737,541.180	

FASTENAL CO	68,855	51.870	3,571,508.850	
FIFTH THIRD BANCORP	77,462	36.290	2,811,095.980	
M&T BANK CORP	20,766	170.190	3,534,165.540	
FISERV INC	71,827	101.000	7,254,527.000	
FORD MOTOR CO	465,038	14.180	6,594,238.840	
FRANKLIN RESOURCES INC	37,916	25.610	971,028.760	
FREEMONT-MCMORAN INC	172,370	36.750	6,334,597.500	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1,270	847.480	1,076,299.600	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,816	193.000	4,789,488.000	
DENTSPLY SIRONA INC	25,599	30.280	775,137.720	
GENERAL DYNAMICS CORP	27,465	253.480	6,961,828.200	
GENERAL MILLS INC	69,455	79.580	5,527,228.900	
GENUINE PARTS CO	16,139	182.200	2,940,525.800	
GILEAD SCIENCES INC	146,012	82.600	12,060,591.200	
GARTNER INC	9,036	340.900	3,080,372.400	
MCKESSON CORP	16,571	370.320	6,136,572.720	
NVIDIA CORP	291,664	157.500	45,937,080.000	
GENERAL ELECTRIC CO	128,824	85.380	10,998,993.120	
WW GRAINGER INC	5,466	608.380	3,325,405.080	
HALLIBURTON CO	104,397	37.810	3,947,250.570	
MONSTER BEVERAGE CORP	47,224	99.300	4,689,343.200	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39,807	378.310	15,059,386.170	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	22,879	239.340	5,475,859.860	
HASBRO INC	15,437	60.390	932,240.430	
HENRY SCHEIN INC	15,048	77.320	1,163,511.360	
HEICO CORP	5,185	163.810	849,354.850	
HERSHEY FOODS CORP	17,397	226.300	3,936,941.100	
HP INC	118,420	29.300	3,469,706.000	
F5 INC	6,924	144.740	1,002,179.760	
CROWN HOLDINGS INC NPR	15,322	77.610	1,189,140.420	
JUNIPER NETWORKS INC	43,715	30.510	1,333,744.650	
HOLOGIC INC	28,090	75.000	2,106,750.000	
HOME DEPOT INC	119,519	311.700	37,254,072.300	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22,880	83.320	1,906,361.600	
HORMEL FOODS CORP	34,578	47.580	1,645,221.240	
CENTERPOINT ENERGY INC	71,052	29.400	2,088,928.800	
LENNOX INTERNATIONAL INC	3,602	263.240	948,190.480	
HUMANA INC	14,894	558.300	8,315,320.200	
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	9,171	182.470	1,673,432.370	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	163,228	15.180	2,477,801.040	
BIOGEN INC	17,603	290.700	5,117,192.100	
IDEX CORP	9,065	232.960	2,111,782.400	
ILLINOIS TOOL WORKS	36,151	224.250	8,106,861.750	
INTUIT INC	31,332	403.240	12,634,315.680	

IDEXX LABORATORIES INC	10,162	416.060	4,228,001.720	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26,475	176.770	4,679,985.750	
INTEL CORP	475,759	29.760	14,158,587.840	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	29,611	96.060	2,844,432.660	
INTERNATIONAL PAPER CO	44,153	35.140	1,551,536.420	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	45,679	31.070	1,419,246.530	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,152	175.750	1,432,714.000	
INCYTE CORP	21,658	77.780	1,684,559.240	
JOHNSON & JOHNSON	305,412	174.470	53,285,231.640	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39,402	74.300	2,927,568.600	
KLA CORPORATION	16,870	368.250	6,212,377.500	
DEVON ENERGY CORP	74,759	68.980	5,156,875.820	
KELLOGG CO	29,915	71.020	2,124,563.300	
KEYCORP	106,247	19.450	2,066,504.150	
KIMBERLY-CLARK CORP	39,997	127.780	5,110,816.660	
BLACKROCK INC/NEW YORK	17,327	759.810	13,165,227.870	
KROGER CO	77,870	48.110	3,746,325.700	
LAM RESEARCH CORP	16,432	485.410	7,976,257.120	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,380	421.250	2,266,325.000	
PACKAGING CORP OF AMERICA	11,029	125.080	1,379,507.320	
AKAMAI TECHNOLOGIES	17,689	92.920	1,643,661.880	
PLUG POWER INC	56,149	17.010	955,094.490	
LENNAR CORP	29,937	88.400	2,646,430.800	
ELI LILLY & CO	94,044	368.720	34,675,903.680	
BATH & BODY WORKS INC	28,156	34.430	969,411.080	
LINCOLN NATIONAL CORP	17,937	34.630	621,158.310	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	85,375	172.320	14,711,820.000	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	33,941	146.300	4,965,568.300	
LOCKHEED MARTIN CORP	27,932	490.770	13,708,187.640	
LOEWS CORP	23,530	56.590	1,331,562.700	
LOWE'S COS INC	74,504	204.320	15,222,657.280	
DOMINION ENERGY INC	94,726	62.370	5,908,060.620	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	40,401	35.310	1,426,559.310	
MCCORMICK & CO INC	29,367	81.860	2,403,982.620	
MCDONALD'S CORPORATION	85,649	275.880	23,628,846.120	
S&P GLOBAL INC	40,442	346.210	14,001,424.820	
EVEREST RE GROUP LTD	4,454	320.190	1,426,126.260	
MARKEL CORPORATION	1,512	1,284.930	1,942,814.160	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	73,886	72.550	5,360,429.300	
MARSH & MCLENNAN COS	58,212	168.390	9,802,318.680	

MASCO CORP	28,937	50.180	1,452,058.660	
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	7,058	362.840	2,560,924.720	
METLIFE INC	76,607	74.720	5,724,075.040	
MEDTRONIC PLC	154,488	81.840	12,643,297.920	
ACTIVISION BLIZZARD INC	91,172	73.620	6,712,082.640	
CVS HEALTH CORP	152,821	99.910	15,268,346.110	
MERCK & CO. INC.	294,122	101.890	29,968,090.580	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	50,668	72.790	3,688,123.720	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10,593	243.070	2,574,840.510	
MICROSOFT CORP	825,895	242.980	200,675,967.100	
MICRON TECH INC	131,009	60.270	7,895,912.430	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62,574	73.920	4,625,470.080	
3M CO	64,586	129.150	8,341,281.900	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,311	102.440	646,498.840	
ENTEGRIS INC	17,709	74.720	1,323,216.480	
CHARLES RIVER LABORATORIES INT	5,578	237.700	1,325,890.600	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,762	259.610	4,870,802.820	
ILLUMINA INC	17,754	240.090	4,262,557.860	
XCEL ENERGY INC	64,922	69.110	4,486,759.420	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10,061	123.220	1,239,716.420	
NETAPP INC	24,953	71.910	1,794,370.230	
NEWELL BRANDS INC	41,984	13.450	564,684.800	
NEWMONT CORP	91,771	46.410	4,259,092.110	
NVR INC	365	4,529.730	1,653,351.450	
NIKE INC-CL B	148,452	99.490	14,769,489.480	
NORDSON CORP	5,664	235.180	1,332,059.520	
NORFOLK SOUTHERN CORP	27,963	242.980	6,794,449.740	
EVERSOURCE ENERGY	40,362	79.120	3,193,441.440	
NISOURCE INC	44,573	26.090	1,162,909.570	
NORTHERN TRUST CORP	22,556	90.400	2,039,062.400	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,264	531.590	9,177,369.760	
WELLS FARGO & CO	441,665	47.950	21,177,836.750	
NUCOR CORP	31,660	139.030	4,401,689.800	
CHENIERE ENERGY INC	25,946	167.320	4,341,284.720	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,654	113.420	5,291,496.680	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	110,048	70.480	7,756,183.040	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11,008	305.630	3,364,375.040	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7,757	843.850	6,545,744.450	
ORACLE CORP	186,292	77.170	14,376,153.640	
PACCAR INC	40,847	101.910	4,162,717.770	
PTC INC	13,665	129.770	1,773,307.050	

EXELON CORP	116,226	39.000	4,532,814.000	
PARKER HANNIFIN CORP	14,702	303.320	4,459,410.640	
PAYCHEX INC	36,225	121.380	4,396,990.500	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,596	196.480	1,688,942.080	
PPL CORPORATION	88,737	27.730	2,460,677.010	
PEPSICO INC	160,382	181.700	29,141,409.400	
PENTAIR PLC	19,804	45.100	893,160.400	
PFIZER INC	653,095	47.380	30,943,641.100	
ESSENTIAL UTILITIES INC	27,796	46.410	1,290,012.360	
CONOCOPHILLIPS	151,445	129.460	19,606,069.700	
PG&E CORP	178,257	14.810	2,639,986.170	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,161	245.450	6,421,217.450	
ALTRIA GROUP INC	210,501	44.220	9,308,354.220	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	48,412	163.850	7,932,306.200	
BROWN & BROWN INC	27,138	58.690	1,592,729.220	
GARMIN LTD	17,835	91.310	1,628,513.850	
PPG INDUSTRIES INC	26,678	124.810	3,329,681.180	
COSTCO WHOLESALE CORP	51,601	513.130	26,478,021.130	
T ROWE PRICE GROUP INC	25,937	124.650	3,233,047.050	
QUEST DIAGNOSTICS	13,048	152.480	1,989,559.040	
PROCTER & GAMBLE CO	278,989	141.180	39,387,667.020	
PROGRESSIVE CORP	68,579	129.740	8,897,439.460	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56,485	59.520	3,361,987.200	
PULTE GROUP INC	29,050	43.780	1,271,809.000	
GLOBAL PAYMENTS INC	31,571	102.890	3,248,340.190	
QUALCOMM INC	130,263	120.680	15,720,138.840	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	23,437	123.980	2,905,719.260	
EXACT SCIENCES CORP	18,866	43.960	829,349.360	
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,661	741.080	9,382,813.880	
RESMED INC	17,366	225.180	3,910,475.880	
US BANCORP	164,969	44.870	7,402,159.030	
SEAGEN INC	16,860	131.060	2,209,671.600	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	45,851	58.400	2,677,698.400	
ROSS STORES INC	40,011	97.130	3,886,268.430	
ROLLINS INC	25,920	42.020	1,089,158.400	
ROPER TECHNOLOGIES INC	12,443	438.430	5,455,384.490	
ROCKWELL AUTOMATION INC	13,905	265.540	3,692,333.700	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27,477	57.720	1,585,972.440	
RPM INTERNATIONAL INC	16,467	100.090	1,648,182.030	
ACCENTURE PLC-CL A	73,565	287.020	21,114,626.300	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	161,069	64.980	10,466,263.620	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13,232	232.120	3,071,411.840	

THE TRAVELERS COMPANIES INC	28,285	183.300	5,184,640.500	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	71,649	64.000	4,585,536.000	
BOOKING HOLDINGS INC	4,639	1,946.510	9,029,859.890	
SCHLUMBERGER LTD	165,948	53.100	8,811,838.800	
SCHWAB (CHARLES) CORP	169,636	78.560	13,326,604.160	
POOL CORP	4,660	339.310	1,581,184.600	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24,453	112.900	2,760,743.700	
BUNGE LTD	16,302	102.190	1,665,901.380	
SEI INVESTMENTS CO	14,477	59.910	867,317.070	
ELEVANCE HEALTH INC	28,117	521.880	14,673,699.960	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,104	155.000	2,961,120.000	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	29,468	93.620	2,758,794.160	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28,153	239.000	6,728,567.000	
CENTENE CORP	66,823	84.430	5,641,865.890	
SVB FINANCIAL GROUP	7,330	230.950	1,692,863.500	
SMITH (A.O.) CORP	14,856	59.280	880,663.680	
SNAP-ON INC	6,118	236.030	1,444,031.540	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42,080	107.720	4,532,857.600	
ADVANCE AUTO PARTS	7,165	183.530	1,314,992.450	
EDISON INTERNATIONAL	45,008	60.290	2,713,532.320	
SOUTHERN CO	123,168	65.710	8,093,369.280	
TRUIST FINANCIAL CORP	151,927	46.040	6,994,719.080	
SOUTHWEST AIRLINES	19,700	38.820	764,754.000	
AT&T INC	834,227	18.840	15,716,836.680	
CHEVRON CORP	217,135	181.300	39,366,575.500	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,270	81.450	1,569,541.500	
STATE STREET CORP	43,118	79.860	3,443,403.480	
STARBUCKS CORP	133,865	96.260	12,885,844.900	
STEEL DYNAMICS INC	22,937	96.340	2,209,750.580	
STRYKER CORP	39,723	218.960	8,697,748.080	
NETFLIX INC	51,986	274.970	14,294,590.420	
GEN DIGITAL INC	73,086	22.630	1,653,936.180	
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,730	52.730	882,172.900	
SYNOPSIS INC	18,073	318.760	5,760,949.480	
SYSCO CORP	59,770	84.240	5,035,024.800	
INTUITIVE SURGICAL INC	41,255	257.860	10,638,014.300	
TELEFLEX INC	5,532	218.200	1,207,082.400	
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	111,349	9.400	1,046,680.600	
TERADYNE INC	18,512	93.330	1,727,724.960	
TEXAS INSTRUMENTS INC	106,757	174.690	18,649,380.330	
TEXTRON INC	25,824	71.520	1,846,932.480	

THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45,604	520.580	23,740,530.320	
GLOBE LIFE INC	12,153	113.850	1,383,619.050	
DAVITA INC	6,813	68.450	466,349.850	
TRACTOR SUPPLY CO	12,713	210.590	2,677,230.670	
BIO-TECHNE CORP	4,403	337.090	1,484,207.270	
TRIMBLE INC	28,676	59.160	1,696,472.160	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,300	309.710	1,641,463.000	
TYSON FOODS INC	32,395	66.460	2,152,971.700	
UGI CORP	24,160	36.690	886,430.400	
MARATHON OIL CORP	84,059	31.600	2,656,264.400	
UNION PACIFIC CORP	73,054	212.990	15,559,771.460	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	172,766	97.840	16,903,425.440	
UNITEDHEALTH GROUP INC	109,012	544.170	59,321,060.040	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	8,096	121.800	986,092.800	
VF CORP	37,887	29.930	1,133,957.910	
PARAMOUNT GLOBAL	67,467	16.570	1,117,928.190	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29,265	311.030	9,102,292.950	
VULCAN MATERIALS CO	15,328	180.070	2,760,112.960	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86,056	38.490	3,312,295.440	
WALMART INC	176,225	142.360	25,087,391.000	
WASTE MANAGEMENT INC	48,739	161.220	7,857,701.580	
WATERS CORP	6,836	331.850	2,268,526.600	
WEBSTER FINANCIAL CORP	22,285	55.400	1,234,589.000	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8,653	242.740	2,100,429.220	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	12,679	145.870	1,849,485.730	
VAIL RESORTS INC	4,389	230.260	1,010,611.140	
WESTERN DIGITAL CORP	35,421	37.750	1,337,142.750	
WABTEC CORP	20,273	100.350	2,034,395.550	
WHIRLPOOL CORP	6,832	149.650	1,022,408.800	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18,833	93.230	1,755,800.590	
WYNN RESORTS LTD	12,757	72.000	918,504.000	
NASDAQ INC	41,596	66.210	2,754,071.160	
CME GROUP INC	40,989	174.340	7,146,022.260	
WILLIAMS COS INC	143,258	33.620	4,816,333.960	
LKQ CORP	31,504	54.120	1,704,996.480	
ALLIANT ENERGY CORP	29,066	55.520	1,613,744.320	
WEC ENERGY GROUP INC	35,483	94.150	3,340,724.450	
CARMAX INC	18,673	70.650	1,319,247.450	
TJX COMPANIES INC	136,815	74.000	10,124,310.000	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	5,958	253.420	1,509,876.360	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	114,349	4.110	469,974.390	

JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	17,328	47.680	826,199.040	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14,121	212.450	3,000,006.450	
SIGNATURE BANK	6,557	140.940	924,143.580	
CBRE GROUP INC	37,573	77.220	2,901,387.060	
LIBERTY GLOBAL PLC	15,779	19.120	301,694.480	
REGIONS FINANCIAL CORP	107,099	23.280	2,493,264.720	
DOMINO'S PIZZA INC	4,115	357.820	1,472,429.300	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4,852	386.870	1,877,093.240	
WESTLAKE CORP	4,187	106.150	444,450.050	
T-MOBILE US INC	73,540	150.450	11,064,093.000	
LAS VEGAS SANDS CORP	38,350	41.050	1,574,267.500	
MOSAIC CO/THE	42,561	53.500	2,277,013.500	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4,193	277.470	1,163,431.710	
CELANESE CORP	13,841	104.290	1,443,477.890	
DEXCOM INC	46,766	119.840	5,604,437.440	
EXPEDIA GROUP INC	19,186	99.040	1,900,181.440	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24,027	108.490	2,606,689.230	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12,462	331.560	4,131,900.720	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	36,034	19.990	720,319.660	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	65,267	102.540	6,692,478.180	
LIVE NATION	20,444	76.360	1,561,103.840	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,304	1,470.920	4,859,919.680	
TRANSDIGM GROUP INC	6,148	640.020	3,934,842.960	
MASTERCARD INC	100,920	337.270	34,037,288.400	
WESTERN UNION CO	46,712	13.450	628,276.400	
OWENS CORNING	10,366	91.360	947,037.760	
LEIDOS HOLDINGS INC	15,108	107.230	1,620,030.840	
AERCAP HOLDINGS NV	17,861	58.610	1,046,833.210	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	13,610	141.240	1,922,276.400	
DELTA AIR LINES INC	15,786	35.490	560,245.140	
INSULET CORP	8,015	304.960	2,444,254.400	
DISCOVER FINANCIAL	33,236	108.320	3,600,123.520	
TE CONNECTIVITY LTD	36,520	122.150	4,460,918.000	
MASIMO CORP	5,688	121.580	691,547.040	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,211	353.850	4,674,712.350	
VMWARE INC	24,654	114.610	2,825,594.940	
MERCADOLIBRE INC	5,154	935.530	4,821,721.620	
ULTA BEAUTY INC	6,073	423.580	2,572,401.340	
INVESCO LTD	38,530	18.750	722,437.500	
MSCI INC	9,313	509.700	4,746,836.100	

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	180,062	93.250	16,790,781.500	
VISA INC	191,227	205.570	39,310,534.390	
KEURIG DR PEPPER INC	92,816	37.940	3,521,439.040	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,210	147.510	3,128,687.100	
MARATHON PETROLEUM CORP	62,332	119.180	7,428,727.760	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	16,182	65.690	1,062,995.580	
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	229,919	18.200	4,184,525.800	
XYLEM INC	20,869	111.740	2,331,902.060	
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	29,975	83.960	2,516,701.000	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,713	244.170	1,150,773.210	
SPLUNK INC	18,478	81.550	1,506,880.900	
EPAM SYSTEMS INC	6,493	350.450	2,275,471.850	
HCA HEALTHCARE INC	27,835	222.500	6,193,287.500	
VERISK ANALYTICS INC	18,974	181.110	3,436,381.140	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	6,554	149.900	982,444.600	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8,844	194.600	1,721,042.400	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	22,434	126.490	2,837,676.660	
NXP SEMICONDUCTOR NV	30,981	165.470	5,126,426.070	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	14,445	111.280	1,607,439.600	
TARGA RESOURCES CORP	25,830	71.590	1,849,169.700	
LEAR CORP	6,911	143.970	994,976.670	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,709	120.960	1,537,280.640	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	26,335	52.090	1,371,790.150	
DOLLAR GENERAL CORP	26,671	253.940	6,772,833.740	
FORTINET INC	77,005	54.390	4,188,301.950	
HORIZON PHARMA PLC	24,711	76.570	1,892,121.270	
TESLA INC	307,485	190.720	58,643,539.200	
GENERAC HOLDINGS INC	6,914	109.900	759,848.600	
ENPHASE ENERGY INC	15,506	309.250	4,795,230.500	
GENERAL MOTORS CO	159,031	39.740	6,319,891.940	
ALLY FINANCIAL INC	39,230	28.680	1,125,116.400	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9,661	242.510	2,342,889.110	
APTIV PLC	31,921	109.320	3,489,603.720	
PHILLIPS 66	56,789	106.240	6,033,263.360	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	9,158	58.360	534,460.880	
META PLATFORMS INC	267,319	111.870	29,904,976.530	
IQVIA HOLDINGS INC	21,481	222.580	4,781,240.980	
DIAMONDBACK ENERGY INC	18,801	160.280	3,013,424.280	

SERVICENOW INC	23,643	404.060	9,553,190.580	
PALO ALTO NETWORKS INC	35,234	163.460	5,759,349.640	
WORKDAY INC	24,052	153.130	3,683,082.760	
ABBVIE INC	205,648	149.720	30,789,618.560	
ZOETIS INC	55,265	142.610	7,881,341.650	
NEWS CORP/NEW-CL A	54,211	17.300	937,850.300	
CDW CORP	15,145	185.500	2,809,397.500	
HOWMET AEROSPACE INC	42,413	38.300	1,624,417.900	
TWILIO INC	21,090	50.710	1,069,473.900	
COUPA SOFTWARE INC	8,176	52.660	430,548.160	
SNAP INC	127,318	10.730	1,366,122.140	
TRADE DESK INC A	53,230	47.510	2,528,957.300	
LIBERTY MEDIA CORP- LIBERTY-C	22,466	58.330	1,310,441.780	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	8,845	44.110	390,152.950	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	19,871	44.010	874,522.710	
OKTA INC	17,828	49.250	878,029.000	
BLACK KNIGHT INC	17,653	58.720	1,036,584.160	
BAKER HUGHES CO	117,520	30.580	3,593,761.600	
BROADCOM INC	46,844	506.570	23,729,765.080	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9,939	36.900	366,749.100	
MONGODB INC	7,891	161.000	1,270,451.000	
BURLINGTON STORES INC	7,274	146.180	1,063,313.320	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	61,321	12.260	751,795.460	
VEEVA SYSTEMS INC	15,824	187.790	2,971,588.960	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	24,212	44.140	1,068,717.680	
EVERGY INC	28,226	61.700	1,741,544.200	
ALLEGION PLC	10,140	113.980	1,155,757.200	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	18,314	63.260	1,158,543.640	
STERIS PLC	12,524	169.270	2,119,937.480	
DOCUSIGN INC	26,362	45.500	1,199,471.000	
WIX.COM LTD	5,855	83.690	490,004.950	
DROPBOX INC	30,479	22.450	684,253.550	
KKR & CO INC	63,201	56.380	3,563,272.380	
FUTU HOLDINGS LTD ADR	5,050	42.110	212,655.500	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	27,921	82.230	2,295,943.830	
MODERNA INC	38,522	168.560	6,493,268.320	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	32,335	136.620	4,417,607.700	
ARAMARK	31,133	38.110	1,186,478.630	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	6.130	367,113.440	
CIGNA CORP	37,115	323.340	12,000,764.100	
DELL TECHNOLOGIES INC	32,770	41.720	1,367,164.400	
DOW INC	83,570	49.960	4,175,157.200	
AMCOR PLC	172,505	11.620	2,004,508.100	
PINTEREST INC	62,041	23.170	1,437,489.970	

FOX CORP-A	36,501	29.440	1,074,589.440	
FOX CORP-B	15,511	27.700	429,654.700	
CLARIVATE ANALYTICS PLC	42,586	10.000	425,860.000	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	23,558	135.760	3,198,234.080	
CHEWY INC	9,648	38.340	369,904.320	
AVANTOR INC	78,214	21.330	1,668,304.620	
LYFT INC	36,887	11.280	416,085.360	
DYNATRACE INC	20,512	36.750	753,816.000	
CLOUDFLARE INC	29,770	47.270	1,407,227.900	
TRADEWEB MARKETS INC	13,800	59.170	816,546.000	
CARRIER GLOBAL CORP	96,568	43.480	4,198,776.640	
OTIS WORLDWIDE CORP	47,395	75.600	3,583,062.000	
UBER TECHNOLOGIES INC	174,585	28.850	5,036,777.250	
CORTEVA INC	82,153	67.210	5,521,503.130	
MATCH GROUP INC	31,784	48.840	1,552,330.560	
BILL.COM HOLDINGS INC	10,180	120.140	1,223,025.200	
BLACKSTONE INC	81,966	103.520	8,485,120.320	
CARLYLE GROUP INC	24,530	29.380	720,691.400	
DATADOG INC	26,832	76.520	2,053,184.640	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	22,308	53.800	1,200,170.400	
INGERSOLL RAND INC	46,398	53.880	2,499,924.240	
PAYCOM SOFTWARE INC	5,733	329.750	1,890,456.750	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC	38,342	32.960	1,263,752.320	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES LTD	9,267	24.810	229,914.270	
UNITY SOFTWARE INC	21,046	27.820	585,499.720	
AON PLC	24,818	296.380	7,355,558.840	
WARNER BROS DISCOVERY INC	275,379	10.800	2,974,093.200	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	736	2,685.850	1,976,785.600	
BENTLEY SYSTEMS INC	22,566	38.580	870,596.280	
COINBASE GLOBAL INC	13,094	50.920	666,746.480	
AFFIRM HOLDINGS INC	18,528	14.990	277,734.720	
IAC INC	9,152	47.180	431,791.360	
AIRBNB INC	44,486	102.400	4,555,366.400	
ZENDESK INC	12,612	76.700	967,340.400	
CONSTELLATION ENERGY CORP	37,045	95.140	3,524,461.300	
APPLOVIN CORP	13,206	16.280	214,993.680	
ROYALTY PHARMA PLC	37,502	43.990	1,649,712.980	
ROBLOX CORP	38,445	33.730	1,296,749.850	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	29,656	30.940	917,556.640	
VIATRIS INC	132,223	11.340	1,499,408.820	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23,146	50.620	1,171,650.520	
SNOWFLAKE INC	26,591	145.380	3,865,799.580	
DOORDASH INC	20,697	59.460	1,230,643.620	

ARISTA NETWORKS INC	27,865	126.980	3,538,297.700	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	47,354	64.230	3,041,547.420	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC	181,564	7.640	1,387,148.960	
FNF GROUP	31,004	40.830	1,265,893.320	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC	59,888	1.400	83,843.200	
JACOBS SOLUTIONS INC	14,561	125.710	1,830,463.310	
MARVELL TECHNOLOGY INC	101,624	42.650	4,334,263.600	
APA CORP	37,156	47.000	1,746,332.000	
LUCID GROUP INC	44,910	12.110	543,860.100	
AMERCO-NON VOTING	8,820	52.060	459,169.200	
GRAB HOLDINGS LTD	113,116	2.670	302,019.720	
CATALENT INC	20,564	44.890	923,117.960	
SYNCHRONY FINANCIAL	61,118	38.730	2,367,100.140	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	56,943	41.420	2,358,579.060	
CYBERARK SOFTWARE LTD	5,237	153.700	804,926.900	
WAYFAIR INC	7,350	36.800	270,480.000	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22,209	171.710	3,813,507.390	
HUBSPOT INC	5,802	303.350	1,760,036.700	
QORVO INC	11,596	94.680	1,097,909.280	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	15,335	85.920	1,317,583.200	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	5,852	283.670	1,660,036.840	
GODADDY INC	17,185	71.760	1,233,195.600	
ETSY INC	13,841	110.210	1,525,416.610	
TRANSUNION	22,126	62.230	1,376,900.980	
ALCOA CORP	19,669	43.830	862,092.270	
BLOCK INC	59,110	67.400	3,984,014.000	
DUPONT DE NEMOURS INC	57,674	69.650	4,016,994.100	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC	22,409	50.900	1,140,618.100	
TELADOC HEALTH INC	20,256	30.980	627,530.880	
WESTROCK CO	27,826	36.950	1,028,170.700	
KRAFT HEINZ CO	87,780	37.870	3,324,228.600	
NOVOCURE LTD	10,423	75.600	787,978.800	
FORTIVE CORP	38,946	67.900	2,644,433.400	
WASTE CONNECTIONS INC	28,997	139.610	4,048,271.170	
ALPHABET INC-CL A	699,502	93.940	65,711,217.880	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	144,397	14.870	2,147,183.390	
PAYPAL HOLDINGS INC	128,931	86.800	11,191,210.800	
SEA LTD ADR	40,917	45.990	1,881,772.830	
EQUITABLE HOLDINGS INC	44,924	31.270	1,404,773.480	
ZILLOW GROUP INC-C	16,321	35.810	584,455.010	

	ALPHABET INC-CL C	656,175	94.170	61,791,999.750	
	ZSCALER INC	10,310	133.120	1,372,467.200	
	CABLE ONE INC	570	652.550	371,953.500	
	LINDE PLC	58,486	328.370	19,205,047.820	
	ROKU INC	12,563	55.510	697,372.130	
	CHARTER COMMUNICATIONS INC	13,524	373.160	5,046,615.840	
	VISTRA CORP	41,133	24.590	1,011,460.470	
アメリカ・ドル	小計	39,596,741		3,975,193,197.580 (563,960,658,944)	
イギリス・ポンド	ANTOFAGASTA PLC	45,963	13.515	621,189.940	
	ASHTAD GROUP	50,699	51.780	2,625,194.220	
	SEVERN TRENT PLC	29,397	27.170	798,716.490	
	BARCLAYS PLC	1,890,510	1.570	2,968,100.700	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	124,196	4.123	512,060.100	
	BT GROUP PLC	756,852	1.203	910,492.950	
	BUNZL PLC	38,593	30.420	1,173,999.060	
	AVIVA PLC	348,683	4.374	1,525,139.440	
	CRODA INTERNATIONAL	16,782	70.960	1,190,850.720	
	DIAGEO PLC	265,932	37.225	9,899,318.700	
	SCHRODERS PLC	71,635	4.510	323,073.850	
	DCC PLC	11,135	46.230	514,771.050	
	NATIONAL GRID PLC	409,380	10.180	4,167,488.400	
	KINGFISHER PLC	225,392	2.369	533,953.640	
	BAE SYSTEMS PLC	379,623	7.770	2,949,670.710	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	251,137	33.165	8,328,958.600	
	HALMA PLC	41,997	23.290	978,110.130	
	NEXT PLC	18,751	56.800	1,065,056.800	
	IMPERIAL BRANDS PLC	107,889	20.930	2,258,116.770	
	JOHNSON MATTHEY PLC	19,976	21.370	426,887.120	
	ANGLO AMERICAN PLC	150,601	31.320	4,716,823.320	
	COMPASS GROUP PLC	200,991	18.780	3,774,610.980	
	HSBC HOLDINGS PLC	2,344,377	4.741	11,114,691.350	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,179	2.468	1,821,825.770	
	UNILEVER PLC	297,740	40.430	12,037,628.200	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	71,616	10.225	732,273.600	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,351	15.375	651,146.620	
	PEARSON PLC	66,974	9.612	643,754.080	
	PERSIMMON PLC	35,252	13.780	485,772.560	
	PRUDENTIAL PLC	333,971	9.296	3,104,594.410	
	RIO TINTO PLC	131,005	51.480	6,744,137.400	
	VODAFONE GROUP PLC	3,044,329	1.057	3,217,855.750	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	82,292	56.800	4,674,185.600	

RELX PLC	216,002	23.770	5,134,367.540	
RENTOKIL INITIAL PLC	279,183	5.628	1,571,241.920	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,121,924	0.859	963,732.710	
NATWEST GROUP PLC	670,464	2.400	1,609,113.600	
ST JAMES'S PLACE PLC	67,448	11.535	778,012.680	
SSE PLC	131,574	16.685	2,195,312.190	
BP PLC	2,266,380	4.707	10,667,850.660	
SAGE GROUP PLC(THE)	128,893	7.594	978,813.440	
SMITHS GROUP PLC	51,695	16.215	838,234.420	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8,936	118.800	1,061,596.800	
STANDARD CHARTERED PLC	294,895	5.628	1,659,669.060	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,991,045	0.433	3,460,122.480	
TAYLOR WIMPLEY PLC	359,514	1.040	373,894.560	
TESCO PLC	846,543	2.279	1,929,271.490	
3I GROUP PLC	107,283	13.000	1,394,679.000	
SMITH & NEPHEW PLC	93,066	10.565	983,242.290	
GSK PLC	463,689	14.082	6,529,668.490	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	36,657	80.720	2,958,953.040	
WPP PLC	120,328	8.440	1,015,568.320	
ASTRAZENECA PLC	180,518	111.580	20,142,198.440	
WHITBREAD PLC	25,470	25.640	653,050.800	
INTERTEK GROUP PLC	23,309	40.170	936,322.530	
BURBERRY GROUP PLC	52,229	19.755	1,031,783.890	
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,752	47.410	1,031,262.320	
SAINSBURY (J) PLC	192,097	2.128	408,782.410	
ADMIRAL GROUP PLC	21,325	20.850	444,626.250	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	11,360	38.260	434,633.600	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	18,455	13.345	246,281.970	
AVEVA GROUP PLC	11,702	31.450	368,027.900	
ABRDN PLC	379,583	1.881	713,995.620	
EXPERIAN PLC	106,747	29.580	3,157,576.260	
MONDI PLC	58,887	15.935	938,364.340	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	36,942	8.914	329,300.980	
OCADO GROUP PLC	69,766	7.132	497,571.110	
INFORMA PLC	157,970	5.580	881,472.600	
GLENCORE PLC	1,141,040	5.012	5,718,892.480	
ENTAIN PLC	61,865	13.560	838,889.400	
COCA-COLA HBC AG	21,338	20.420	435,721.960	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	86,223	5.670	488,884.410	
FERGUSON PLC	24,704	104.750	2,587,744.000	
M&G PLC	270,401	1.853	501,053.050	
JD SPORTS FASHION PLC	252,180	1.163	293,285.340	
HALEON PLC	567,403	2.796	1,586,458.780	
SHELL PLC	867,852	23.150	20,090,773.800	

	AUTO TRADER GROUP PLC	110,833	5.710	632,856.430	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	487,207	1.259	613,393.610	
イギリス・ポンド 小計		33,158,877		209,596,998.000 (34,692,495,109)	
イスラエル・ シュケル	BANK HAPOALIM BM	146,703	34.700	5,090,594.100	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	180,343	34.700	6,257,902.100	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	287,773	6.340	1,824,480.820	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,553	689.900	1,761,314.700	
	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12,574	142.300	1,789,280.200	
	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	162,944	21.160	3,447,895.040	
	ICL GROUP LTD	72,257	30.070	2,172,767.990	
	NICE LTD	7,640	708.000	5,409,120.000	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,440	135.800	2,368,352.000	
	AZRIELI GROUP	4,672	262.700	1,227,334.400	
イスラエル・シュケル 小計		894,899		31,349,041.350 (1,278,116,090)	
オーストラリ ア・ドル	RAMSAY HEALTH CARE LTD	21,754	59.060	1,284,791.240	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	340,969	24.280	8,278,727.320	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	410,671	23.610	9,695,942.310	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	194,047	16.780	3,256,108.660	
	ASX LTD	23,664	68.980	1,632,342.720	
	BHP GROUP LTD	572,913	40.560	23,237,351.280	
	AMPOL LTD	31,828	27.710	881,953.880	
	COMPUTERSHARE LT	72,081	27.070	1,951,232.670	
	CSL LIMITED	56,391	282.730	15,943,427.430	
	REA GROUP LTD	6,134	110.990	680,812.660	
	TRANSURBAN GROUP	358,707	13.570	4,867,653.990	
	COCHLEAR LTD	7,836	202.520	1,586,946.720	
	ORIGIN ENERGY LTD	213,229	7.830	1,669,583.070	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	198,269	104.040	20,627,906.760	
	RIO TINTO LIMITED	42,295	98.300	4,157,598.500	
	APA GROUP	164,300	10.840	1,781,012.000	
	ARISTOCRAT LEISU	76,675	36.840	2,824,707.000	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	281,664	4.940	1,391,420.160	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	60,767	28.200	1,713,629.400	
	ORICA LTD	43,659	14.990	654,448.410	
LEND LEASE CORP LTD	65,475	7.960	521,181.000		
BLUESCOPE STEEL LTD	50,325	15.840	797,148.000		
MACQUARIE GROUP LTD	41,229	169.790	7,000,271.910		
SUNCORP GROUP LTD	154,162	12.010	1,851,485.620		

	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	374,560	31.000	11,611,360.000	
	NEWCREST MINING LTD	98,073	19.160	1,879,078.680	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	112,659	5.980	673,700.820	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	172,487	12.720	2,194,034.640	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	135,578	9.900	1,342,222.200	
	REECE LTD	31,558	14.610	461,062.380	
	SANTOS LTD	359,516	7.520	2,703,560.320	
	SONIC HEALTHCARE	52,774	32.500	1,715,155.000	
	WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	25,985	28.360	736,934.600	
	WESFARMERS LTD	130,037	46.220	6,010,310.140	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	210,573	37.980	7,997,562.540	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	136,728	33.750	4,614,570.000	
	SEEK LTD	38,405	20.420	784,230.100	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	6,284	56.890	357,496.760	
	MINERAL RESOURCES LTD	21,179	81.830	1,733,077.570	
	BRAMBLES LTD	170,929	11.370	1,943,462.730	
	EVOLUTION MINING LTD	224,674	2.430	545,957.820	
	AURIZON HOLDINGS LTD	222,849	3.710	826,769.790	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	79,233	12.740	1,009,428.420	
	XERO LTD	14,590	64.740	944,556.600	
	IDP EDUCATION LTD	23,781	28.570	679,423.170	
	TELSTRA GROUP LTD	482,855	3.960	1,912,105.800	
	LOTTERY CORP LTD	227,460	4.440	1,009,922.400	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	160,470	6.990	1,121,685.300	
	MEDIBANK PVT LTD	298,576	2.790	833,027.040	
	SOUTH32 LTD(AUD)	596,694	3.870	2,309,205.780	
	COLES GROUP LTD	151,233	16.590	2,508,955.470	
	WISETECH GLOBAL LTD	14,823	52.420	777,021.660	
	オーストラリア・ドル 小計	8,063,607		179,523,560.440 (16,799,814,786)	
カナダ・ドル	AGNICO EAGLE MINES LTD	52,200	63.500	3,314,700.000	
	BARRICK GOLD CORP	200,288	21.900	4,386,307.200	
	BANK OF MONTREAL	78,537	131.420	10,321,332.540	
	BANK OF NOVA SCOTIA	139,486	69.040	9,630,113.440	
	NATIONAL BANK OF CANADA	38,087	96.430	3,672,729.410	
	BCE INC	7,697	62.460	480,754.620	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	165,389	59.560	9,850,568.840	
	BAUSCH HEALTH COS INC	30,250	9.820	297,055.000	
	SAPUTO INC	26,668	33.530	894,178.040	
	BLACKBERRY LTD	49,855	6.550	326,550.250	

ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	92,311	15.290	1,411,435.190	
CGI INC	25,261	113.840	2,875,712.240	
CCL INDUSTRIES INC	16,363	60.140	984,070.820	
CAE INC	32,283	28.430	917,805.690	
CAMECO CORP	45,781	32.050	1,467,281.050	
ROGERS COMM-CL B	40,412	57.480	2,322,881.760	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	103,470	63.940	6,615,871.800	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	136,276	81.210	11,066,973.960	
CANADIAN TIRE CORP-CL A	6,124	146.160	895,083.840	
CANADIAN UTILITIES LTD	16,330	35.760	583,960.800	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	68,613	164.360	11,277,232.680	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	21,713	37.260	809,026.380	
OPEN TEXT CORP	33,217	38.850	1,290,480.450	
EMPIRE CO LTD	29,433	34.650	1,019,853.450	
KINROSS GOLD CORP	219,914	5.660	1,244,713.240	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	13,286	70.970	942,907.420	
FORTIS INC	54,416	53.820	2,928,669.120	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,491	32.110	2,070,806.010	
TELUS CORP	31,890	28.930	922,577.700	
GREAT WEST LIFECO INC	34,208	30.780	1,052,922.240	
IMPERIAL OIL LTD	27,246	75.920	2,068,516.320	
ENBRIDGE INC	233,153	54.520	12,711,501.560	
IGM FINANCIAL INC	12,478	38.880	485,144.640	
MANULIFE FINANCIAL CORP	219,912	23.050	5,068,971.600	
LOBLAW CO LTD	18,620	111.900	2,083,578.000	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	95,432	62.820	5,995,038.240	
MAGNA INTERNATIONAL INC	32,328	78.730	2,545,183.440	
SUN LIFE FINANCIAL INC	69,566	61.050	4,247,004.300	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,799	726.360	2,033,081.640	
METRO INC	28,629	73.230	2,096,501.670	
EMERA INC	30,947	51.090	1,581,082.230	
ONEX CORP	10,157	71.680	728,053.760	
PAN AMERICAN SILVER CORP	19,323	19.420	375,252.660	
POWER CORP OF CANADA	65,500	32.680	2,140,540.000	
QUEBECOR INC-B	17,195	27.020	464,608.900	
ROYAL BANK OF CANADA	163,125	130.890	21,351,431.250	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	109,135	104.010	11,351,131.350	
SHAW COMM INC-B	52,487	35.980	1,888,482.260	
SUNCOR ENERGY INC	165,413	47.700	7,890,200.100	
LUNDIN MINING CORP	68,762	8.080	555,596.960	
TECK RESOURCES LTD-CL B	57,326	45.750	2,622,664.500	

	THOMSON REUTERS CORP	19,979	147.000	2,936,913.000	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	9,665	102.580	991,435.700	
	TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	210,946	89.290	18,835,368.340	
	TC ENERGY CORP	115,612	63.140	7,299,741.680	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	5,862	110.550	648,044.100	
	WESTON (GEORGE) LTD	8,379	154.900	1,297,907.100	
	INTACT FINANCIAL CORP	20,070	199.500	4,003,965.000	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	53,414	50.580	2,701,680.120	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,335	1,994.740	4,657,717.900	
	FRANCO-NEVADA CORP NPR	21,662	186.070	4,030,648.340	
	TOURMALINE OIL CORP	39,298	77.630	3,050,703.740	
	KEYERA CORP	24,571	28.200	692,902.200	
	PARKLAND CORP	15,665	25.100	393,191.500	
	ALTAGAS LTD	33,833	23.140	782,895.620	
	PEMBINA PIPELINE CORP	68,179	45.860	3,126,688.940	
	DOLLARAMA INC	32,535	81.320	2,645,746.200	
	CENOVUS ENERGY INC W/I	158,757	27.810	4,415,032.170	
	ARC RESOURCES LTD	74,961	18.680	1,400,271.480	
	NORTHLAND POWER INC	25,030	41.020	1,026,730.600	
	TMX GROUP LTD	7,040	135.430	953,427.200	
	BRP INC	4,307	93.360	402,101.520	
	IVANHOE MINES LTD	64,027	10.910	698,534.570	
	NUTRIEN LTD	66,177	105.500	6,981,673.500	
	TFI INTERNATIONAL INC	9,399	134.350	1,262,755.650	
	LIGHTSPEED COMMERCE INC	12,150	21.650	263,047.500	
	WSP GLOBAL INC	15,681	163.720	2,567,293.320	
	IA FINANCIAL CORP INC	12,011	70.600	847,976.600	
	GFL ENVIRONMENTAL INC	27,577	36.000	992,772.000	
	NUVEI CORP	7,929	41.970	332,780.130	
	BROOKFIELD RENEWABLE CORP	16,103	43.770	704,828.310	
	AIR CANADA	18,814	18.120	340,909.680	
	RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,443	82.430	2,674,276.490	
	SHOPIFY INC	133,298	48.650	6,484,947.700	
	FIRSTSERVICE CORP	5,237	170.430	892,541.910	
	HYDRO ONE LTD	37,626	34.350	1,292,453.100	
	カナダ・ドル 小計	4,784,354		278,788,023.470 (29,643,530,536)	
シンガポール・ ドル	SINGAPORE TECH ENG	144,200	3.380	487,396.000	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	203,210	34.540	7,018,873.400	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	39,400	7.670	302,198.000	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	99,800	8.830	881,234.000	
	GENTING SINGAPORE LTD	761,193	0.815	620,372.290	

	KEPPEL CORP LTD	225,700	7.100	1,602,470.000	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	368,898	12.240	4,515,311.520	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	943,330	2.630	2,480,957.900	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	162,700	5.330	867,191.000	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	129,766	29.210	3,790,464.860	
	UOL GROUP LIMITED	43,600	6.390	278,604.000	
	VENTURE CORP LTD	43,800	17.260	755,988.000	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	194,400	3.940	765,936.000	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD SINGAPORE	306,590	3.350	1,027,076.500	
	シンガポール・ドル 小計	3,666,587		25,394,073.470 (2,604,162,234)	
スイス・フラン	CREDIT SUISSE GROUP AG	331,797	4.089	1,356,717.930	
	LOGITECH INTL-REG	18,983	56.520	1,072,919.160	
	NESTLE SA-REGISTERED	326,919	110.080	35,987,243.520	
	CIE FINANC RICHEMONT	59,444	107.100	6,366,452.400	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	82,297	330.500	27,199,158.500	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,208	179.800	756,598.400	
	SIKA INHABER	17,793	254.300	4,524,759.900	
	SGS SA-REG	748	2,312.000	1,729,376.000	
	NOVARTIS AG-REG SHS	250,451	82.300	20,612,117.300	
	BALOISE HOLDING AG -R	5,675	139.500	791,662.500	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,947.000	895,620.000	
	CLARIANT AG-REG	21,072	16.650	350,848.800	
	SWISSCOM AG-REG	3,431	501.600	1,720,989.600	
	ABB LTD	194,538	29.450	5,729,144.100	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,842	34.250	679,588.500	
	GEBERIT AG	4,377	477.500	2,090,017.500	
	LONZA GROUP AG-REG	9,027	516.400	4,661,542.800	
	LINDT & SPRUENGLI PART	117	10,080.000	1,179,360.000	
	LINDT & SPRUENGLI NAMEN	13	99,900.000	1,298,700.000	
	GIVAUDAN-REG	1,043	3,215.000	3,353,245.000	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,530	431.800	7,569,454.000	
	ROCHE HOLDING AG-BEARER	2,595	399.400	1,036,443.000	
	HOLCIM LTD	66,607	48.340	3,219,782.380	
	TEMENOS GROUP	7,082	63.180	447,440.760	
	BACHEM HOLDING AG	2,630	83.100	218,553.000	
	SONOVA HOLDING AG	6,135	247.100	1,515,958.500	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG	5,959	234.800	1,399,173.200	
	STRAUMANN HOLDING AG	12,969	111.450	1,445,395.050	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,130	248.100	776,553.000	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	5,026	46.280	232,603.280	
	SCHINDLER NAMEN	2,720	171.400	466,208.000	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,610	497.000	1,794,170.000	

	EMS-CHEMIE HOLDING	810	684.500	554,445.000	
	SWISS PRIME SITE AG	8,372	83.500	699,062.000	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,623	979.600	2,569,490.800	
	JULIUS BAER GROUP LTD	26,031	52.080	1,355,694.480	
	SWISS RE LTD	36,229	78.380	2,839,629.020	
	SIG GROUP AG	38,322	21.920	840,018.240	
	ALCON INC	57,507	59.160	3,402,114.120	
	UBS GROUP AG	403,136	16.890	6,808,967.040	
	VAT GROUP AG	3,325	279.600	929,670.000	
スイス・フラン	小計	2,064,583		162,476,886.780 (23,856,481,286)	
スウェーデン・ クローナ	ATLAS COPCO AB-A SHS	313,452	134.020	42,008,837.040	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	168,168	119.380	20,075,895.840	
	ERICSSON LM-B SHS	330,309	61.830	20,423,005.470	
	GETINGE AB-B SHS	25,755	245.700	6,328,003.500	
	INVESTOR AB-A SHS	58,437	201.600	11,780,899.200	
	LUNDBERGS B	7,859	470.000	3,693,730.000	
	SKF AB-B SHS	46,594	178.150	8,300,721.100	
	SANDVIK AB	133,350	191.100	25,483,185.000	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	179,371	118.700	21,291,337.700	
	SKANSKA AB-B SHS	43,937	182.450	8,016,305.650	
	SWEDBANK AB	112,296	164.200	18,439,003.200	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,211	139.300	9,780,392.300	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	162,036	103.900	16,835,540.400	
	VOLVO AB-A SHS	24,198	203.800	4,931,552.400	
	VOLVO AB-B SHS	168,857	193.500	32,673,829.500	
	HOLMEN AB-B SHS	10,142	407.500	4,132,865.000	
	SWEDISH MATCH AB	186,902	116.200	21,718,012.400	
	TELE2 AB-B SHS	64,416	92.380	5,950,750.080	
	INDUSTRIVARDEN A	15,292	266.300	4,072,259.600	
	INDUSTRIVARDEN C	21,325	264.900	5,648,992.500	
	ELECTROLUX AB-SER B	26,907	146.960	3,954,252.720	
	SECURITAS AB-B SHS	76,085	91.820	6,986,124.700	
	INVESTOR AB-B SHS	204,473	193.540	39,573,704.420	
	HENNES&MAURITZ AB-B SHS	82,287	120.520	9,917,229.240	
	ASSA ABLOY AB-B	124,612	241.500	30,093,798.000	
	TELIA CO AB	344,810	29.520	10,178,791.200	
	BOLIDEN AB	29,779	363.750	10,832,111.250	
	ALFA LAVAL AB	35,313	300.000	10,593,900.000	
	KINNEVIK AB-B	22,633	163.550	3,701,627.150	
	FASTIGHETS AB BALDER	72,942	49.000	3,574,158.000	
	INDUTRADE AB	29,769	216.900	6,456,896.100	
	HUSQVARNA AB-B SHS	47,769	76.160	3,638,087.040	
	NIBE INDUSTRIER AB	162,506	97.300	15,811,833.800	

	SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	18,380	208.500	3,832,230.000	
	HEXAGON AB-B SHS	223,124	123.900	27,645,063.600	
	SAGAX AB	19,038	234.800	4,470,122.400	
	EPIROC AB-A	84,563	191.000	16,151,533.000	
	EPIROC AB-B	41,205	165.450	6,817,367.250	
	ESSITY AB-B	66,425	242.700	16,121,347.500	
	EQT AB	31,718	249.300	7,907,297.400	
	EMBRACER GROUP AB	79,791	58.350	4,655,804.850	
	VOLVO CAR AB	63,710	53.660	3,418,678.600	
	LIFCO AB	26,835	181.600	4,873,236.000	
	EVOLUTION AB	22,326	1,041.800	23,259,226.800	
	NORDEA BANK ABP	403,793	106.240	42,898,968.320	
	INVESTMENT AB LATOUR	15,539	217.100	3,373,516.900	
スウェーデン・クローナ 小計		4,499,239		612,322,024.120 (8,174,499,022)	
デンマーク・クローネ	CARLSBERG AS-B	10,908	915.400	9,985,183.200	
	A P MOLLER A/S	557	15,400.000	8,577,800.000	
	AP MOLLER MAERSK A	359	14,980.000	5,377,820.000	
	DANSKE BANK A/S	72,887	120.650	8,793,816.550	
	GENMAB A/S	7,409	3,124.000	23,145,716.000	
	NOVOZYMES-B SHS	23,859	418.900	9,994,535.100	
	ROCKWOOL AS	873	1,663.000	1,451,799.000	
	NOVO NORDISK A/S-B	193,450	836.700	161,859,615.000	
	GN STORE NORD A/S	15,343	179.300	2,750,999.900	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	114,856	187.260	21,507,934.560	
	COLOPLAST-B	15,343	899.200	13,796,425.600	
	DSV A/S	22,074	1,106.000	24,413,844.000	
	DEMANT A/S	11,367	201.400	2,289,313.800	
	TRYG A/S	44,887	168.750	7,574,681.250	
	PANDORA A/S	9,912	499.400	4,950,052.800	
	CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	12,538	450.700	5,650,876.600	
ORSTED A/S	20,956	687.800	14,413,536.800		
デンマーク・クローネ 小計		577,578		326,533,950.160 (6,338,023,973)	
ニュージーランド・ドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	164,341	7.600	1,248,991.600	
	FISHER & PAYKEL	60,887	19.310	1,175,727.970	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	219,038	5.140	1,125,855.320	
	MIGHTY RIVER POWER LTD	62,834	5.375	337,732.750	
	MERIDIAN ENERGY LTD	132,157	4.535	599,331.990	
ニュージーランド・ドル 小計		639,257		4,487,639.630 (382,077,638)	
ノルウェー・クローネ	MOWI ASA	45,504	156.150	7,105,449.600	
	NORSK HYDRO ASA	162,971	69.740	11,365,597.540	
	TELENOR ASA	85,954	97.480	8,378,795.920	

	KONGSBERG GRUPPEN ASA	11,185	383.600	4,290,566.000	
	ORKLA ASA	116,068	67.740	7,862,446.320	
	EQUINOR ASA	110,053	362.950	39,943,736.350	
	YARA INTERNATIONAL ASA	19,834	464.200	9,206,942.800	
	AKER BP ASA	33,719	349.300	11,778,046.700	
	SALMAR ASA	7,248	332.000	2,406,336.000	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,721	194.400	5,000,162.400	
	ADEVINTA ASA	24,382	78.350	1,910,329.700	
	DNB BANK ASA	105,251	184.250	19,392,496.750	
	ノルウェー・クローネ 小計	747,890		128,640,906.080 (1,802,259,094)	
ユーロ	CRH PLC	85,408	37.845	3,232,265.760	
	FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	19,953	133.950	2,672,704.350	
	KERRY GROUP PLC-A	18,268	93.540	1,708,788.720	
	KINGSPAN GROUP PLC	17,451	59.680	1,041,475.680	
	UMICORE	24,290	35.320	857,922.800	
	AIR LIQUIDE	61,364	137.440	8,433,868.160	
	AIRBUS SE	67,715	113.140	7,661,275.100	
	AXA SA	216,175	26.620	5,754,578.500	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	83,720	24.170	2,023,512.400	
	ADIDAS AG	20,476	128.000	2,620,928.000	
	ASSICURAZIONI GENERALI	133,912	16.660	2,230,973.920	
	DASSAULT AVIATION SA	3,120	144.800	451,776.000	
	DANONE	74,107	49.530	3,670,519.710	
	SAFRAN SA	38,630	112.200	4,334,286.000	
	INTESA SANPAOLO	2,050,973	2.177	4,464,968.220	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39,262	82.850	3,252,856.700	
	ACCOR SA	18,305	24.740	452,865.700	
	BOUYGUES	29,123	30.290	882,135.670	
	BNP PARIBAS	128,203	50.850	6,519,122.550	
	THALES SA	12,886	122.850	1,583,045.100	
	CAPGEMINI SA	19,839	175.100	3,473,808.900	
	UNICREDIT SPA	241,149	13.034	3,143,136.060	
	D'IETEREN TRDG	2,736	171.900	470,318.400	
	KONINKLIJKE DSM NV	20,425	128.350	2,621,548.750	
	COMMERZBANK AG	112,781	7.708	869,315.940	
	EIFFAGE	8,993	92.660	833,291.380	
	FRESENIUS SE & CO KGAA	48,948	24.040	1,176,709.920	
	UNITED INTERNET	10,010	19.515	195,345.150	
	PUBLICIS GROUPE	26,472	62.280	1,648,676.160	
	IBERDROLA SA	701,074	10.515	7,371,793.110	
	ENI SPA	278,442	14.070	3,917,678.940	
	JERONIMO MARTINS	34,644	20.840	721,980.960	
	KESKO OYJ-B	35,252	21.490	757,565.480	
	KBC GROUPE	28,279	50.000	1,413,950.000	
	HANNOVER RUECK SE	7,105	172.600	1,226,323.000	

WARTSILA OYJ	50,956	7.714	393,074.580	
L'OREAL	28,260	338.550	9,567,423.000	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	32,383	686.800	22,240,644.400	
GEA GROUP AG	17,490	39.820	696,451.800	
BOLLORE	114,808	5.155	591,835.240	
MEDIOBANCA SPA	60,688	9.814	595,592.030	
MICHELIN(CGDE) -B	77,776	26.520	2,062,619.520	
CONTINENTAL AG	12,921	59.760	772,158.960	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,731	38.230	4,539,086.130	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	22,291	18.000	401,238.000	
OMV AG	17,258	48.160	831,145.280	
VERBUND AG	7,320	85.350	624,762.000	
PERNOD-RICARD	24,888	186.600	4,644,100.800	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG- PFD	16,854	58.660	988,655.640	
RENAULT SA	27,902	31.135	868,728.770	
REPSOL SA	161,783	13.650	2,208,337.950	
REMY COINTREAU	2,866	164.600	471,743.600	
MERCK KGAA	15,234	177.950	2,710,890.300	
COMPAGNIE DE SAINT- GOBAIN	56,977	44.355	2,527,214.830	
RWE AG	77,853	40.600	3,160,831.800	
SEB SA	2,596	73.550	190,935.800	
SOCIETE GENERALE-A	90,814	23.575	2,140,940.050	
VINCI S.A.	61,180	95.890	5,866,550.200	
SODEXO	9,822	89.240	876,515.280	
SOFINA	1,449	225.000	326,025.000	
SOLVAY SA	9,070	98.460	893,032.200	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	63,972	140.580	8,993,183.760	
VIVENDI SE	76,073	8.554	650,728.440	
SAP SE	119,009	105.020	12,498,325.180	
TELEFONICA S.A	614,947	3.624	2,228,567.920	
TOTALENERGIES SE	288,377	56.520	16,299,068.040	
VALEO	26,570	18.605	494,334.850	
E.ON SE	256,515	8.840	2,267,592.600	
VOEST-ALPINE AG	10,593	25.100	265,884.300	
HENKEL AG & CO KGAA	13,376	61.600	823,961.600	
SIEMENS AG-REG	89,533	120.700	10,806,633.100	
UPM-KYMMENE OYJ	62,233	34.940	2,174,421.020	
ING GROEP NV-CVA	454,638	11.024	5,011,929.310	
PUMA AG	10,980	47.910	526,051.800	
BAYER AG	113,431	51.410	5,831,487.710	
STORA ENSO OYJ-R SHS	58,535	14.210	831,782.350	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19,644	66.080	1,298,075.520	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	95,638	63.340	6,057,710.920	
BASF SE	104,334	48.905	5,102,454.270	

BEIERSDORF AG	10,944	100.550	1,100,419.200	
HEIDELBERGCEMENT AG	20,809	50.720	1,055,432.480	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	23,855	28.970	691,079.350	
ASM INTERNATIONAL NV	5,188	255.750	1,326,831.000	
ORANGE	228,746	9.755	2,231,417.230	
SAMPO OYJ-A SHS	58,396	47.390	2,767,386.440	
RANDSTAD NV	11,897	54.120	643,865.640	
ALLIANZ SE	47,164	200.050	9,435,158.200	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	317,956	4.527	1,439,386.810	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	125,884	28.435	3,579,511.540	
HERMES INTL	3,764	1,434.000	5,397,576.000	
ENDESA S.A.	37,701	17.995	678,429.490	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	72,342	7.233	523,249.680	
ERSTE GROUP BANK AG	38,446	28.090	1,079,948.140	
MUENCHENER RUECKVER AG- REG	15,818	288.500	4,563,493.000	
ARCELOR MITTAL (NL)	57,374	24.660	1,414,842.840	
DASSAULT SYSTEMES SA	75,193	36.430	2,739,280.990	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	23,571	26.270	619,210.170	
RHEINMETALL STAMM	4,693	167.100	784,200.300	
HEINEKEN NV	29,630	86.060	2,549,957.800	
AKZO NOBEL	19,812	68.360	1,354,348.320	
ASML HOLDING NV	47,485	544.200	25,841,337.000	
AEGON NV	196,332	4.680	918,833.760	
VOLKSWAGEN AG	3,315	184.300	610,954.500	
VOLKSWAGEN AG PFD	20,739	139.000	2,882,721.000	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	770,046	5.306	4,085,864.070	
KERING	8,881	532.000	4,724,692.000	
ACCIONA S.A.	2,642	190.000	501,980.000	
FORTUM OYJ	54,194	14.380	779,309.720	
AGEAS	18,136	36.700	665,591.200	
UCB SA	16,732	78.260	1,309,446.320	
NEMETSCHKE SE	9,878	47.500	469,205.000	
CARREFOUR SA	64,831	16.365	1,060,959.310	
NATURGY ENERGY GROUP SA	17,677	26.200	463,137.400	
NOKIA OYJ	592,026	4.563	2,701,414.630	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	101,426	13.750	1,394,607.500	
WOLTERS KLUWER-CVA	29,952	103.550	3,101,529.600	
SANOFI	133,151	86.970	11,580,142.470	
STMICROELECTRONICS NV	80,161	35.770	2,867,358.970	
ELISA OYJ	20,242	50.020	1,012,504.840	
BANCO SANTANDER SA	2,066,857	2.553	5,276,685.920	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	49,011	17.195	842,744.140	
QIAGEN N.V.	27,412	45.590	1,249,713.080	

DEUTSCHE BANK AG-REG	253,716	9.964	2,528,026.220	
BMW VORZUG	7,821	78.850	616,685.850	
ENEL SPA	958,960	5.010	4,804,389.600	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	383,429	19.408	7,441,590.030	
SARTORIUS AG	2,847	400.400	1,139,938.800	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,032	26.770	295,326.640	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	159,023	29.685	4,720,597.750	
RATIONAL AG	516	584.500	301,602.000	
CARL ZEISS MEDITEC AG	4,866	129.250	628,930.500	
BECHTLE AG	8,139	37.740	307,165.860	
KONINKLIJKE KPN NV	475,739	2.851	1,356,331.880	
EUROFINS SCIENTIFIC	14,779	70.380	1,040,146.020	
TELEPERFORMANCE	6,746	175.950	1,186,958.700	
DEUTSCHE BOERSE AG	21,263	163.300	3,472,247.900	
EURAZEO	5,673	60.250	341,798.250	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,318	78.500	888,463.000	
HEINEKEN HOLDING NV-A	10,853	70.150	761,337.950	
INDITEX	126,694	24.460	3,098,935.240	
ESSILORLUXOTTICA	32,904	172.250	5,667,714.000	
SNAM SPA	210,122	4.825	1,013,838.650	
CREDIT AGRICOLE SA	143,720	9.458	1,359,303.760	
ENAGAS	24,864	17.075	424,552.800	
WENDEL	2,354	86.500	203,621.000	
TENARIS SA	55,855	15.665	874,968.570	
TELECOM ITALIA SPA	908,286	0.245	222,530.070	
ATLANTIA SPA	55,336	22.730	1,257,787.280	
PROXIMUS	14,640	11.130	162,943.200	
TERNA SPA	166,064	7.316	1,214,924.220	
BIOMERIEUX	4,870	100.450	489,191.500	
GRIFOLS SA	31,982	9.812	313,807.380	
FERROVIAL SA	55,374	24.400	1,351,125.600	
NESTE OYJ	45,715	46.100	2,107,461.500	
RECORDATI SPA	10,908	41.530	453,009.240	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	57,775	9.642	557,066.550	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	6,008	179.900	1,080,839.200	
KONE OYJ	39,178	47.730	1,869,965.940	
ELIA GROUP	4,078	136.800	557,870.400	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3,109	347.100	1,079,133.900	
ENGIE	206,708	13.900	2,873,241.200	
ALSTOM	37,007	24.000	888,168.000	
ELECTRICITE DE FRANCE	65,012	11.910	774,292.920	
IPSEN SA	3,873	107.200	415,185.600	
ARKEMA SA	6,392	88.200	563,774.400	
LEGRAND SA	30,081	78.900	2,373,390.900	
AMPLIFON SPA	12,300	28.150	346,245.000	
ADP	3,975	142.050	564,648.750	
ORION OYJ	13,559	49.100	665,746.900	

GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	59,406	10.980	652,277.880	
SYMRISE AG	15,064	109.600	1,651,014.400	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,422	35.910	1,164,274.020	
PRYSMIAN SPA	30,728	34.150	1,049,361.200	
DIASORIN ITALIA SPA	2,429	136.750	332,165.750	
CAIXABANK	498,058	3.187	1,587,310.840	
BUREAU VERITAS SA	31,295	26.710	835,889.450	
GETLINK	63,509	16.405	1,041,865.140	
EDP RENOVAVEIS SA	29,561	22.780	673,399.580	
AMADEUS IT GROUP SA	51,056	52.260	2,668,186.560	
BRENTAG SE	17,934	67.200	1,205,164.800	
EVONIK INDUSTRIES AG	24,687	18.680	461,153.160	
EDENRED	31,091	53.820	1,673,317.620	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	105,474	2.364	249,340.530	
LEG IMMOBILIEN SE	8,209	64.500	529,480.500	
KION GROUP AG	7,874	27.060	213,070.440	
VONOVIA SE	85,937	24.570	2,111,472.090	
KNORR-BREMSE AG	7,195	53.700	386,371.500	
OCI NV	12,329	36.800	453,707.200	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	30,120	51.700	1,557,204.000	
FERRARI NV	15,435	209.200	3,229,002.000	
CNH INDUSTRIAL NV	112,387	14.355	1,613,315.380	
AROUNDTOWN SA	113,225	2.354	266,531.650	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17,293	35.550	614,766.150	
MONCLER SPA	25,014	49.570	1,239,943.980	
NEXI SPA	58,847	9.768	574,817.490	
PROSUS NV	98,305	51.690	5,081,385.450	
DR ING HC F PORSCHE AG	12,500	101.400	1,267,500.000	
FERROVIAL SA-RTS	55,374	0.436	24,143.060	
JDE PEET'S BV	7,893	29.300	231,264.900	
EXOR NV	14,142	70.720	1,000,122.240	
SIEMENS ENERGY AG	46,508	14.000	651,112.000	
EURONEXT NV	10,081	68.420	689,742.020	
IMCD NV	6,823	141.500	965,454.500	
WORLDLINE SA	29,916	46.820	1,400,667.120	
NN GROUP NV	31,214	43.730	1,364,988.220	
FINECOBANK SPA	75,180	14.365	1,079,960.700	
ARGENX SE	6,753	368.200	2,486,454.600	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	82,533	20.805	1,717,099.060	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	56,693	28.705	1,627,372.560	
ZALANDO SE	24,405	29.450	718,727.250	
STELLANTIS NV	245,839	14.158	3,480,588.560	
AENA SME SA	8,494	122.950	1,044,337.300	
CELLNEX TELECOM SAU	64,293	36.160	2,324,834.880	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	22,670	22.590	512,115.300	
ABN AMRO BANK NV	52,835	10.965	579,335.770	

	SCOUT24 SE	10,048	55.900	561,683.200	
	COVESTRO AG	27,558	35.630	981,891.540	
	HELLOFRESH SE	17,856	24.780	442,471.680	
	ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	97,316	52.900	5,148,016.400	
	POSTE ITALIANE SPA	58,889	9.754	574,403.300	
	AMUNDI SA	6,292	53.500	336,622.000	
	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	41,879	9.930	415,858.470	
	ADYEN NV	2,458	1,512.200	3,716,987.600	
	DELIVERY HERO SE	17,246	41.310	712,432.260	
ユーロ 小計		21,312,402		503,188,589.960 (72,665,464,276)	
香港・ドル	HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	11.140	2,862,980.000	
	CLP HOLDINGS LTD	197,296	54.250	10,703,308.000	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	57,314	37.350	2,140,677.900	
	HONG KONG EXCHANGES &CLEAR	138,691	255.800	35,477,157.800	
	MTR CORP	192,441	35.650	6,860,521.650	
	HANG SENG BANK LTD	95,096	114.100	10,850,453.600	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170,972	21.550	3,684,446.600	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	151,320	37.600	5,689,632.000	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,245,406	6.160	7,671,700.960	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	260,904	42.250	11,023,194.000	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	419,995	25.300	10,625,873.500	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	173,066	16.740	2,897,124.840	
	SINO LAND CO	411,200	8.940	3,676,128.000	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,065	85.850	13,827,430.250	
	SWIRE PACIFIC LTD A	53,020	55.950	2,966,469.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	159,156	79.500	12,652,902.000	
	XINYI GLASS HOLDING CO LTD	178,000	12.400	2,207,200.000	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	233,000	15.220	3,546,260.000	
	AIA GROUP LTD	1,416,316	67.150	95,105,619.400	
	HKT TRUST / HKT LTD	463,136	8.880	4,112,647.680	
	SANDS CHINA LTD	260,600	16.800	4,378,080.000	
	SITC INTERNATIONAL CO LTD	140,000	13.840	1,937,600.000	
	SWIRE PROPERTIES LTD	114,400	16.300	1,864,720.000	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	196,135	33.500	6,570,522.500	
	ESR GROUP LTD	216,400	14.560	3,150,784.000	

	HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	246,500	5.440	1,340,960.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	265,000	19.100	5,061,500.000	
	WH GROUP LTD	931,500	4.270	3,977,505.000	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	310,445	40.850	12,681,678.250	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	266,195	45.500	12,111,872.500	
香港・ドル	小計	9,381,569		301,656,949.430 (5,456,974,215)	
合計		129,387,583		767,654,557,203 (767,654,557,203)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	オーストラリア・ドル	DEXUS	163,989.000	1,259,435.520	
		GOODMAN GROUP	214,602.000	3,697,592.460	
		GPT GROUP	219,223.000	942,658.900	
		MIRVAC GROUP	432,802.000	913,212.220	
		SCENTRE GROUP	647,197.000	1,876,871.300	
		STOCKLAND	259,328.000	925,800.960	
		VICINITY CENTRES	386,564.000	755,732.620	
		オーストラリア・ドル 小計	2,323,705.000	10,371,303.980 (970,546,626)	
	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	1,145,762.800	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	474,100.000	715,891.000	
		MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	206,400.000	324,048.000	
		シンガポール・ドル 小計	1,690,009.000	3,266,480.700 (334,977,596)	
投資信託受益証券 合計			4,013,714	1,305,524,222 (1,305,524,222)	
投資証券	アメリカ・ドル	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,835.000	2,892,679.300	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	34,348.000	1,116,310.000	
		AMERICAN TOWER CORP	53,284.000	11,770,435.600	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	45,448.000	957,589.360	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,932.000	2,909,256.240	
		BOSTON PROPERTIES INC	18,531.000	1,398,719.880	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	11,279.000	1,310,619.800	
		CROWN CASTLE INC	50,735.000	7,034,915.100	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	32,050.000	3,480,309.500	

	EQUINIX INC	10,743.000	6,961,464.000	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,486.000	1,348,798.240	
	EQUITY RESIDENTIAL	41,364.000	2,646,055.080	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,316.000	1,598,984.960	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	14,919.000	2,433,139.710	
	GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	30,095.000	1,545,679.200	
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	42,371.000	877,503.410	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62,566.000	1,586,048.100	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	78,715.000	1,427,102.950	
	INVITATION HOMES INC	69,205.000	2,234,629.450	
	IRON MOUNTAIN INC	34,514.000	1,814,400.980	
	KIMCO REALTY	71,517.000	1,595,544.270	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST	72,327.000	873,710.160	
	MID AMERICA	13,578.000	2,224,483.740	
	PROLOGIS INC	107,773.000	12,753,856.820	
	PUBLIC STORAGE	18,529.000	5,610,766.490	
	REALTY INCOME CORP	69,294.000	4,529,748.780	
	REGENCY CENTERS CORP	19,311.000	1,279,546.860	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	12,240.000	3,633,688.800	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,061.000	4,448,802.440	
	SUN COMMUNITIES INC	14,694.000	2,097,862.380	
	UDR INC	41,516.000	1,689,286.040	
	VENTAS INC	48,092.000	2,157,407.120	
	VICI PROPERTIES INC	105,199.000	3,431,591.380	
	VORNADO REALTY TRUST	16,223.000	407,035.070	
	WELLTOWER INC	54,422.000	3,812,805.320	
	WEYERHAEUSER CO	83,741.000	2,751,729.260	
	WP CAREY INC	21,266.000	1,697,664.780	
アメリカ・ドル	小計	1,500,519.000	112,340,170.570 (15,937,699,999)	
イギリス・ポンド	BRITISH LAND CO PLC	119,111.000	482,637.770	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,092.000	487,838.170	
	SEGRO PLC	139,569.000	1,197,222.880	
イギリス・ポンド	小計	335,772.000	2,167,698.820 (358,797,509)	
カナダ・ドル	CANADIAN APT PPTYS REIT	8,722.000	379,058.120	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	14,424.000	303,625.200	
カナダ・ドル	小計	23,146.000	682,683.320 (72,589,717)	
ユーロ	COVIVIO	5,066.000	303,453.400	
	GECINA SA	5,045.000	489,869.500	
	KLEPIERRE	25,279.000	564,732.860	

		UNIBAIL-RODAMCO	13,535.000	708,963.300	
		WESTFIELD			
		WAREHOUSES DE PAUW	16,790.000	470,455.800	
	ユーロ 小計		65,715.000	2,537,474.860 (366,436,745)	
	香港・ドル	LINK REIT	233,616.000	11,902,735.200	
	香港・ドル 小計		233,616.000	11,902,735.200 (215,320,480)	
投資証券 合計			2,158,768	16,950,844,450 (16,950,844,450)	
合計				18,256,368,672 (18,256,368,672)	

(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 599銘柄 投資証券 37銘柄	69.75 -	- -	- 1.97	73.79
イギリス・ポンド	株式 79銘柄 投資証券 3銘柄	4.29 -	- -	- 0.04	4.46
イスラエル・シケル	株式 10銘柄	0.16	-	-	0.16
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	2.08 -	- 0.12	- -	2.26
カナダ・ドル	株式 86銘柄 投資証券 2銘柄	3.67 -	- -	- 0.01	3.78
シンガポール・ドル	株式 14銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	0.32 -	- 0.04	- -	0.37
スイス・フラン	株式 41銘柄	2.95	-	-	3.04
スウェーデン・クローナ	株式 46銘柄	1.01	-	-	1.04
デンマーク・クローネ	株式 17銘柄	0.78	-	-	0.81
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 224銘柄 投資証券 5銘柄	8.99 -	- -	- 0.05	9.29
香港・ドル	株式 30銘柄 投資証券 1銘柄	0.67 -	- -	- 0.03	0.72

(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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,573,862,542
投資証券	207,970,081,150
未収入金	519,394,187
未収配当金	1,874,185,801
前払金	166,628,100
差入委託証拠金	266,418,000
流動資産合計	213,370,569,780
資産合計	213,370,569,780
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	90,932,670
未払解約金	38,760,000
流動負債合計	129,692,670
負債合計	129,692,670
純資産の部	
元本等	
元本	87,353,406,924
剰余金	
剰余金又は欠損金()	125,887,470,186
元本等合計	213,240,877,110
純資産合計	213,240,877,110
負債純資産合計	213,370,569,780

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	88,358,860,745円
同期中追加設定元本額	98,551,417,505円
同期中一部解約元本額	99,556,871,326円
元本の内訳	
ファンド名	
MITO ラップ型ファンド(安定型)	193,421円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	1,246,203円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	4,228,222円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	2,207,583円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	1,349,739円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	2,279,210円
たわらノーロード 国内リート	5,227,291,865円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,178,906,629円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,910,708,314円
たわらノーロード バランス(堅実型)	33,127,532円
たわらノーロード バランス(標準型)	627,397,754円
たわらノーロード バランス(積極型)	694,709,106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)	140,948,641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)	378,610,214円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	227,333,339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)	288,881,954円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,301,931円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	38,019,549円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,233,452円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,011,782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>	439,818,465円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	3,270,803円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	125,636,380円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	192,208,080円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	346,056,332円
投資のソムリエ	13,373,726,138円
投資のソムリエ<DC年金>	925,811,977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	835,802,652円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,803,911,929円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	30,653,676円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	15,347,586円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,704,697円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	139,458,280円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	224,059,883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)	40,458,648円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	15,738,616円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	10,226,054円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,947,882円
Jリートインデックスファンド(DC)	59,980,569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)	78,312,971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)	708,261,061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)	43,663,130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)	31,251,187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)	34,420,595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)	187,533,873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)	75,670,901円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-07(適格機関投資家限定)	124,733,821円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-08(適格機関投資家限定)	87,478,489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)	34,362,622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)	87,230,616円
マルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)2021-12(適格機関投資家限定)	125,377,020円
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)	53,295,408円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	3,508,954,808円 346,550,232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)	40,425,243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)	582,062,507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)	7,309,127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)	84,699,539円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	10,037,521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)	1,316,034,226円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,809,013,690円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	37,420,490,581円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,640,571,344円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	98,482,890円
計	87,353,406,924円
2. 受益権の総数	87,353,406,924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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、不動産投信指数先物取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、不動産投資信託証券の価格の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資証券	1,889,618,909	
合計	1,889,618,909	

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2022年11月11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	4,701,576,600	-		4,610,901,000	90,675,600
合計	4,701,576,600	-		4,610,901,000	90,675,600

(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。

(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11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4411円 (24,411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11月11日現在

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
投資証券	CREロジスティクスファンド 投資法人	7,287	1,499,664,600	
	GLP投資法人	60,731	9,504,401,500	
	NTT都市開発リート投資法人	18,087	2,633,467,200	
	Oneリート投資法人	3,282	817,218,000	
	SOSILA物流リート投資法人	8,796	1,243,754,400	
	いちごオフィスリート投資法人	15,417	1,348,987,500	
	いちごホテルリート投資法人	3,117	326,349,900	
	アクティブア・プロパティーズ 投資法人	9,934	4,346,125,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	18,813	6,462,265,500	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	8,202	1,209,795,000	
	イオンリート投資法人	20,828	3,372,053,200	
	インヴィンシブル投資法人	82,815	3,834,334,500	
	エスコンジャパンリート投資法人	3,825	444,465,000	
	オリックス不動産投資法人	37,490	7,141,845,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	12,890	1,469,460,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	10,948	3,755,164,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,495	2,900,075,500	
	ケネディクス商業リート投資法人	8,180	2,213,508,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	8,753	2,774,701,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	4,891	584,963,600	
サンケイリアルエステート投資法人	6,027	565,332,600		
ザイマックス・リート投資法人	3,052	371,733,600		

ジャパン・ホテル・リート投資法人	60,677	4,550,775,000	
ジャパンエクセレント投資法人	17,261	2,368,209,200	
ジャパンリアルエステイト投資法人	18,816	11,590,656,000	
スターアジア不動産投資法人	23,493	1,317,957,300	
スターツプロシード投資法人	3,261	775,139,700	
タカラレーベン不動産投資法人	8,241	834,813,300	
トーセイ・リート投資法人	4,174	565,159,600	
ヒューリックリート投資法人	17,604	3,054,294,000	
フロンティア不動産投資法人	6,981	3,658,044,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	4,639	893,935,300	
マリモ地方創生リート投資法人	2,350	321,950,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	42,357	6,611,927,700	
ラサールロジポート投資法人	23,034	3,802,913,400	
阪急阪神リート投資法人	8,499	1,309,695,900	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	7,433	3,761,098,000	
三菱地所物流リート投資法人	6,464	2,970,208,000	
産業ファンド投資法人	28,118	4,512,939,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,415	628,254,500	
森トラスト総合リート投資法人	13,447	1,992,845,400	
森ヒルズリート投資法人	22,126	3,571,136,400	
星野リゾート・リート投資法人	3,291	2,300,409,000	
積水ハウス・リート投資法人	57,180	4,608,708,000	
大江戸温泉リート投資法人	3,037	205,604,900	
大和ハウスリート投資法人	28,362	8,749,677,000	
大和証券オフィス投資法人	3,933	2,682,306,000	
大和証券リビング投資法人	26,073	3,084,435,900	
投資法人みらい	22,859	1,093,803,150	
東海道リート投資法人	2,281	277,597,700	
東急リアル・エステート投資法人	12,615	2,665,549,500	
日本アコモデーションファンド投資法人	6,497	4,086,613,000	
日本ビルファンド投資法人	21,950	14,443,100,000	
日本プライムリアルティ投資法人	12,868	5,076,426,000	
日本プロロジスリート投資法人	30,831	10,020,075,000	
日本リート投資法人	6,112	2,249,216,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	12,687	4,154,992,500	
日本都市ファンド投資法人	94,935	10,309,941,000	
福岡リート投資法人	9,731	1,669,839,600	
平和不動産リート投資法人	12,859	2,030,436,100	
野村不動産マスターファンド投資法人	60,845	10,349,734,500	
投資証券 合計	1,119,196	207,970,081,150	

合計		207,970,081,150	
----	--	-----------------	--

(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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	91,659,470
コール・ローン	131,379,214
投資信託受益証券	6,622,105,697
投資証券	61,509,025,010
未収入金	1,532,507
未収配当金	73,358,692
流動資産合計	68,429,060,590
資産合計	68,429,060,590
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,074,433
未払金	40,077,320
未払解約金	6,207,000
流動負債合計	47,358,753
負債合計	47,358,753
純資産の部	
元本等	
元本	39,946,447,436
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	28,435,254,401
元本等合計	68,381,701,837
純資産合計	68,381,701,837
負債純資産合計	68,429,060,590

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11月12日 至 2022年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	49,033,840,425円
同期中追加設定元本額	105,825,706,913円
同期中一部解約元本額	114,913,099,902円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M先進国 R E I Tインデックスファンド<為替ヘッジなし> (ファンドラップ)	75,892,592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)	32,526,684円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	3,178,961円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	20,611,085円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	70,921,474円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	36,365,657円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	22,226,109円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	37,254,409円
たわらノーロード 先進国リート	14,498,662,120円
たわらノーロード 先進国リート<ラップ向け>	1,774,874,722円
たわらノーロード 先進国リート<為替ヘッジあり>	292,660,057円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,760,018,526円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,687,212円

たわらノーロード バランス(標準型)	447,241,259円
たわらノーロード バランス(積極型)	915,991,632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)	202,243,692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)	217,486,563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)	370,204,154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)	20,309,202円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,619,003円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	14,260,284円
One DC 先進国リートインデックスファンド	1,483,680,658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>	508,628,309円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	42,883,778円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	180,444,921円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	277,205,835円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	510,611,336円
投資のソムリエ	7,972,053,914円
投資のソムリエ<DC年金>	551,356,685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	489,016,603円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,241,865,276円
ワールドアセットバランス(基本コース)	340,900,854円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	177,581,303円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	17,663,397円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	8,826,299円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	3,331,254円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	86,656,991円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	169,200,023円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	159,550,838円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	21,087,815円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	9,078,922円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,878,277円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	1,112,283円
DIAMパッシブ資産分散ファンド	259,405,069円
DIAM外国リートインデックスファンド<DC年金>	276,738,773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)	206,175,617円
AMOneマルチアセット・インカム戦略ファンド(シグナルヘッジ付き)(適格機関投資家限定)	5,711,696円
インカム重視マルチアセット運用ファンド(適格機関投資家限定)	1,380,735円

リスクコントロール世界8資産バランスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4,351,968円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	5,876,951円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	78,345,476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)	186,651,533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)	1,376,965,572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)	213,238,304円
計	39,946,447,436円
2. 受益権の総数	39,946,447,436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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
----------------------------	---

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
投資信託受益証券		253,000,609
投資証券		365,659,356
合計		618,659,965

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年11月11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	41,226,680	-	40,152,247		1,074,433
ユーロ	36,430,000	-	35,455,875		974,125
香港・ドル	2,932,380	-	2,887,852		44,528
合計	1,864,300	-	1,808,520		55,780
合計	41,226,680	-	40,152,247		1,074,433

(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11月11日現在
--	---------------

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7118円 (17,118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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT PTE LTD	96,300.000	56,817.000		
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	72,700.000	0.000		
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	309,900.000	164,247.000		
		MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	645,800.000	232,488.000		
		PRIME US REIT	238,000.000	111,860.000		
		アメリカ・ドル	小計	1,362,700.000	565,412.000 (80,215,000)	
	オーストラリア・ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	149,481.000	402,103.890		
		ARENA REIT	125,752.000	487,917.760		
		BWP TRUST	184,333.000	735,488.670		
		CENTURIA CAPITAL GROUP	269,403.000	457,985.100		
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	195,918.000	574,039.740		
		CENTURIA OFFICE REIT	170,806.000	263,041.240		
		CHARTER HALL GROUP	176,176.000	2,300,858.560		
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	244,528.000	1,044,134.560		
		CHARTER HALL RETAIL REIT	197,672.000	786,734.560		
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	122,555.000	406,882.600		
		CROMWELL PROPERTY GROUP	516,778.000	366,912.380		
		DEXUS	399,704.000	3,069,726.720		
		DEXUS INDUSTRIA REIT	78,918.000	217,813.680		
		GDI PROPERTY GROUP	210,436.000	162,035.720		
GOODMAN GROUP		636,039.000	10,958,951.970			
GPT GROUP	711,997.000	3,061,587.100				
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTRALIA	114,912.000	371,165.760				
HEALTHCO REIT	92,113.000	129,879.330				
HOME CONSORTIUM LTD	75,942.000	359,965.080				
HOME CO DAILY NEEDS REIT	593,199.000	744,464.740				
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	73,699.000	229,203.890				
INGENIA COMMUNITIES GROUP	132,240.000	515,736.000				
MIRVAC GROUP	1,466,840.000	3,095,032.400				

	NATIONAL STORAGE REIT	404,675.000	987,407.000	
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY FUND	140,343.000	103,152.100	
	RURAL FUNDS GROUP	141,590.000	346,895.500	
	SCENTRE GROUP	1,944,791.000	5,639,893.900	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	419,075.000	1,106,358.000	
	STOCKLAND	887,085.000	3,166,893.450	
	VICINITY CENTRES	1,438,828.000	2,812,908.740	
	WAYPOINT REIT LTD	263,507.000	727,279.320	
	オーストラリア・ドル 小計	12,579,335.000	45,632,449.460 (4,270,284,619)	
シンガポール・ ドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	201,395.000	245,701.900	
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	754,316.000	716,600.200	
	CAPITALAND CHINA TRUST	423,480.000	419,245.200	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,869,009.000	3,551,117.100	
	CAPLAND ASCENDAS REIT	1,247,860.000	3,244,436.000	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	307,200.000	365,568.000	
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	224,800.000	133,756.000	
	EC WORLD REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	112,400.000	49,456.000	
	ESR LOGOS REIT	2,141,040.000	749,364.000	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	393,900.000	238,309.500	
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	520,200.000	130,050.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	399,900.000	775,806.000	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	1,079,464.000	1,219,794.320	
	KEPPEL DC REIT	497,700.000	890,883.000	
	KEPPEL REIT	756,800.000	662,200.000	
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL REIT	673,000.000	457,640.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	742,320.000	1,618,257.600	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,199,520.000	1,811,275.200	
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL	860,400.000	1,350,828.000	
	QUE COMMERCIAL REIT	910,555.000	295,930.370	
	PARKWAY LIFE REIT	138,900.000	558,378.000	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	207,400.000	147,254.000	
	SPH REIT	394,200.000	339,012.000	
	STARHILL GLOBAL REIT	553,000.000	282,030.000	

		SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	840,390.000	1,109,314.800	
	シンガポール・ドル 小計		17,449,149.000	21,362,207.190 (2,190,694,347)	
	ユーロ	CROMWELL REIT EUR	133,740.000	211,309.200	
	ユーロ 小計		133,740.000	211,309.200 (30,515,162)	
	香港・ドル	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	542,000.000	2,785,880.000	
	香港・ドル 小計		542,000.000	2,785,880.000 (50,396,569)	
投資信託受益証券 合計			32,066,924	6,622,105,697 (6,622,105,697)	
投資証券	アメリカ・ドル	ACADIA REALTY TRUST	35,926.000	545,715.940	
		AGREE REALTY CORP	29,664.000	2,089,235.520	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	27,741.000	570,909.780	
		ALEXANDER'S INC.	801.000	191,334.870	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	55,538.000	8,529,526.040	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	4,698.000	86,819.040	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	19,859.000	574,123.690	
		AMERICAN HOMES 4 RENT	113,354.000	3,684,005.000	
		AMERICOLD REALTY TRUST	100,618.000	2,977,286.620	
		APARTMENT INCOME REIT CORP	57,270.000	2,189,432.100	
		APARTMENT INVT & MGMT CO-A	54,917.000	427,254.260	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	79,318.000	1,296,056.120	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	25,069.000	303,585.590	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,922.000	78,923.640	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	52,293.000	8,984,983.260	
		BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,188.000	27,074.520	
		BOSTON PROPERTIES INC	53,430.000	4,032,896.400	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	20,173.000	80,288.540	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	61,450.000	417,245.500	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	111,263.000	2,526,782.730	
		BROADSTONE NET LEASE INC	64,619.000	1,137,294.400	
		BRT APARTMENTS CORP	4,220.000	91,025.400	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	39,888.000	4,634,985.600	
		CARETRUST REIT INC	36,853.000	734,480.290	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES INC	9,033.000	261,324.690	

CENTERSPACE	5,510.000	360,354.000	
CHATHAM LODGING TRUST	19,111.000	246,149.680	
CITY OFFICE REIT INC	15,657.000	153,908.310	
CLIPPER REALTY INC	5,086.000	35,958.020	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	8,646.000	301,053.720	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	41,972.000	1,165,562.440	
COUSINS PROPERTIES INC	56,428.000	1,435,528.320	
CTO REALTY GROUTH INC	5,120.000	103,577.600	
CUBESMART	84,107.000	3,517,354.740	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	80,005.000	715,244.700	
DIGITAL REALTY TRUST INC	107,462.000	11,669,298.580	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	80,900.000	107,597.000	
DOUGLAS EMMETT INC	65,601.000	1,129,649.220	
EAST GROUP	16,170.000	2,645,735.400	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	34,578.000	557,743.140	
ELME COMMUNITIES	33,244.000	642,938.960	
EMPIRE STATE REALTY TRUST INC	47,956.000	364,945.160	
EPR PROPERTIES	28,010.000	1,121,800.500	
EQUINIX INC	34,037.000	22,055,976.000	
EQUITY COMMONWEALTH	41,536.000	1,103,196.160	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	65,510.000	4,313,178.400	
EQUITY RESIDENTIAL	126,615.000	8,099,561.550	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST INC	52,709.000	1,176,991.970	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	24,375.000	5,327,400.000	
EXTRA SPACE STORAGE INC	50,081.000	8,167,710.290	
FARMLAND PARTNERS INC	17,744.000	248,948.320	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	27,326.000	2,925,794.820	
FIRST INDUSTRIAL RT	49,037.000	2,478,329.980	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST INC	30,872.000	844,657.920	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	33,176.000	100,855.040	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	95,650.000	4,912,584.000	
GETTY REALTY CORP	15,326.000	506,064.520	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	14,534.000	273,529.880	
GLADSTONE LAND CORP	11,727.000	257,876.730	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	22,924.000	220,528.880	
GLOBAL NET LEASE INC	37,405.000	483,646.650	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	142,812.000	2,957,636.520	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	202,017.000	5,121,130.950	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	13,525.000	134,032.750	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	39,267.000	1,176,046.650	
HOST HOTELS & RESORTS INC	267,621.000	4,851,968.730	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	49,184.000	567,091.520	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	82,641.000	1,463,572.110	
INDUS REALTY TRUST INC	1,612.000	89,611.080	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES TRUST	26,881.000	119,351.640	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	10,445.000	1,200,548.300	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	25,638.000	669,408.180	
INVITATION HOMES INC	216,934.000	7,004,798.860	
IRON MOUNTAIN INC	108,800.000	5,719,616.000	
ISTAR INC	31,134.000	360,220.380	
JBG SMITH PROPERTIES	37,752.000	750,509.760	
KILROY REALTY CORP	39,130.000	1,708,415.800	
KIMCO REALTY	231,540.000	5,165,657.400	
KITE REALTY GROUP TRUST	81,547.000	1,772,831.780	
LIFE STORAGE INC	31,621.000	3,453,013.200	
LTC PROPERTIES INC	15,425.000	611,447.000	
LXP INDUSTRIAL TRUST	104,582.000	1,127,393.960	
MEDICAL PROPERTIES TRUST	222,308.000	2,685,480.640	
MID AMERICA	43,189.000	7,075,653.870	
NATIONAL HEALTH INVS INC	16,699.000	961,528.420	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	66,458.000	3,021,180.680	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES TRUST	31,798.000	1,303,400.020	
NETSTREIT CORP	18,304.000	344,298.240	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	8,208.000	390,044.160	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	17,765.000	277,666.950	
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	87,868.000	2,810,897.320	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,609.000	136,018.250	
ORION OFFICE REIT INC	21,073.000	206,515.400	
PARAMOUNT GROUP INC	60,451.000	406,230.720	
PARK HOTELS & RESORTS INC	83,950.000	1,035,943.000	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	49,811.000	784,025.140	
PHILLIPS EDISON & CO INC	43,499.000	1,378,483.310	
PHYSICIANS REALTY TRUST	84,372.000	1,249,549.320	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	47,250.000	505,102.500	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,446.000	277,659.900	
POSTAL REALTY TRUST INC	5,420.000	86,178.000	
PROLOGIS INC	344,939.000	40,820,081.260	
PUBLIC STORAGE	59,046.000	17,879,719.260	
REALTY INCOME CORP	230,851.000	15,090,729.870	
REGENCY CENTERS CORP	57,710.000	3,823,864.600	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	47,307.000	729,473.940	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	64,101.000	3,719,781.030	
RLJ LODGING TRUST	61,727.000	732,699.490	
RPT REALTY	31,140.000	337,246.200	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	20,507.000	1,834,556.220	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	86,169.000	1,125,367.140	
SAFEHOLD INC	6,511.000	212,388.820	
SAUL CENTERS INC	4,804.000	205,419.040	
SERVICE PROPERTIES TRUST	62,996.000	486,329.120	
SIMON PROPERTY GROUP INC	122,372.000	14,689,534.880	
SITE CENTERS CORP	69,723.000	916,160.220	
SL GREEN	24,047.000	975,586.790	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	50,674.000	2,035,067.840	
STAG INDUSTRIAL INC	66,578.000	2,251,667.960	
STORE CAPITAL CORP	99,609.000	3,159,597.480	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	38,921.000	323,822.720	
SUN COMMUNITIES INC	46,147.000	6,588,407.190	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	79,465.000	850,275.500	
TANGER FACTORY OUTLET	39,618.000	769,381.560	
TERRENO REALTY CORP	24,763.000	1,477,608.210	
THE MACERICH COMPANY	80,390.000	1,029,795.900	
THE NECESSITY RETAIL REIT INC	46,893.000	308,555.940	
UDR INC	114,366.000	4,653,552.540	
UMH PROPERTIES INC	18,532.000	338,950.280	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,699.000	235,137.960	
URBAN EDGE PROPERTIES	44,675.000	671,465.250	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES	11,191.000	210,614.620	

	VENTAS INC	149,586.000	6,710,427.960	
	VERIS RESIDENTIAL INC	30,360.000	459,954.000	
	VICI PROPERTIES INC	360,076.000	11,745,679.120	
	VORNADO REALTY TRUST	60,000.000	1,505,400.000	
	WELLTOWER INC	173,258.000	12,138,455.480	
	WHITESTONE REIT	16,382.000	154,154.620	
	WP CAREY INC	77,670.000	6,200,396.100	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	43,381.000	670,670.260	
	アメリカ・ドル 小計	8,216,022.000	375,271,954.920 (53,239,832,245)	
イギリス・ポ ンド	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LI	162,134.000	85,768.880	
	AEW UK REIT PLC	58,660.000	53,908.540	
	ASSURA PLC	1,111,014.000	651,054.200	
	BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	289,303.000	273,969.940	
	BIG YELLOW GROUP PLC	65,470.000	783,021.200	
	BRITISH LAND CO PLC	349,260.000	1,415,201.520	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	305,868.000	346,548.440	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	232,446.000	149,462.770	
	CUSTODIAN REIT PLC	149,817.000	134,985.110	
	DERWENT LONDON PLC	41,944.000	1,035,177.920	
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT CO PLC	74,836.000	48,643.400	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	221,510.000	201,131.080	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	96,753.000	537,462.910	
	HAMMERSON PLC	1,294,519.000	310,684.560	
	HOME REIT PLC	286,621.000	246,494.060	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	160,660.000	169,335.640	
	INTU PROPERTIES PLC	231,040.000	0.000	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	279,312.000	1,767,486.330	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	367,573.000	724,853.950	
	LXI REIT PLC	641,403.000	810,733.390	
	NEWRIVER REIT PLC	124,025.000	90,414.220	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	213,675.000	190,170.750	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	503,577.000	604,795.970	
	PRS REIT PLC/THE	206,206.000	175,893.710	
	REGIONAL REIT LTD	168,230.000	107,667.200	
	SAFESTORE HOLDINGS LTD	78,966.000	759,258.090	

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LTD	206,528.000	98,100.800	
	SEGRO PLC	452,866.000	3,884,684.540	
	SHAFTESBURY PLC	110,375.000	440,175.500	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	472,477.000	505,550.390	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING REIT PLC	153,569.000	104,426.920	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	697,471.000	1,058,063.500	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT LTD	316,742.000	210,633.430	
	UNITE GROUP PLC	148,925.000	1,437,870.870	
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	171,713.000	257,569.500	
	WAREHOUSE REIT PLC	156,027.000	190,352.940	
	WORKSPACE GROUP PLC	50,876.000	237,997.920	
イギリス・ボンド 小計		10,652,391.000	20,099,550.090 (3,326,877,531)	
イスラエル・シュケル	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	237,208.000	431,244.140	
	REIT 1 LTD	66,499.000	1,242,201.320	
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LTD	85,547.000	780,188.640	
イスラエル・シュケル 小計		389,254.000	2,453,634.100 (100,035,889)	
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REIT	24,008.000	624,208.000	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,633.000	176,454.510	
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,337.000	100,961.070	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	8,165.000	419,109.450	
	BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,285.000	136,958.000	
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,423.000	55,214.340	
	CANADIAN APT PPTYS REIT	31,697.000	1,377,551.620	
	CHOICE PROPERTIES REIT	60,510.000	850,165.500	
	CROMBIE REAL ESTATE INV	18,845.000	299,447.050	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,186.000	310,813.200	
	DREAM INDUSTRIAL REIT	44,860.000	536,525.600	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV TRUST	9,013.000	144,208.000	
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,876.000	55,773.120	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,195.000	689,344.250	

	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,076.000	926,470.720	
	H & R REAL ESTATE INVESTMENT	46,816.000	561,323.840	
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,643.000	16,854.090	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	25,307.000	315,325.220	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	20,565.000	347,137.200	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,096.000	117,715.840	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	6,458.000	104,102.960	
	NEXUS INDUSTRIAL REIT	12,304.000	123,409.120	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	42,192.000	477,191.520	
	PRIMARIS REIT	18,329.000	281,900.020	
	PRO REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,243.000	63,506.600	
	RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	55,723.000	1,172,969.150	
	SLATE GROCERY REIT	11,204.000	172,765.680	
	SLATE OFFICE REIT	17,818.000	82,319.160	
	SMARTCENTRES REIT	26,752.000	762,699.520	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	35,658.000	789,824.700	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REIT	14,758.000	90,171.380	
	カナダ・ドル 小計	692,975.000	12,182,420.430 (1,295,356,764)	
ニュージーランド・ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	329,282.000	383,613.530	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	398,171.000	808,287.130	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	568,732.000	491,953.180	
	PRECINCT PROPERTIES	485,406.000	587,341.260	
	STRIDE STAPLED GROUP	200,290.000	308,446.600	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	181,050.000	420,036.000	
	ニュージーランド・ドル 小計	2,162,931.000	2,999,677.700 (255,392,559)	
ユーロ	AEDIFICA	14,873.000	1,227,766.150	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,939.000	32,674.000	
	ALTAREA	1,836.000	244,555.200	
	CARE PROPERTY INVEST NV	10,525.000	176,609.500	
	CARMILA SA	20,795.000	292,377.700	
	COFINIMMO SA	11,221.000	1,023,355.200	
	COVIVIO	17,363.000	1,040,043.700	

	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	15,373.000	356,346.140	
	GECINA SA	20,215.000	1,962,876.500	
	HAMBORNER REIT AG	25,669.000	195,854.470	
	ICADE	12,266.000	491,621.280	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZIONE	19,492.000	61,887.100	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	110,515.000	644,302.450	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	8,821.000	194,062.000	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES REIT PLC	149,598.000	171,140.110	
	KLEPIERRE	72,636.000	1,622,688.240	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	22,349.000	89,507.740	
	MERCIALYS	28,373.000	266,138.740	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	124,572.000	1,144,816.680	
	MONTEA SCA	4,768.000	331,852.800	
	NSI NV	6,797.000	180,120.500	
	RETAIL ESTATES	4,131.000	254,056.500	
	UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	40,038.000	2,097,190.440	
	VASTNED RETAIL	6,847.000	145,841.100	
	WAREHOUSES DE PAUW	52,550.000	1,472,451.000	
	WERELDHAVE NV	15,800.000	207,928.000	
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,591.000	238,357.400	
	ユーロ 小計	828,953.000	16,166,420.640 (2,334,592,805)	
韓国・ウォン	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,294.000	52,222,270.000	
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	11,135.000	57,902,000.000	
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD	60,102.000	220,874,850.000	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,032.000	48,540,800.000	
	JR REIT XXVII	55,330.000	229,066,200.000	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	14,110.000	66,246,450.000	
	LOTTE REIT CO LTD	46,445.000	164,647,525.000	
	MIRAE ASSET MAPS ASIA PACIFIC REAL ESTATE 1 INVESTMENT	38,762.000	155,048,000.000	
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	10,401.000	31,879,065.000	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	23,249.000	163,905,450.000	
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	9,851.000	35,562,110.000	
	SK REITS CO LTD	29,445.000	134,121,975.000	
	韓国・ウォン 小計	326,156.000	1,360,016,695.000 (143,481,761)	

	香港・ドル	CHAMPION REIT	696,070.000	1,691,450.100	
		LINK REIT	790,720.000	40,287,184.000	
		PROSPERITY REIT	506,000.000	809,600.000	
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	346,000.000	937,660.000	
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	806,000.000	1,241,240.000	
	香港・ドル 小計		3,144,790.000	44,967,134.100 (813,455,456)	
投資証券 合計			26,413,472	61,509,025,010 (61,509,025,010)	
合計				68,131,130,707 (68,131,130,707)	

(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	0.12	-	78.26
	投資証券 140銘柄	-	77.86	
イギリス・ポンド	投資証券 37銘柄	-	4.87	4.88
イスラエル・シケル	投資証券 3銘柄	-	0.15	0.15
オーストラリア・ドル	投資信託受益証券 31銘柄	6.24	-	6.27
カナダ・ドル	投資証券 31銘柄	-	1.89	1.90
シンガポール・ドル	投資信託受益証券 25銘柄	3.20	-	3.22
ニュージーランド・ドル	投資証券 6銘柄	-	0.37	0.37
ユーロ	投資信託受益証券 1銘柄	0.04	-	3.47
	投資証券 27銘柄	-	3.41	
韓国・ウォン	投資証券 12銘柄	-	0.21	0.21
香港・ドル	投資信託受益証券 1銘柄	0.07	-	1.27
	投資証券 5銘柄	-	1.19	

(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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,436,206,779
コール・ローン	421,280,973
国債証券	120,041,032,301
未収利息	753,725,081
前払費用	449,389,883
流動資産合計	124,101,635,017
資産合計	124,101,635,017
負債の部	
流動負債	
未払金	492,192,428
未払解約金	275,000
流動負債合計	492,467,428
負債合計	492,467,428
純資産の部	
元本等	
元本	61,928,920,109
剰余金	
剰余金又は欠損金()	61,680,247,480
元本等合計	123,609,167,589
純資産合計	123,609,167,589
負債純資産合計	124,101,635,017

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	2022年11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	75,939,809,812円
同期中追加設定元本額	170,109,233,164円
同期中一部解約元本額	184,120,122,867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）	108,328,840円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,237,227,389円
たわらノーロード バランス（堅実型）	157,739,172円
たわらノーロード バランス（標準型）	445,536,157円
たわらノーロード バランス（積極型）	187,896,874円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	850,832円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	3,678,236円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	39,943,761円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	2,541,566円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	4,807,834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）	382,163,143円
D I A M D C 8資産バランスファンド（新興国30）	695,718,655円
投資のソムリエ	17,541,514,873円
クルーズコントロール	374,353,050円
投資のソムリエ<DC年金>	1,212,317,584円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	287,567,742円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,313,338,944円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,980,040,851円
ワールドアセットバランス（基本コース）	436,492,144円
ワールドアセットバランス（リスク抑制コース）	208,997,439円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	55,460,020円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	27,721,097円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	8,892,043円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	179,098,017円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	488,663,806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)	66,210,280円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	28,500,388円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	18,453,047円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,492,073円
エマージング債券リスク抑制型(適格機関投資家限定)	23,467,137,437円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	453,543,499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)	1,230,195,209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)	330,285,906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)	9,574,198円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	15,761,769円
エマージング債券パッシブファンドVA(適格機関投資家専用)	7,554,901円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	156,160,482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)	70,459,475円
DIAMグローバル・リスクファクター・パリティ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	3,169,395,826円
計	61,928,920,109円
2. 受益権の総数	61,928,920,109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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク)、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
国債証券	4,924,874,821	
合計	4,924,874,821	

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

2022年11月11日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9960円 (19,960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11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	ABU DHABI GOVT INT'L 0.75 09/02/23	3,000,000.000	2,904,210.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.625 06/02/28	5,000,000.000	4,262,500.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.7 03/02/31	7,000,000.000	5,630,940.000	
		ABU DHABI GOVT INT'L 1.875 09/15/31	7,000,000.000	5,635,630.000	

ABU DHABI GOVT INT'L 2.125 09/30/24	7,000,000.000	6,698,195.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 04/16/25	9,000,000.000	8,534,700.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.5 09/30/29	8,000,000.000	7,089,672.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 2.7 09/02/70	2,000,000.000	1,167,500.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 04/16/30	8,000,000.000	7,308,880.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 09/30/49	10,000,000.000	6,897,300.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.125 10/11/27	5,000,000.000	4,732,260.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 3.875 04/16/50	9,000,000.000	7,138,098.000	
ABU DHABI GOVT INT'L 4.125 10/11/47	2,000,000.000	1,596,800.000	
BRAZIL 2.875 06/06/25	9,000,000.000	8,436,091.140	
BRAZIL 3.75 09/12/31	6,000,000.000	4,958,219.700	
BRAZIL 3.875 06/12/30	13,000,000.000	11,005,063.160	
BRAZIL 4.5 05/30/29	8,000,000.000	7,152,800.000	
BRAZIL 4.625 01/13/28	6,000,000.000	5,645,062.020	
BRAZIL 4.75 01/14/50	15,000,000.000	10,159,557.600	
BRAZIL 5.625 01/07/41	2,100,000.000	1,713,864.990	
BRAZIL 6.0 04/07/26	4,800,000.000	4,929,581.040	
CHINA GOVT INTL BOND 1.2 10/21/30	2,000,000.000	1,615,658.740	
CHINA GOVT INTL BOND 1.25 10/26/26	4,000,000.000	3,602,156.440	
COLOMBIA 3.0 01/30/30	7,000,000.000	5,187,555.940	
COLOMBIA 3.125 04/15/31	11,000,000.000	7,919,279.830	
COLOMBIA 3.25 04/22/32	9,000,000.000	6,325,203.150	
COLOMBIA 4.125 05/15/51	5,000,000.000	2,811,110.050	
COLOMBIA 4.5 01/28/26	5,000,000.000	4,588,248.100	
COLOMBIA 4.5 03/15/29	8,000,000.000	6,704,823.520	
COLOMBIA 5.2 05/15/49	11,000,000.000	6,721,000.000	
COLOMBIA 5.625 02/26/44	2,000,000.000	1,366,717.100	
DOMINICAN REPUBLIC 5.5 02/22/29	20,000,000.000	18,275,207.400	
DOMINICAN REPUBLIC 5.875 01/30/60	19,000,000.000	13,658,460.080	
DOMINICAN REPUBLIC 6.0 02/22/33	23,200,000.000	20,422,789.940	
HUNGARY 2.125 09/22/31	14,000,000.000	10,282,692.000	
HUNGARY 3.125 09/21/51	11,000,000.000	6,294,222.000	
HUNGARY 5.25 06/16/29	8,000,000.000	7,554,391.520	
HUNGARY 5.375 03/25/24	4,380,000.000	4,371,261.900	
HUNGARY 7.625 03/29/41	2,400,000.000	2,497,852.800	

INDONESIA 1.85 03/12/31	3,200,000.000	2,455,999.900	
INDONESIA 2.85 02/14/30	2,000,000.000	1,702,288.400	
INDONESIA 3.05 03/12/51	5,000,000.000	3,218,250.000	
INDONESIA 3.4 09/18/29	2,200,000.000	1,942,300.690	
INDONESIA 3.5 01/11/28	4,200,000.000	3,857,961.780	
INDONESIA 3.85 10/15/30	5,400,000.000	4,800,415.150	
INDONESIA 4.1 04/24/28	3,000,000.000	2,843,243.610	
INDONESIA 4.125 01/15/25	3,200,000.000	3,132,852.380	
INDONESIA 4.2 10/15/50	7,000,000.000	5,285,001.120	
INDONESIA 4.35 01/08/27	3,600,000.000	3,479,768.960	
INDONESIA 4.35 01/11/48	6,600,000.000	5,164,500.000	
INDONESIA 4.75 01/08/26	2,000,000.000	1,964,824.400	
INDONESIA 5.25 01/17/42	2,500,000.000	2,270,784.750	
INDONESIA 7.75 01/17/38	3,500,000.000	3,867,500.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 5.625 01/17/28	7,000,000.000	6,731,900.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.0 08/01/29	7,000,000.000	6,810,398.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.25 01/25/31	9,000,000.000	8,814,600.000	
OMAN GOV INTERNTL BOND 6.75 01/17/48	6,000,000.000	5,095,200.000	
PANAMA 2.252 09/29/32	14,000,000.000	10,299,996.840	
PANAMA 3.16 01/23/30	8,000,000.000	6,626,400.000	
PANAMA 3.87 07/23/60	11,000,000.000	6,919,281.270	
PANAMA 4.5 01/19/63	5,000,000.000	3,471,953.750	
PANAMA 4.5 04/01/56	11,000,000.000	7,812,552.880	
PANAMA 4.5 04/16/50	10,300,000.000	7,516,915.070	
PANAMA 7.125 01/29/26	1,000,000.000	1,063,768.250	
PERU 2.392 01/23/26	2,000,000.000	1,837,780.160	
PERU 2.78 12/01/60	7,000,000.000	4,038,476.400	
PERU 2.783 01/23/31	16,000,000.000	13,121,365.440	
PERU 3.0 01/15/34	14,000,000.000	10,985,701.440	
PERU 3.55 03/10/51	8,000,000.000	5,613,792.080	
PHILIPPINES 1.648 06/10/31	3,600,000.000	2,681,981.850	
PHILIPPINES 2.457 05/05/30	3,800,000.000	3,125,481.830	
PHILIPPINES 2.65 12/10/45	6,000,000.000	3,598,550.100	
PHILIPPINES 3.0 02/01/28	10,000,000.000	9,040,654.800	
PHILIPPINES 3.2 07/06/46	7,000,000.000	4,574,554.390	
PHILIPPINES 3.7 02/02/42	2,000,000.000	1,484,527.280	
PHILIPPINES 3.75 01/14/29	7,200,000.000	6,634,001.730	
REPUBLIC OF CHILE 2.45 01/31/31	6,200,000.000	5,179,291.210	
REPUBLIC OF CHILE 2.55 01/27/32	7,200,000.000	5,920,703.640	

REPUBLIC OF CHILE 2.55 07/27/33	8,000,000.000	6,289,878.560	
REPUBLIC OF CHILE 2.75 01/31/27	9,200,000.000	8,477,211.380	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 01/22/61	5,000,000.000	2,994,984.800	
REPUBLIC OF CHILE 3.1 05/07/41	10,000,000.000	7,011,113.500	
REPUBLIC OF CHILE 3.24 02/06/28	6,600,000.000	6,110,306.660	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/25/50	6,000,000.000	4,210,726.320	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 01/31/34	7,200,000.000	6,113,575.220	
REPUBLIC OF CHILE 3.5 04/15/53	4,000,000.000	2,754,927.880	
REPUBLIC OF CHILE 4.34 03/07/42	7,000,000.000	5,732,689.690	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.375 01/23/31	14,000,000.000	13,702,324.440	
REPUBLICA ORIENT URUGUAY 4.975 04/20/55	13,000,000.000	11,841,233.430	
ROMANIA 3.0 02/14/31	5,000,000.000	3,880,220.000	
ROMANIA 4.0 02/14/51	10,000,000.000	6,184,260.000	
ROMANIA 5.125 06/15/48	4,600,000.000	3,382,177.600	
ROMANIA 6.125 01/22/44	6,600,000.000	5,549,022.600	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.25 02/02/33	6,000,000.000	4,721,400.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.9 10/22/25	9,000,000.000	8,474,400.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.25 10/22/30	13,200,000.000	11,790,688.800	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.45 02/02/61	4,000,000.000	2,655,800.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.625 03/04/28	6,000,000.000	5,638,200.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 3.75 01/21/55	4,400,000.000	3,182,656.400	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.0 04/17/25	9,000,000.000	8,779,500.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.375 04/16/29	12,000,000.000	11,619,144.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/17/30	12,000,000.000	11,682,036.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.5 04/22/60	5,000,000.000	4,083,325.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 4.625 10/04/47	5,000,000.000	4,121,135.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.0 04/17/49	9,000,000.000	7,816,095.000	

SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.25 01/16/50	7,000,000.000	6,354,271.000	
SAUDI INTERNATIONAL BOND 5.5 10/25/32	3,000,000.000	3,086,340.000	
SOUTH AFRICA 4.85 09/30/29	12,000,000.000	10,590,840.000	
SOUTH AFRICA 4.875 04/14/26	2,400,000.000	2,320,934.400	
SOUTH AFRICA 5.75 09/30/49	17,000,000.000	12,072,550.000	
SOUTH AFRICA 5.875 06/22/30	4,000,000.000	3,703,020.000	
SOUTH AFRICA 7.3 04/20/52	10,000,000.000	8,298,000.000	
STATE OF QATAR 3.375 03/14/24	6,000,000.000	5,872,800.000	
STATE OF QATAR 3.4 04/16/25	7,000,000.000	6,573,350.000	
STATE OF QATAR 3.75 04/16/30	11,000,000.000	10,374,100.000	
STATE OF QATAR 4.0 03/14/29	10,000,000.000	9,636,500.000	
STATE OF QATAR 4.4 04/16/50	13,000,000.000	10,851,100.000	
STATE OF QATAR 4.5 04/23/28	11,000,000.000	10,790,450.000	
STATE OF QATAR 4.817 03/14/49	15,000,000.000	13,749,300.000	
STATE OF QATAR 5.103 04/23/48	16,000,000.000	14,944,000.000	
UAE INT'L GOVT BOND 3.25 10/19/61	6,000,000.000	3,904,800.000	
UAE INT'L GOVT BOND 4.05 07/07/32	5,000,000.000	4,742,480.000	
UNITED MEXICAN STATES 2.659 05/24/31	9,000,000.000	7,269,699.510	
UNITED MEXICAN STATES 3.25 04/16/30	6,000,000.000	5,248,035.720	
UNITED MEXICAN STATES 3.5 02/12/34	9,000,000.000	7,197,353.640	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 01/11/28	5,200,000.000	4,868,131.730	
UNITED MEXICAN STATES 3.75 04/19/71	7,000,000.000	4,319,203.630	
UNITED MEXICAN STATES 3.771 05/24/61	6,000,000.000	3,751,483.800	
UNITED MEXICAN STATES 3.9 04/27/25	2,600,000.000	2,573,356.470	
UNITED MEXICAN STATES 4.15 03/28/27	3,400,000.000	3,313,159.540	

	UNITED MEXICAN STATES 4.28 08/14/41	11,000,000.000	8,405,131.460	
	UNITED MEXICAN STATES 4.4 02/12/52	5,000,000.000	3,631,065.900	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 01/31/50	4,000,000.000	3,016,476.160	
	UNITED MEXICAN STATES 4.5 04/22/29	7,000,000.000	6,706,853.440	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 01/23/46	2,000,000.000	1,532,127.220	
	UNITED MEXICAN STATES 4.6 02/10/48	1,400,000.000	1,064,332.900	
	UNITED MEXICAN STATES 4.75 04/27/32	8,000,000.000	7,515,511.040	
	UNITED MEXICAN STATES 4.875 05/19/33	6,000,000.000	5,468,582.760	
	UNITED MEXICAN STATES 5.0 04/27/51	6,000,000.000	4,808,564.820	
	アメリカ・ドル 小計	1,019,380,000.000 (144,619,440,600)	846,134,012.130 (120,041,032,301)	
国債証券 合計		144,619,440,600 (144,619,440,600)	120,041,032,301 (120,041,032,301)	
合計			120,041,032,301 (120,041,032,301)	

(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 139銘柄	97.11	100.00

(注)「組入時価比率」は、純資産に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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11月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,348,636,947
コール・ローン	146,785,686
株式	80,795,423,595
投資信託受益証券	565,060,142
投資証券	88,532,145
派生商品評価勘定	404,696,615
未収配当金	66,096,627
差入委託証拠金	2,622,996,846
流動資産合計	93,038,228,603
資産合計	93,038,228,603
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	338,255,523
未払金	558,060
未払解約金	5,399,000
流動負債合計	344,212,583
負債合計	344,212,583
純資産の部	
元本等	
元本	69,564,245,495
剰余金	
剰余金又は欠損金()	23,129,770,525
元本等合計	92,694,016,020
純資産合計	92,694,016,020
負債純資産合計	93,038,228,603

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11月12日 至 2022年11月11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11月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	53,596,041,865円
同期中追加設定元本額	63,441,961,522円
同期中一部解約元本額	47,473,757,892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 >	8,684,963,849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)	224,254,448円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	2,496,419円

MITO ラップ型ファンド(中立型)	16,164,599円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	54,714,421円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	28,595,372円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	17,465,258円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,315,289円
たわらノーロード 新興国株式	10,435,593,619円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,782,381,647円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,393,214,590円
たわらノーロード バランス(堅実型)	28,729,374円
たわらノーロード バランス(標準型)	106,264,239円
たわらノーロード バランス(積極型)	187,759,288円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	93,091円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	104,554,110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)	263,389,860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)	187,208,030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)	321,367,155円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	694,796円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	17,654,491円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,358,977円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,437,219円
たわらノーロード 全世界株式	273,982,208円
One DC 新興国株式インデックスファンド	594,212,779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)	364,790,461円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	582,694,822円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,058,516,282円
投資のソムリエ	24,943,146,668円
クルーズコントロール	557,217,681円
投資のソムリエ<DC年金>	1,726,020,782円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	437,592,748円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	1,560,519,847円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	7,107,225,552円
ワールドアセットバランス(基本コース)	615,131,636円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	268,059,425円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	57,191,134円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	28,462,291円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	10,582,288円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	235,953,604円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	343,511,203円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	325,527,880円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	94,209,792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)	11,109,242円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	642,686,014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)	13,552,163円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	18,699,845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)	243,297,708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)	109,778,740円
計	69,564,245,495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11月12日 至 2022年11月11日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、証券投資信託であり、信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「附属明細表」に記載しております。これらは、市場リスク（価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク）、信用リスク、及び流動性リスクを有しております。 また、当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、株価指数先物取引及び為替予約取引であります。当該デリバティブ取引は、信託財産が運用対象とする資産の価格変動リスクの低減及び信託財産に属する資産の効率的な運用に資する事を目的とし行っており、株価及び為替相場の変動によるリスクを有しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用担当部署から独立したコンプライアンス・リスク管理担当部署が、運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用担当部署へ対応の指示等を行うことにより、適切な管理を行います。運用評価委員会等はこれらの運用リスク管理状況の報告を受け、総合的な見地から運用状況全般の管理を行います。

2. 金融商品の時価等に関する事項

項目	2022年11月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	2022年11月11日現在	
	当期の 損益に含まれた 評価差額(円)	
株式	11,425,660,622	
投資信託受益証券	25,050,726	
投資証券	3,088,700	
合計	11,447,622,648	

(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11月11日まで)に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2022年11月11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	633,472	-	589,820	43,652	
ブラジル・リアル	633,472	-	589,820	43,652	
買建	41,169,652	-	39,896,521	1,273,131	
アメリカ・ドル	41,169,652	-	39,896,521	1,273,131	
合計	41,803,124	-	40,486,341	1,229,479	

(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11月11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	11,163,581,474	-	11,231,252,045	67,670,571	
合計	11,163,581,474	-	11,231,252,045	67,670,571	

(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11月11日現在	
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.3325円 (13,325円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

2022年11月11日現在

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル	TRIP.COM GROUP LTD ADR	53,901	27.500	1,482,277.500	
	CIA DE MINAS BUENAVENTURA SA ADR	19,333	7.800	150,797.400	
	SURGUTNEFTEGAZ SP ADR PREF	24,210	0.000	0.000	
	CREDICORP LTD	7,120	154.980	1,103,457.600	
	MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT STOCK COMPANY ADR	42,311	0.000	0.000	
	SOUTHERN COPPER CORP	8,443	56.220	474,665.460	
	GAZPROM PJSC	966,942	0.000	0.000	
	LUKOIL PJSC	33,845	0.000	0.000	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK SP GDR	265,492	1.290	342,484.680	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL CO	90,200	1.527	137,735.400	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRADE	86,488	0.780	67,460.640	
	SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	40,940	3.124	127,896.560	
	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 PJSC	107,951	0.000	0.000	
SEVERSTAL GDR	18,608	0.000	0.000		
TATNEFT ADR	19,509	0.000	0.000		

	VTB BANK PJSC	304,000,000	0.000	0.000	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	43,473	8.160	354,739.680	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	46,195	4.990	230,513.050	
	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	33.590	643,550.810	
	JOYY INC-ADR	4,368	28.000	122,304.000	
	DAQO NEW ENERGY CORP ADR	5,996	55.670	333,797.320	
	ZAI LAB LTD ADR	8,902	30.390	270,531.780	
	TCS GROUP HOLDING PLC GDR	9,961	0.000	0.000	
	360 DIGITECH INC ADR	9,625	13.600	130,900.000	
	NIO INC ADR	134,586	10.340	1,391,619.240	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP ADR	72,505	3.870	280,594.350	
	AUTOHOME INC ADR	7,801	29.230	228,023.230	
	WEIBO CORP ADR	6,293	13.010	81,871.930	
	KANZHUN LTD ADR	18,254	13.080	238,762.320	
	RLX TECHNOLOGY INC ADR	30,011	1.440	43,215.840	
	KE HOLDINGS INC ADR	65,788	11.340	746,035.920	
	LEGEND BIOTECH CORP ADR	5,058	52.000	263,016.000	
	LI AUTO INC ADR	53,865	17.410	937,789.650	
	XPENG INC ADR	41,917	7.040	295,095.680	
	OZON HOLDINGS PLC ADR	4,537	0.000	0.000	
	LUFAX HOLDING LTD ADR	60,438	1.660	100,327.080	
	PINDUODUO INC ADR	49,642	64.050	3,179,570.100	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	41,390	51.000	2,110,890.000	
	IQIYI INC ADR	27,254	2.310	62,956.740	
	POLYUS PJSC GDR	6,787	0.000	0.000	
	HUTCHMED CHINA LTD ADR	9,743	9.520	92,753.360	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC ADR	41,642	19.460	810,353.320	
	BEIGENE LTD ADR	4,717	188.800	890,569.600	
アメリカ・ドル	小計	307,785,480		17,781,841.140 (2,522,709,803)	
アラブ首長国連 邦・ディルハム	ABU DHABI ISLAMIC BANK PJSC	149,810	9.520	1,426,191.200	
	DUBAI ISLAMIC BANK PJSC	289,285	5.830	1,686,531.550	
	EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC	340,747	25.200	8,586,824.400	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC	275,693	9.660	2,663,194.380	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	429,052	18.380	7,885,975.760	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	392,432	6.270	2,460,548.640	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	376,332	4.590	1,727,363.880	

	EMIRATES NBD BANK PJSC	187,144	13.150	2,460,943.600	
	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC	307,502	4.470	1,374,533.940	
	アラブ首長国連邦・ディルハム 小計	2,747,997		30,272,107.350 (1,171,227,833)	
インド・ルピー	RELIANCE INDUSTRIES LTD	297,652	2,572.500	765,709,770.000	
	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	88,686	305.500	27,093,573.000	
	ASIAN PAINTS LTD	37,513	3,045.150	114,232,711.950	
	EICHER MOTORS LTD	13,548	3,700.850	50,139,115.800	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	25,957	1,704.550	44,245,004.350	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	85,411	1,298.200	110,880,560.200	
	SHREE CEMENT LTD	1,110	22,399.550	24,863,500.500	
	ICICI BANK LTD	501,813	910.700	457,001,099.100	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD	68,931	205.800	14,185,999.800	
	STATE BANK OF INDIA LTD	172,899	605.750	104,733,569.250	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	28,293	803.300	22,727,766.900	
	TATA STEEL LTD	726,289	104.700	76,042,458.300	
	TATA MOTORS LTD	162,216	412.200	66,865,435.200	
	JSW STEEL LTD	71,233	701.050	49,937,894.650	
	TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	54,602	768.700	41,972,557.400	
	TATA POWER CO LTD	141,916	229.200	32,527,147.200	
	BRITANNIA INDUSTRIES LTD	10,830	4,134.650	44,778,259.500	
	NESTLE INDIA LTD	3,296	20,175.300	66,497,788.800	
	GAIL INDIA LTD	215,317	88.200	18,990,959.400	
	KOTAK MAHINDRA BANK LTD	54,544	1,912.150	104,296,309.600	
	VEDANTA LTD	74,877	307.150	22,998,470.550	
	AXIS BANK LTD	222,656	843.700	187,854,867.200	
	TITAN COMPANY LTD	34,606	2,641.000	91,394,446.000	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	255,742	139.850	35,765,518.700	
	COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD	11,609	1,597.400	18,544,216.600	
	BHARAT ELECTRONICS LTD	362,967	106.700	38,728,578.900	
	LUPIN LTD	19,147	719.350	13,773,394.450	
	MPHASIS LTD	8,886	1,928.150	17,133,540.900	
	ACC LTD	6,327	2,392.250	15,135,765.750	
	BAJAJ FINANCE LTD	26,621	6,975.100	185,684,137.100	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP	168,458	2,504.100	421,835,677.800	
	INFOSYS LTD	329,086	1,501.950	494,270,717.700	
	WIPRO LTD	134,766	388.900	52,410,497.400	
	TATA ELXSI LTD	3,406	6,925.700	23,588,934.200	
	MRF LTD	161	87,468.650	14,082,452.650	
	INDIAN OIL CORP LTD	263,140	69.600	18,314,544.000	
	HINDUSTAN UNILEVER LTD	80,280	2,513.600	201,791,808.000	

TRENT LTD	18,269	1,470.900	26,871,872.100	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD	10,027	4,285.450	42,970,207.150	
HCL TECHNOLOGIES LTD	106,697	1,052.450	112,293,257.650	
DABUR INDIA LTD	61,644	553.900	34,144,611.600	
HERO MOTOCORP LTD	11,148	2,712.500	30,238,950.000	
SRF LTD	14,620	2,338.450	34,188,139.000	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	6,428	1,881.050	12,091,389.400	
DR REDDYS LABORATORIES LTD	11,683	4,549.450	53,151,224.350	
BHARTI AIRTEL LTD	214,924	825.750	177,473,493.000	
UNITED SPIRITS LTD	26,462	879.300	23,268,036.600	
SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	93,758	1,010.650	94,756,522.700	
DIVI'S LABORATORIES LTD	13,232	3,286.750	43,490,276.000	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11,841	9,097.250	107,720,537.250	
AUROBINDO PHARMA LTD	23,755	477.800	11,350,139.000	
HAVELLS INDIA LTD	24,994	1,226.750	30,661,389.500	
INDRAPRASTHA GAS LTD	30,576	419.450	12,825,103.200	
JINDAL STEEL & POWER LTD	35,331	474.850	16,776,925.350	
BIOCON LTD	37,897	275.900	10,455,782.300	
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERNAT	210,454	70.450	14,826,484.300	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD	19,175	1,245.150	23,875,751.250	
PETRONET LNG LTD	65,873	212.600	14,004,599.800	
CIPLA LTD/INDIA	48,137	1,122.300	54,024,155.100	
LARSEN & TOUBRO LTD	67,047	1,977.650	132,595,499.550	
ULTRATECH CEMENT LTD	9,888	6,801.300	67,251,254.400	
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	89,025	3,205.650	285,382,991.250	
ADANI ENTERPRISES LTD	27,829	3,992.250	111,100,325.250	
NTPC LTD	381,139	172.100	65,594,021.900	
YES BANK LTD	955,944	16.500	15,773,076.000	
AMBUJA CEMENTS LTD	59,555	558.150	33,240,623.250	
BHARAT FORGE LTD	26,609	880.400	23,426,563.600	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	133,783	415.100	55,533,323.300	
ITC LTD	288,979	356.000	102,876,524.000	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	15,019	2,656.350	39,895,720.650	
UNITED PHOSPHORUS LTD	48,286	756.100	36,509,044.600	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	9,851	1,664.650	16,398,467.150	
SIEMENS INDIA LTD	7,173	2,918.800	20,936,552.400	
INFO EDGE INDIA LTD	7,181	3,815.150	27,396,592.150	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41,356	820.200	33,920,191.200	
TECH MAHINDRA LTD	57,779	1,021.100	58,998,136.900	
MINDTREE LTD	5,472	3,479.800	19,041,465.600	

MARICO LTD	52,342	504.050	26,382,985.100	
PAGE INDUSTRIES LTD	613	48,666.000	29,832,258.000	
DLF LTD	60,549	391.150	23,683,741.350	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	308,608	214.900	66,319,859.200	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	51,713	893.450	46,202,979.850	
BAJAJ FINSERV LTD	37,350	1,700.350	63,508,072.500	
BAJAJ AUTO LTD	6,864	3,724.600	25,565,654.400	
JUBILANT FOODWORKS LTD	40,548	554.300	22,475,756.400	
ADANI POWER LTD	77,437	371.400	28,760,101.800	
MUTHOOT FINANCE LTD	11,565	1,105.450	12,784,529.250	
COAL INDIA LTD	153,824	253.600	39,009,766.400	
INDUS TOWERS LTD	64,346	186.450	11,997,311.700	
PI INDUSTRIES LTD	7,535	3,494.500	26,331,057.500	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	5,306	4,862.500	25,800,425.000	
ADANI GREEN ENERGY LTD	31,246	2,176.000	67,991,296.000	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	94,595	528.250	49,969,808.750	
AU SMALL FINANCE BANK LTD	15,799	628.400	9,928,091.600	
BANDHAN BANK LTD	54,907	222.050	12,192,099.350	
ADANI TOTAL GAS LTD	26,973	3,707.100	99,991,608.300	
GODREJ PROPERTIES LTD	12,688	1,235.350	15,674,120.800	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND FINANCE CO LTD	40,943	722.100	29,564,940.300	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES LTD	23,890	806.600	19,269,674.000	
INDIAN RAILWAY CATERING & TOURISM CORP LTD	21,490	744.450	15,998,230.500	
ZOMATO LTD	223,089	63.950	14,266,541.550	
BERGER PAINTS INDIA LTD	21,517	583.150	12,547,638.550	
ADANI TRANSMISSIONS LTD	27,334	3,295.150	90,069,630.100	
AVENUE SUPERMARTS LTD	15,958	4,138.850	66,047,768.300	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD	24,802	1,134.850	28,146,549.700	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	36,667	489.100	17,933,829.700	
INTERGLOBE AVIATION LTD	9,662	1,710.400	16,525,884.800	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	44,309	1,238.350	54,870,050.150	
インド・ルピー 小計	9,698,100		7,288,000,529.450 (12,899,760,937)	
インドネシア・ルピア				
ANEKA TAMBANG TBK PT	902,200	2,000.000	1,804,400,000.000	
BARITO PACIFIC TBK PT	2,875,400	785.000	2,257,189,000.000	
UNITED TRACTORS TBK PT	169,701	29,400.000	4,989,209,400.000	

	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK PT	391,300	6,475.000	2,533,667,500.000	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	650,500	4,560.000	2,966,280,000.000	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,992,500	6,525.000	13,001,062,500.000	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	4,868,100	4,170.000	20,299,977,000.000	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA TBK PT	752,600	5,650.000	4,252,190,000.000	
	GUDANG GARAM TBK PT	32,400	22,025.000	713,610,000.000	
	INDAH KIAT PULP AND PAPER CORP TBK PT	292,400	10,000.000	2,924,000,000.000	
	BANK MANDIRI	1,831,800	10,100.000	18,501,180,000.000	
	BANK RAKYAT INDONESIA	6,657,300	4,530.000	30,157,569,000.000	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT	756,200	9,275.000	7,013,755,000.000	
	KALBE FARMA TBK PT	1,875,300	1,980.000	3,713,094,000.000	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	273,600	7,975.000	2,181,960,000.000	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,390,200	8,800.000	47,433,760,000.000	
	VALE INDONESIA TBK PT	168,900	7,100.000	1,199,190,000.000	
	ADARO ENERGY INDONESIA TBK PT	1,455,300	3,480.000	5,064,444,000.000	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	259,300	9,725.000	2,521,692,500.000	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE TBK PT	460,700	2,330.000	1,073,431,000.000	
	SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK PT	1,697,900	2,600.000	4,414,540,000.000	
	SARANA MENARA NUSANTARA TBK PT	2,218,600	1,130.000	2,507,018,000.000	
	ADARO MINERALS INDONESIA TBK PT	847,400	1,810.000	1,533,794,000.000	
	BANK JAGO TBK PT	428,300	4,550.000	1,948,765,000.000	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	1,232,482	4,100.000	5,053,176,200.000	
	インドネシア・ルピア 小計	38,480,383		190,058,954,100.000 (1,729,536,482)	
オフショア・人 民元	EVE ENERGY CO LTD	13,032	91.350	1,190,473.200	
	SIEYUAN ELECTRIC CO LTD	5,800	36.380	211,004.000	
	LUXI CHEMICAL GROUP CO LTD	22,700	12.190	276,713.000	
	WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHAN CO LTD	5,940	12.190	72,408.600	
	CHINA ZHENHUA GROUP SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	3,000	119.860	359,580.000	

DO-FLUORIDE NEW MATERIALS CO LTD	5,100	33.960	173,196.000	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL HOLDINGS GROUP CO LTD	48,300	5.980	288,834.000	
BEIJING SHUNXIN AGRICULTURE CO LTD	3,000	26.350	79,050.000	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,000	8.640	103,680.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	12,080	85.650	1,034,652.000	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD	5,200	9.970	51,844.000	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO LTD	17,500	17.730	310,275.000	
UNISPLENDOR CORP LTD	21,240	17.250	366,390.000	
JIANGXI SPECIAL ELECTRIC MOTOR CO LTD	10,500	22.250	233,625.000	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTRY JSC LTD	19,100	10.220	195,202.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	1,200	91.320	109,584.000	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD	16,200	24.770	401,274.000	
HUAGONG TECH CO LTD	7,500	17.500	131,250.000	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC	2,100	170.710	358,491.000	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED ARROW CO LTD	8,900	21.340	189,926.000	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO LTD	5,300	24.830	131,599.000	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION MANUFACTURING CO LTD	13,900	26.740	371,686.000	
YINTAI GOLD CO LTD	23,900	14.860	355,154.000	
TANGSHAN JIDONG CEMENT CO LTD	31,500	8.060	253,890.000	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD	61,800	4.100	253,380.000	
GEM CO LTD	29,100	7.920	230,472.000	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD	2,600	118.180	307,268.000	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD	6,900	41.290	284,901.000	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG GROUP CO LTD	18,600	3.930	73,098.000	
INNER MONGOLIA DIAN TOU ENERGY CORP LTD	16,900	12.790	216,151.000	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD	9,800	122.100	1,196,580.000	

WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD	11,995	11.780	141,301.100	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD	5,904	22.450	132,544.800	
ZHEJIANG NHU CO LTD	27,312	19.200	524,390.400	
SHIJIAZHANG YILING PHARMACEUTICAL CO LTD	2,660	34.480	91,716.800	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT CO LTD	6,600	26.370	174,042.000	
BEIJING NEW BUILDING MATERIALS PLC	5,100	22.600	115,260.000	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY CO LTD	2,600	8.820	22,932.000	
GUANGDONG HAID GROUP CO LTD	9,300	57.740	536,982.000	
GOTION HIGH-TECH CO LTD	10,400	33.630	349,752.000	
AVIC ELECTROMECHANICAL SYSTEMS CO LTD	41,400	11.180	462,852.000	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQUIPMENT & SUPPLY CO LTD	11,500	37.800	434,700.000	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD	33,300	48.270	1,607,391.000	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	11,300	95.710	1,081,523.000	
WESTONE INFORMATION INDUSTRY INC	5,700	36.730	209,361.000	
SHANXI XISHAN COAL & ELECTRICITY POWER CO LTD	18,000	12.150	218,700.000	
CHINA BAOAN GROUP CO LTD	18,000	13.150	236,700.000	
TIANQI LITHIUM CORP	10,100	100.350	1,013,535.000	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	11,200	10.850	121,520.000	
TIANMA MICROELECTRONICS CO LTD	10,100	9.080	91,708.000	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD	31,400	5.930	186,202.000	
NAVINFO CO LTD	5,600	12.110	67,816.000	
BY-HEALTH CO LTD	14,100	18.090	255,069.000	
DAAN GENE CO LTD	13,900	18.420	256,038.000	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,730	9.530	26,016.900	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTICAL CO LTD	18,300	24.120	441,396.000	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEERING INC	7,800	18.370	143,286.000	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL CO LTD	71,750	12.050	864,587.500	
CHINA RESOURCES SANJIU MEDICAL & PHARMACEUTICAL CO LTD	6,000	52.010	312,060.000	

UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD	6,139	150.100	921,463.900	
INSPUR ELECTRONIC INFORMATION INDUSTRY CO LTD	3,570	22.360	79,825.200	
GRG BANKING EQUIPMENT CO LTD	12,700	9.310	118,237.000	
O-FILM TECH CO LTD	8,600	5.350	46,010.000	
SHANXI TAIGANG STAINLESS STEEL CO LTD	36,700	4.300	157,810.000	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD	32,000	7.230	231,360.000	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO LTD	36,967	26.180	967,796.060	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROUP CO LTD	10,800	28.860	311,688.000	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT HOLDING GROUP CO LTD	784	35.980	28,208.320	
SHENZHEN SALUBRIS PHARMACEUTICALS CO LTD	11,100	32.830	364,413.000	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY BEIJING CO LTD	6,900	23.950	165,255.000	
XCMG CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD	38,200	4.700	179,540.000	
DONG-E-E-JIAO CO LTD	4,900	38.100	186,690.000	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICATIONS GROUP INC CO	15,300	8.440	129,132.000	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO LTD	21,000	4.870	102,270.000	
HUADONG MEDICINE CO LTD	7,500	42.110	315,825.000	
YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD	5,000	33.490	167,450.000	
TONGLING NONFERROUS METALS GROUP CO LTD	99,100	2.870	284,417.000	
37 INTERACTIVE ENTERTAINMENT NETWORK TECHNOLOGY GROUP CO LTD	6,600	15.480	102,168.000	
AECC AERO-ENGINE CONTROL CO LTD	9,800	27.940	273,812.000	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD	7,800	177.320	1,383,096.000	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD	17,800	68.490	1,219,122.000	
BEIJING DABEINONG TECHNOLOGY GROUP CO LTD	14,950	9.560	142,922.000	
NORTHEAST SECURITIES CO LTD	17,700	6.750	119,475.000	
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE ENERGY	22,300	43.410	968,043.000	

SONGCHENG PERFORMANCE DEVELOPMENT CO LTD	5,940	13.590	80,724.600	
BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	7,448	15.140	112,762.720	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMATION NETWORK CO LTD	2,100	90.100	189,210.000	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO LTD	36,480	5.830	212,678.400	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO LTD	14,300	7.610	108,823.000	
LUXSHARE PRECISION INDUSTRY CO LTD	45,054	30.430	1,370,993.220	
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY CO LTD	29,900	25.320	757,068.000	
SHANXI SECURITIES CO LTD	27,500	5.380	147,950.000	
FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	71,300	5.380	383,594.000	
NEW HOPE LIUHE CO LTD	19,900	13.480	268,252.000	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY CO LTD	19,100	11.660	222,706.000	
DHC SOFTWARE CO LTD	3,800	6.190	23,522.000	
IFLYTEK CO LTD	11,800	33.890	399,902.000	
HESTEEL CO LTD	93,400	2.340	218,556.000	
GOERTEK INC	25,100	18.650	468,115.000	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD	21,300	6.750	143,775.000	
BANK OF NINGBO CO LTD	45,200	26.040	1,177,008.000	
LENS TECHNOLOGY CO LTD	39,600	9.950	394,020.000	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORPORATION	135,200	4.080	551,616.000	
CHANGJIANG SECURITIES CO LTD	28,300	5.420	153,386.000	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD	37,600	4.600	172,960.000	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD	38,688	12.210	472,380.480	
WESTERN SECURITIES CO LTD	22,700	6.220	141,194.000	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD	27,400	24.300	665,820.000	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD	10,520	55.340	582,176.800	
EAST MONEY INFORMATION CO LTD	84,349	17.070	1,439,837.430	
JIANGSU YANGHE BREWERY JOINT-STOCK CO LTD	7,800	136.490	1,064,622.000	
WULIANGYE YIBIN CO LTD	23,400	145.760	3,410,784.000	

SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUCTS CO LTD	76,600	5.550	425,130.000	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LTD	218,100	3.480	758,988.000	
CHINA MERCHANTS SHEKOU INDUSTRIAL ZONE HOLDINGS CO LTD	45,900	13.930	639,387.000	
GREE ELECTRIC APPLIANCES INC OF ZHUHAI	18,700	30.120	563,244.000	
GUOSEN SECURITIES CO LTD	42,300	8.840	373,932.000	
PING AN BANK CO LTD	128,100	10.870	1,392,447.000	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD	34,080	18.320	624,345.600	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO LTD	146,300	4.010	586,663.000	
CHINA VANKE CO LTD	55,100	14.330	789,583.000	
ZTE CORP	19,700	22.890	450,933.000	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	28,500	5.540	157,890.000	
WEICHAI POWER CO LTD	48,100	9.920	477,152.000	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROUP INC	4,200	36.050	151,410.000	
GF SECURITIES CO LTD	38,700	14.620	565,794.000	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	21,100	11.140	235,054.000	
BYD CO LTD	11,200	260.260	2,914,912.000	
YOUNGY CO LTD	2,100	139.950	293,895.000	
CECEP SOLAR ENERGY CO LTD	30,200	7.220	218,044.000	
GUANGDONG LY INTELLIGENT MANUFACTURING CO LTD	34,100	4.760	162,316.000	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	9,660	47.140	455,372.400	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOGY CO LTD	5,220	40.410	210,940.200	
LB GROUP CO LTD	11,000	16.700	183,700.000	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG CO LTD	17,900	13.250	237,175.000	
SICHUAN YAHUA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	8,400	28.380	238,392.000	
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,100	53.440	112,224.000	
ASIA - POTASH INTERNATIONAL INVESTMENT GUANGZHOU CO LTD	9,600	28.170	270,432.000	

SINOMA SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	11,700	19.250	225,225.000	
CHACHA FOOD CO LTD	2,900	47.020	136,358.000	
APELOA PHARMACEUTICAL CO LTD	8,000	22.310	178,480.000	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILDING MATERIALS CO LTD	12,700	19.190	243,713.000	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD	3,500	235.000	822,500.000	
JIANGXI ZHENGBOANG TECHNOLOGY CO LTD	3,600	3.960	14,256.000	
INNER MONGOLIA YUAN XING ENERGY CO LTD	30,100	6.940	208,894.000	
NANTONG FUJITSU MICROELECTRONICS CO LTD	12,800	17.720	226,816.000	
HUAFON CHEMICAL CO LTD	34,200	6.840	233,928.000	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD	57,300	4.410	252,693.000	
PERFECT WORLD CO LTD/CHINA	5,550	12.220	67,821.000	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	2,000	216.900	433,800.000	
HENGYI PETROCHEMICAL CO LTD	15,600	7.020	109,512.000	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD	6,600	72.100	475,860.000	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD	600	42.650	25,590.000	
NINESTAR CORP	5,700	55.800	318,060.000	
YUNDA HOLDING CO LTD	25,420	12.250	311,395.000	
GCL SYSTEM INTEGRATION TECHNOLOGY CO LTD	33,800	3.300	111,540.000	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD	12,000	8.060	96,720.000	
BETTA PHARMACEUTICALS CO LTD	1,600	50.380	80,608.000	
HENAN SHENHUO COAL & POWER CO LTD	16,900	15.700	265,330.000	
ASYMCHAM LABORATORIES TIANJIN CO LTD	1,820	149.310	271,744.200	
JIUGUI LIQUOR CO LTD	1,800	123.820	222,876.000	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	15,100	4.960	74,896.000	
SF HOLDING CO LTD	32,000	49.310	1,577,920.000	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD	1,800	86.060	154,908.000	
FIRST CAPITAL SECURITIES CO LTD	23,600	5.730	135,228.000	

BEIJING EASPRING MATERIAL TECHNOLOGY CO LTD	4,000	61.900	247,600.000	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO LTD	2,500	68.510	171,275.000	
BANK OF SHANGHAI CO LTD	119,490	5.690	679,898.100	
360 SECURITY TECHNOLOGY INC	38,900	7.100	276,190.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	73,000	4.950	361,350.000	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD	2,300	65.940	151,662.000	
CSC FINANCIAL CO LTD	26,100	25.050	653,805.000	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	5,880	56.310	331,102.800	
NANJING KING-FRIEND BIOCHEMICAL PHARMACEUTICAL CO LTD	9,100	17.750	161,525.000	
HENGLI PETROCHEMICAL CO LTD	33,200	15.950	529,540.000	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD	3,100	63.160	195,796.000	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD	22,500	10.410	234,225.000	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	1,872	37.060	69,376.320	
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LTD	38,800	9.380	363,944.000	
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO LTD	3,700	47.510	175,787.000	
CHONGQING FULING ZHACAI GROUP CO LTD	5,200	24.420	126,984.000	
SATELLITE CHEMICAL CO LTD	15,278	13.930	212,822.540	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD	3,150	67.290	211,963.500	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD	4,600	162.850	749,110.000	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,700	63.000	170,100.000	
JUEWEI FOOD CO LTD	3,100	58.510	181,381.000	
OPPEIN HOME GROUP INC	2,100	90.060	189,126.000	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO LTD	9,116	64.210	585,338.360	
HEILONGJIANG AGRICULTURE CO LTD	9,500	14.390	136,705.000	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD	3,000	29.150	87,450.000	
SICHUAN NEW ENERGY POWER CO LTD	10,300	22.560	232,368.000	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY CO LTD	4,700	58.300	274,010.000	

HANGZHOU OXYGEN PLANT GROUP CO LTD	6,900	38.260	263,994.000	
SHENAN CIRCUITS CO LTD	4,540	74.250	337,095.000	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIVE CO LTD	3,000	117.650	352,950.000	
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMACEUTICAL CO LTD	2,700	50.750	137,025.000	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD	8,030	32.480	260,814.400	
BGI GENOMICS CO LTD	1,300	58.750	76,375.000	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES CO LTD	3,000	73.460	220,380.000	
CHINA RARE EARTH RESOURCES AND TECHNOLOGY CO LTD	11,600	36.370	421,892.000	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD	3,200	34.790	111,328.000	
CAITONG SECURITIES CO LTD	12,700	7.300	92,710.000	
HOSHINE SILICON INDUSTRY CO LTD	2,400	100.100	240,240.000	
BANK OF CHENGDU CO LTD	21,300	13.250	282,225.000	
SHENGHE RESOURCES HOLDING CO LTD	13,200	14.960	197,472.000	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOSTICS GROUP CO LTD	1,900	73.200	139,080.000	
NANJING SECURITIES CO LTD	9,800	8.250	80,850.000	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD	56,100	8.620	483,582.000	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD	7,400	302.100	2,235,540.000	
HUAXI SECURITIES CO LTD	15,500	7.980	123,690.000	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC	4,400	122.700	539,880.000	
SHENZHEN SENIOR TECHNOLOGY MATERIAL CO LTD	8,500	21.410	181,985.000	
OVCTEK CHINA INC	4,060	32.070	130,204.200	
SG MICRO CORP	1,350	147.000	198,450.000	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	13,800	385.300	5,317,140.000	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR INC	3,016	86.770	261,698.320	
WUXI APTEC CO LTD	17,572	82.270	1,445,648.440	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	10,300	38.580	397,374.000	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD	92,100	3.480	320,508.000	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD	7,300	50.600	369,380.000	

MAXSCEND MICROELECTRONICS CO LTD	2,560	99.780	255,436.800	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GROUP CO LTD	29,700	13.150	390,555.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	4,950	63.030	311,998.500	
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD	600	295.150	177,090.000	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN ELECTRONIC TECHNOLOGY CO LTD	2,900	114.500	332,050.000	
SHANGHAI FRIENDESS ELECTRONIC TECHNOLOGY CORP LTD	1,100	230.910	254,001.000	
AMLOGIC SHANGHAI CO LTD	1,100	61.000	67,100.000	
BEIJING UNITED INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD	3,900	123.860	483,054.000	
WESTERN SUPERCONDUCTING TECHNOLOGIES CO LTD	1,800	103.800	186,840.000	
ADVANCED MICRO- FABRICATION EQUIPMENT INC CHINA	3,000	103.780	311,340.000	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD	5,400	63.810	344,574.000	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COMMUNICATION CORP LTD	75,000	4.510	338,250.000	
NINGBO RONBAY NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	2,700	85.190	230,013.000	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY INC CO	3,500	48.660	170,310.000	
TIANJIN 712 COMMUNICATION & BROADCASTING CO LTD	8,200	35.250	289,050.000	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS CORP LTD	26,300	11.960	314,548.000	
WILL SEMICONDUCTOR LTD	9,130	78.780	719,261.400	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO LTD	2,380	131.830	313,755.400	
JOINN LABORATORIES CHINA CO LTD	3,220	62.150	200,123.000	
MING YANG SMART ENERGY GROUP LTD	12,800	25.080	321,024.000	
BANK OF CHANGSHA CO LTD	43,700	6.540	285,798.000	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD	114,300	2.860	326,898.000	
PANGANG GROUP VANADIUM TITANIUM & RESOURCES CO LTD	70,700	5.250	371,175.000	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD	10,700	29.740	318,218.000	

CHINA GREAT WALL SECURITIES CO LTD	24,800	8.470	210,056.000	
SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP	2,200	139.340	306,548.000	
PROYA COSMETICS CO LTD	1,260	174.000	219,240.000	
NINGBO ORIENT WIRES & CABLES CO LTD	2,900	75.230	218,167.000	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPEED RAILWAY CO LTD	285,200	4.780	1,363,256.000	
STARPOWER SEMICONDUCTOR LTD	800	345.340	276,272.000	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIES CO LTD	960	475.700	456,672.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	185,000	4.100	758,500.000	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO LTD	21,000	10.940	229,740.000	
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCES CO LTD	2,300	69.850	160,655.000	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD	32,900	10.190	335,251.000	
SUZHOU TA&A ULTRA CLEAN TECHNOLOGY CO LTD	3,900	67.100	261,690.000	
GINLONG TECHNOLOGIES CO LTD	1,400	203.160	284,424.000	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDINGS CO LTD	6,100	40.590	247,599.000	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEUTICAL CO LTD	1,600	40.550	64,880.000	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY CO LTD	1,440	24.310	35,006.400	
YONGXING SPECIAL MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD	2,200	142.780	314,116.000	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD	11,580	66.450	769,491.000	
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD	35,600	6.760	240,656.000	
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL PHARMACY ENTERPRISE CO LTD	2,755	127.800	352,089.000	
SHENZHEN NEW INDUSTRIES BIOMEDICAL ENGINEERING CO LTD	9,100	54.050	491,855.000	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD	2,600	155.450	404,170.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	7,500	36.370	272,775.000	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	4,600	57.390	263,994.000	

SINOMINE RESOURCE GROUP CO LTD	2,900	87.340	253,286.000	
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPMENT CO LTD	800	483.980	387,184.000	
SHENZHEN TRANSSION HOLDINGS CO LTD	3,200	66.600	213,120.000	
BEIJING KINGSOFT OFFICE SOFTWARE INC	2,047	269.500	551,666.500	
NATIONAL SILICON INDUSTRY GROUP CO LTD	11,000	19.570	215,270.000	
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOGY CO LTD	637	243.410	155,052.170	
SHANGHAI MEDICILON INC	800	233.500	186,800.000	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	185,600	2.340	434,304.000	
PETROCHINA CO LTD	100,600	4.950	497,970.000	
INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	332,300	4.110	1,365,753.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	433,000	2.760	1,195,080.000	
BANK OF CHINA LTD	135,800	3.050	414,190.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	143,200	4.250	608,600.000	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	22,700	30.030	681,681.000	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	33,000	29.450	971,850.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	123,100	29.190	3,593,289.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	64,700	38.460	2,488,362.000	
INDUSTRIAL BANK CO LTD	129,900	15.560	2,021,244.000	
SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD	156,900	6.780	1,063,782.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	217,700	3.390	738,003.000	
SAIC MOTOR CORP LTD	42,500	14.250	605,625.000	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD	7,300	1,475.000	10,767,500.000	
BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD	225,700	4.530	1,022,421.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	83,100	18.430	1,531,533.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	40,700	21.280	866,096.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL PORT GROUP CO LTD	38,300	5.260	201,458.000	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD	130,000	20.000	2,600,000.000	
DAQIN RAILWAY CO LTD	82,600	6.610	545,986.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	215,100	2.790	600,129.000	

CHINA STATE CONSTRUCTION ENGINEERING CORP LTD	220,000	4.930	1,084,600.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	55,500	8.560	475,080.000	
HUAXIA BANK CO LTD	70,700	4.900	346,430.000	
INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD	33,300	27.710	922,743.000	
BANK OF BEIJING CO LTD	87,900	4.080	358,632.000	
CHINA UNITED NETWORK COMMUNICATIONS LTD	191,200	3.460	661,552.000	
BAOSHAN IRON & STEEL CO LTD	169,900	5.120	869,888.000	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	23,200	26.040	604,128.000	
CHINA MERCHANTS SECURITIES CO LTD	59,800	12.920	772,616.000	
HUANENG POWER INTERNATIONAL INC	59,000	7.060	416,540.000	
GREAT WALL MOTOR CO LTD	11,700	30.240	353,808.000	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLDINGS GROUP CO LTD	63,600	14.390	915,204.000	
CRRC CORP LTD	141,700	5.170	732,589.000	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE CO LTD	43,252	40.190	1,738,297.880	
CHINA NORTHERN RARE EARTH GROUP HIGH-TECH CO LTD	16,800	26.800	450,240.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	49,500	12.400	613,800.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	157,500	5.150	811,125.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	16,300	25.630	417,769.000	
HAIER SMART HOME CO LTD	45,500	22.360	1,017,380.000	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD	48,200	14.960	721,072.000	
GD POWER DEVELOPMENT CO LTD	101,300	4.210	426,473.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK CORP	56,200	5.310	298,422.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	17,400	34.730	604,302.000	
GUANGHUI ENERGY CO LTD	26,400	10.400	274,560.000	
GEMDALE CORP	39,700	8.810	349,757.000	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO LTD	20,000	81.580	1,631,600.000	
SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO LTD	78,700	4.070	320,309.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	140,200	9.150	1,282,830.000	

FOUNDER SECURITIES CO LTD	67,400	6.780	456,972.000	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD	31,600	10.180	321,688.000	
NARI TECHNOLOGY CO LTD	35,044	25.620	897,827.280	
OFFSHORE OIL ENGINEERING CO LTD	29,800	5.210	155,258.000	
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD	12,000	188.990	2,267,880.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	30,900	11.850	366,165.000	
INNER MONGOLIA BAOTOU STEEL UNION CO LTD	222,500	2.120	471,700.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	4,400	98.350	432,740.000	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLDINGS CO LTD	25,000	3.110	77,750.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	102,000	4.230	431,460.000	
AIR CHINA LTD	28,400	10.930	310,412.000	
TBEA CO LTD	18,600	21.500	399,900.000	
CHINA NATIONAL CHEMICAL ENGINEERING CO LTD	43,500	7.640	332,340.000	
METALLURGICAL CORP OF CHINA LTD	164,900	3.090	509,541.000	
POWER CONSTRUCTION CORP OF CHINA LTD	71,300	7.200	513,360.000	
CHINA CSSC HOLDINGS LTD	33,700	24.920	839,804.000	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD	3,300	59.590	196,647.000	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHARMACEUTICAL HOLDINGS CO LTD	6,900	29.050	200,445.000	
JIANGXI COPPER CO LTD	14,900	17.020	253,598.000	
SOUTHWEST SECURITIES CO LTD	34,300	3.860	132,398.000	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD	28,500	17.850	508,725.000	
SINOLINK SECURITIES CO LTD	14,800	8.450	125,060.000	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO LTD	23,700	11.310	268,047.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	11,400	18.530	211,242.000	
AECC AVIATION POWER CO LTD	12,600	44.960	566,496.000	
BANK OF NANJING CO LTD	57,300	9.600	550,080.000	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	7,600	12.750	96,900.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	89,670	11.900	1,067,073.000	

CMOC GROUP LIMITED	119,700	4.560	545,832.000	
INDUSTRIAL SECURITIES CO LTD	84,800	5.740	486,752.000	
BEIJING TONGRENTANG CO LTD	9,000	46.100	414,900.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	20,120	18.580	373,829.600	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS CO LTD	7,600	28.320	215,232.000	
BBMG CORP	54,200	2.460	133,332.000	
YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	14,000	43.120	603,680.000	
CHINA EASTERN AIRLINES CORP LTD	38,600	5.270	203,422.000	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD	15,019	24.920	374,273.480	
HUADIAN POWER INTERNATIONAL CORP LTD	58,000	5.370	311,460.000	
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL ENERGY DEVELOPMENT CO LTD	7,700	17.320	133,364.000	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC	10,264	40.390	414,562.960	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD	16,250	24.210	393,412.500	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD	3,300	22.720	74,976.000	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	96,500	7.420	716,030.000	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROUP CO LTD	59,000	2.620	154,580.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	10,200	37.090	378,318.000	
XIAMEN C & D INC	18,900	12.300	232,470.000	
YOUNGOR GROUP CO LTD	25,600	6.100	156,160.000	
AVIC HELICOPTER CO LTD	4,600	41.920	192,832.000	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD	16,800	6.780	113,904.000	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP CO LTD	15,100	19.520	294,752.000	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES CITY GROUP CO LTD	49,500	4.420	218,790.000	
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW ENERGY CO LTD	14,900	18.190	271,031.000	
INNER MONGOLIA JUNZHENG ENERGY & CHEMICAL INDUSTRY GROUP CO LTD	39,400	4.190	165,086.000	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL CO LTD	19,600	6.510	127,596.000	
WESTERN MINING CO LTD	23,300	11.160	260,028.000	

ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD	3,900	256.810	1,001,559.000	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE FACTORY CO LTD	7,480	258.990	1,937,245.200	
FIBERHOME TELECOMMUNICATION TECHNOLOGIES CO LTD	1,200	13.660	16,392.000	
KEDA INDUSTRIAL GROUP CO LTD	12,600	17.240	217,224.000	
CHINA MERCHANTS ENERGY SHIPPING CO LTD	56,800	7.170	407,256.000	
KINGFA SCI & TECH CO LTD	26,600	10.100	268,660.000	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD	25,000	6.830	170,750.000	
ZHEJIANG JUHUA CO LTD	20,300	17.580	356,874.000	
PINGDINGSHAN TIANAN COAL MINING CO LTD	19,400	11.730	227,562.000	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM CO LTD	26,200	3.320	86,984.000	
BEIJING TIANAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD	6,480	21.020	136,209.600	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLOGY CO LTD	12,600	20.460	257,796.000	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD	26,100	17.940	468,234.000	
JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD	4,200	33.980	142,716.000	
DALIAN PORT PDA CO LTD	173,200	1.620	280,584.000	
SICHUAN ROAD & BRIDGE GROUP CO LTD	33,900	11.000	372,900.000	
YUNNAN YUNTIANHUA CO LTD	12,700	21.910	278,257.000	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUTICAL CO LTD	5,830	21.410	124,820.300	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GROUP INDUSTRY CO LTD	11,800	11.860	139,948.000	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD	26,800	13.800	369,840.000	
TONGWEI CO LTD	29,000	45.000	1,305,000.000	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD	8,879	41.500	368,478.500	
JCET GROUP CO LTD	10,900	23.220	253,098.000	
HANGZHOU SILAN MICROELECTRONICS CO LTD	6,800	33.470	227,596.000	
CHONGQING BREWERY CO LTD	2,500	108.980	272,450.000	
SHANGHAI JINJIANG INTERNATIONAL HOTELS CO LTD	5,300	54.600	289,380.000	

HUAXIN CEMENT CO LTD	5,600	14.310	80,136.000	
SHANDONG HUALU HENGSHENG CHEMICAL CO LTD	10,490	27.820	291,831.800	
XIAMEN FARATRONIC CO LTD	1,700	164.730	280,041.000	
CHINA JUSHI CO LTD	20,246	13.080	264,817.680	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOLOGY CO LTD	62,400	3.120	194,688.000	
NINGBO SHANSHAN CO LTD	13,200	19.300	254,760.000	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD	5,924	58.750	348,035.000	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LTD	19,600	8.550	167,580.000	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO LTD	19,600	16.930	331,828.000	
SAILUN GROUP CO LTD	19,700	9.190	181,043.000	
TONGKUN GROUP CO LTD	15,700	13.310	208,967.000	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL CO LTD	1,700	100.240	170,408.000	
ANGEL YEAST CO LTD	4,900	39.970	195,853.000	
HUBEI XINGFA CHEMICALS GROUP CO LTD	5,600	30.040	168,224.000	
CNGR ADVANCED MATERIAL CO LTD	1,400	79.390	111,146.000	
YUNNAN BOTANEE BIO- TECHNOLOGY GROUP CO LTD	900	153.710	138,339.000	
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO LTD	800	366.660	293,328.000	
HANGZHOU LION ELECTRONICS CO LTD	2,600	46.390	120,614.000	
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY CORP LTD	1,000	106.680	106,680.000	
CHINA RESOURCES MICROELECTRONICS LTD	7,100	51.060	362,526.000	
TRINA SOLAR CO LTD	11,100	70.980	787,878.000	
CHINA THREE GORGES RENEWABLES GROUP CO LTD	181,700	5.630	1,022,971.000	
ZANGGE MINING CO LTD	11,600	31.010	359,716.000	
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD	1,000	331.400	331,400.000	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	46,968	48.360	2,271,372.480	
HUAIBEI MINING HOLDINGS CO LTD	12,700	13.670	173,609.000	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIVE LIGHTING SYSTEMS CO LTD	1,800	133.000	239,400.000	
SHAANXI COAL INDUSTRY CO LTD	63,251	20.500	1,296,645.500	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING & FOOD CO LTD	24,016	70.690	1,697,691.040	

JIANGSU KING'S LUCK BREWERY JSC LTD	5,000	41.530	207,650.000	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC CORP	1,200	15.720	18,864.000	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD	7,000	34.570	241,990.000	
DONGXING SECURITIES CO LTD	13,200	8.060	106,392.000	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD	7,000	71.940	503,580.000	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	40,700	13.500	549,450.000	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POWER CO LTD	105,000	5.950	624,750.000	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO LTD	3,400	44.500	151,300.000	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY CO LTD	5,300	47.200	250,160.000	
SKSHU PAINT CO LTD	2,000	95.700	191,400.000	
BANK OF JIANGSU CO LTD	83,200	6.850	569,920.000	
BANK OF HANGZHOU CO LTD	45,400	12.260	556,604.000	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO LTD	11,400	18.460	210,444.000	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEUTICALS CO LTD	2,000	20.550	41,100.000	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD	28,300	18.700	529,210.000	
JASON FURNITURE HANGZHOU CO LTD	8,850	32.060	283,731.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	30,400	9.260	281,504.000	
TOPCHOICE MEDICAL CORP	800	128.590	102,872.000	
ENN NATURAL GAS CO LTD	21,300	17.150	365,295.000	
HANGZHOU FIRST APPLIED MATERIAL CO LTD	5,480	65.250	357,570.000	
TOLY BREAD CO LTD	7,056	12.200	86,083.200	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD	2,860	62.140	177,720.400	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY CO LTD	2,940	45.300	133,182.000	
ZHEJIANG WEIMING ENVIRONMENT PROTECTION CO LTD	11,310	21.760	246,105.600	
ORIENT SECURITIES CO LTD/CHINA	49,300	8.300	409,190.000	
CHIFENG JILONG GOLD MINING CO LTD	14,700	20.350	299,145.000	
EVERBRIGHT SECURITIES CO LTD	16,000	14.460	231,360.000	
SHANGHAI M&G STATIONERY INC	4,500	46.000	207,000.000	

	FUTURE LAND HOLDINGS CO LTD	10,700	17.080	182,756.000	
オフショア・人民元 小計		14,397,934		211,543,780.980 (4,187,551,453)	
カタール・リアル	QATAR NATIONAL BANK	450,826	20.120	9,070,619.120	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR QSC	325,231	6.200	2,016,432.200	
	OOREDOO QSC	65,947	10.480	691,124.560	
	QATAR FUEL QSC	50,528	19.700	995,401.600	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	37,060	19.270	714,146.200	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC BANK QSC	65,041	12.380	805,207.580	
	INDUSTRIES QATAR QSC	148,624	15.800	2,348,259.200	
	QATAR ISLAMIC BANK SAQ	163,055	24.990	4,074,744.450	
	QATAR GAS TRANSPORT CO LTD	249,488	4.110	1,025,395.680	
	MASRAF AL RAYAN	562,961	3.794	2,135,874.030	
	BARWA REAL ESTATE CO	203,813	3.427	698,467.150	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING CO	451,662	2.252	1,017,142.820	
カタール・リアル 小計		2,774,236		25,592,814.590 (991,721,565)	
クウェート・ディナール	KUWAIT FINANCE HOUSE KSCP	721,107	0.848	611,498.730	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC	216,726	0.606	131,335.950	
	GULF BANK KSCP	137,969	0.350	48,289.150	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT SAKP	697,988	1.120	781,746.560	
	AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC	149,005	0.803	119,651.010	
	MABANEE CO KPSC	53,023	0.898	47,614.650	
	BOUBYAN BANK KSCP	136,266	0.838	114,190.900	
クウェート・ディナール 小計		2,112,084		1,854,326.950 (856,087,123)	
コロンビア・ペソ	INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP	37,356	18,590.000	694,448,040.000	
	ECOPETROL SA	508,321	2,599.000	1,321,126,279.000	
	BANCOLOMBIA SA	29,016	39,700.000	1,151,935,200.000	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	40,127	32,080.000	1,287,274,160.000	
コロンビア・ペソ 小計		614,820		4,454,783,679.000 (131,536,398)	
サウジアラビア・リアル	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL CO	26,055	42.800	1,115,154.000	
	JARIR MARKETING CO	6,127	161.400	988,897.800	
	ETIHAD ETISALAT CO	38,569	36.300	1,400,054.700	
	SAUDI BRITISH BANK	91,386	42.000	3,838,212.000	

AL RAJHI BANK	191,199	84.100	16,079,835.900	
ARAB NATIONAL BANK	60,216	33.250	2,002,182.000	
BANK ALBILAD	48,763	52.500	2,560,057.500	
BANK AL-JAZIRA	41,743	23.020	960,923.860	
BANQUE SAUDI FRANSI	58,427	42.300	2,471,462.100	
RIYAD BANK	132,730	36.650	4,864,554.500	
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	52,554	18.260	959,636.040	
SAUDI TELECOM CO	146,310	38.300	5,603,673.000	
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	21,085	146.000	3,078,410.000	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	87,305	83.900	7,324,889.500	
SAUDI ELECTRICITY CO	81,360	25.300	2,058,408.000	
SAUDI INDUSTRIAL INVESTMENT GROUP	38,856	20.660	802,764.960	
SAVOLA GROUP	22,831	28.100	641,551.100	
NATIONAL INDUSTRIALIZATION CO	26,550	11.760	312,228.000	
ALMARAI CO JSC	24,903	57.000	1,419,471.000	
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	3,070	192.600	591,282.000	
EMAAR ECONOMIC CITY	28,311	8.920	252,534.120	
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL CO	35,820	38.400	1,375,488.000	
ADVANCED PETROCHEMICAL CO	14,397	43.150	621,230.550	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	75,912	11.200	850,214.400	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEVELOPMENT CO	45,345	12.860	583,136.700	
RABIGH REFINING & PETROCHEMICAL CO	35,214	11.000	387,354.000	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO SAUDI ARABIA	53,271	11.500	612,616.500	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE INSURANCE CO	5,610	174.200	977,262.000	
ALINMA BANK	96,142	38.150	3,667,817.300	
SAUDI ARABIAN MINING CO	84,602	71.400	6,040,582.800	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	5,036	181.200	912,523.200	
SAUDI ARABIAN OIL CO	235,349	34.200	8,048,935.800	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL SERVICES GROUP CO	8,656	211.800	1,833,340.800	
ACWA POWER CO	7,940	151.200	1,200,528.000	
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING CO	3,616	209.600	757,913.600	
ELM CO	2,420	306.400	741,488.000	

	THE SAUDI NATIONAL BANK	213,622	54.900	11,727,847.800	
サウジアラビア・リアル	小計	2,151,302		99,664,461.530 (3,767,316,646)	
タイ・パーツ	BERLI JUCKER PCL NVDR	90,400	32.000	2,892,800.000	
	KRUNG THAI BANK PCL NVDR	302,300	17.700	5,350,710.000	
	RATCHABURI ELECTRICITY GENERATING HOLDING PCL NVDR	124,300	41.500	5,158,450.000	
	TRUE CORP PCL NVDR	1,039,555	4.900	5,093,819.500	
	KASIKORNBANK PCL NVDR	52,000	148.000	7,696,000.000	
	ELECTRICITY GENERATING PCL NVDR	29,400	172.000	5,056,800.000	
	SHIN CORP PCL	96,300	71.250	6,861,375.000	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL	392,200	25.000	9,805,000.000	
	ADVANCED INFO SERVICE PCL	118,600	186.500	22,118,900.000	
	HOME PRODUCT CENTER PCL- NVDR	517,120	14.500	7,498,240.000	
	DELTA ELECTRONICS THAI PCL NVDR	30,900	606.000	18,725,400.000	
	PTT PCL	963,100	34.250	32,986,175.000	
	THAI UNION GROUP PCL- NVDR	265,000	17.300	4,584,500.000	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	83,100	58.500	4,861,350.000	
	LAND AND HOUSES PCL NVDR	826,100	9.450	7,806,645.000	
	SIAM CEMENT PCL NVDR	75,650	339.000	25,645,350.000	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL-NVDR	413,700	74.750	30,924,075.000	
	CENTRAL PATTANA PCL NVDR	201,700	70.000	14,119,000.000	
	BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES NVDR	1,028,300	31.250	32,134,375.000	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL- NVDR	62,700	233.000	14,609,100.000	
	MINOR INTERNATIONAL PCL- NVDR	328,110	29.750	9,761,272.500	
	THAI OIL PCL NVDR	124,700	54.500	6,796,150.000	
	CP ALL PCL NVDR	573,200	61.000	34,965,200.000	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL	866,900	8.350	7,238,615.000	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL NVDR	138,845	189.500	26,311,127.500	
	INDORAMA VENTURES PCL NVDR	142,922	42.750	6,109,915.500	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL- NVDR	234,908	46.500	10,923,222.000	
	JMT NETWORK SERVICES PCL NVDR	56,700	65.250	3,699,675.000	
	ENERGY ABSOLUTE PCL NVDR	168,000	97.250	16,338,000.000	
	BANGKOK EXPRESSWAY & METRO PCL NVDR	860,800	9.400	8,091,520.000	

	B GRIMM POWER PCL NVDR	98,200	34.750	3,412,450.000	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT PCL NVDR	286,200	50.750	14,524,650.000	
	OSOTSPA PCL NVDR	142,800	26.500	3,784,200.000	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSET MANAGEMENT PCL NVDR	201,700	15.000	3,025,500.000	
	ASSET WORLD CORP PCL NVDR	817,200	6.000	4,903,200.000	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL NVDR	154,733	40.500	6,266,686.500	
	SCG PACKAGING PCL NVDR	108,300	55.500	6,010,650.000	
	SRISAWAD POWER 1979 PCL NVDR	69,000	41.500	2,863,500.000	
	PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL NVDR	295,300	24.300	7,175,790.000	
	SCB X PCL NVDR	90,300	106.000	9,571,800.000	
	CARABAO GROUP PCL NVDR	24,000	95.500	2,292,000.000	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL NVDR	57,900	34.500	1,997,550.000	
	GLOBAL POWER SYNERGY CO LTD NVDR	74,400	65.500	4,873,200.000	
	タイ・パーツ 小計	12,627,543		464,863,938.500 (1,826,915,278)	
チェコ・コルナ	KOMERCNI BANKA AS	6,555	763.000	5,001,465.000	
	CEZ	15,836	829.000	13,128,044.000	
	MONETA MONEY BANK AS	40,915	73.200	2,994,978.000	
	チェコ・コルナ 小計	63,306		21,124,487.000 (125,646,336)	
チリ・ペソ	BANCO SANTANDER CHILE	6,868,510	33.960	233,254,599.600	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	5,121	26,051.000	133,407,171.000	
	BANCO DE CHILE	4,571,902	85.000	388,611,670.000	
	EMPRESAS CMPC SA	119,258	1,577.000	188,069,866.000	
	EMPRESAS COPEC SA	40,423	6,710.100	271,242,372.300	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	10,516	5,053.300	53,140,502.800	
	CIA SUD AMERICANA DE VAPORES SA	1,250,262	70.950	88,706,088.900	
	ENEL AMERICAS SA	2,133,152	95.250	203,182,728.000	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	13,966	96,224.000	1,343,864,384.000	
	FALABELLA SA	63,666	1,750.000	111,415,500.000	
	CENCOSUD SA	152,261	1,311.100	199,629,397.100	
	ENEL CHILE SA	2,415,702	33.500	80,926,017.000	
	チリ・ペソ 小計	17,644,739		3,295,450,296.700 (522,576,031)	
トルコ・リラ	AKBANK TAS	335,192	15.430	5,172,012.560	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	84,401	38.040	3,210,614.040	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS	121,748	37.540	4,570,419.920	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	7,410	368.000	2,726,880.000	
	KOC HOLDING AS	70,710	64.000	4,525,440.000	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	121,871	35.640	4,343,482.440	
	TURK HAVA YOLLARI	49,093	113.400	5,567,146.200	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	137,757	32.420	4,466,081.940	
	TURKIYE IS BANKASI	331,103	9.400	3,112,368.200	
	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFFINE	10,975	433.700	4,759,857.500	
	HACI OMER SABANCI HOLDING AS	94,865	36.900	3,500,518.500	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	48,467	142.400	6,901,700.800	
トルコ・リラ 小計		1,413,592		52,856,522.100 (405,478,238)	
ハンガリー・フォロント	RICHTER GEDEON NYRT	13,715	8,350.000	114,520,250.000	
	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	40,781	2,624.000	107,009,344.000	
	OTP BANK NYRT	22,689	9,660.000	219,175,740.000	
ハンガリー・フォロント 小計		77,185		440,705,334.000 (159,176,597)	
フィリピン・ペソ	AYALA LAND INC	752,600	26.150	19,680,490.000	
	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	158,120	56.500	8,933,780.000	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAND	188,130	91.600	17,232,708.000	
	AYALA CORP	22,173	659.000	14,612,007.000	
	GLOBE TELECOM INC	1,995	2,292.000	4,572,540.000	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERM SERVICES INC	103,500	176.700	18,288,450.000	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	318,290	43.600	13,877,444.000	
	JOLLIBEE FOODS CORP	46,960	233.000	10,941,680.000	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	159,865	51.900	8,296,993.500	
	BDO UNIBANK INC	200,993	132.800	26,691,870.400	
	PLDT INC	8,985	1,536.000	13,800,960.000	
	SM PRIME HOLDINGS INC	1,121,775	33.900	38,028,172.500	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	76,860	121.000	9,300,060.000	
	SM INVESTMENTS CORP	24,153	787.000	19,008,411.000	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CORP	889,900	3.400	3,025,660.000	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	24,720	299.000	7,391,280.000	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	6,601	380.000	2,508,380.000	
ACEN CORP	763,119	6.280	4,792,387.320		
MONDE NISSIN CORP	649,200	11.940	7,751,448.000		

	CONVERGE INFORMATION AND COMMUNICATIONS TECHNOLOGY SOLUTIONS INC	132,900	12.000	1,594,800.000	
フィリピン・ペソ 小計		5,650,839		250,329,521.720 (610,253,308)	
ブラジル・リアル	BRF SA	54,692	11.000	601,612.000	
	VALE SA	392,389	74.550	29,252,599.950	
	RAIA DROGASIL SA	106,700	24.380	2,601,346.000	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	23,950	48.530	1,162,293.500	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA	103,700	45.000	4,666,500.000	
	BANCO DO BRASIL SA	84,500	36.330	3,069,885.000	
	ITAUSA SA	453,388	9.920	4,497,608.960	
	GERDAU SA	115,430	28.550	3,295,526.500	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	366,710	29.690	10,887,619.900	
	VIBRA ENERGIA SA	117,700	17.180	2,022,086.000	
	PETROLEO BRASILEIRO SA	464,312	26.120	12,127,829.440	
	CCR SA	121,020	11.260	1,362,685.200	
	WEG SA	165,044	39.230	6,474,676.120	
	BANCO BRADESCO SA PREF	521,702	14.900	7,773,359.800	
	BANCO BRADESCO SA	155,292	12.850	1,995,502.200	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	64,606	13.210	853,445.260	
	SUZANO SA	74,375	56.380	4,193,262.500	
	CPFL ENERGIA SA	23,600	32.900	776,440.000	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	471,547	27.620	13,024,128.140	
	AMERICANAS SA	46,471	12.640	587,393.440	
	BRASKEM SA	19,900	28.900	575,110.000	
	ENGIE BRASIL SA	17,987	39.510	710,666.370	
	LOCALIZA RENT A CAR	72,089	64.940	4,681,459.660	
	LOJAS RENNER SA	99,120	25.130	2,490,885.600	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	66,304	13.240	877,864.960	
	COSAN SA	119,800	17.360	2,079,728.000	
	TOTVS SA	53,400	31.570	1,685,838.000	
	EQUATORIAL ENERGIA SA	100,500	28.520	2,866,260.000	
	JBS SA	76,700	24.840	1,905,228.000	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS	136,462	10.750	1,466,966.500	
	CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	34,098	55.420	1,889,711.160	
	HYPERA SA	41,200	47.210	1,945,052.000	
B3 SA-BRASIL BOLSA BAICAO	597,648	13.310	7,954,694.880		
MAGAZINE LUIZA SA	271,500	3.980	1,080,570.000		
HRT PARTICIPACOES EM PETROLEO SA	70,200	36.580	2,567,916.000		

	TELEFONICA BRASIL SA	50,528	40.380	2,040,320.640	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	68,700	29.950	2,057,565.000	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS SA	463,461	6.380	2,956,881.180	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO E INDUSTRIA LTDA	42,700	15.900	678,930.000	
	AMBEV SA	459,295	15.990	7,344,127.050	
	NATURA &CO HOLDING SA	92,700	13.020	1,206,954.000	
	TIM SA	69,800	13.520	943,696.000	
	REDE D'OR SAO LUIZ SA	34,800	32.200	1,120,560.000	
	RUMO SA	127,600	19.600	2,500,960.000	
	ブラジル・リアル 小計	7,113,620		166,853,744.910 (4,396,279,156)	
ポーランド・ズロチ	MBANK	1,344	320.000	430,080.000	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	15,187	118.900	1,805,734.300	
	BANK PEKAO SA	20,059	82.020	1,645,239.180	
	ORANGE POLSKA SA	52,852	6.632	350,514.460	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	40,886	62.600	2,559,463.600	
	LPP SA	112	9,165.000	1,026,480.000	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,881	268.200	772,684.200	
	CD PROJEKT RED SA	7,001	140.800	985,740.800	
	POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA	90,467	27.600	2,496,889.200	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA	180,060	5.148	926,948.880	
	CYFROWY POLSAT SA	19,008	18.710	355,639.680	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	74,101	6.248	462,983.040	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	60,071	28.540	1,714,426.340	
	DINO POLSKA SA	4,847	343.000	1,662,521.000	
	ALLEGRO.EU SA	30,158	25.925	781,846.150	
	ポーランド・ズロチ 小計	599,034		17,977,190.830 (554,788,693)	
マレーシア・リングギット	AMMB HOLDINGS BHD	157,100	3.930	617,403.000	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	674,000	5.480	3,693,520.000	
	DIGI.COM BHD	275,700	3.830	1,055,931.000	
	MALAYSIA AIRPORTS HOLDINGS BHD	47,920	6.010	287,999.200	
	RHB BANK BHD	133,680	5.600	748,608.000	
	HAP SENG CONSOLIDATED BHD	60,000	6.150	369,000.000	
	TOP GLOVE CORP BHD	500,700	0.885	443,119.500	
	GENTING BHD	182,400	4.380	798,912.000	

	HONG LEONG FINANCIAL GROUP BHD	18,056	18.760	338,730.560	
	HONG LEONG BANK BHD	65,508	20.600	1,349,464.800	
	IOI CORP BHD	276,613	3.990	1,103,685.870	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	37,900	21.200	803,480.000	
	MALAYAN BANKING BHD	453,375	8.640	3,917,160.000	
	MISC BHD	115,180	7.200	829,296.000	
	NESTLE MALAYSIA BHD	6,800	130.200	885,360.000	
	PPB GROUP BHD	70,260	16.220	1,139,617.200	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	34,400	21.480	738,912.000	
	PETRONAS GAS BHD	79,500	16.960	1,348,320.000	
	GENTING MALAYSIA BHD	275,400	2.680	738,072.000	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	99,500	5.470	544,265.000	
	TENAGA NASIONAL BHD	252,550	8.300	2,096,165.000	
	QL RESOURCES BHD	115,450	5.260	607,267.000	
	DIALOG GROUP BHD	418,344	1.980	828,321.120	
	PUBLIC BANK BHD(LLOCAL)	1,419,350	4.430	6,287,720.500	
	SIME DARBY BERHAD	320,700	2.210	708,747.000	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	105,800	2.060	217,948.000	
	AXIATA GROUP BERHAD	317,100	2.860	906,906.000	
	MAXIS BHD	214,200	3.860	826,812.000	
	INARI AMERTRON BHD	236,500	2.470	584,155.000	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	238,100	8.640	2,057,184.000	
	IHH HEALTHCARE BHD	177,700	5.970	1,060,869.000	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS BHD	376,100	4.450	1,673,645.000	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	220,800	4.350	960,480.000	
	MR DIY GROUP M BHD	259,200	1.980	513,216.000	
	マレーシア・リンギット 小計	8,235,886		41,080,291.750 (1,255,101,506)	
メキシコ・ペソ	ALFA SAB DE CV	254,900	13.790	3,515,071.000	
	GRUPO BIMBO SAB DE CV	132,300	82.730	10,945,179.000	
	GRUMA SAB DE CV	21,700	226.540	4,915,918.000	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	22,660	162.550	3,683,383.000	
	GRUPO CARSO SAB DE CV	36,400	83.060	3,023,384.000	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	255,800	154.220	39,449,476.000	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	85,925	37.780	3,246,246.500	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	12,455	279.460	3,480,674.300	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO SAB DE CV	133,000	32.500	4,322,500.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV	19,220	459.930	8,839,854.600	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	308,752	76.460	23,607,177.920	

	AMERICA MOVIL SAB DE CV	2,737,378	19.380	53,050,385.640	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA SA	219,900	36.640	8,057,136.000	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	44,700	170.130	7,604,811.000	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	511,300	73.300	37,478,290.000	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV	35,785	323.020	11,559,270.700	
	OPERADORA DE SITES MEXICANOS SA DE CV	117,000	22.920	2,681,640.000	
	SITIOS LATINOAMERICA SAB DE CV	136,869	6.930	948,502.170	
メキシコ・ペソ	小計	5,086,044		230,408,899.830 (1,693,390,209)	
ユーロ	ALPHA BANK A.E.	198,844	0.985	195,861.340	
	NATIONAL BANK OF GREECE	62,656	3.833	240,160.440	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	20,850	15.890	331,306.500	
	FF GROUP	3,130	0.000	0.000	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES	220,526	1.090	240,373.340	
	MYTILINEOS HOLDINGS	10,944	17.060	186,704.640	
	OPAP SA	19,031	12.850	244,548.350	
	JUMBO SA	9,875	15.190	150,001.250	
	PUBLIC POWER CORP	21,441	6.450	138,294.450	
ユーロ	小計	567,297		1,727,250.310 (249,432,217)	
韓国・ウォン	SKC CO LTD	1,775	106,000.000	188,150,000.000	
	CHEIL WORLDWIDE INC	8,603	23,750.000	204,321,250.000	
	HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	3,498	82,500.000	288,585,000.000	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANC	3,110	201,000.000	625,110,000.000	
	DB INSURANCE CO LTD	3,976	55,400.000	220,270,400.000	
	COWAY CO LTD	5,833	55,200.000	321,981,600.000	
	KT&G CORP	10,777	94,400.000	1,017,348,800.000	
	S-1 CORPORATION	1,557	63,500.000	98,869,500.000	
	CJ CORP	1,958	75,700.000	148,220,600.000	
	KAKAO CORP	30,480	50,800.000	1,548,384,000.000	
	CJ ENM CO LTD	1,490	76,000.000	113,240,000.000	
	MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	31,228	6,580.000	205,480,240.000	
	NCSOFT CORPORATION	1,664	410,000.000	682,240,000.000	
	LG UPLUS CORP	19,033	11,800.000	224,589,400.000	
	DOOSAN ENERBILITY	40,670	15,850.000	644,619,500.000	
	LG H&H CO LTD	981	577,000.000	566,037,000.000	
	LG CHEM LTD	4,903	695,000.000	3,407,585,000.000	
	LG CHEM LTD	622	323,000.000	200,906,000.000	

LG H&H CO LTD	102	299,000.000	30,498,000.000	
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	45,807	37,550.000	1,720,052,850.000	
HYUNDAI MERCHANT MARINE	27,028	20,250.000	547,317,000.000	
S-OIL CORP	4,649	89,000.000	413,761,000.000	
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	11,502	49,600.000	570,499,200.000	
MERITZ SECURITIES CO LTD	17,730	4,290.000	76,061,700.000	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6,276	33,450.000	209,932,200.000	
POSCO CHEMICAL CO LTD	2,719	219,500.000	596,820,500.000	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,831	176,500.000	323,171,500.000	
HOTEL SHILLA CO LTD	3,641	66,700.000	242,854,700.000	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD	4,383	75,900.000	332,669,700.000	
HYUNDAI MOBIS	6,038	220,500.000	1,331,379,000.000	
SK HYNIX INC	53,581	89,100.000	4,774,067,100.000	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD	7,044	40,500.000	285,282,000.000	
HYUNDAI MOTOR CO	2,064	81,200.000	167,596,800.000	
HYUNDAI MOTOR CO	13,617	169,500.000	2,308,081,500.000	
HYUNDAI STEEL CO	7,657	30,900.000	236,601,300.000	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	23,131	10,550.000	244,032,050.000	
KIA CORPORATION	25,784	66,600.000	1,717,214,400.000	
KOREA ZINC CO LTD	861	610,000.000	525,210,000.000	
KOREA ELECTRIC POWER CORP	25,278	18,150.000	458,795,700.000	
KOREAN AIR CO LTD	17,387	24,550.000	426,850,850.000	
CJ LOGISTICS	958	84,200.000	80,663,600.000	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	1,557	144,500.000	224,986,500.000	
HLB INC	9,695	35,900.000	348,050,500.000	
LG ELECTRONICS INC	10,517	91,900.000	966,512,300.000	
LG CORP	9,347	82,300.000	769,258,100.000	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	15,290	9,300.000	142,197,000.000	
GS ENGINEERING & CONSTRUCTION	6,167	23,800.000	146,774,600.000	
NAVER CORP	12,842	176,000.000	2,260,192,000.000	
L&F CO LTD	2,321	222,500.000	516,422,500.000	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD	3,706	54,000.000	200,124,000.000	
AMOREPACIFIC GROUP	2,234	27,200.000	60,764,800.000	
KANGWON LAND INC	9,245	23,700.000	219,106,500.000	
POSCO HOLDINGS INC	7,765	281,000.000	2,181,965,000.000	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	13,977	25,550.000	357,112,350.000	

SAMSUNG SDI CO LTD	5,386	725,000.000	3,904,850,000.000	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	5,630	136,500.000	768,495,000.000	
GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA	410	126,000.000	51,660,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	467,131	60,400.000	28,214,712,400.000	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD	54,875	5,320.000	291,935,000.000	
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	79,802	55,500.000	4,429,011,000.000	
YUHAN CORP	4,610	57,100.000	263,231,000.000	
HANON SYSTEMS	19,141	7,930.000	151,788,130.000	
GS HOLDINGS CORP	4,259	48,100.000	204,857,900.000	
LG DISPLAY CO LTD	23,742	14,300.000	339,510,600.000	
CELLTRION INC	9,724	187,000.000	1,818,388,000.000	
HANA FINANCIAL GROUP	29,761	40,550.000	1,206,808,550.000	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,928	179,500.000	346,076,000.000	
CELLTRION PHARM INC	1,680	67,000.000	112,560,000.000	
LOTTE SHOPPING CO	1,025	87,600.000	89,790,000.000	
MERITZ FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD	2,499	33,600.000	83,966,400.000	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	8,005	67,600.000	541,138,000.000	
AMOREPACIFIC CORP	3,032	111,500.000	338,068,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	5,484	181,000.000	992,604,000.000	
CJ CHEILJEDANG CORP	709	422,000.000	299,198,000.000	
STX PAN OCEAN CO LTD	31,293	4,790.000	149,893,470.000	
LG INNOTEK CO LTD	1,436	287,500.000	412,850,000.000	
SK INC	3,655	220,000.000	804,100,000.000	
KB FINANCIAL GROUP INC	38,671	49,100.000	1,898,746,100.000	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	7,426	47,200.000	350,507,200.000	
ILJIN MATERIALS CO LTD	2,508	61,400.000	153,991,200.000	
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	2,277	27,950.000	63,642,150.000	
HANMI PHARM CO LTD	545	260,500.000	141,972,500.000	
SEEGENE INC	3,334	31,700.000	105,687,800.000	
E-MART CO LTD	1,887	89,300.000	168,509,100.000	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD	7,697	33,000.000	254,001,000.000	
HD HYUNDAI CO LTD	4,097	61,500.000	251,965,500.000	
BGF RETAIL CO LTD	715	178,000.000	127,270,000.000	
ORION CORP REPUBLIC OF KOREA	2,318	103,000.000	238,754,000.000	
SK CHEMICALS CO LTD	1,094	90,000.000	98,460,000.000	
NETMARBLE CORP	2,597	48,200.000	125,175,400.000	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	56,041	11,800.000	661,283,800.000	
ECOPRO BM CO LTD	4,843	106,900.000	517,716,700.000	

	SD BIOSENSOR INC	2,353	32,900.000	77,413,700.000	
	SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	2,850	65,900.000	187,815,000.000	
	KRAFTON INC	2,486	192,000.000	477,312,000.000	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	1,482	110,000.000	163,020,000.000	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	2,720	59,200.000	161,024,000.000	
	SK SQUARE CO LTD	10,144	39,100.000	396,630,400.000	
	SK BIOSCIENCE CO LTD	1,958	86,500.000	169,367,000.000	
	KAKAO GAMES CORP	3,264	41,050.000	133,987,200.000	
	HYBE CO LTD	1,920	126,500.000	242,880,000.000	
	LG ENERGY SOLUTION	2,285	605,000.000	1,382,425,000.000	
	KAKAObANK CORP	10,111	22,950.000	232,047,450.000	
	F&F CO LTD / NEW	1,439	152,000.000	218,728,000.000	
	SAMSUNG SDS CO LTD	3,640	127,000.000	462,280,000.000	
	ALTEOGEN INC	3,612	37,100.000	134,005,200.000	
	SAMSUNG C&T CORP	8,288	121,500.000	1,006,992,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,737	907,000.000	1,575,459,000.000	
	PEARL ABYSS CORP	2,080	39,750.000	82,680,000.000	
	DOOSAN BOBCAT INC	4,600	36,000.000	165,600,000.000	
	CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	8,748	67,900.000	593,989,200.000	
	韓国・ウォン 小計	1,562,873		95,555,646,140.000 (10,081,120,668)	
香港・ドル	JIANGXI COPPER CO LTD	98,000	9.920	972,160.000	
	JIANGSU EXPRESS	144,000	5.820	838,080.000	
	CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD	152,000	4.420	671,840.000	
	ANHUI GUJING DISTILLERY CO LTD	12,000	106.200	1,274,400.000	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD	123,500	22.600	2,791,100.000	
	BEIJING ENTERPRISES	58,000	22.000	1,276,000.000	
	HUANENG POWER INTERNATIONAL IN	390,000	3.110	1,212,900.000	
	ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY	496,000	3.940	1,954,240.000	
	YANKUANG ENERGY GROUP CO LTD	150,000	24.200	3,630,000.000	
	HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS LTD	62,423	6.430	401,379.890	
	HENGAN INTERNATIONAL GROUP	67,500	32.900	2,220,750.000	
	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	885,600	9.350	8,280,360.000	
	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTME	377,120	16.460	6,207,395.200	
	CHINA RESOURCES LAND LTD	312,888	27.850	8,713,930.800	
CITIC LTD	570,000	7.350	4,189,500.000		

BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL	164,000	4.640	760,960.000	
LENOVO GROUP LTD	718,000	6.390	4,588,020.000	
PETRO CHINA CO LTD	2,090,000	3.250	6,792,500.000	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD	170,790	6.100	1,041,819.000	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL COR	2,501,200	3.350	8,379,020.000	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	81,000	12.900	1,044,900.000	
KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD	263,000	12.900	3,392,700.000	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	77,900	81.450	6,344,955.000	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	392,000	5.120	2,007,040.000	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	150,000	4.950	742,500.000	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	152,200	7.370	1,121,714.000	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDINGS CO LTD	128,000	10.260	1,313,280.000	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	380,000	2.610	991,800.000	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	121,000	26.950	3,260,950.000	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDING	130,500	6.220	811,710.000	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	304,400	7.510	2,286,044.000	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	57,500	21.250	1,221,875.000	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	592,000	9.740	5,766,080.000	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	93,400	22.150	2,068,810.000	
BYD CO LTD	79,500	178.000	14,151,000.000	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD	154,000	9.350	1,439,900.000	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,170,000	0.345	403,650.000	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP	411,592	3.030	1,247,123.760	
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	238,000	6.420	1,527,960.000	
MMG LTD	380,000	2.000	760,000.000	
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL	13,000	121.600	1,580,800.000	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	679,788	7.480	5,084,814.240	
AVICHINA INDUSTRY & TECHNOLOGY	219,000	3.480	762,120.000	
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS	191,200	12.700	2,428,240.000	
GREAT WALL MOTOR COMPANY LTD	314,000	8.680	2,725,520.000	

CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	706,000	9.490	6,699,940.000	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	547,000	9.080	4,966,760.000	
SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL-H	256,000	10.840	2,775,040.000	
WEICAI POWER CO LTD	189,440	8.480	1,606,451.200	
TINGYI HOLDING CORP	202,000	11.440	2,310,880.000	
TSINGTAO BREWERY CO LTD	60,000	65.150	3,909,000.000	
GUANGDONG INVESTMENTS LTD	258,000	6.030	1,555,740.000	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD	316,000	3.780	1,194,480.000	
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS	159,333	46.150	7,353,217.950	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD	116,000	5.260	610,160.000	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,044,250	4.190	4,375,407.500	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	311,000	29.850	9,283,350.000	
TENCENT HOLDINGS LTD	612,000	231.400	141,616,800.000	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	618,500	34.750	21,492,875.000	
LI NING CO LTD	231,500	50.550	11,702,325.000	
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	522,000	1.810	944,820.000	
CHINA POWER INTERNATIONAL	543,000	2.670	1,449,810.000	
AIR CHINA / HONG KONG	196,000	6.290	1,232,840.000	
ZTE CORP	65,288	14.780	964,956.640	
CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	336,500	22.850	7,689,025.000	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD	300,750	9.430	2,836,072.500	
BANK OF COMMUNICATIONS	843,205	4.030	3,398,116.150	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT HOLDINGS LTD	172,250	7.990	1,376,277.500	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	85,000	17.400	1,479,000.000	
BAIDU INC	216,200	78.300	16,928,460.000	
CHINA CONSTRUCTION BANK	9,370,530	4.390	41,136,626.700	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	82,000	56.950	4,669,900.000	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	238,000	3.830	911,540.000	
MINTH GROUP LTD	64,000	17.420	1,114,880.000	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS LTD	162,000	4.960	803,520.000	
CHINA NATIONAL BLDG MATERIAL	390,000	5.210	2,031,900.000	

BANK OF CHINA LTD	7,714,200	2.610	20,134,062.000	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS LTD	84,000	9.800	823,200.000	
CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	380,470	29.350	11,166,794.500	
IND & COMM BK OF CHINA - H	5,507,235	3.560	19,605,756.600	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	137,000	7.700	1,054,900.000	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	112,500	6.960	783,000.000	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES	285,600	2.330	665,448.000	
CHINA COAL ENERGY CO	209,000	6.260	1,308,340.000	
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	74,000	16.160	1,195,840.000	
ZHUZHOU CRRRC TIMES ELECTRIC CO LTD	53,500	33.100	1,770,850.000	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD	675,142	1.660	1,120,735.720	
CMOC GROUP LIMITED	282,000	3.050	860,100.000	
CHINA CITIC BANK-H	869,800	3.070	2,670,286.000	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	70,400	85.400	6,012,160.000	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	120,200	77.100	9,267,420.000	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	35,000	16.540	578,900.000	
FOSUN INTERNATIONAL	288,028	5.050	1,454,541.400	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	558,000	1.210	675,180.000	
BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	274,000	3.680	1,008,320.000	
KINGSOFT CORP LTD	98,800	23.200	2,292,160.000	
SINOTRUK HONG KONG LTD	65,500	8.410	550,855.000	
CHINA RAILWAY GROUP LTD	395,000	3.610	1,425,950.000	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	152,000	6.550	995,600.000	
DONGYUE GROUP	116,000	8.150	945,400.000	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	71,000	22.700	1,611,700.000	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	492,000	5.530	2,720,760.000	
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	260,600	14.580	3,799,548.000	
CRRRC CORP LTD - H	349,000	2.700	942,300.000	
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	110,000	7.140	785,400.000	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD	143,000	9.100	1,301,300.000	
SINOPHARM GROUP CO	140,400	15.700	2,204,280.000	

CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY CORP LTD	125,000	3.310	413,750.000	
CHINA RESOURCES CEMENT	222,000	3.160	701,520.000	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD	290,527	5.100	1,481,687.700	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	194,000	6.230	1,208,620.000	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP CORP	327,000	9.500	3,106,500.000	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD	74,900	12.000	898,800.000	
ZOOLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD	107,200	2.960	317,312.000	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL HOLDINGS CO LTD	99,000	7.450	737,550.000	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	182,000	14.100	2,566,200.000	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	88,300	14.760	1,303,308.000	
CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	628,156	2.410	1,513,855.960	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD	62,200	7.330	455,926.000	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	106,000	7.050	747,300.000	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD	250,000	2.100	525,000.000	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	2,807,000	2.330	6,540,310.000	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD	61,500	34.650	2,130,975.000	
FAR EAST HORIZON LTD	188,000	5.350	1,005,800.000	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	61,200	16.400	1,003,680.000	
CITIC SECURITIES CO LTD	196,000	13.660	2,677,360.000	
SEAZEN GROUP LIMITED	212,000	1.990	421,880.000	
HAITONG SECURITIES CO LTD	236,400	4.160	983,424.000	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP OF CHINA LTD	746,000	2.280	1,700,880.000	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	46,000	22.300	1,025,800.000	
CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD	348,000	3.310	1,151,880.000	
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	4.280	462,240.000	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD	767,000	4.140	3,175,380.000	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	42,000	18.540	778,680.000	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	116,000	21.300	2,470,800.000	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD	204,000	10.900	2,223,600.000	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	56,100	15.740	883,014.000	
SHANDONG GOLD MINING CO LTD	62,000	13.600	843,200.000	
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD	108,500	5.780	627,130.000	
CHINA TOWER CORP LTD	4,406,000	0.760	3,348,560.000	
XIAOMI CORP	1,503,800	9.860	14,827,468.000	
WUXI APPTec CO LTD	32,812	72.600	2,382,151.200	
MEITUAN	431,600	141.900	61,244,040.000	
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	128,000	14.100	1,804,800.000	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD	96,000	14.580	1,399,680.000	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	484,000	9.130	4,418,920.000	
INNOVENT BIOLOGICS INC	104,000	31.200	3,244,800.000	
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT CO LTD	997,000	0.810	807,570.000	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD	50,000	12.080	604,000.000	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LTD	176,500	14.120	2,492,180.000	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	107,500	4.360	468,700.000	
CANSINO BIOLOGICS INC	6,200	117.200	726,640.000	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	163,000	4.210	686,230.000	
HANSON PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD	102,000	13.260	1,352,520.000	
CHINA FEIHE LTD	374,000	4.980	1,862,520.000	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	1,487,868	63.000	93,735,684.000	
PHARMARON BEIJING CO LTD	19,300	35.550	686,115.000	
JD.COM INC	211,535	165.800	35,072,503.000	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	184,000	10.700	1,968,800.000	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	69,000	15.140	1,044,660.000	
KUAISHOU TECHNOLOGY	172,200	40.750	7,017,150.000	

HAIER SMART HOME CO LTD	218,800	21.750	4,758,900.000	
BILIBILI INC	18,540	79.300	1,470,222.000	
NETEASE INC	203,200	91.850	18,663,920.000	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDINGS LTD	65,000	4.180	271,700.000	
GDS HOLDINGS LTD	90,500	9.090	822,645.000	
NONGFU SPRING CO LTD	172,600	42.000	7,249,200.000	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	111,150	50.600	5,624,190.000	
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS CO LTD	29,400	41.000	1,205,400.000	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTYLE SERVICES LTD	69,200	28.750	1,989,500.000	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD	12,600	64.850	817,110.000	
CHINA VANKE CO LTD-H	171,761	11.260	1,934,028.860	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TECHNOLOGY GROUP INC	151,900	20.600	3,129,140.000	
POP MART INTERNATIONAL GROUP LTD	49,600	12.240	607,104.000	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	50,000	23.200	1,160,000.000	
CGN POWER CO LTD	1,043,000	1.680	1,752,240.000	
GF SECURITIES CO LTD	106,000	9.020	956,120.000	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	61,600	31.850	1,961,960.000	
HUATAI SECURITIES CO LTD	149,400	8.220	1,228,068.000	
3SBIO INC	146,500	6.810	997,665.000	
CHINA LITERATURE LTD	38,600	22.000	849,200.000	
FLAT GLASS GROUP CO LTD	43,000	21.400	920,200.000	
DALI FOODS GROUP CO LTD	261,500	3.460	904,790.000	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLDINGS LTD	105,000	6.450	677,250.000	
BOC AVIATION LTD	16,400	58.000	951,200.000	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD	62,600	16.120	1,009,112.000	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	124,000	13.420	1,664,080.000	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD	150,400	11.760	1,768,704.000	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	352,000	43.750	15,400,000.000	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	396,000	1.480	586,080.000	
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD	33,240	63.250	2,102,430.000	
香港・ドル 小計	81,893,911		913,544,311.970 (16,526,016,607)	
台湾・ドル				
ACCTON TECHNOLOGY CORP	50,000	245.000	12,250,000.000	
ACER INC	278,532	24.200	6,740,474.400	
ASUSTEK COMPUTER INC	69,554	241.000	16,762,514.000	

REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	46,616	283.000	13,192,328.000	
ASIA CEMENT CORP	223,928	38.550	8,632,424.400	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	96,000	74.100	7,113,600.000	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	70,000	120.000	8,400,000.000	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	123,000	147.000	18,081,000.000	
QUANTA COMPUTER INC	263,858	68.100	17,968,729.800	
EVA AIRWAYS CORP	255,000	25.500	6,502,500.000	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	65,760	180.000	11,836,800.000	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	465,030	16.800	7,812,504.000	
CHINA AIRLINES	290,000	17.250	5,002,500.000	
CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO	178,169	33.050	5,888,485.450	
CHINA STEEL CORP	1,161,058	27.550	31,987,147.900	
ADVANTECH CO LTD	41,675	300.500	12,523,337.500	
COMPAL ELECTRONICS INC	423,304	21.750	9,206,862.000	
DELTA ELECTRONICS INC	188,663	271.000	51,127,673.000	
NANYA TECHNOLOGY CORP	134,000	58.000	7,772,000.000	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	364,427	108.500	39,540,329.500	
AUO CORP	652,155	17.350	11,314,889.250	
TAIWAN MOBILE CO LTD	168,800	94.000	15,867,200.000	
EVERGREEN MARINE CORP	83,528	151.000	12,612,728.000	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	314,824	32.350	10,184,556.400	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	44,768	172.000	7,700,096.000	
ECLAT TEXTILE CO LTD	19,322	428.000	8,269,816.000	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	58,285	290.000	16,902,650.000	
FORMOSA PLASTICS CORP	403,633	86.000	34,712,438.000	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CO	338,594	70.800	23,972,455.200	
GIANT MANUFACTURING	30,151	221.500	6,678,446.500	
MEDIATEK INC	148,507	660.000	98,014,620.000	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	721,289	52.800	38,084,059.200	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	865,441	21.600	18,693,525.600	
HOTAI MOTOR CO LTD	28,000	591.000	16,548,000.000	
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	165,000	68.500	11,302,500.000	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	961,090	20.400	19,606,236.000	

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	765,941	39.650	30,369,560.650	
CHINA DEPT FINANCIAL HOLDING	1,503,011	12.300	18,487,035.300	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,260,383	23.200	29,240,885.600	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,213,225	100.500	121,929,112.500	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,083,607	30.000	32,508,210.000	
LARGAN PRECISION CO LTD	9,220	1,965.000	18,117,300.000	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,067,114	14.100	15,046,307.400	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO	1,303,345	8.300	10,817,763.500	
INVENTEC CO LTD	270,005	23.950	6,466,619.750	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	197,845	65.600	12,978,632.000	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	1,007,777	16.450	16,577,931.650	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,720,048	21.150	36,379,015.200	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,027,662	25.150	25,845,699.300	
NAN YA PLASTICS CORP	460,828	70.600	32,534,456.800	
POU CHEN CORP	233,990	28.350	6,633,616.500	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP	464,297	64.900	30,132,875.300	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	55,392	262.500	14,540,400.000	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	109,480	82.500	9,032,100.000	
E INK HOLDINGS INC	84,000	185.000	15,540,000.000	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	174,336	43.300	7,548,748.800	
SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP	114,899	54.200	6,227,525.800	
TAIWAN CEMENT CORP	585,662	31.700	18,565,485.400	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	2,411,083	407.500	982,516,322.500	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,165,525	41.650	48,544,116.250	
WAN HAI LINES LTD	58,425	74.400	4,346,820.000	
WALSIN LIHWA CORP	257,421	41.050	10,567,132.050	
WINBOND ELECTRONICS CORP	278,000	21.100	5,865,800.000	
YAGEO CORP	34,352	421.500	14,479,368.000	
YANG MING MARINE TRANSPORT	173,000	64.300	11,123,900.000	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	193,000	27.900	5,384,700.000	
INNOLUX CORPORATION	910,742	12.750	11,611,960.500	
WPG HOLDINGS CO LTD	165,203	46.300	7,648,898.900	

	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP	19,000	233.500	4,436,500.000	
	EMEMORY TECHNOLOGY INC	6,000	1,275.000	7,650,000.000	
	PEGATRON CORP	196,554	58.700	11,537,719.800	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	13,371	842.000	11,258,382.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	29,000	142.000	4,118,000.000	
	CHAILEASE HOLDING CO LTD	133,922	168.500	22,565,857.000	
	PARADE TECHNOLOGIES LTD	8,000	705.000	5,640,000.000	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	2,000	601.000	1,202,000.000	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	60,385	114.500	6,914,082.500	
	TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING	953,564	25.900	24,697,307.600	
	SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK LTD	353,993	45.200	16,000,483.600	
	VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY CORP	6,000	1,475.000	8,850,000.000	
	WIWYNN CORP	8,000	824.000	6,592,000.000	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	320,903	86.500	27,758,109.500	
	SILERGY CORP	32,000	432.000	13,824,000.000	
	POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CORP	267,000	32.600	8,704,200.000	
	MOMO.COM INC	6,600	501.000	3,306,600.000	
	GLOBALWAFERS CO LTD	21,000	424.000	8,904,000.000	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	15,000	241.500	3,622,500.000	
	台湾・ドル 小計	32,603,071		2,463,995,467.750 (10,981,288,601)	
南アフリカ・ランド	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	10,125	279.340	2,828,317.500	
	BIDVEST GROUP LTD	28,428	221.470	6,295,949.160	
	CLICKS GROUP LTD	24,148	303.000	7,316,844.000	
	DISCOVERY LTD	49,614	125.540	6,228,541.560	
	GOLD FIELDS LTD	88,078	187.860	16,546,333.080	
	REMGRO LTD	51,843	143.270	7,427,546.610	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	32,991	117.960	3,891,618.360	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	48,229	59.320	2,860,944.280	
	EXXARO RESOURCES LTD	24,734	217.350	5,375,934.900	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8,511	1,967.220	16,743,009.420	
	MTN GROUP LTD	166,841	137.300	22,907,269.300	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	41,441	304.690	12,626,658.290	
	FIRSTRAND LTD	488,807	66.900	32,701,188.300	
	NASPERS LTD	21,352	2,201.790	47,012,620.080	
	NEDBANK GROUP LTD	45,103	226.060	10,195,984.180	

ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	5,182	1,655.370	8,578,127.340	
SASOL LTD	55,931	300.240	16,792,723.440	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	49,019	240.010	11,765,050.190	
MR PRICE GROUP LTD	25,493	185.920	4,739,658.560	
STANDARD BANK GROUP LTD	130,035	179.860	23,388,095.100	
SPAR GROUP LTD/THE	21,004	161.580	3,393,826.320	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	99,816	66.810	6,668,706.960	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	38,563	153.320	5,912,479.160	
ABSA GROUP LTD	82,519	199.080	16,427,882.520	
SANLAM LTD	172,142	54.610	9,400,674.620	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	83,354	206.940	17,249,276.760	
KUMBA IRON ORE LTD	5,412	422.360	2,285,812.320	
VODACOM GROUP PTY LTD	62,110	130.880	8,128,956.800	
NEPI ROCKCASTLE NV	43,623	95.510	4,166,432.730	
OLD MUTUAL LTD	479,238	10.970	5,257,240.860	
REINET INVESTMENTS SCA	13,711	301.270	4,130,712.970	
PEPKOR HOLDINGS LTD	166,142	23.760	3,947,533.920	
MULTICHOICE GROUP LTD	37,859	123.070	4,659,307.130	
SIBANYE STILLWATER LTD	280,658	45.460	12,758,712.680	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD	34,041	177.100	6,028,661.100	
BID CORP LTD	32,800	302.660	9,927,248.000	
南アフリカ・ランド 小計	3,048,897		386,565,878.500 (3,150,511,910)	
合計	558,950,173		80,795,423,595 (80,795,423,595)	

(2) 株式以外の有価証券

2022年11月11日現在

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	ブラジル・リアル	BANCO BTG PACTUAL SA	114,400.000	3,009,864.000	
		BANCO SANTANDER BRASIL SA	38,000.000	1,071,220.000	
		ENERGISA SA	18,000.000	815,760.000	
		KLABIN SA	78,200.000	1,774,358.000	
	ブラジル・リアル 小計		248,600.000	6,671,202.000 (175,773,497)	
	メキシコ・ペソ	CEMEX SAB DE CV	1,508,275.000	12,805,254.750	
		COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	52,300.000	6,707,475.000	
		FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV	192,300.000	28,356,558.000	
		GRUPO TELEVISA SAB	246,900.000	5,098,485.000	
	メキシコ・ペソ 小計		1,999,775.000	52,967,772.750 (389,286,645)	
投資信託受益証券 合計		2,248,375	565,060,142		

				(565,060,142)	
投資証券	メキシコ・ペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	303,700.000	7,264,504.000	
	メキシコ・ペソ	小計	303,700.000	7,264,504.000	(53,390,474)
	南アフリカ・ランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	323,228.000	4,311,861.520	
	南アフリカ・ランド	小計	323,228.000	4,311,861.520	(35,141,671)
投資証券 合計			626,928	88,532,145	(88,532,145)
合計				653,592,287	(653,592,287)

(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	2.72	-	-	3.10
アラブ首長国連邦・ディルハム	株式 9銘柄	1.26	-	-	1.44
インド・ルピー	株式 108銘柄	13.92	-	-	15.84
インドネシア・ルピア	株式 25銘柄	1.87	-	-	2.12
オフショア・人民元	株式 464銘柄	4.52	-	-	5.14
カタール・リアル	株式 12銘柄	1.07	-	-	1.22
クウェート・ディナール	株式 7銘柄	0.92	-	-	1.05
コロンビア・ペソ	株式 4銘柄	0.14	-	-	0.16
サウジアラビア・リアル	株式 37銘柄	4.06	-	-	4.63
タイ・バーツ	株式 43銘柄	1.97	-	-	2.24
チェコ・コルナ	株式 3銘柄	0.14	-	-	0.15
チリ・ペソ	株式 12銘柄	0.56	-	-	0.64
トルコ・リラ	株式 12銘柄	0.44	-	-	0.50
ハンガリー・フォリント	株式 3銘柄	0.17	-	-	0.20
フィリピン・ペソ	株式 20銘柄	0.66	-	-	0.75
ブラジル・レアル	株式 44銘柄 投資信託受益証券 4銘柄	4.74 -	- 0.19	- -	5.61
ポーランド・ズロチ	株式 15銘柄	0.60	-	-	0.68
マレーシア・リンギット	株式 34銘柄	1.35	-	-	1.54
メキシコ・ペソ	株式 18銘柄 投資信託受益証券 4銘柄 投資証券 1銘柄	1.83 - -	- 0.42 -	- - 0.06	2.62

ユーロ	株式	9銘柄	0.27	-	-	0.31
韓国・ウォン	株式	111銘柄	10.88	-	-	12.38
香港・ドル	株式	193銘柄	17.83	-	-	20.29
台湾・ドル	株式	87銘柄	11.85	-	-	13.48
南アフリカ・ランド	株式	36銘柄	3.40	-	-	3.91
	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。

- (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11月12日から2023年5月11日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【リスクコントロール世界資産分散ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2022年11月11日現在	第6期中間計算期間末 2023年5月11日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	29,917,956,186	4,524,103,717
国債証券	21,009,720,000	-
親投資信託受益証券	12,892,638,217	54,451,068,799
派生商品評価勘定	39,996,081	128,955,447
流動資産合計	63,860,310,484	59,104,127,963
資産合計	63,860,310,484	59,104,127,963
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	10,666,080
未払解約金	61,938,279	31,176,819
未払受託者報酬	11,172,378	9,938,201
未払委託者報酬	357,517,366	318,024,183
その他未払費用	860,218	783,765
流動負債合計	431,488,241	370,589,048
負債合計	431,488,241	370,589,048
純資産の部		
元本等		
元本	65,605,596,090	60,733,874,953
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2,176,773,847	2,000,336,038
（分配準備積立金）	1,137,584,148	1,031,957,660
元本等合計	63,428,822,243	58,733,538,915
純資産合計	63,428,822,243	58,733,538,915
負債純資産合計	63,860,310,484	59,104,127,963

(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11月12日 至 2022年5月11日	第6期中間計算期間 自 2022年11月12日 至 2023年5月11日
営業収益		
受取利息	28,178	72,487
有価証券売買等損益	3,623,176,418	666,777,713
為替差損益	383,529,188	337,677,262
営業収益合計	4,006,677,428	329,172,938
営業費用		
支払利息	1,151,990	4,189,002
受託者報酬	12,572,445	9,938,201
委託者報酬	402,319,326	318,024,183
その他費用	1,716,491	1,691,098
営業費用合計	417,760,252	333,842,484
営業利益又は営業損失()	4,424,437,680	4,669,546
経常利益又は経常損失()	4,424,437,680	4,669,546
中間純利益又は中間純損失()	4,424,437,680	4,669,546
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()	230,172,710	24,425,932
期首剰余金又は期首欠損金()	3,496,932,267	2,176,773,847
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,173,497	204,246,512
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	204,246,512
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,173,497	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	451,011,527	47,565,089
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	451,011,527	-
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	47,565,089
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	1,111,170,733	2,000,336,038

(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11月12日	至 2023年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	

(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11月11日現在	2023年5月11日現在
1. 期首元本額	80,161,551,507円	65,605,596,090円
期中追加設定元本額	3,490,938,507円	1,277,469,254円
期中一部解約元本額	18,046,893,924円	6,149,190,391円
2. 受益権の総数	65,605,596,090口	60,733,874,953口
3. 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,176,773,847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2,000,336,038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11月11日現在	2023年5月11日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<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>	同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	第5期 2022年11月11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	1,732,188,345	-	-	1,692,192,264	39,996,081
イギリス・ポンド	718,483,696	-	-	697,007,694	21,476,002
オーストラリア・ドル	290,552,508	-	-	285,764,526	4,787,982
カナダ・ドル	144,761,323	-	-	141,039,584	3,721,739
ユーロ	578,390,818	-	-	568,380,460	10,010,358
合計	1,732,188,345	-	-	1,692,192,264	39,996,081

種類	第6期中間計算期間末 2023年5月11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	9,820,249,145	-	-	9,701,959,778	118,289,367
イギリス・ポンド	3,883,273,740	-	-	3,837,067,974	46,205,766
オーストラリア・ドル	1,484,231,120	-	-	1,494,897,200	10,666,080
カナダ・ドル	298,288,980	-	-	297,105,732	1,183,248

ユーロ	4,154,455,305	-	4,072,888,872	81,566,433
合計	9,820,249,145	-	9,701,959,778	118,289,367

(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)

	第5期 2022年11月11日現在	第6期中間計算期間末 2023年5月11日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9668円 (9,668円)	0.9671円 (9,671円)

(参考)

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

同親投資信託の状況は以下の通りであります。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,181,577,263
国債証券	505,010,306,950
地方債証券	32,818,844,886
特殊債証券	30,404,946,713
社債証券	25,705,731,100
未収利息	625,012,658
前払費用	341,087,686
流動資産合計	597,087,507,256
資産合計	597,087,507,256
負債の部	
流動負債	
未払金	917,130,000
未払解約金	125,276,000
流動負債合計	1,042,406,000
負債合計	1,042,406,000
純資産の部	
元本等	
元本	469,534,984,076
剰余金	
剰余金又は欠損金()	126,510,117,180
元本等合計	596,045,101,256
純資産合計	596,045,101,256
負債純資産合計	597,087,507,256

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11月12日 至 2023年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	613,180,832,594円
同期中追加設定元本額	623,984,033,286円
同期中一部解約元本額	767,629,881,804円
元本の内訳	
ファンド名	
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	25,432,106,416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)	97,635,700円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	54,027,230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)	202,481,087円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	45,417,547円
たわらノーロード 国内債券	17,989,186,779円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	4,127,135,480円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,323,022,406円
たわらノーロード バランス(標準型)	2,366,872,408円
たわらノーロード バランス(積極型)	307,076,615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)	138,277,557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)	1,776,846,708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)	1,888,965,761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)	531,013,958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)	27,284,416円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	18,504,239円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	164,086,895円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	5,087,262円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	62,284円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,867,307,641円
Oneグローバルバランス	45,502,583円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	9,876,194,900円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	14,097,590,565円
DIAMバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	6,047,385,035円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	2,411,861,990円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	2,483,260,391円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	436,048,600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)	4,858,815,993円

DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,017,867,730円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	393,122,638円
投資のソムリエ	112,501,888,928円
クルーズコントロール	1,232,324,772円
投資のソムリエ<DC年金>	8,794,521,896円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,739,966,860円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,440,681,220円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	9,236,046,178円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	36,836,257,803円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	384,083,292円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	189,976,679円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	66,138,413円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,573,874,339円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,649,713,537円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	13,919,729,467円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,625,564,143円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	502,644,601円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	209,630,171円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	125,960,307円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,391,118,768円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	27,538,437円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	133,538,355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)	1,909,029,792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)	1,954,033,546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)	1,194,334,138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)	1,886,328,528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)	4,880,494,938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)	1,696,213,839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)	9,419,436,914円
Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,647,924,770円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	2,995,010,295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)	262,347,735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)	3,175,355,513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)	46,298,861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)	103,765,896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)	142,702,237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)	98,027,504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)	19,426,638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)	63,136,155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)	27,822,251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)	332,511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)	23,613,464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)	108,567,161円
D I A M バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,862,824,051円
D I A M バランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,062,674,949円
D I A M バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,078,727,935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)	54,974,945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)	137,630,900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)	1,695,711,268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)	110,962,615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)	530,977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)	1,920,394,010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)	43,241,940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)	285,653,743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)	430,297,673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)	754,882,927円
D I A M 世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	195,609,909円
D I A M 国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	94,547,964円
コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	881,640,818円
動的パッケージファンド< D C 年金 >	332,891,205円
コア資産形成ファンド	222,867,031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)	23,210,423,737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]	41,399,605,431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]	11,220,722,617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]	1,425,008,051円
計	469,534,984,076円
2. 受益権の総数	469,534,984,076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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

2. 時価の算定方法	<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5月11日現在	
1口当たり純資産額	1,2694円
(1万口当たり純資産額)	(12,694円)

国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2023年5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,370,143,735
株式	416,736,177,780
派生商品評価勘定	308,055,150
未収配当金	4,543,481,401
差入委託証拠金	449,625,000
流動資産合計	429,407,483,066
資産合計	429,407,483,066
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	182,970
前受金	338,210,000
未払解約金	846,232,000
流動負債合計	1,184,624,970
負債合計	1,184,624,970
純資産の部	
元本等	
元本	119,316,793,450
剰余金	
剰余金又は欠損金()	308,906,064,646
元本等合計	428,222,858,096
純資産合計	428,222,858,096
負債純資産合計	429,407,483,066

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11月12日 至 2023年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	112,340,543,501円
同期中追加設定元本額	33,541,091,292円
同期中一部解約元本額	26,564,841,343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	2,612,091,880円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ)	3,268,713,818円
One DC 国内株式インデックスファンド	25,881,917,420円
DIAM国内株式パッシブ・ファンド	4,598,953,796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)	12,695,470円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	29,741,680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)	26,252,146円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	25,005,856円
たわらノーロード TOPIX	1,798,233,072円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,523,554,059円
たわらノーロード バランス(堅実型)	53,649,267円
たわらノーロード バランス(標準型)	355,699,895円
たわらノーロード バランス(積極型)	567,613,512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)	3,035,598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)	172,327,816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)	439,581,334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)	340,498,937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)	452,269,529円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	397,799円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,690,119円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	34,078,224円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,302,340円

たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,713,429円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	33,309,995,849円
Oneグローバルバランス	17,167,565円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,042,254,288円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,578,861,903円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,953,125,569円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	333,204,785円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,060,259,081円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,123,763,139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)	315,035,192円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	351,109,262円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	566,577,160円
投資のソムリエ	9,196,036,090円
クルーズコントロール	452,265,594円
投資のソムリエ<DC年金>	716,784,816円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	362,007,850円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	930,546,095円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	733,910,233円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,930,898,203円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	37,067,302円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	18,335,254円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,254,799円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	94,353,123円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	500,990,483円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,484,643,474円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	262,933,027円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	43,863,574円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	20,229,926円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	12,154,806円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	404,573,192円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,657,065円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	1,949,928円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	44,575,506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)	55,891,882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)	57,225,511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)	40,272,351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)	35,136,605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)	55,226,539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)	139,105,012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)	198,117,875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)	50,019,791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)	174,360,992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)	463,170,806円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	244,415,180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)	29,803,715円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	28,555,014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)	197,723,450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)	93,198,630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)	3,778,231円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	8,245,298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)	42,380,134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)	87,744,623円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	2,977,625円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	15,056,286円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	3,980,420円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	89,050円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	5,627,092円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	25,890,331円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	383,918,840円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	491,887,783円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	1,459,239,358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)	13,124,691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)	19,684,313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)	201,900,154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)	39,693,270円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	63,348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)	257,593,292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)	15,470,729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)	50,813,938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)	115,047,613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)	162,001,951円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	21,245,784円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	14,496,340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)	567,298,181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)	44,458,208円
動的パッケージファンド<DC年金>	28,995,654円
コア資産形成ファンド	19,523,044円
MHAMトピックスファンド	766,343,729円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用)	48,096,243円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定]	3,561,338,508円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定]	1,467,959,145円

計	119,316,793,450円
2. 受益権の総数	119,316,793,450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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

株式関連

種類	2023年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち		
		1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引 先物取引 買建	11,226,225,000	-	11,534,280,000	308,055,000
合計	11,226,225,000	-	11,534,280,000	308,055,000

(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5月11日現在
1口当たり純資産額	3.5890円
(1万口当たり純資産額)	(35,890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5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,346,093,891
コール・ローン	1,479,269,046
国債証券	323,976,974,501
派生商品評価勘定	4,628,018,090
未収入金	8,700,995
未収利息	1,259,741,127
前払費用	1,252,989,718
流動資産合計	334,951,787,368
資産合計	334,951,787,368
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	146,663,442
未払金	2,649,513,037
未払解約金	15,761,000
流動負債合計	2,811,937,479
負債合計	2,811,937,479
純資産の部	
元本等	
元本	274,782,034,724
剰余金	
剰余金又は欠損金()	57,357,815,165
元本等合計	332,139,849,889
純資産合計	332,139,849,889
負債純資産合計	334,951,787,368

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11月12日 至 2023年5月11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5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	182,027,030,485円
同期中追加設定元本額	244,336,061,420円
同期中一部解約元本額	151,581,057,181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>	10,333,435,973円
たわらノーロード バランス(堅実型)	1,291,373,105円
たわらノーロード バランス(標準型)	3,470,573,127円
たわらノーロード バランス(積極型)	1,676,450,062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)	37,779,637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)	1,269,748,562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)	1,175,503,691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)	117,050,175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)	3,911,530円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	15,770,868円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	145,059,502円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,875,579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	126,367,137,608円
投資のソムリエ<DC年金>	9,852,855,467円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,217,021,511円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	40,798,026,691円
ワールドアセットバランス(基本コース)	2,080,190,673円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	5,465,689,056円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	412,461,938円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	203,957,990円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	73,144,120円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,551,321,353円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	15,307,314,951円

9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,909,145,314円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	520,278,368円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	225,068,090円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	136,801,583円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	29,588,116円
Oneグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	19,152,048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)	21,382,064,145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)	7,176,882,599円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	3,357,718,075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)	51,901,737円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	114,767,123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)	505,970,634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)	45,588,459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)	299,393,374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)	565,278,862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)	795,857,293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)	1,649,251,049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	274,782,034,724円
2. 受益権の総数	274,782,034,724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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引以外の取引 為替予約取引				
売建	330,559,929,263	-	326,074,398,481	4,485,530,782
アメリカ・ドル	162,863,696,330	-	160,716,512,640	2,147,183,690
イギリス・ポンド	16,000,225,789	-	15,869,729,095	130,496,694
イスラエル・シケル	973,062,428	-	957,266,520	15,795,908
オーストラリア・ドル	5,091,702,584	-	5,159,076,120	67,373,536
オフショア・人民元	17,100,071,458	-	16,833,730,142	266,341,316
カナダ・ドル	6,738,687,313	-	6,746,373,421	7,686,108
シンガポール・ドル	1,493,739,141	-	1,484,906,578	8,832,563
スウェーデン・クローナ	696,615,121	-	690,243,863	6,371,258
デンマーク・クローネ	1,061,321,033	-	1,042,841,853	18,479,180
ニュージーランド・ドル	793,919,302	-	809,155,205	15,235,903
ノルウェー・クローネ	539,490,050	-	542,312,793	2,822,743
ポーランド・ズロチ	1,563,360,329	-	1,557,655,982	5,704,347
マレーシア・リンギット	1,775,138,832	-	1,758,214,152	16,924,680
メキシコ・ペソ	3,003,015,906	-	3,052,381,654	49,365,748
ユーロ	110,865,883,647	-	108,853,998,463	2,011,885,184
買建	821,011,338	-	816,835,204	4,176,134
アメリカ・ドル	414,961,402	-	412,273,680	2,687,722
イギリス・ポンド	79,386,361	-	79,000,094	386,267
ユーロ	326,663,575	-	325,561,430	1,102,145
合計	331,380,940,601	-	326,891,233,685	4,481,354,648

(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5月11日現在
1口当たり純資産額	1.2087円
(1万口当たり純資産額)	(12,087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5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	7,930,376,496
コール・ローン	612,243,551
株式	898,419,769,336
投資信託受益証券	1,576,190,178
投資証券	18,212,050,034
派生商品評価勘定	40,734,668
未収入金	73,547,486
未収配当金	952,446,899
差入委託証拠金	6,929,008,103
流動資産合計	934,746,366,751
資産合計	
934,746,366,751	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	75,756,516
未払解約金	763,041,000
流動負債合計	838,797,516
負債合計	
838,797,516	
純資産の部	
元本等	
元本	146,939,276,979
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	786,968,292,256
元本等合計	933,907,569,235
純資産合計	933,907,569,235
負債純資産合計	934,746,366,751

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11月12日 至 2023年5月11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5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	129,749,605,564円
同期中追加設定元本額	32,949,625,028円
同期中一部解約元本額	15,759,953,613円
元本の内訳	
ファンド名	
D I A M外国株式パッシブ・ファンド	3,278,148,934円
M I T O ラップ型ファンド（安定型）	2,230,953円
M I T O ラップ型ファンド（中立型）	10,077,678円
M I T O ラップ型ファンド（積極型）	26,413,429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)	20,907,437円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,185,586円
たわらノーロード 先進国株式	46,299,237,098円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	340,472,796円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	3,047,361,815円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	851,745,187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)	771,019,946円
たわらノーロード バランス(積極型)	976,608,165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)	72,271,601円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	287,323,506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)	257,569,366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)	429,734,098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)	629,938円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	21,170,622円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,515,542円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	11,710,035円
たわらノーロード 全世界株式	725,701,636円
DIAM外国株式インデックスファンド<DC年金>	55,536,276,494円
One DC 先進国株式インデックスファンド	2,897,489,037円
Oneグローバルバランス	9,575,832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	804,843,555円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,045,744,601円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	93,451,385円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	254,386,950円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	250,235,496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)	173,762,943円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	197,254,038円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	315,085,692円
投資のソムリエ	8,703,567,758円
クルーズコントロール	124,641,391円
投資のソムリエ<DC年金>	678,329,908円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	202,708,678円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	249,072,977円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	717,227,766円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,865,121,961円
ワールドアセットバランス(基本コース)	141,819,504円
ワールドアセットバランス(リスク抑制コース)	353,661,381円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	48,414,493円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	23,946,299円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,135,491円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	110,777,724円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	140,558,358円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	695,249,413円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	147,808,852円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	47,729,102円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	26,421,048円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	15,876,566円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	112,890,717円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	3,471,385円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	41,071,425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)	319,011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)	341,688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)	178,485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)	305,114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)	823,988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)	300,781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)	357,837,503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)	40,292,434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)	1,117,797,619円
DIAM先進国株式パッシブファンド(適格機関投資家限定)	201,241,723円
外国株式パッシブ・ファンド2(適格機関投資家限定)	1,283,392,848円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	231,184,354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)	6,843,976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)	570,140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)	3,572,693円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	8,058,737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)	23,709,257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)	49,090,086円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,666,350円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	12,641,465円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	1,113,207円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	33,270円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	3,149,288円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	21,737,799円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	143,187,953円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	240,850,481円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	816,636,054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)	35,716,023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)	32,385,241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)	226,227,510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)	7,425,395円
DIAM世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	156,338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)	96,085,143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）	8,657,740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）	28,379,458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）	42,901,426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）	90,661,366円
動的パッケージファンド<DC年金>	11,694,657円
コア資産形成ファンド	7,812,638円
MHAM外国株式インデックスファンド（ファンドラップ）	3,243,682,838円
MHAM外国株式インデックスファンド	138,179,392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）	6,287,002円
MHAM動的パッケージファンド〔適格機関投資家限定〕	1,437,313,157円
MHAM外国株式パッシブファンド〔適格機関投資家限定〕	1,390,660,018円
計	146,939,276,979円
2. 受益権の総数	146,939,276,979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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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つた場合、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5月11日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち 1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	275,978,239	-	274,238,338	1,739,901
アメリカ・ドル	157,549,920	-	156,430,560	1,119,360
イギリス・ポンド	6,654,531	-	6,611,595	42,936
オーストラリア・ドル	3,198,825	-	3,187,800	11,025
カナダ・ドル	6,159,780	-	6,122,990	36,790

ユーロ	102,415,183	-	101,885,393	529,790
買建	815,786,205	-	815,786,967	762
アメリカ・ドル	625,710,600	-	625,710,600	-
イギリス・ポンド	42,365,750	-	42,365,625	125
オーストラリア・ドル	20,213,988	-	20,213,100	888
カナダ・ドル	33,010,544	-	33,011,037	493
ユーロ	94,485,323	-	94,486,605	1,282
合計	1,091,764,444	-	1,090,025,305	1,740,663

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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5月11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	16,372,906,667	-	16,336,144,156	36,762,511
合計	16,372,906,667	-	16,336,144,156	36,762,511

(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5月11日現在	
1口当たり純資産額	6.3557円
(1万口当たり純資産額)	(63,557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5月11日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,056,435,115
投資証券	199,317,900,274
派生商品評価勘定	119,420,700
未収入金	1,579,847,116
未収配当金	2,116,650,068
差入委託証拠金	261,744,000
流動資産合計	207,451,997,273
資産合計	207,451,997,273
負債の部	
流動負債	
前受金	132,531,270
未払解約金	3,023,365,294
流動負債合計	3,155,896,564
負債合計	3,155,896,564
純資産の部	
元本等	
元本	87,246,759,652
剰余金	
剰余金又は欠損金()	117,049,341,057
元本等合計	204,296,100,709
純資産合計	204,296,100,709
負債純資産合計	207,451,997,273

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11月12日 至 2023年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる金融商品取引所等の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	87,353,406,924円
同期中追加設定元本額	26,047,012,151円
同期中一部解約元本額	26,153,659,423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)	1,137,797円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	2,971,983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)	2,355,444円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	2,505,973円
たわらノーロード 国内リート	5,639,348,625円
たわらノーロード 国内リート<ラップ向け>	1,179,477,901円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	2,324,831,194円
たわらノーロード バランス(堅実型)	40,400,885円
たわらノーロード バランス(標準型)	776,201,414円
たわらノーロード バランス(積極型)	864,941,740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)	226,461,331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)	550,170,978円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	361,002,327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)	407,544,453円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	2,538,679円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	45,630,651円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	4,970,480円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	12,351,658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)	386,063,331円
投資のソムリエ	9,621,384,207円
投資のソムリエ<DC年金>	750,143,469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	832,954,300円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,326,204,401円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	40,011,169円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	19,785,776円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	5,961,695円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	117,267,274円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	376,810,428円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	120,549,676円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	47,751,705円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	21,832,556円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	13,225,557円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	2,870,856円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	43,314,520円
Jリートインデックスファンド(DC)	66,192,545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)	694,730,215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)	2,238,851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)	2,089,099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)	1,287,716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)	188,600,781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)	81,793,611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)	2,317,326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)	5,481,997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)	50,863,696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)	83,763,731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)	58,706,785円
低リスク・損失抑制型マルチアセット戦略ファンド2021-09(適格機関投資家限定)	81,316,281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)	2,127,352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)	58,458,912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)	84,406,930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)	11,422,898円
DIAM J-REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	3,532,338,455円 255,772,370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)	81,931,359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)	435,975,434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)	3,481,597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)	3,949,662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)	62,162,048円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	9,358,253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)	1,016,521,207円
MHAM J-REITインデックスファンド DC年金	7,798,543,062円
MHAM J-REITインデックスファンド(毎月決算型)	36,623,298,621円
MHAM J-REITインデックスファンド(年1回決算型)	2,672,437,040円
MHAM J-REITインデックスファンド(ファンドラップ)	3,999,303,686円
計	87,246,759,652円
2. 受益権の総数	87,246,759,652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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

不動産投信関連

種類	2023年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち 1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引				

先物取引 買建	4,213,120,230	-	4,332,798,000	119,677,770
合計	4,213,120,230	-	4,332,798,000	119,677,770

(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5月11日現在
1口当たり純資産額	2.3416円
(1万口当たり純資産額)	(23,416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5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,823,344,518
コール・ローン	524,816,135
国債証券	128,901,007,370
未収入金	6,772,225,616
未収利息	1,063,287,294
前払費用	287,034,177
流動資産合計	139,371,715,110
資産合計	139,371,715,110
負債の部	
流動負債	
未払金	7,545,200,367
未払解約金	123,377,000
流動負債合計	7,668,577,367
負債合計	7,668,577,367
純資産の部	
元本等	
元本	64,690,028,081
剰余金	
剰余金又は欠損金()	67,013,109,662
元本等合計	131,703,137,743
純資産合計	131,703,137,743
負債純資産合計	139,371,715,110

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11月12日 至 2023年5月11日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産及び負債は、計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円貨に換算するほか、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び同第61条にしたがって換算しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	2023年5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	61,928,920,109円
同期中追加設定元本額	32,662,068,931円
同期中一部解約元本額	29,900,960,959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）	97,384,011円
たわらノーロード バランス（8資産均等型）	2,656,690,350円
たわらノーロード バランス（堅実型）	184,420,775円
たわらノーロード バランス（標準型）	533,877,016円
たわらノーロード バランス（積極型）	228,574,229円
たわらノーロード 最適化バランス（保守型）	927,858円
たわらノーロード 最適化バランス（安定型）	5,420,499円
たわらノーロード 最適化バランス（安定成長型）	66,239,974円
たわらノーロード 最適化バランス（成長型）	4,631,022円
たわらノーロード 最適化バランス（積極型）	6,531,692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）	733,812,833円
投資のソムリエ	17,137,105,418円
クルーズコントロール	383,416,973円
投資のソムリエ<DC年金>	1,335,858,518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	1,479,472,119円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,909,293,159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）	1,089,902,449円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2045）	59,303,666円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2055）	29,330,648円
リスク抑制世界8資産バランスファンド（DC）	10,590,249円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2035）	208,973,857円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,007,132,739円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	231,791,447円

投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2040）	76,217,315円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2050）	32,365,977円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2060）	19,445,172円
投資のソムリエ（ターゲット・イヤー2065）	4,250,324円
Oneグローバル最適化バランス（安定型）＜ラップ向け＞	4,547,957円
Oneグローバル最適化バランス（成長型）＜ラップ向け＞	22,918,965円
エマージング債券リスク抑制型（適格機関投資家限定）	23,503,117,586円
投資のソムリエ・私募（適格機関投資家限定）	455,344,616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）	1,249,767,384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）	332,861,028円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	7,037,185円
しあわせの一步・私募（適格機関投資家限定）	16,624,353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）	7,528,113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）	149,928,078円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA（適格機関投資家限定）	66,873,016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）	2,851,567,456円
計	64,690,028,081円
2. 受益権の総数	64,690,028,081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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「（重要な会計方針に係る事項に関する注記）」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務）は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（デリバティブ取引等に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

	2023年5月11日現在
1口当たり純資産額	2.0359円
（1万口当たり純資産額）	（20,359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5月11日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,617,403,997
コール・ローン	333,785,497
株式	82,648,720,209
投資信託受益証券	639,917,743
投資証券	83,200,263
派生商品評価勘定	54,100,035
未収入金	340,926
未収配当金	181,762,195
差入委託証拠金	2,209,288,362
流動資産合計	88,768,519,227
資産合計	88,768,519,227
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,156,415
未払解約金	57,790,000
流動負債合計	77,946,415
負債合計	77,946,415
純資産の部	
元本等	
元本	63,823,362,626
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	24,867,210,186
元本等合計	88,690,572,812
純資産合計	88,690,572,812
負債純資産合計	88,768,519,227

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11月12日 至 2023年5月11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5月11日現在
1. 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	69,564,245,495円
同期中追加設定元本額	20,991,138,658円
同期中一部解約元本額	26,732,021,527円
元本の内訳 ファンド名	
DIAM新興国株式インデックスファンド<DC年金>	9,209,865,900円
DIAM新興国株式インデックスファンド<為替ヘッジなし>（ファン ドラップ）	5,554,280,130円
MITO 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)	13,488,680円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	35,424,595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)	28,006,114円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	29,741,994円
たわらノーロード 新興国株式	11,573,033,098円
たわらノーロード 新興国株式<ラップ向け>	2,994,716,094円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	3,898,745,202円
たわらノーロード バランス(堅実型)	34,372,328円
たわらノーロード バランス(標準型)	129,833,851円
たわらノーロード バランス(積極型)	223,129,069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)	55,544,424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)	187,781,842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)	154,257,251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)	291,347,579円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	725,737円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	9,723,635円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,558,867円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	7,696,620円
たわらノーロード 全世界株式	424,810,994円
One DC 新興国株式インデックスファンド	844,278,832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)	596,408,352円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	1,087,770,065円
投資のソムリエ	12,713,727,623円
クルーズコントロール	558,841,258円
投資のソムリエ<DC年金>	990,511,302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	950,127,208円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	3,796,500,721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)	1,529,097,915円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	72,997,198円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	36,093,886円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	6,811,041円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	156,283,800円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	2,564,457,161円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	336,045,745円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	71,235,637円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	39,832,126円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	24,185,088円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	5,234,766円
Oneグローバル最適化バランス(成長型)<ラップ向け>	27,014,458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)	11,065,925円
投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	337,479,081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)	5,220,897円
しあわせの一步・私募(適格機関投資家限定)	10,674,871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)	221,451,276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)	98,874,233円
計	63,823,362,626円

2. 受益権の総数	63,823,362,626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5月11日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1)有価証券 「(重要な会計方針に係る事項に関する注記)」にて記載しております。 (2)デリバティブ取引 「(デリバティブ取引等に関する注記)」にて記載しております。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務)は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(デリバティブ取引等に関する注記)

通貨関連

種類	2023年5月11日現在			
	契約額等(円)	うち		評価損益(円)
		1年超		
市場取引以外の取引 為替予約取引 買建 アメリカ・ドル	208,092,360	-	206,985,480	1,106,880
合計	208,092,360	-	206,985,480	1,106,880

(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5月11日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち 1年超		
市場取引 先物取引 買建	5,318,892,516	-	5,353,943,016	35,050,500
合計	5,318,892,516	-	5,353,943,016	35,050,500

(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5月11日現在
1口当たり純資産額	1.3896円
(1万口当たり純資産額)	(13,896円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2023年5月31日現在

資産総額	58,552,777,296円
負債総額	131,668,401円
純資産総額（ - ）	58,421,108,895円
発行済数量	60,371,579,036口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9677円

（参考）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	607,698,207,595円
負債総額	12,240,570,000円
純資産総額（ - ）	595,457,637,595円
発行済数量	470,050,368,996口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2668円

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	435,144,827,444円
負債総額	546,209,184円
純資産総額（ - ）	434,598,618,260円
発行済数量	118,370,573,385口
1口当たり純資産額（ / ）	3.6715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5月31日現在

資産総額	219,767,287,854円
負債総額	6,278,201,908円
純資産総額（ - ）	213,489,085,946円
発行済数量	179,050,992,965口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1923円

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	976,911,044,858円
負債総額	98,469,022円
純資産総額（ - ）	976,812,575,836円
発行済数量	147,178,005,581口
1口当たり純資産額（ / ）	6.6369円

J-REITインデックスファンド・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	207,363,978,659円
負債総額	709,198,870円
純資産総額（ - ）	206,654,779,789円
発行済数量	87,020,816,926口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3748円

エマージング債券パッシブ・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	130,868,916,097円
負債総額	2,975円
純資産総額(-)	130,868,913,122円
発行済数量	62,592,884,564口
1口当たり純資産額(/)	2.0908円

エマージング株式パッシブ・マザーファンド

2023年5月31日現在

資産総額	90,924,775,879円
負債総額	90,046,053円
純資産総額(-)	90,834,729,826円
発行済数量	63,343,771,791口
1口当たり純資産額(/)	1.4340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5月31日現在)

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

直近5カ年の資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構(2023年5月31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. 投資環境見通しおよび運用方針の策定

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

2. 運用計画、売買計画の決定

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2023年5月31日現在、委託会社の運用する投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除く）

基本的性格	本数	純資産総額（単位：円）
追加型公社債投資信託	26	1,451,770,775,342
追加型株式投資信託	793	14,811,823,510,932
単位型公社債投資信託	23	39,882,073,259
単位型株式投資信託	211	1,113,561,477,132
合計	1,053	17,417,037,836,665

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			利益剰余金				株主資本 合計
		資本準備金	その他 資本剰余金	資本剰余 金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000	2,428	17,124	19,552	123	31,680	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おります。

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

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

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第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	-	-	-	-
その他有価証券	-	-	-	-
資産計	-	6,932	-	6,932

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

委託会社は、アストマックス株式会社からPayPayアセットマネジメント株式会社（以下「PPAM」といいます。）の発行済株式の49.9%を2022年8月1日付で譲り受けており、同日付でPPAMは委託会社の関連会社となりました。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称	みずほ信託銀行株式会社
資本金の額	247,369百万円（2022年3月末日現在）
事業の内容	日本において銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

販売会社の名称、資本金の額および事業内容は以下の「販売会社一覧表」の通りです。

名 称	資本金の額 (単位:百万円)	事 業 の 内 容
株式会社みずほ銀行	1,404,065	日本において銀行業務を営んでおります。
株式会社長野銀行	13,017	日本において銀行業務を営んでおります。
a u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。
あかつき証券株式会社	3,067	「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。
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

(3) 投資顧問会社

名称	Asset Management One USA Inc.
資本金の額	400万米ドル（2022年12月末日現在）
事業の内容	米国において投資顧問業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

「受託会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 委託会社の指図に基づく信託財産の管理、保管、処分
- (2) 信託財産の計算
- (3) 信託財産に関する報告書の作成
- (4) その他上記に付帯する業務

「販売会社」は、以下の業務を行います。

- (1) 募集の取扱い
- (2) 追加設定の申込事務
- (3) 信託契約の一部解約事務
- (4) 受益者に対する収益分配金、一部解約金および償還金の支払い
- (5) 受益者に対する収益分配金の再投資
- (6) 受益者に対する投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の交付
- (7) その他上記に付帯する業務

「投資顧問会社」は、委託会社との投資顧問契約に基づき、信託財産の運用の助言を行います。

3【資本関係】

委託会社は、Asset Management One USA Inc.の株式を、100%保有しています。

持株比率5%以上を記載します。

第3【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

2023年1月13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」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの2021年11月12日から2022年11月11日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの2022年11月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

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

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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。

独立監査人の中間監査報告書

2023年7月14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」に掲げられているリスクコントロール世界資産分散ファンドの2022年11月12日から2023年5月11日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、リスクコントロール世界資産分散ファンドの2023年5月11日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2022年11月12日から2023年5月11日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

アセットマネジメントOne株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注2) X B R L データは監査の対象には含まれておりません。